

上海清算所人民币利率互换集中清算系统

客户端操作手册（V5.3）

第一章 交易管理.....	7
一、交易查询（自营）.....	7
1. 会员申请交易列表.....	7
2. 交易信息.....	8
二、交易查询（代理）.....	8
1. 会员申请交易列表.....	8
2. 交易信息.....	9
三、代理接单确认.....	9
1. 代理接单等待操作.....	9
2. 代理接单确认.....	11
3. 代理接单复核.....	12
第二章 实时承接管理.....	13
一、平台额度维护.....	13
1. 平台额度维护（自营）.....	13
2. 平台额度维护（代理）.....	15
3. 平台额度查询（客户）.....	17
二、实时承接总额度查询.....	18
1. 实时承接总额度查询（自营）.....	18
实时承接总额度查询（代理）.....	18
实时承接总额度查询（客户）.....	19
三、成交额度占用监控.....	19
1. 成交额度占用监控（代理）.....	19
2. 成交额度占用监控（自营）.....	20
3. 成交额度占用监控（客户）.....	21
第三章 合约管理.....	22
一、合约查询（自营）.....	22
1. 合约列表.....	22

2. 浮（固）息方支付现金流详细信息.....	23
3. 交易信息.....	24
二、合约查询（代理）.....	24
1. 合约列表.....	24
2. 浮（固）息方支付现金流详细信息.....	25
3. 交易信息.....	26
三、清算退出.....	26
1. 清算退出申请查询（自营）.....	26
2. 清算退出申请查询（代理）.....	27
四、提前终止.....	27
1. 提前终止申请查询（自营）.....	27
2. 提前终止申请查询（代理）.....	28
五、合约转移查询（自营）.....	29
六、合约转移查询（代理）.....	29
第四章 客户端利息查询.....	30
一、 利息计算.....	30
1. 参考利率查询.....	30
2. 利息试算.....	31
二、 利息查询.....	32
1. 单笔合约利息查询（自营）.....	32
2. 单笔合约利息查询（代理）.....	33
3. 未来 5 天现金流（自营）.....	35
4. 未来 5 天现金流（代理）.....	37
第五章 估值信息查询.....	39
一、 单笔合约估值查询（自营）.....	39
二、 单笔合约估值查询（代理）.....	40
三、 合约组合估值查询（自营）.....	41
四、 合约组合估值查询（代理）.....	42
第六章 风险敞口信息查询.....	43
一、 合约组合风险敞口查询（自营）.....	43
二、 合约组合风险敞口查询（代理）.....	44

三、收盘曲线查询	45
四、已接单头寸保证金要求明细查询（自营）	46
五、已接单头寸保证金要求明细查询（代理）	47
第七章 资金管理.....	48
一、资金提取申请/审核（自营）	48
1. 新增资金提取申请.....	48
二、资金提取申请/审核（代理）	49
1. 新增资金提取申请.....	49
2. 修改申请操作.....	50
3. 删除申请操作.....	51
三、资金提取申请查询（自营）	52
四、资金提取申请查询（代理）	52
五、待结算资金净额查询（自营）	53
六、待结算资金净额查询（代理）	54
七、资金账户明细查询（自营）	56
八、资金账户明细查询（代理）	56
第八章 保证金管理.....	57
一、保证金提取申请/审核（自营）	57
1. 新增保证金申请/审核.....	57
2. 修改申请操作.....	58
3. 删除申请操作.....	59
二、保证金提取申请/审核（代理）	60
1. 新增保证金申请/审核	60
2. 修改申请操作	62
3. 删除申请操作	63
三、互换通资源池提取/审核（自营）	64
1. 新增资源池提取/审核.....	64
2. 修改资源池提取/审核	66
3. 删除申请操作	67
4. 互换通资源池全市场敞口占用查询.....	67

四、保证金提取申请查询（自营）、保证金提取申请查询（代理）	68
五、互换通资源池提取申请查询（自营）	68
六、日终保证金（自营）	69
七、日终保证金（代理）	70
八、保证金查询（自营）	70
九、互换通资源池查询（自营）	71
十、保证金查询（代理）	71
十一、保证金追缴查询（自营）	72
十二、资源池追缴查询（自营）	72
十三、保证金追缴查询（代理）	73
十四、保证金明细查询（自营）	73
十五、资源池明细查询（自营）	74
十六、保证金明细查询（代理）	74
十七、非清算会员保证金台账簿记.....	75
1. 新增保证金台账流水维护.....	75
2. 修改申请操作	77
3. 删除申请操作	78
4. 批量增加申请操作.....	79
十八、非清算会员保证金余额查询.....	81
十九、债券流水簿记（自营）	81
1. 新增债券流水簿记.....	81
二十、债券流水簿记（代理）	83
1. 新增债券流水簿记.....	83
二十一、债券折扣率	84
二十二、债券余额查询（自营/代理）	85
第九章 费用管理.....	86
一、费用查询	86
1. 费用查询（自营）	86
2. 费用查询（代理）	87
二、计费方案设置（自营）	88

三、计费方案设置（代理）	91
四、费用预轧差（自营）	95
五、费用预轧差（代理）	96
第十章 信息提示.....	98
一、信息查询	98
第十一章 单据下载.....	100
一、单据下载	100
第十二章 用户/权限.....	101
一、用户管理	101
1. 查询.....	101
2. 新增用户.....	101
3. 修改.....	102
4. 删除.....	103
5. 冻结.....	104
6. 解冻.....	106
7. 初始化密码.....	107
8. 用户属性.....	109
9. 强制签退.....	109
二、岗位管理	110
1. 查询.....	110
2. 新增.....	110
3. 修改.....	111
4. 删除.....	112
5. 岗位属性.....	113
6. 岗位权限设置.....	113
三、用户操作日志	115
第十三章 合约压缩.....	115
一、客户端合约压缩申请.....	115
（一）手动压缩申请	115
1.合约压缩申请.....	116
2.合约编号.....	116

3.交易编号.....	117
4.申请驳回.....	117
(二) 自动化压缩申请.....	117
二、单一/若干机构合约压缩申请复核.....	119
(一) 手动压缩复核	119
(二) 自动化压缩复核.....	119
三、匹配规则管理	121
1.修改.....	121
2.复核.....	121
3.压缩规则.....	121
四、合约压缩申请查询.....	122
五、合约压缩参数管理.....	123
1.修改压缩参数.....	123
2. 复核	123
3. 修改页面	123
六、新合约提取	125
七、合约压缩结果确认.....	125
1.查询.....	125
2.合约压缩结果确认.....	126
3. 合约压缩结果确认复核.....	126
八、客户端合约压缩可视化.....	127
第十四章 代理客户线上化（综合清算会员代理业务功能）	128
一、代理客户信息维护-新增.....	128
二、代理客户信息维护-复核.....	132
三、代理客户信息维护-提交.....	133
四、代理客户信息维护-修改.....	134
五、代理客户信息维护-删除.....	136

第一章 交易管理

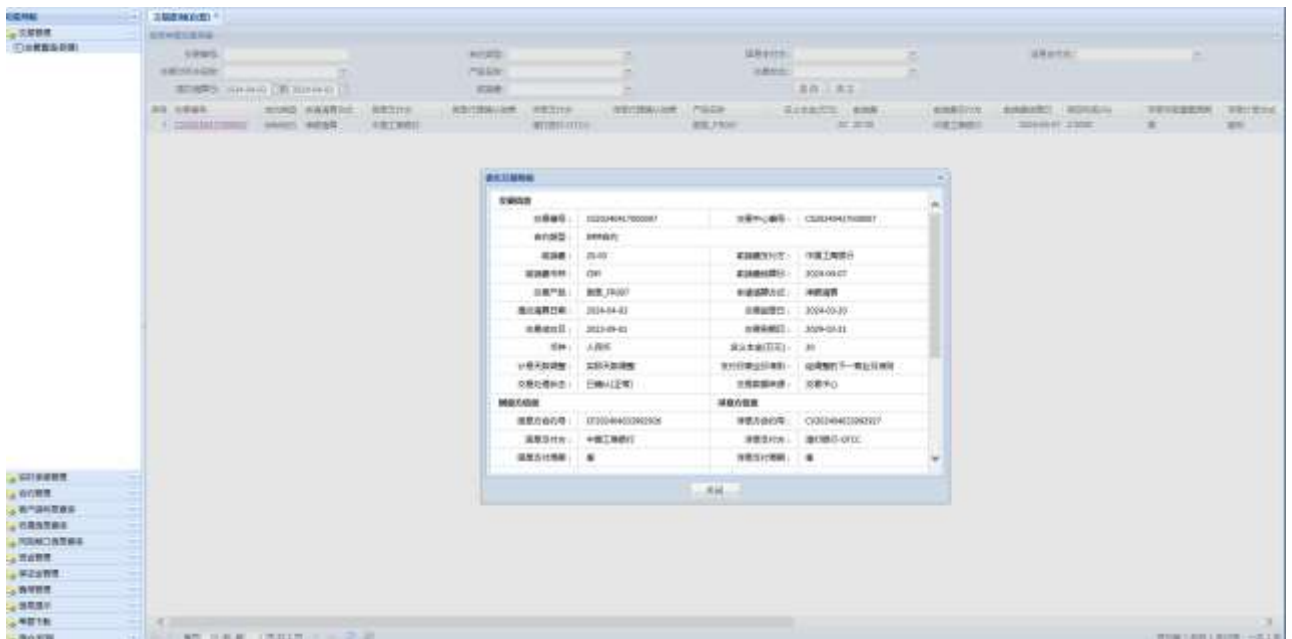
一、交易查询（自营）

1. 会员申请交易列表



如上图：进入菜单“交易管理”—“交易查询（自营）”，该界面提供会员的所有自营利率互换交易信息（只显示已经通过合规要素检查的交易）。可按“交易编号”、“固息支付方”、“浮息支付方”、“交易对手方名称”、“产品名称”、“交易状态”、“提交清算日”和“前端费”筛选查询。查询按钮包括“查询”“清空”。可以将显示列表的首页以 excel 表格的形式导出；如需导出全部记录，可以修改每页条数，点击刷新按钮，使全部记录均显示在首页，随后再导出（下同）。

2. 交易信息



如上图，点击交易编号，弹出该笔交易的详细信息，包括交易信息、固息方信息、浮息方信息、前端费信息和备注。

二、交易查询（代理）

1. 会员申请交易列表



如上图，进入菜单“交易管理”—“交易查询（代理）”，该界面

提供综合会员所代理的客户提交集中清算的交易信息（只显示已经通过合规要素检查的交易）。可按“交易编号”、“固息支付方”、“浮息支付方”、“交易对手方名称”、“产品名称”、“交易状态”、“提交清算日”和“前端费”筛选查询。查询按钮包括“查询”“清空”。

2. 交易信息



如上图，点击交易编号，弹出该笔交易的详细信息，包括交易信息、固息方信息、浮息方信息、前端费信息和备注。

三、代理接单确认

1. 代理接单等待操作

The screenshot shows a table with the following columns: 交易编号, 交易金额, 交易日期, 交易对手, 交易对手名称, 交易对手地址, 交易对手电话, 交易对手邮箱, 交易对手备注. The table contains multiple rows of transaction data, with several rows highlighted in yellow.

综合清算会员可以实时对自己代理客户的交易进行确认。若某客

户项下存在未完成代理接单确认的交易，则该条记录背景显示为黄色，正常情况为白色（如上图，红框中的代理客户存在未完成接单确认的交易）

点击会员单位列表中的一条链接，弹出该代理客户待接单的全部交易（交易按照交易编号进行由小到大排序）。综合会员可根据试算结果，批量对交易点击确认或等待。若选择等待，则不做任何操作。见下图。



此外，该页面可以按照会员单位进行查询。下拉框展示当前综合清算会员的代理客户名称，点击“查询”，只查此客户的数据，点击“清空”，则清除查询条件，如下图。

序号	券商名称	券种	保证金余额	数量	持仓合约	持仓市值	总市值	最新净值
1	华泰证券-中国工商银行	国债期货	0.00	6,660,000.00	1,000,000,000.00	0.00	0.00	6,660.000
2	东北证券-中国工商银行	工银私人理财T7号-中国工商银行	156,726.42	4,450,000,000.00	1,000,000,000.00	0.00	-4,002,446.12	4,450,000.000
3	工银私人	中金财富-中国工商银行	0.00	1,000,000.00	1,000,000,000.00	0.00	0.00	1,000.000
4	国信证券	三井住友银行-中国工商银行	0.00	10,020,000.00	1,000,000,000.00	0.00	0.00	10,020.000
5	德邦证券	万联证券-中国工商银行	0.00	1,170,000.00	1,000,000,000.00	0.00	0.00	1,170.000
6	华泰证券	中信证券广德1号-中国工商银行	0.00	4,650,000.00	1,000,000,000.00	0.00	0.00	4,650.000
7	宏观配置	中金财富1号-中国工商银行	0.00	330,000.00	1,000,000,000.00	0.00	0.00	330.000
8	华商银行	华泰证券-中国工商银行	0.00	100,000.00	1,000,000,000.00	0.00	0.00	100.000
9	三井住友	华泰证券-中国工商银行	0.00	48,000,000.00	1,000,000,000.00	0.00	0.00	48,000.000
10	五矿证券	中国工商银行	0.00	0.00	500,000.00	1,000,000,000.00	0.00	500.000
11	中金财富	中国工商银行	0.00	0.00	20,810,000.00	1,000,000,000.00	0.00	20,810.000
12	中信证券	广德1号-中国工商银行	0.00	0.00	550,000.00	1,000,000,000.00	0.00	550.000

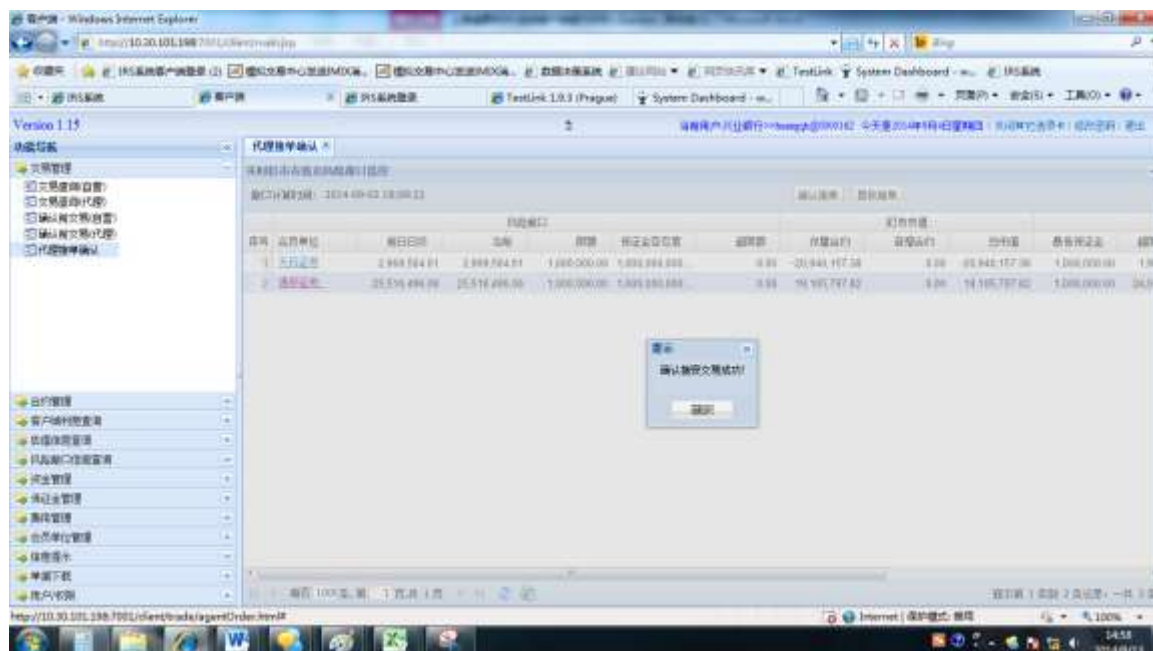
同时该页面每列具有排序功能。操作人员点击每列名称，可以设置排序顺序（正序、倒序）。涉及文字的按照拼音首字母排序（首字母相同往后类推），涉及数字的按照金额大小顺序排序，如下图所示。

序号	券商名称	券种	保证金余额	数量	持仓合约	持仓市值	总市值	最新净值
1	华泰证券-中国工商银行	国债期货	0.00	6,660,000.00	1,000,000,000.00	0.00	0.00	6,660.000
2	东北证券-中国工商银行	工银私人理财T7号-中国工商银行	156,726.42	4,450,000,000.00	1,000,000,000.00	0.00	-4,002,446.12	4,450,000.000
3	工银私人	中金财富-中国工商银行	0.00	1,000,000.00	1,000,000,000.00	0.00	0.00	1,000.000
4	国信证券-中国工商银行	三井住友银行-中国工商银行	0.00	10,020,000.00	1,000,000,000.00	0.00	0.00	10,020.000
5	德邦证券-中国工商银行	万联证券-中国工商银行	0.00	1,170,000.00	1,000,000,000.00	0.00	0.00	1,170.000
6	华泰证券-中国工商银行	中信证券广德1号-中国工商银行	0.00	4,650,000.00	1,000,000,000.00	0.00	0.00	4,650.000
7	宏观配置-中国工商银行	中金财富1号-中国工商银行	0.00	330,000.00	1,000,000,000.00	0.00	0.00	330.000
8	华商银行-中国工商银行	华泰证券-中国工商银行	0.00	100,000.00	1,000,000,000.00	0.00	0.00	100.000
9	三井住友银行-中国工商银行	华泰证券-中国工商银行	0.00	48,000,000.00	1,000,000,000.00	0.00	0.00	48,000.000

2. 代理接单确认

序号	券商名称	券种	保证金余额	数量	持仓合约	持仓市值	总市值	最新净值
1	华泰证券	国债期货	0.00	6,660,000.00	1,000,000,000.00	0.00	0.00	6,660.000
2	东北证券	工银私人理财T7号-中国工商银行	156,726.42	4,450,000,000.00	1,000,000,000.00	0.00	-4,002,446.12	4,450,000.000
3	工银私人	中金财富-中国工商银行	0.00	1,000,000.00	1,000,000,000.00	0.00	0.00	1,000.000
4	国信证券	三井住友银行-中国工商银行	0.00	10,020,000.00	1,000,000,000.00	0.00	0.00	10,020.000
5	德邦证券	万联证券-中国工商银行	0.00	1,170,000.00	1,000,000,000.00	0.00	0.00	1,170.000
6	华泰证券	中信证券广德1号-中国工商银行	0.00	4,650,000.00	1,000,000,000.00	0.00	0.00	4,650.000
7	宏观配置	中金财富1号-中国工商银行	0.00	330,000.00	1,000,000,000.00	0.00	0.00	330.000
8	华商银行	华泰证券-中国工商银行	0.00	100,000.00	1,000,000,000.00	0.00	0.00	100.000
9	三井住友	华泰证券-中国工商银行	0.00	48,000,000.00	1,000,000,000.00	0.00	0.00	48,000.000

如上图，若综合清算会员决定确认为客户代理交易，点击“确认接单”按钮（交易编号由小到大排序），点击“通过”，确认接单成功，如下图。

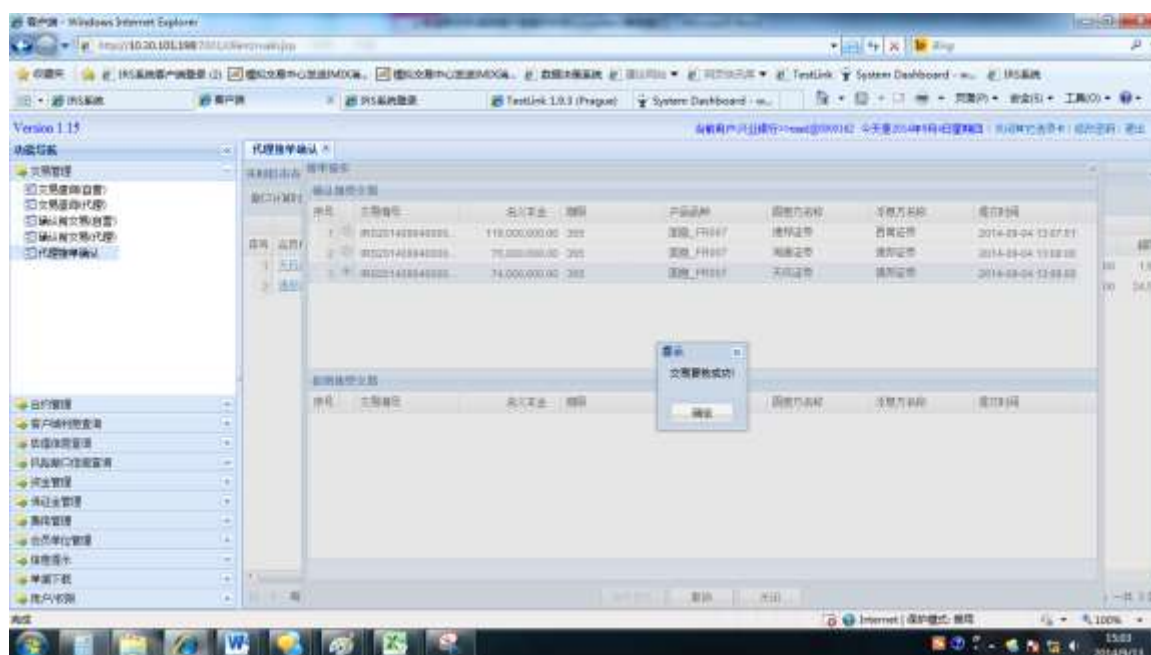


3. 代理接单复核



如上图，当综合清算会员完成确认接单操作之后，换人复核，点

击“复核接单”按钮，点击“通过”，复核接单成功，如下图。

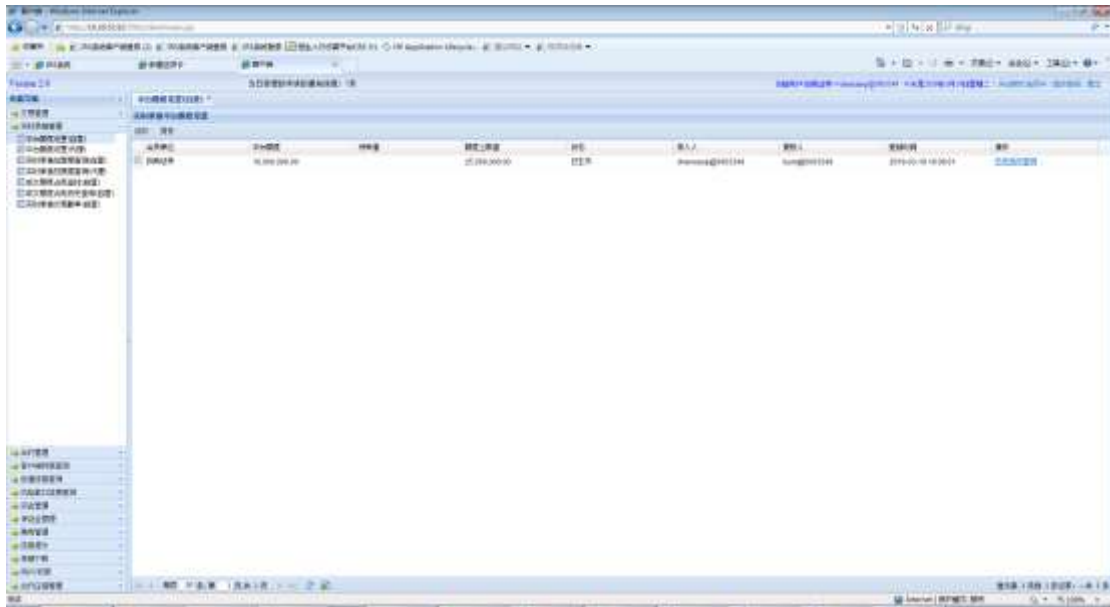


第二章 实时承接管理

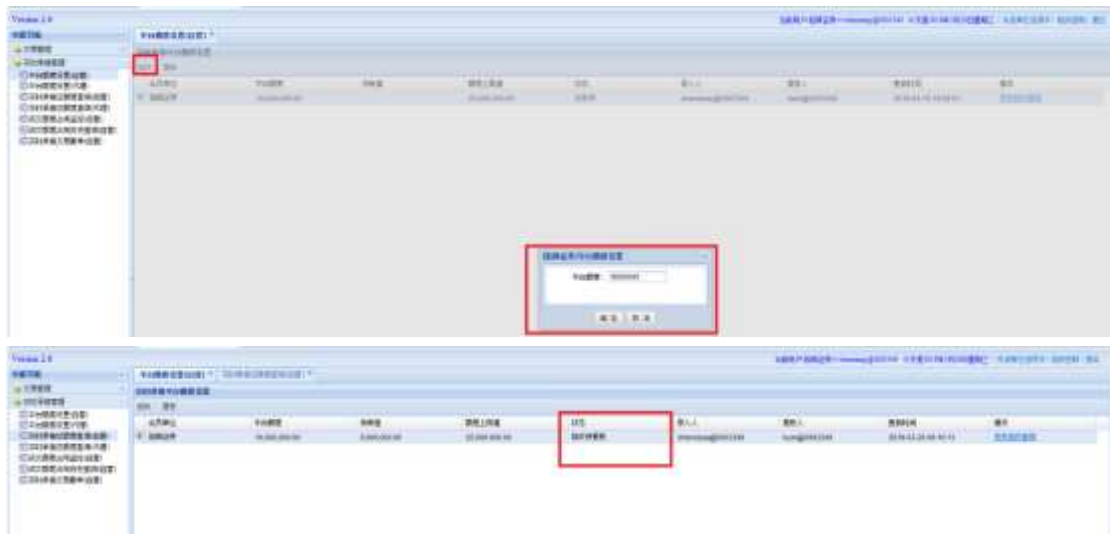
一、平台额度维护

1. 平台额度维护（自营）

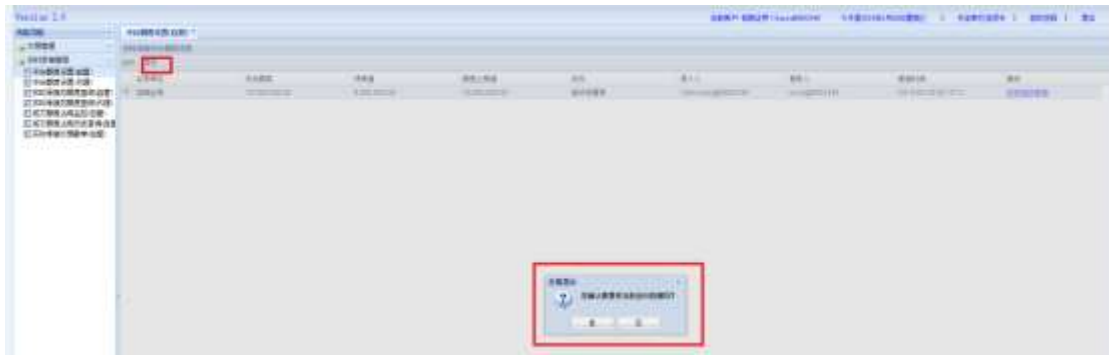
自营清算会员进入客户端菜单实时承接管理—平台额度维护(自营)界面，系统初始默认会生成值为0的平台额度。



选择一条需修改的记录，点击【修改】按钮，弹出修改页面，对平台额度进行修改；修改后点击【确定】，该条记录状态变为【修改待复核】。



复核时，登录另一操作员账号，进入“平台额度维护（自营）”界面，选中状态为【修改待复核】的记录，点击【复核】按钮，弹出提示框；点击【是】，复核成功，该条记录状态变为【已复核未生效】。



2. 平台额度维护（代理）

综合清算会员登录客户端，进入“实时承接管理—平台额度维护（代理）”界面，系统初始默认会对其代理非清算会员生成值为 0 的平台额度。

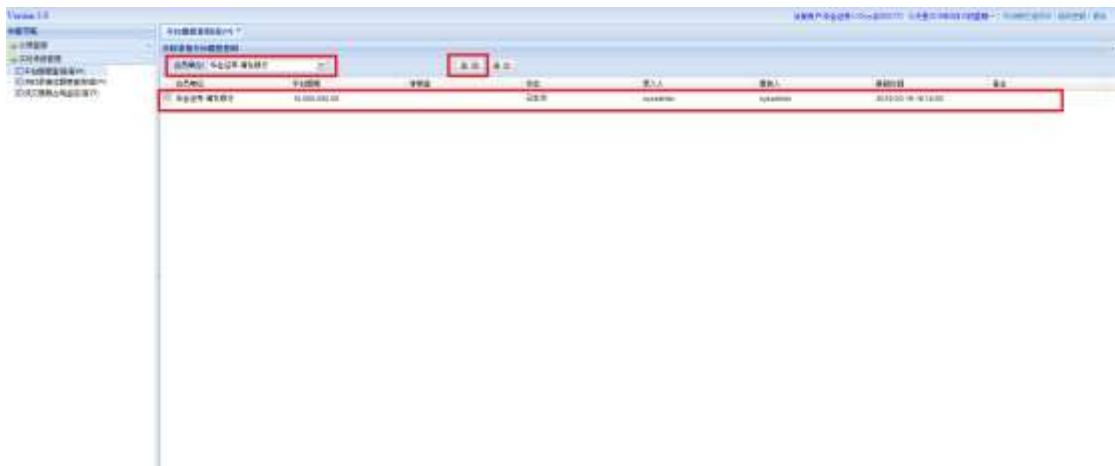
序号	代理名称	平台额度	币种	申请人	审批人	审批时间	操作
1	瑞泰证券	0	人民币	zhang@000001	zhang@000001	2019-05-18 12:17:08	查看详情
2	瑞泰证券	0	人民币	zhang@000001	zhang@000001	2019-05-18 12:17:08	查看详情
3	瑞泰证券	0	人民币	zhang@000001	zhang@000001	2019-05-18 12:17:08	查看详情
4	瑞泰证券	0	人民币	zhang@000001	zhang@000001	2019-05-18 12:17:08	查看详情
5	瑞泰证券	0	人民币	zhang@000001	zhang@000001	2019-05-18 12:17:08	查看详情
6	瑞泰证券	0	人民币	zhang@000001	zhang@000001	2019-05-18 12:17:08	查看详情
7	瑞泰证券	0	人民币	zhang@000001	zhang@000001	2019-05-18 12:17:08	查看详情
8	瑞泰证券	0	人民币	zhang@000001	zhang@000001	2019-05-18 12:17:08	查看详情
9	瑞泰证券	0	人民币	zhang@000001	zhang@000001	2019-05-18 12:17:08	查看详情
10	瑞泰证券	0	人民币	zhang@000001	zhang@000001	2019-05-18 12:17:08	查看详情
11	瑞泰证券	0	人民币	zhang@000001	zhang@000001	2019-05-18 12:17:08	查看详情
12	瑞泰证券	0	人民币	zhang@000001	zhang@000001	2019-05-18 12:17:08	查看详情
13	瑞泰证券	0	人民币	zhang@000001	zhang@000001	2019-05-18 12:17:08	查看详情
14	瑞泰证券	0	人民币	zhang@000001	zhang@000001	2019-05-18 12:17:08	查看详情
15	瑞泰证券	0	人民币	zhang@000001	zhang@000001	2019-05-18 12:17:08	查看详情
16	瑞泰证券	0	人民币	zhang@000001	zhang@000001	2019-05-18 12:17:08	查看详情
17	瑞泰证券	0	人民币	zhang@000001	zhang@000001	2019-05-18 12:17:08	查看详情
18	瑞泰证券	0	人民币	zhang@000001	zhang@000001	2019-05-18 12:17:08	查看详情
19	瑞泰证券	0	人民币	zhang@000001	zhang@000001	2019-05-18 12:17:08	查看详情
20	瑞泰证券	0	人民币	zhang@000001	zhang@000001	2019-05-18 12:17:08	查看详情

选择需要修改的记录，点击【修改】按钮，弹出修改页面，对代理客户的平台额度进行修改，修改后点击【确定】，该条记录状态变为【修改待复核】。



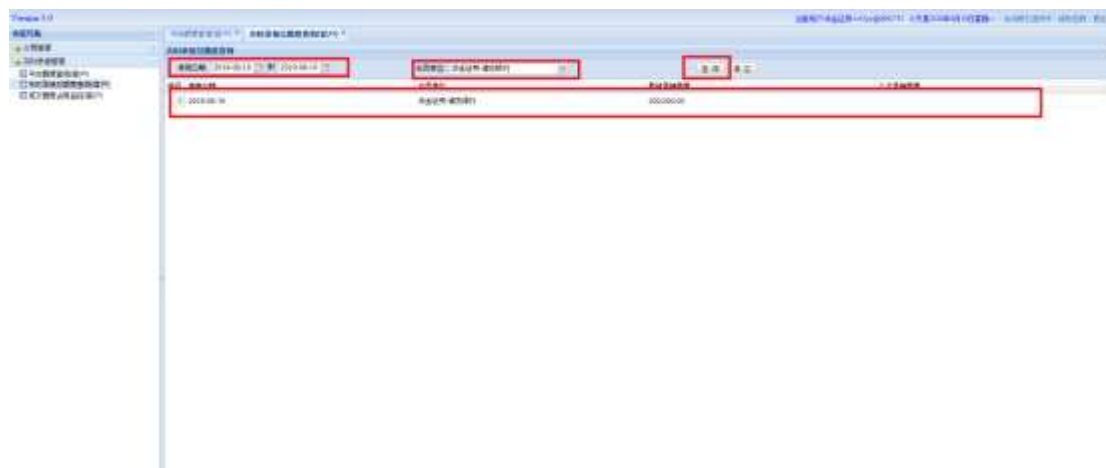
3. 平台额度查询（客户）

非清算会员登录客户端，进入“实时承接管理--平台额度查询（客户）”界面，在“会员单位”下选择该非清算会员，点击“查询”，显示非清会员平台额度。



实时承接总额度查询（客户）

非清算会员登录客户端，进入“实时承接管理—实时承接总额度查询（客户）”，选择“使用日期”“会员单位”，点击“查询”，显示其实时承接额度。



三、成交额占用监控

1. 成交额占用监控（代理）

综合清算会员登录客户端，进入“实时承接管理—成交额占用监控（代理）”界面，显示其参与实时承接业务的代理客户的成交额占用情况。



如需“额度试算”，点击“额度试算”。



2. 成交额占用监控（自营）

自营清算会员登录客户端，进入“实时承接管理--成交额占用监控（自营）”界面，显示其成交额占用情况。



如需“额度试算”，点击“额度试算”。



3. 成交额度占用监控（客户）

非清算会员登录客户端，进入“实时承接管理—成交额度占用监控（客户）”界面，显示其成交额度占用情况。



如需“额度试算”，点击“额度试算”



第三章 合约管理

一、合约查询（自营）

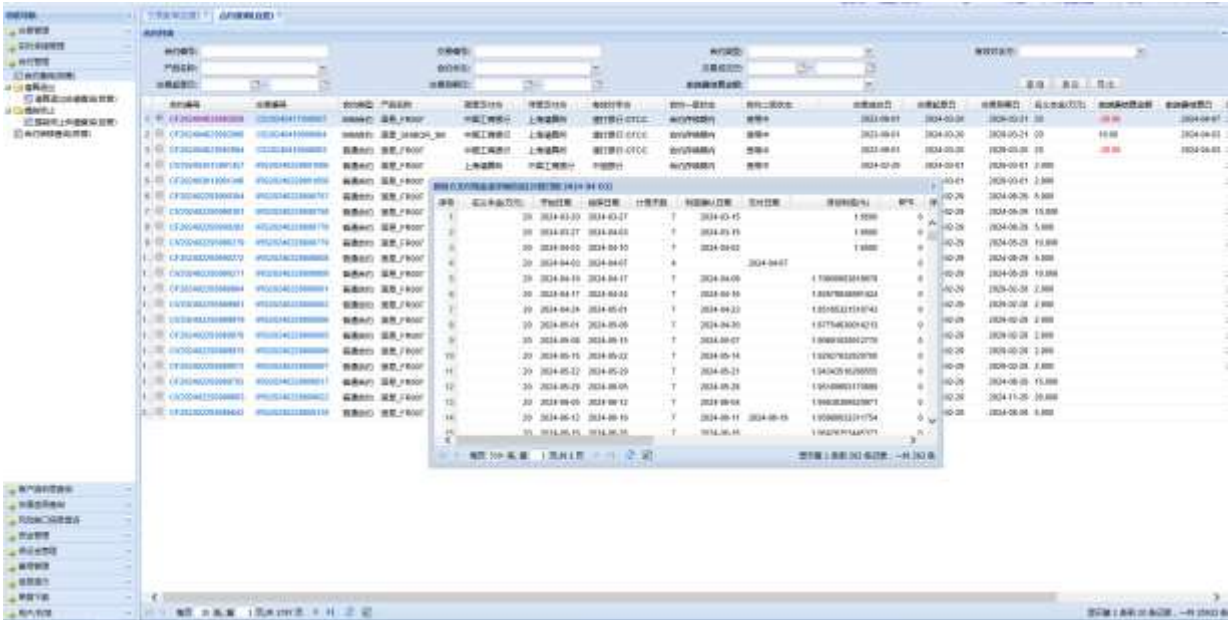
1. 合约列表

合约编号	交易编号	合约类型	产品代码	交易日期	交易起息日	交易到期日	交易利率	交易币种	交易对手	交易状态	交易金额	交易净额	交易损益	交易成本	交易收益
CF20240301000001	CF20240301000001	固定利率	CF20240301000001	2024-03-01	2024-03-01	2024-03-31	3.50%	CNY	工商银行	正常	10000000.00	10000000.00	0.00	0.00	0.00
CF20240301000002	CF20240301000002	固定利率	CF20240301000002	2024-03-01	2024-03-01	2024-03-31	3.50%	CNY	工商银行	正常	10000000.00	10000000.00	0.00	0.00	0.00
CF20240301000003	CF20240301000003	固定利率	CF20240301000003	2024-03-01	2024-03-01	2024-03-31	3.50%	CNY	工商银行	正常	10000000.00	10000000.00	0.00	0.00	0.00
CF20240301000004	CF20240301000004	固定利率	CF20240301000004	2024-03-01	2024-03-01	2024-03-31	3.50%	CNY	工商银行	正常	10000000.00	10000000.00	0.00	0.00	0.00
CF20240301000005	CF20240301000005	固定利率	CF20240301000005	2024-03-01	2024-03-01	2024-03-31	3.50%	CNY	工商银行	正常	10000000.00	10000000.00	0.00	0.00	0.00
CF20240301000006	CF20240301000006	固定利率	CF20240301000006	2024-03-01	2024-03-01	2024-03-31	3.50%	CNY	工商银行	正常	10000000.00	10000000.00	0.00	0.00	0.00
CF20240301000007	CF20240301000007	固定利率	CF20240301000007	2024-03-01	2024-03-01	2024-03-31	3.50%	CNY	工商银行	正常	10000000.00	10000000.00	0.00	0.00	0.00
CF20240301000008	CF20240301000008	固定利率	CF20240301000008	2024-03-01	2024-03-01	2024-03-31	3.50%	CNY	工商银行	正常	10000000.00	10000000.00	0.00	0.00	0.00
CF20240301000009	CF20240301000009	固定利率	CF20240301000009	2024-03-01	2024-03-01	2024-03-31	3.50%	CNY	工商银行	正常	10000000.00	10000000.00	0.00	0.00	0.00
CF20240301000010	CF20240301000010	固定利率	CF20240301000010	2024-03-01	2024-03-01	2024-03-31	3.50%	CNY	工商银行	正常	10000000.00	10000000.00	0.00	0.00	0.00

如上图，进入菜单“合约管理”—“合约查询（自营）”，该界面提供会员自己作为交易方的所有利率互换合约信息。可按“合约编号”（浮息支付方以 CV 开头，固定支付方 CF 开头）、“交易编号”、“合约类型”“会员单位”（即交易的有效对手方）、“产品名称”、“合约状态”、“交易成交日”、“交易起息日”、“交易到期日”和“前端费结算

金额”筛选查询。查询按钮包括“查询”“清空”。该界面列表初始显示登录综合会员的所有利率互换合约，且按照合约编号倒序排列。

2. 浮（固）息方支付现金流详细信息



如上图，点击列表中的“合约编号”链接，弹出“浮息方支付现金流详细信息”或者“固息方支付现金流详细信息”，可查看该合约每个支付日期的浮息现金流、固息现金流、现金流净额，以及每个支付日贴现后浮息现金流、贴现后固息现金流、前端费现金流。

3. 交易信息

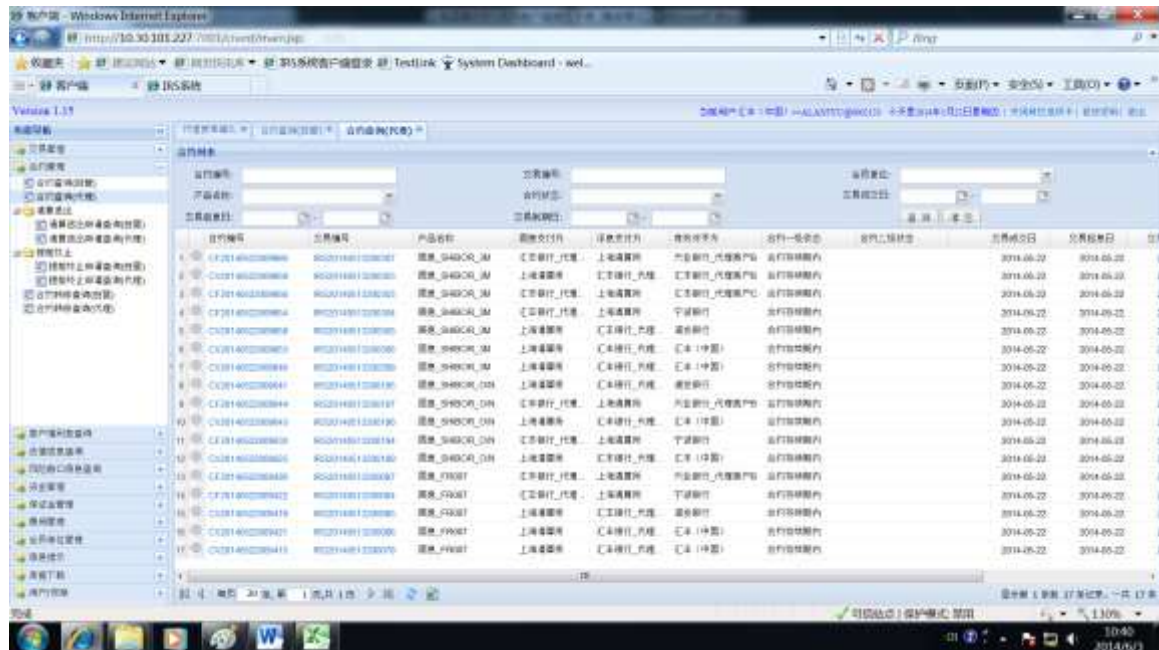


交易信息			
交易编号:	CS20240417000007	交易中心编号:	CS20240417000007
合约类型:	BMM合约		
前馈费:	20.00	前馈费支付方:	中国工商银行
前馈费币种:	CNY	前馈费结算日:	2024-04-07
交易产品:	国债_FR007	申请清算方式:	净额清算
提交清算日期:	2024-04-03	交易起息日:	2024-03-20
交易成交日:	2023-09-01	交易到期日:	2029-03-21
币种:	人民币	名义本金(万元):	20
计息天数调整:	实际天数调整	支付日营业日准则:	经调整的下一营业日准则
交易处理状态:	已确认(正常)	交易数据来源:	交易中心
固息方信息		浮息方信息	
固息方合约号:	CF202404033992926	浮息方合约号:	CV202404033992927
固息支付方:	中国工商银行	浮息支付方:	渣打银行-OTCC
固息支付周期:	季	浮息支付周期:	季

如上图，单击列表中的“交易编号”链接，弹出交易明细提示框，包括交易信息、固息方信息、浮息方信息、前端费信息和备注。

二、合约查询（代理）

1. 合约列表

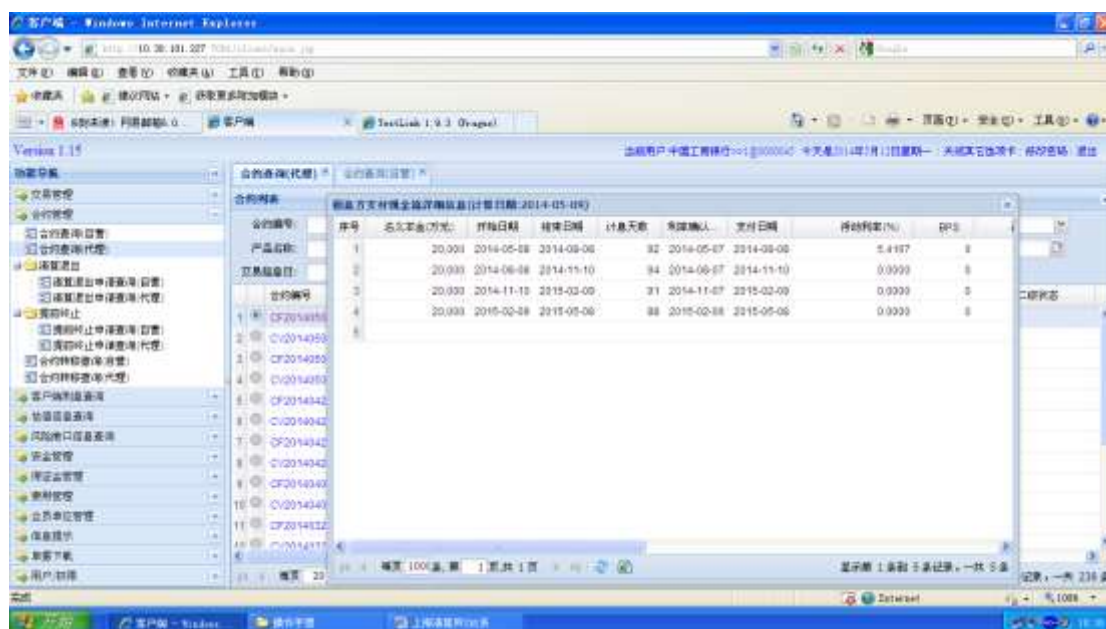


行号	合约编号	交易编号	产品名称	固息支付方	浮息支付方	清算方式	合约一方名称	合约生效日期	合约到期日
1	CF201402200000	80201401200001	国债_SH90C_3M	工商银行_代理	上海清算所	产品银行_代理清算	工商银行代理	2014-06-22	2014-06-22
2	CF201402200000	80201401200002	国债_SH90C_3M	工商银行_代理	上海清算所	产品银行_代理清算	工商银行代理	2014-06-22	2014-06-22
3	CF201402200000	80201401200003	国债_SH90C_3M	工商银行_代理	上海清算所	产品银行_代理清算	工商银行代理	2014-06-22	2014-06-22
4	CF201402200000	80201401200004	国债_SH90C_3M	工商银行_代理	上海清算所	净额清算	工商银行代理	2014-06-22	2014-06-22
5	CF201402200000	80201401200005	国债_SH90C_3M	工商银行_代理	上海清算所	净额清算	工商银行代理	2014-06-22	2014-06-22
6	CF201402200000	80201401200006	国债_SH90C_3M	工商银行_代理	上海清算所	净额清算	工商银行代理	2014-06-22	2014-06-22
7	CF201402200000	80201401200007	国债_SH90C_3M	工商银行_代理	上海清算所	净额清算	工商银行代理	2014-06-22	2014-06-22
8	CF201402200000	80201401200008	国债_SH90C_3M	工商银行_代理	上海清算所	净额清算	工商银行代理	2014-06-22	2014-06-22
9	CF201402200000	80201401200009	国债_SH90C_3M	工商银行_代理	上海清算所	净额清算	工商银行代理	2014-06-22	2014-06-22
10	CF201402200000	80201401200010	国债_SH90C_3M	工商银行_代理	上海清算所	净额清算	工商银行代理	2014-06-22	2014-06-22
11	CF201402200000	80201401200011	国债_SH90C_3M	工商银行_代理	上海清算所	净额清算	工商银行代理	2014-06-22	2014-06-22
12	CF201402200000	80201401200012	国债_SH90C_3M	工商银行_代理	上海清算所	净额清算	工商银行代理	2014-06-22	2014-06-22
13	CF201402200000	80201401200013	国债_SH90C_3M	工商银行_代理	上海清算所	净额清算	工商银行代理	2014-06-22	2014-06-22
14	CF201402200000	80201401200014	国债_FR007	工商银行_代理	上海清算所	产品银行_代理清算	工商银行代理	2014-06-22	2014-06-22
15	CF201402200000	80201401200015	国债_FR007	工商银行_代理	上海清算所	净额清算	工商银行代理	2014-06-22	2014-06-22
16	CF201402200000	80201401200016	国债_FR007	工商银行_代理	上海清算所	净额清算	工商银行代理	2014-06-22	2014-06-22
17	CF201402200000	80201401200017	国债_FR007	工商银行_代理	上海清算所	净额清算	工商银行代理	2014-06-22	2014-06-22
18	CF201402200000	80201401200018	国债_FR007	工商银行_代理	上海清算所	净额清算	工商银行代理	2014-06-22	2014-06-22
19	CF201402200000	80201401200019	国债_FR007	工商银行_代理	上海清算所	净额清算	工商银行代理	2014-06-22	2014-06-22
20	CF201402200000	80201401200020	国债_FR007	工商银行_代理	上海清算所	净额清算	工商银行代理	2014-06-22	2014-06-22

如上图，进入菜单“合约管理”—“合约查询（代理）”，该界面提供综合会员所代理客户作为交易方的所有利率互换合约信息。可按

“合约编号”（浮息支付方以 CV 开头，固息支付方 CF 开头）、“交易编号”、“会员单位”（即交易的有效对手方）、“产品名称”、“合约状态”、“交易成交日”、“交易起息日”、“交易到期日”和“前端费结算金额”筛选查询。查询按钮包括“查询”“清空”。该界面列表初始显示该综合会员代理客户的所有利率互换合约，且按照合约编号倒序排列。

2. 浮（固）息方支付现金流详细信息



如上图，点击列表中的“合约编号”链接，弹出“浮息方支付现金流详细信息”或者“固息方支付现金流详细信息”及前端费现金流。

3. 交易信息



如上图，单击列表中的“交易编号”链接，弹出交易明细提示框，包括交易信息、固息方信息、浮息方信息、前端费信息和备注。

三、清算退出

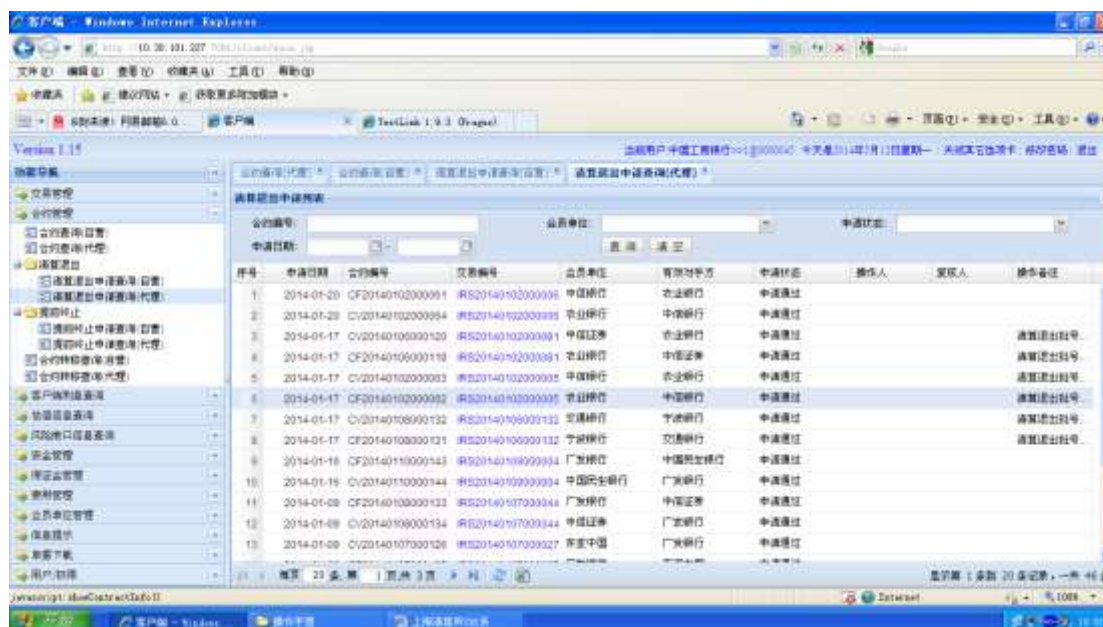
1. 清算退出申请查询（自营）



如上图，进入菜单“合约管理”—“清算退出”—“清算退出申请查询(自营)”，可以查询清算退出的合约明细。该界面提供按照“合

约编号”、“会员单位”、“申请状态”、“申请日期”进行查询的功能，提供“查询”、“清空”两个操作按钮。

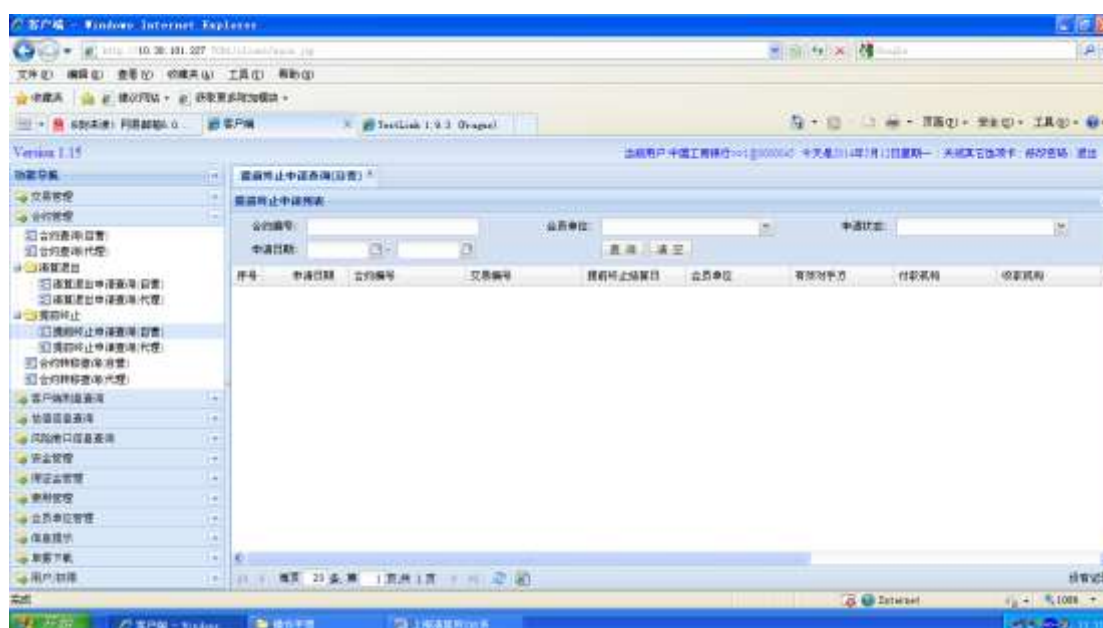
2. 清算退出申请查询（代理）



如上图，进入菜单“合约管理”—“清算退出”—“清算退出申请查询(代理)”，可以查询综合会员所代理客户清算退出的合约明细。

四、提前终止

1. 提前终止申请查询（自营）



如上图，进入菜单“合约管理”—“提前终止”—“提前终止申请查询(自营)”，可以查询提前终止的合约明细。该界面提供按照“合约编号”、“会员单位”、“申请状态”、“申请日期”进行查询的功能，提供“查询”、“清空”两个操作按钮。

2. 提前终止申请查询（代理）



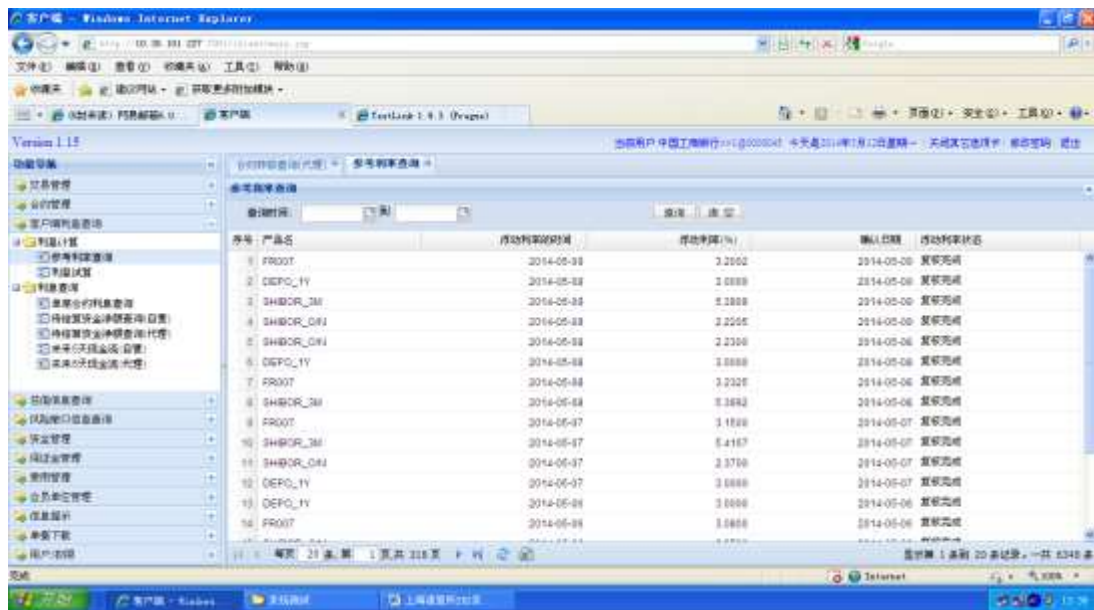
如上图，进入菜单“合约管理”—“提前终止”—“提前终止申请查询（代理）”，可以查询提前终止的合约明细。

界面提供综合会员代理客户所有转移操作的合约信息查询功能。可按“合约编号”、“交易编号”、“会员单位”、“产品名称”和“转移日期”进行筛选查询。

第四章 客户端利息查询

一、利息计算

1. 参考利率查询



序号	产品名称	浮动利率时间	浮动利率%	确认日期	浮动利率状态
1	FR00T	2014-05-28	3.2000	2014-05-28	复核完成
2	DEPC_IV	2014-05-28	3.0800	2014-05-28	复核完成
3	SHBOR_3M	2014-05-28	3.2800	2014-05-28	复核完成
4	SHBOR_6M	2014-05-28	3.2500	2014-05-28	复核完成
5	SHBOR_9M	2014-05-28	3.2300	2014-05-28	复核完成
6	DEPC_IV	2014-05-28	3.0800	2014-05-28	复核完成
7	FR00T	2014-05-28	3.2320	2014-05-28	复核完成
8	SHBOR_3M	2014-05-28	3.2692	2014-05-28	复核完成
9	FR00T	2014-05-27	3.1800	2014-05-27	复核完成
10	SHBOR_3M	2014-05-27	3.4167	2014-05-27	复核完成
11	SHBOR_6M	2014-05-27	3.3700	2014-05-27	复核完成
12	DEPC_IV	2014-05-27	3.0800	2014-05-27	复核完成
13	DEPC_IV	2014-05-28	3.0800	2014-05-28	复核完成
14	FR00T	2014-05-28	3.0800	2014-05-28	复核完成

如上图，进入菜单“客户端利息查询”—“利息计算”—“参考利率查询”，该界面提供当日及历史的参考利率查询功能。可按日期进行筛选查询。列表中“浮动利率状态”为“复核完成”的利率已确认使用。

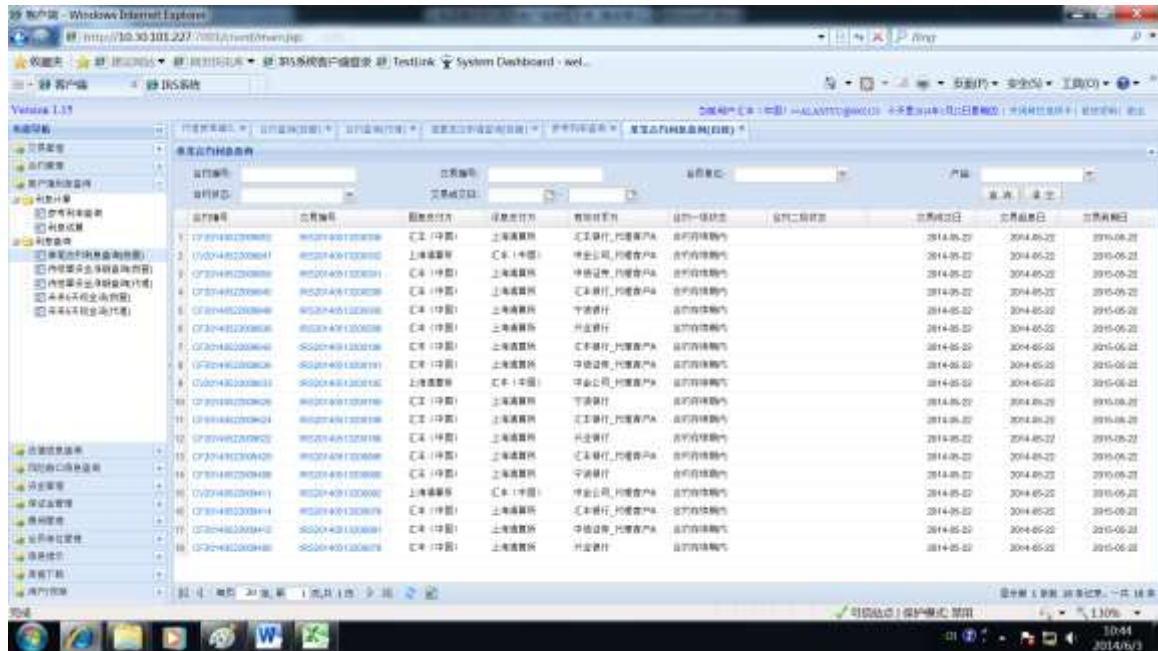
2. 利息试算

交易编号: E1111111					
交易产品: 固息_FR007	币种: 人民币				
交易成交日: 2021-09-07	交易起息日: 2021-09-08	交易到期日: 2022-09-08			
固息支付方: 利息周期普通	名义本金(万元): 1,000	固定利率(%): 2.3	浮息支付方: 利息周期普通	名义本金(万元): 1,000	1x固息_FR007+ 0 bps
计算基准: A/365	打市价值(元): 21,776.14		计算基准: A/365	打市价值(元): -21,776.14	
支付周期: 季	单利/复利: 单利		支付周期: 季	单利/复利: 复利	利息 accrual: 周
试算 导出本次试算结果 查询最近试算					

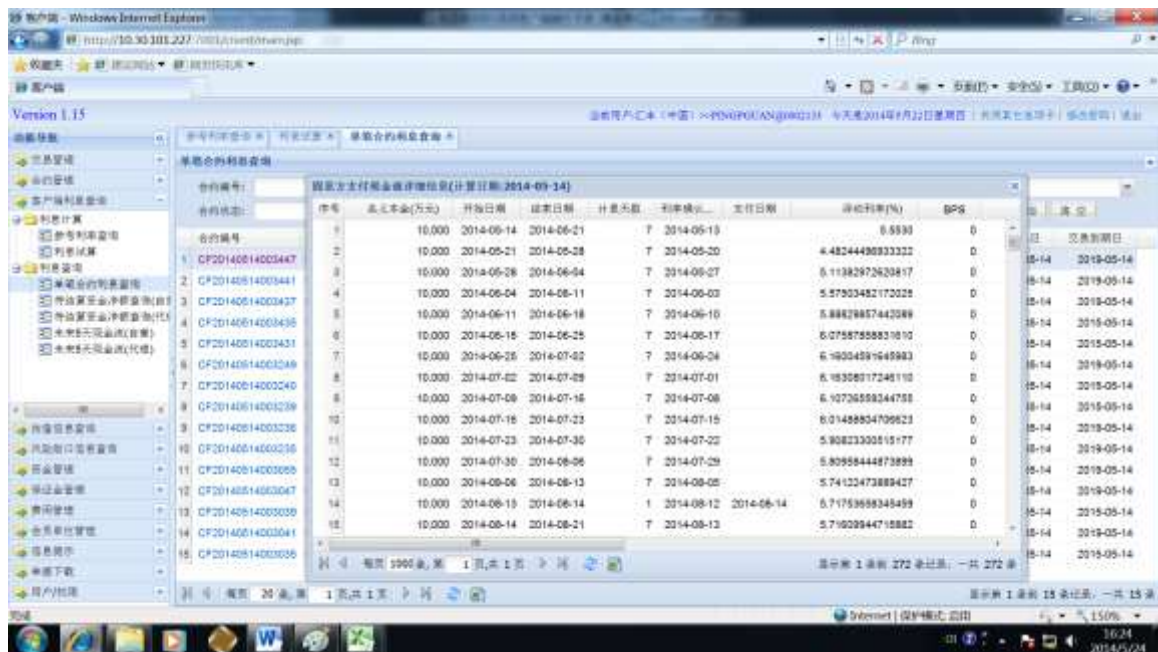
如上图，进入菜单“客户端利息查询”—“利息计算”—“利息试算”，该界面可以通过输入交易产品、交易期限、名义本金、固定利率、支付周期来计算某一交易的现金流详细信息。点击“试算”，显示固息支付方、浮息支付方的盯市价值；点击“导出本次试算结果”，可以导出固息支付方的详细现金流信息；点击“查询最近试算”，试算界面的录入信息会自动重置为上一次试算的录入信息。

二、利息查询

1. 单笔合约利息查询（自营）



如上图，进入菜单“客户端利息查询”—“利息计算”—“单笔合约利息查询(自营)”，该界面提供每个自营合约各个支付日的现金流信息查询功能。可按“合约编号”、“交易编号”、“会员单位”、“产品”、“合约状态”和“交易成交日”进行筛选查询。



如上图，单击列表中的“合约编号”，弹出该笔合约的现金流详细信息。



如上图，单击列表中的“交易编号”，弹出该笔合约对应的交易明细信息。

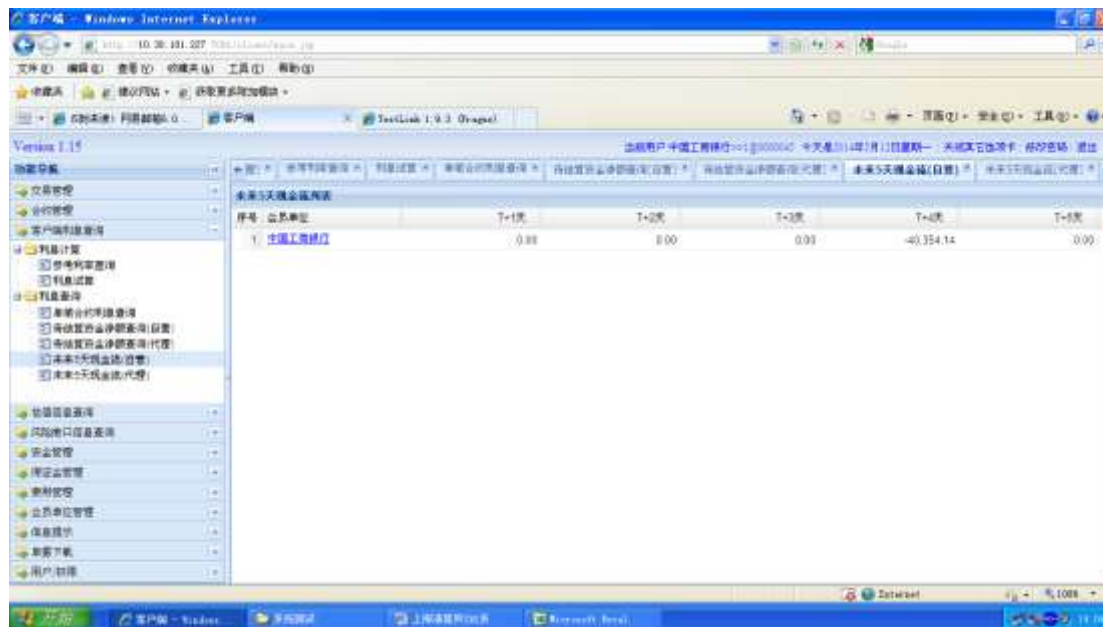
2. 单笔合约利息查询（代理）



如上图，进入菜单“客户端利息查询”——“利息计算”——“单笔

细信息。

3. 未来 5 天现金流（自营）



如上图，进入菜单“客户端利率查询”—“利息查询”—“未来5天现金流（自营）”，该界面提供未来五个工作日的现金流详细信息查询功能。



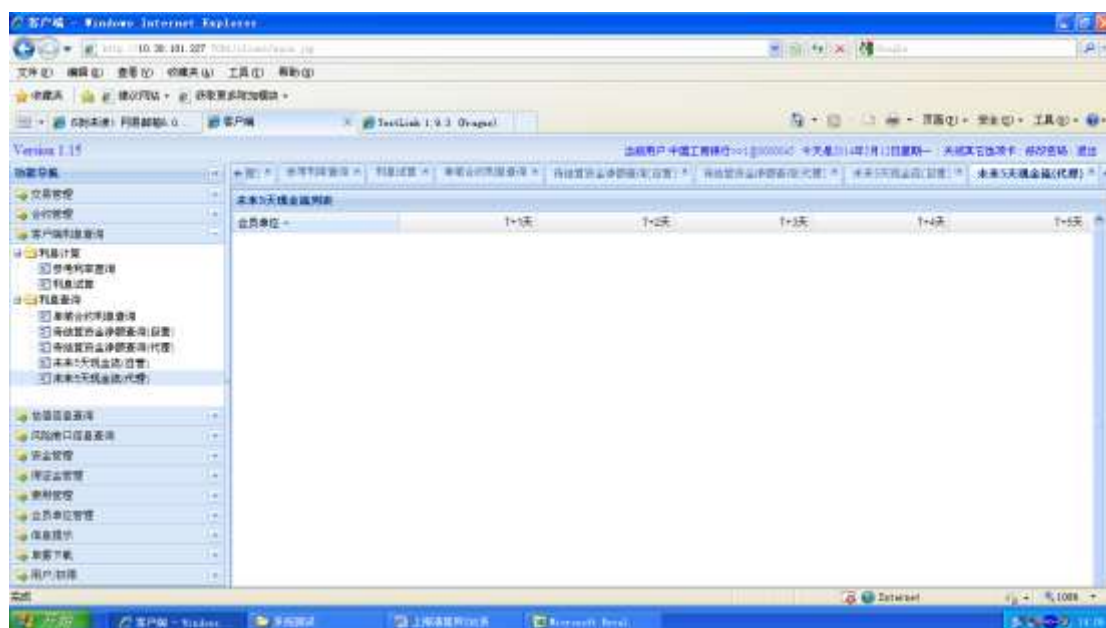
如上图，单击列表中的“会员单位”，弹出未来五个工作日每天每

笔合约的现金流信息。

此外，该界面具有导出功能。点击“导出”按钮，弹出导出框，操作人员可根据需要勾选条件。其中未来天数可多选（支持选择T+1-T+5）；是否需要合约明细，若选否，则仅导出现金流金额；选是，则附加导出对应的合约现金流。



4. 未来 5 天现金流（代理）



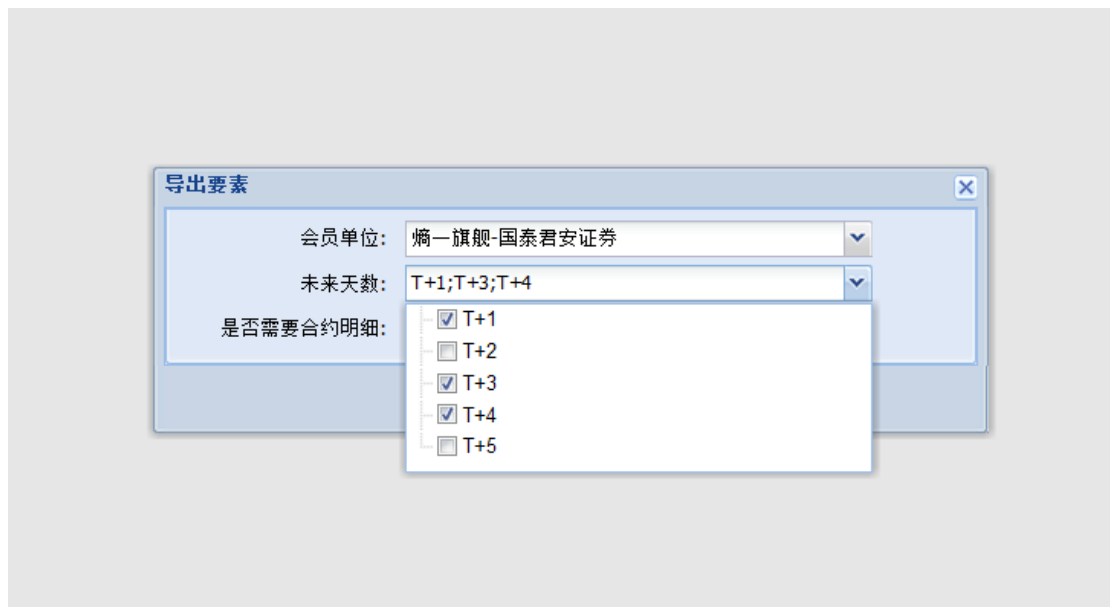
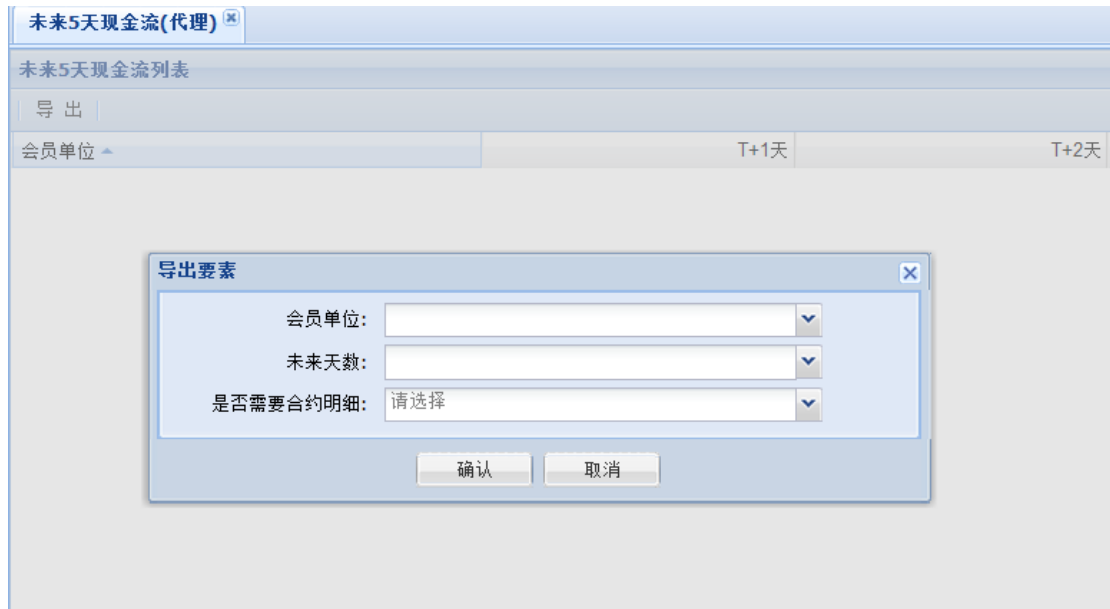
如上图，进入菜单“客户端利息查询”—“利息查询”—“未来5天现金流（代理）”，该界面提供未来五个工作日的现金流详细信息查询功能。



如上图，单击列表中的“会员单位”，弹出未来五个工作日每天每笔合约的现金流信息。

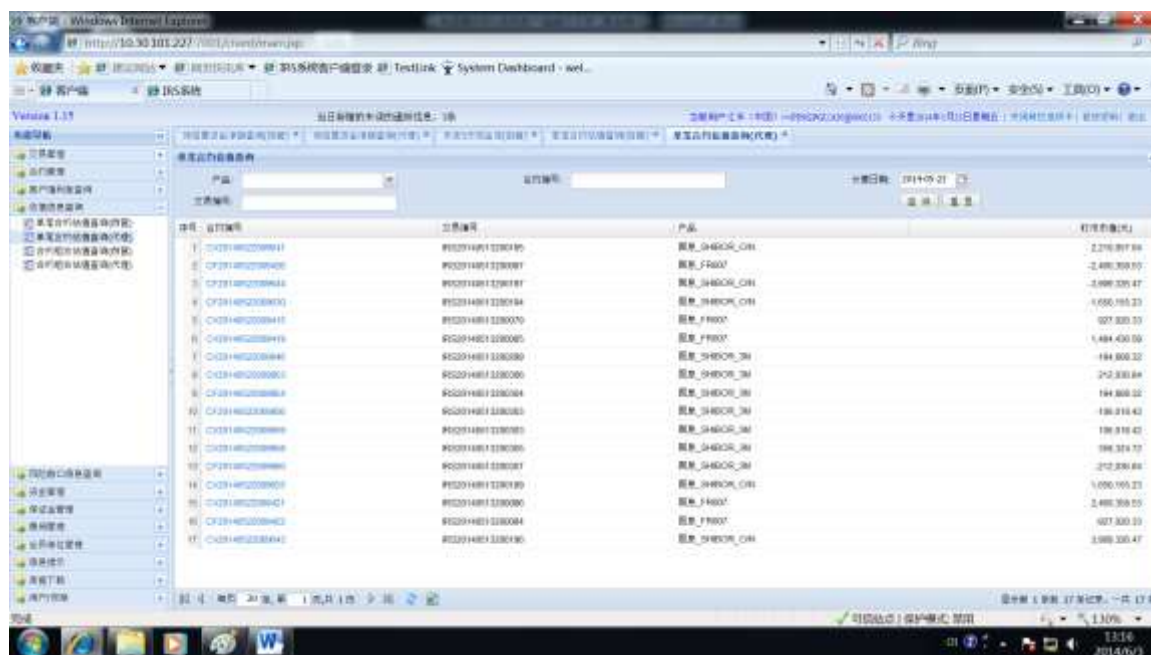
此外，该界面具有导出功能。点击“导出”按钮，弹出导出框，

操作人员可根据需要勾选条件。其中未来天数可多选（支持选择T+1-T+5）；是否需要合约明细，若选否，则仅导出现金流金额；选是，则附加导出对应的合约现金流。



交易详细信息。

二、单笔合约估值查询（代理）



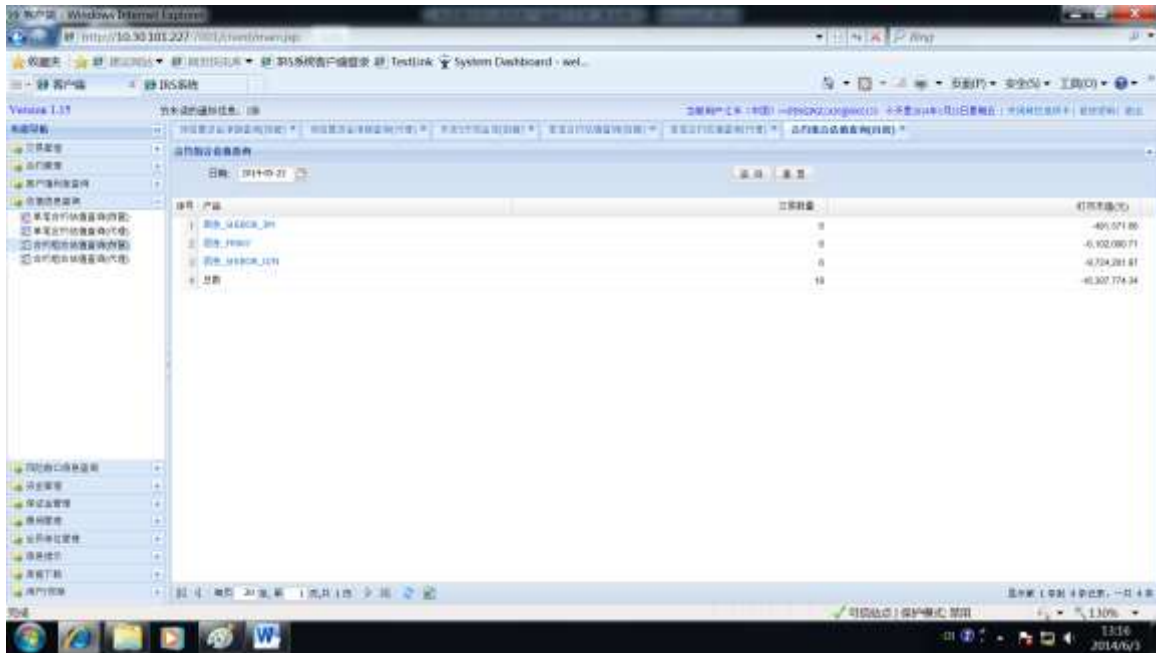
如上图，进入菜单“估值信息查询”——“单笔合约估值查询（代理）”，该界面提供合约估值信息查询功能。可按“产品”、“合约编号”、“计算日期”和“交易编号”进行筛选查询。



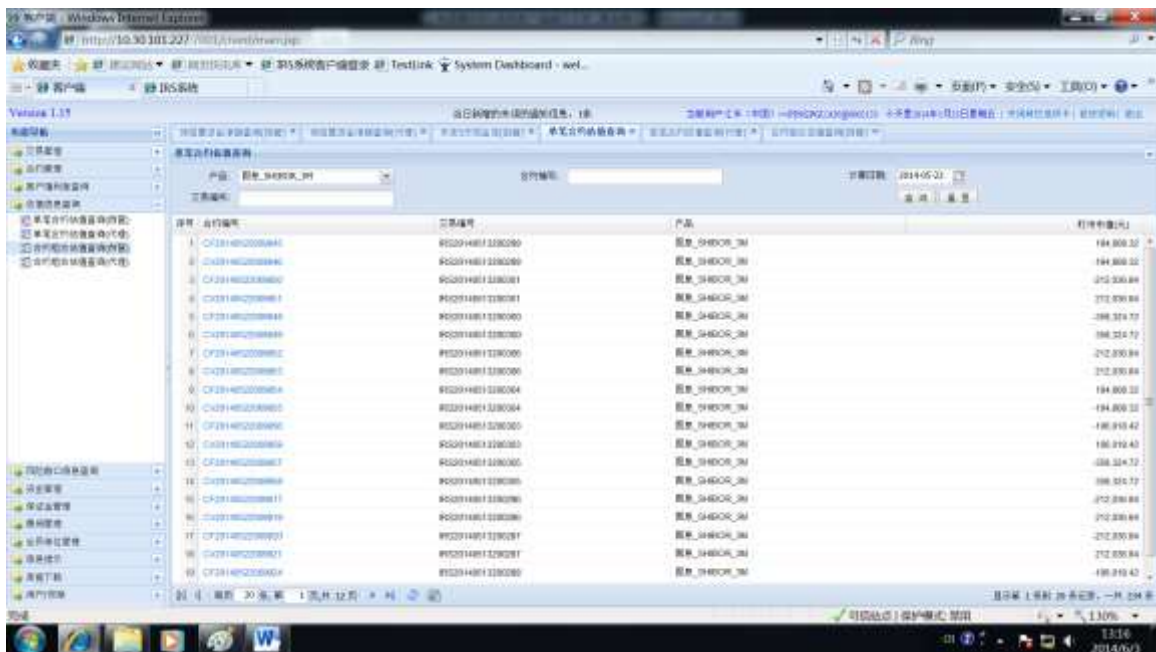
如上图，单击列表中的“合约编号”链接，弹出该笔合约对应的

交易详细信息。

三、合约组合估值查询（自营）

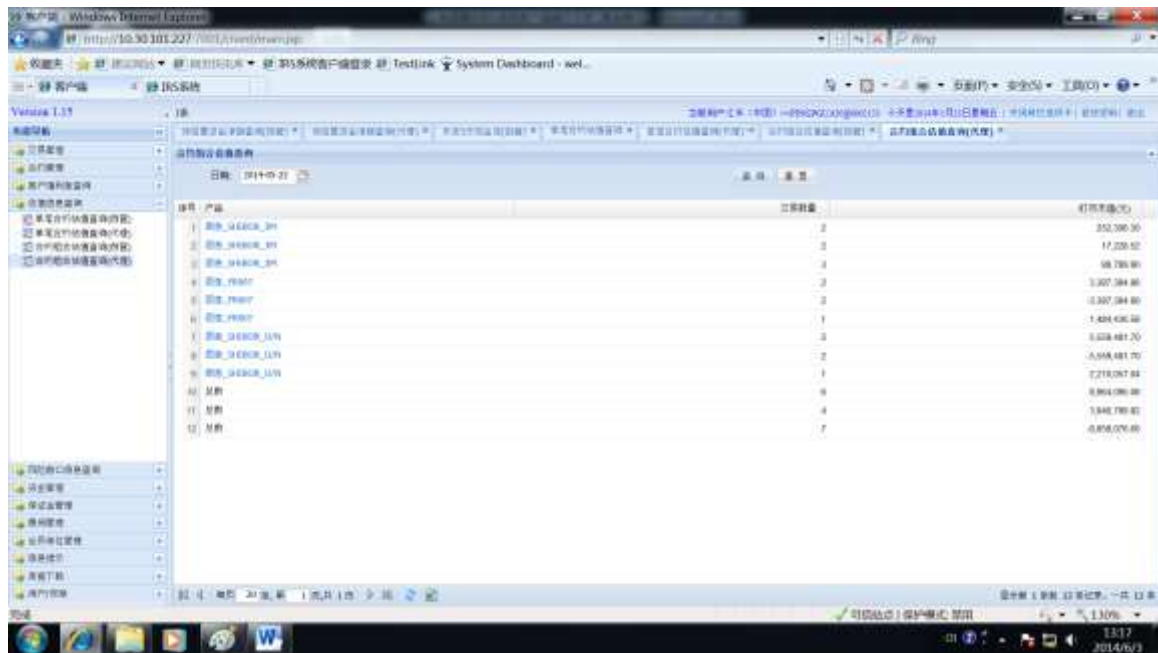


如上图，进入菜单“估值信息查询”—“合约组合估值查询（自营）”，该界面提供合约组合估值信息查询功能，按产品分类统计每类产品包含的交易数量，可按“日期”进行筛选查询。单击列表中的“产品”链接，弹出该类产品所有单笔合约估值查询界面。



如上图，单击列表中的“合约编号”，弹出此类合约的详细信息。

四、合约组合估值查询（代理）



如上图，进入菜单“估值信息查询”—“合约组合估值查询（代理）”，该界面提供合约组合估值信息查询功能，按产品分类统计每类产品包含的交易数量，可按“日期”进行筛选查询。单击列表中的“产品”链接，弹出该类产品所有单笔合约估值查询界面。



如上图，单击列表中的“合约编号”，弹出此类合约的详细信息。

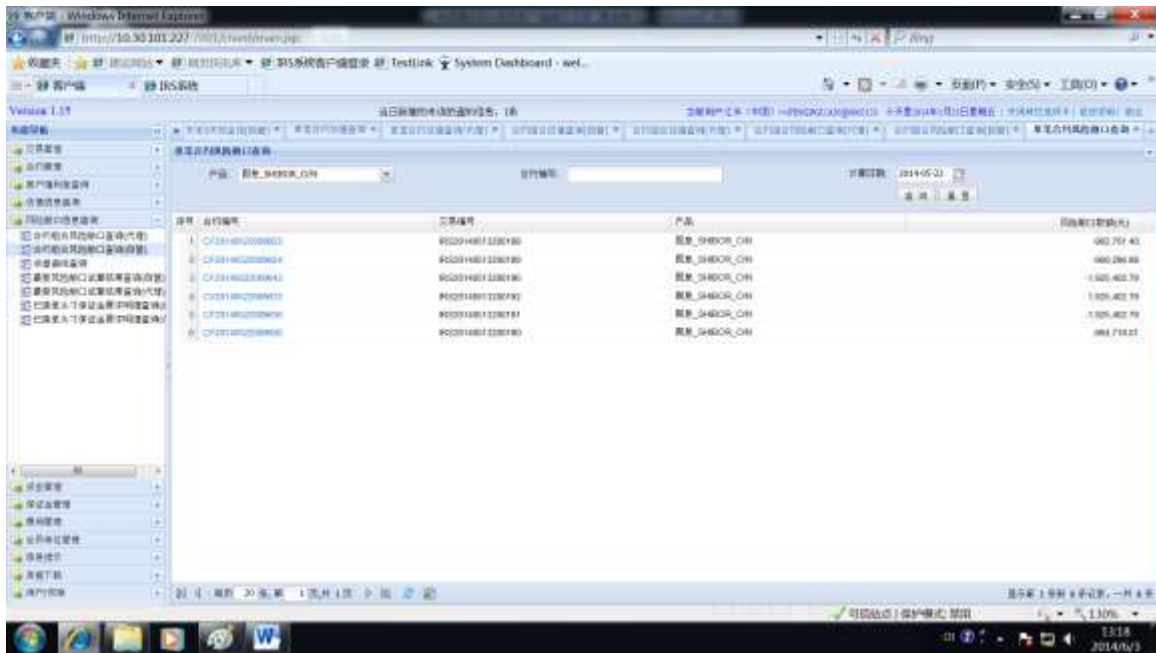
第六章 风险敞口信息查询

一、合约组合风险敞口查询（自营）

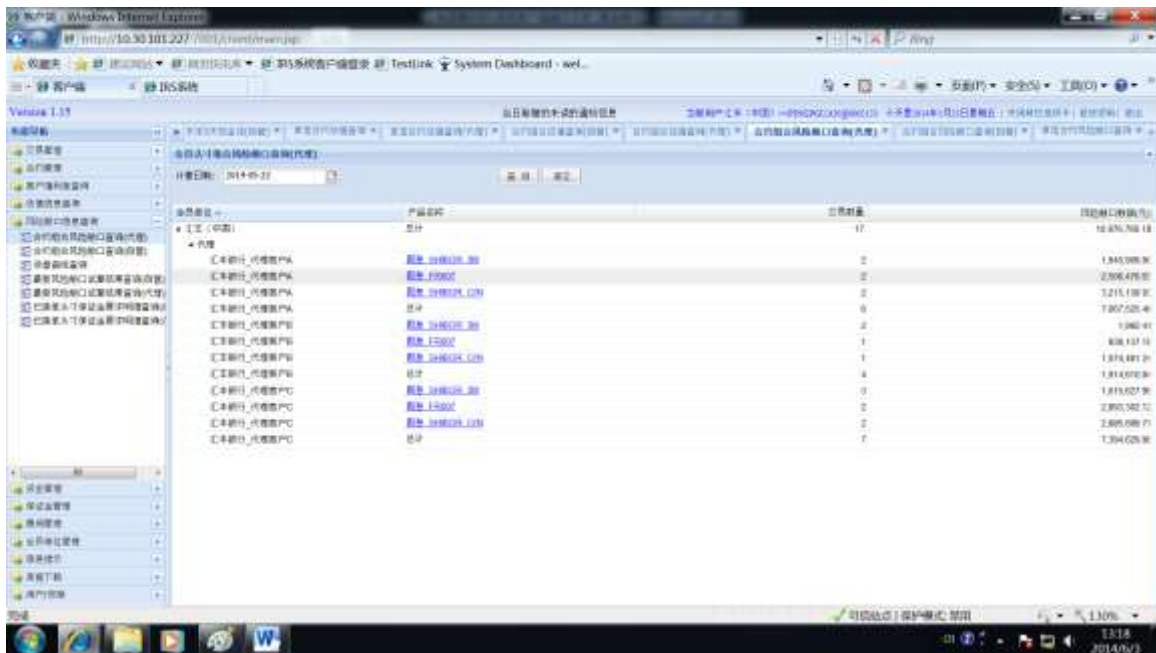


合同类型	产品名称	总量数量	风险敞口金额(元)
合计		97	17,902,127.88
自营			
北丰银行_自营客户A	国债_3098C01_0M	22	2,081,238.11
北丰银行_自营客户A	国债_3153C1	22	2,087,705.89
北丰银行_自营客户A	国债_3098C01_0M	22	3,170,790.89
北丰银行_自营客户A	合计	66	7,239,734.89
北丰银行_自营客户B	国债_3098C01_0M	22	1,802.47
北丰银行_自营客户B	国债_3153C1	21	491,872.60
北丰银行_自营客户B	国债_3098C01_0M	1	1,080,308.06
北丰银行_自营客户B	合计	44	1,493,983.13
北丰银行_自营客户C	国债_3098C01_0M	10	1,389,888.00
北丰银行_自营客户C	国债_3153C1	2	3,072,348.36
北丰银行_自营客户C	国债_3098C01_0M	2	2,880,229.20
北丰银行_自营客户C	合计	14	7,342,465.56

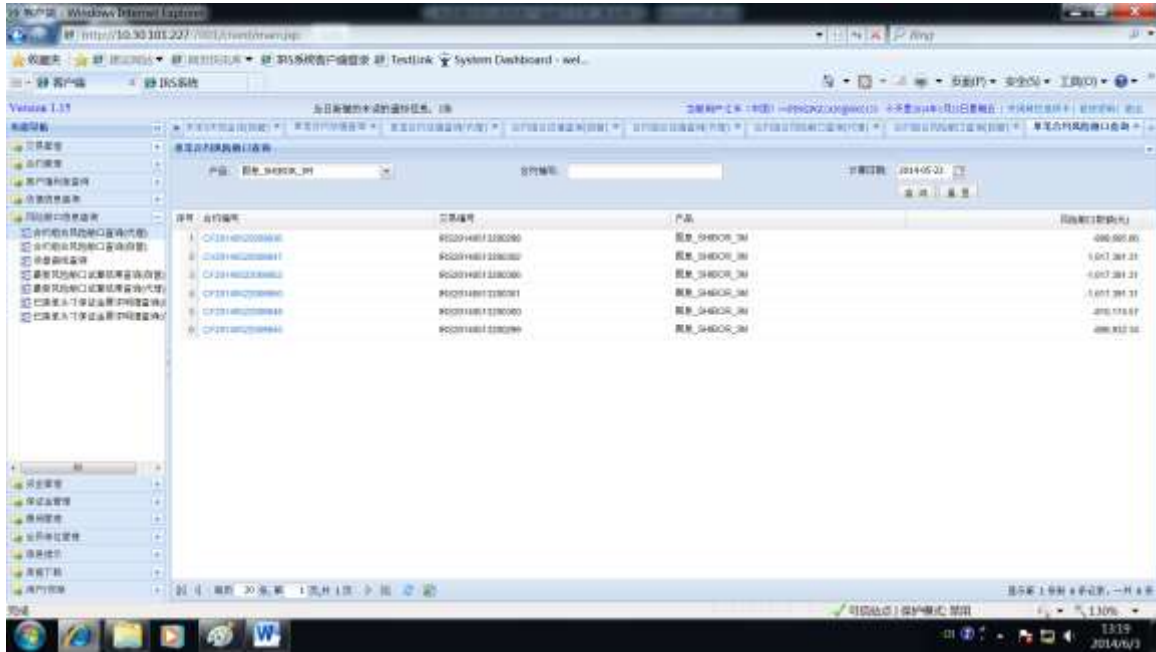
如上图，进入菜单“风险敞口信息查询”—“合约组合风险敞口查询（自营）”，该界面提供综合会员自营业务所有合约组合风险敞口信息查询功能。单击列表中的“产品”链接，即转入该类产品所有单笔合约风险敞口查询界面，如下图。



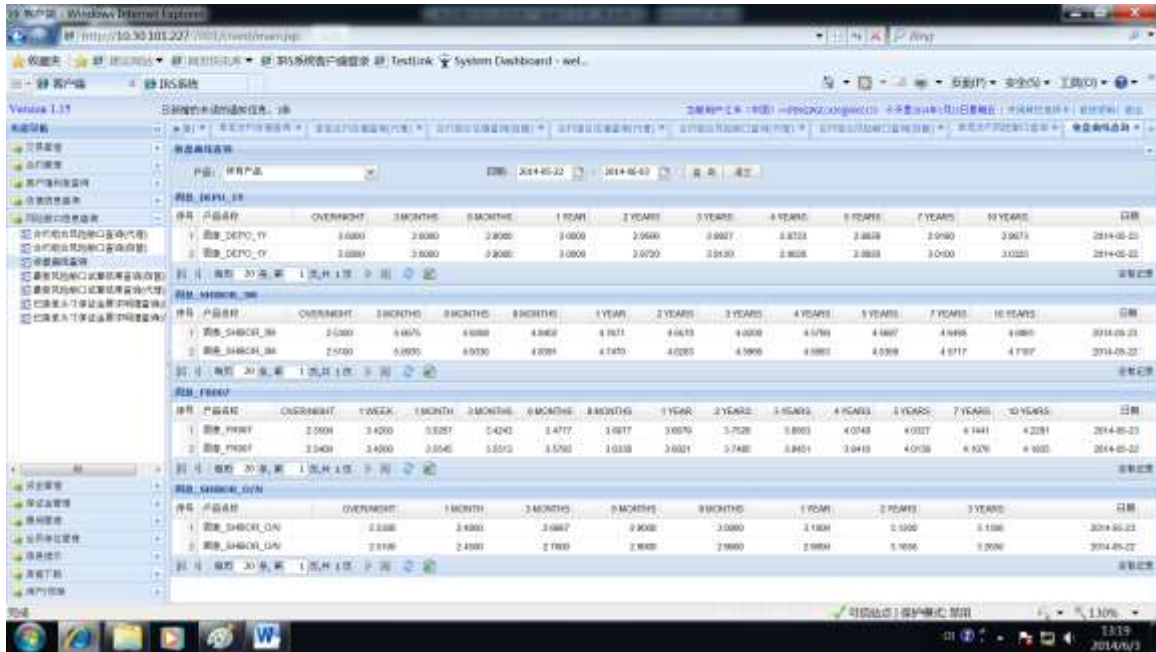
二、合约组合风险敞口查询（代理）



如上图，进入菜单“风险敞口信息查询”—“合约组合风险敞口查询（代理）”，该界面提供综合会员代理客户所有合约组合风险敞口信息查询功能。单击列表中的“产品名称”链接，即转入该类产品所有单笔合约风险敞口查询界面，如下图。



三、收盘曲线查询

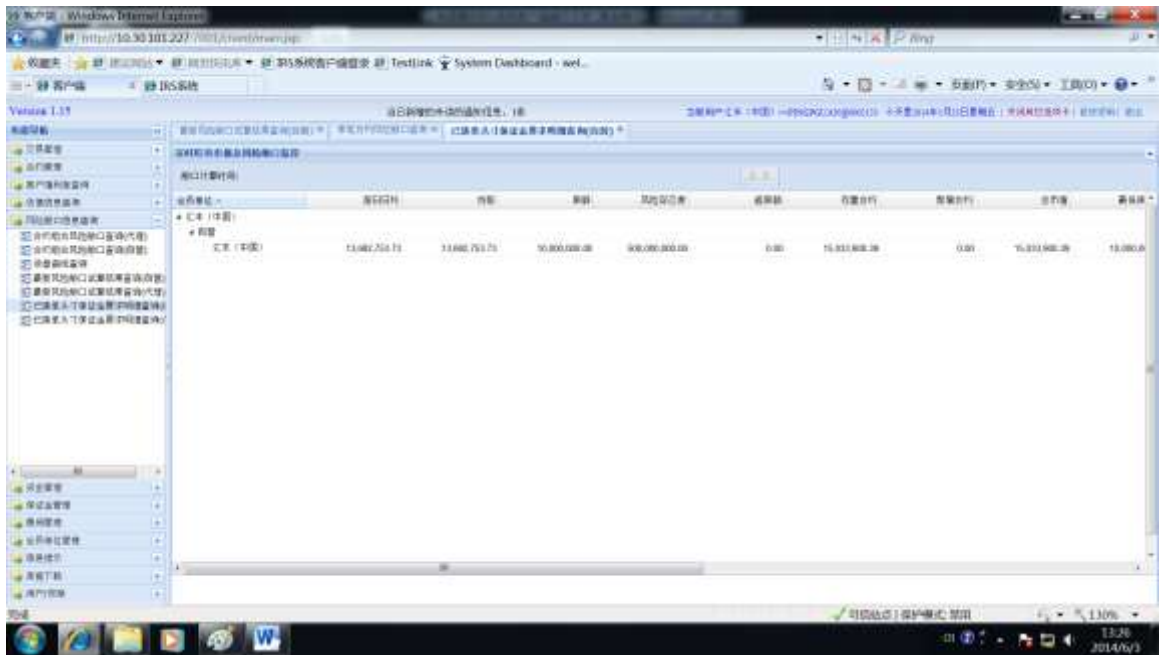


如上图，进入菜单“风险敞口信息查询”—“收盘曲线查询”，该界面提供当日及历史每种产品的收盘曲线查询功能。可按照“产品”和“日期”进行查询。

收盘曲线界面设置导出功能，输入相应条件，点击“导出”按钮，可将查询的数据以 excel 格式导出，如下图。

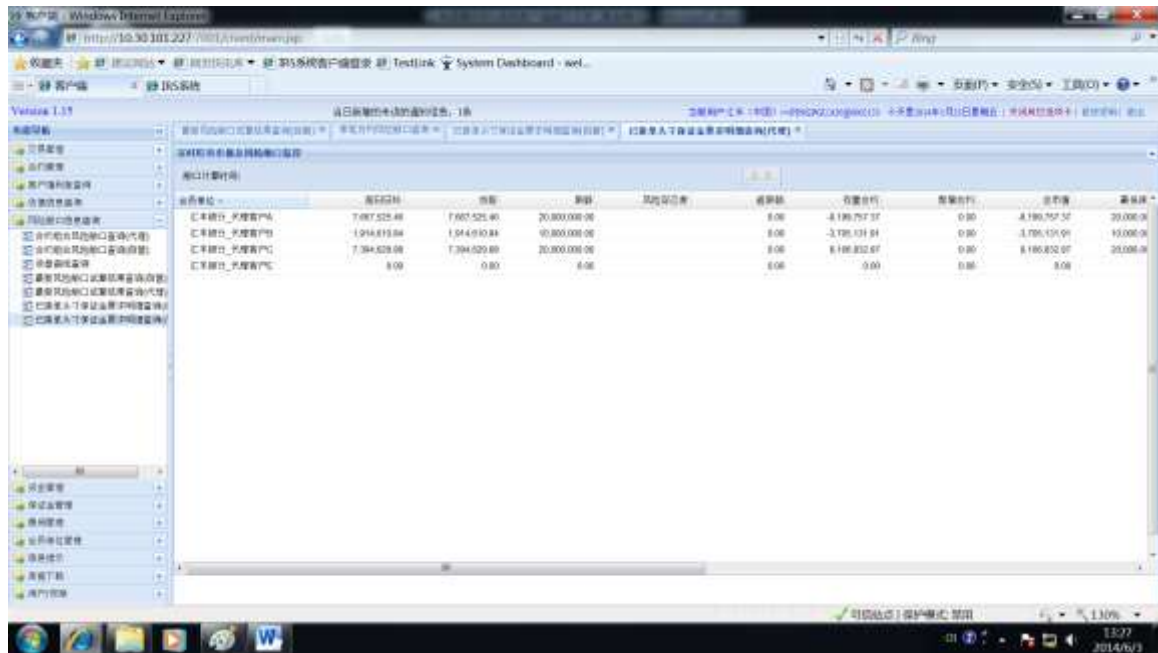


四、已接单头寸保证金要求明细查询（自营）



如上图，进入菜单“风险敞口信息查询”—“已接单头寸保证金要求明细查询（自营）”，该界面提供已接单自营头寸最近一次风险敞口试算结果。

五、已接单头寸保证金要求明细查询（代理）



如上图，进入菜单“风险敞口信息查询”—“已接单头寸保证金要求明细查询（代理）”，该界面提供已接单代理头寸最近一次风险敞口试算结果。

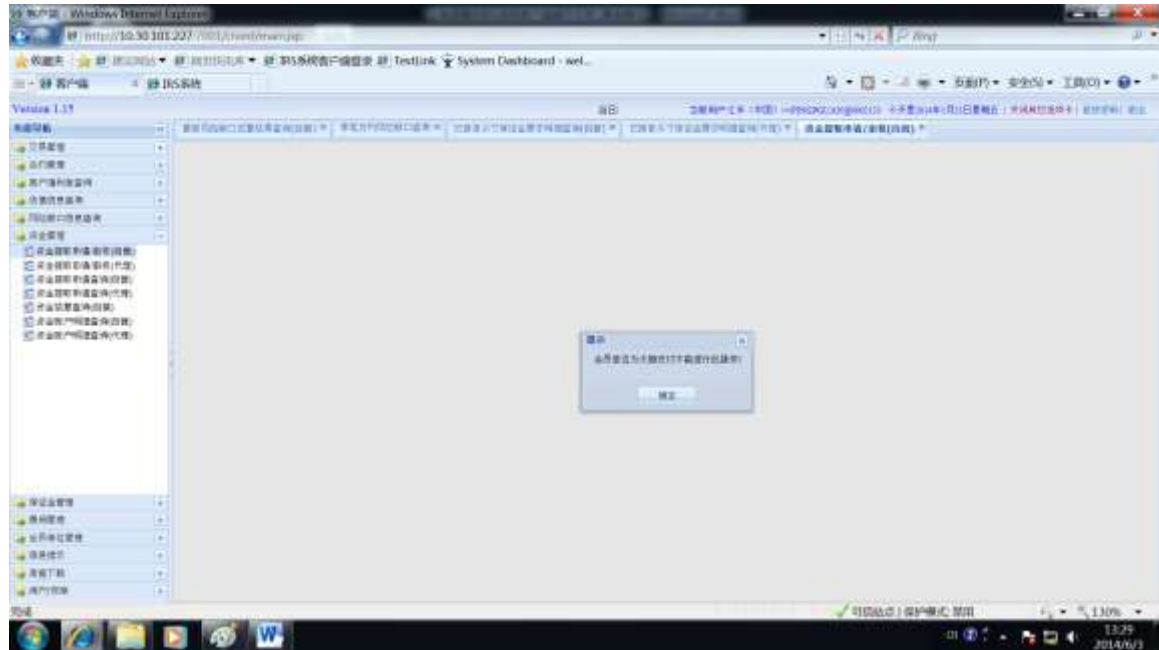
同时，该页面每列具有排序功能。操作人员点击每列名称，设置排序顺序（正序、倒序）。涉及文字的按照拼音首字母排序（首字母相同往后类推），涉及数字的按照金额大小顺序排序。见下图。

会员单位	已接单合约敞口	会员合约敞口	限额
万联证券-中国工商银行	0.00	0.00	500,000.00
三井住友银行-中国工商银行	0.00	0.00	48,000,000.00
东北证券-中国工商银行	5,726.42	156,726.42	4,450,000,000.00
中信证券广债1号-中国工商银行	0.00	0.00	550,000.00
中金财富-中国工商银行	0.00	0.00	20,810,000.00
创金合信昭尊1号-中国工商银行	0.00	0.00	6,660,000.00
华商银行-中国工商银行	0.00	0.00	100,000.00
国信证券-中国工商银行	0.00	0.00	10,020,000.00
宏观配置3号-中国工商银行	0.00	0.00	330,000.00
工银私人理财T7号-中国工商银行	0.00	0.00	1,000,000.00
恒泰证券-中国工商银行	0.00	0.00	4,650,000.00
海尔财务-中国工商银行	0.00	0.00	1,170,000.00

第七章 资金管理

一、资金提取申请/审核（自营）

1. 新增资金提取申请



如上图，进入菜单“资金管理”—“资金提取申请审核（自营）”，该界面提供综合会员自营业务的结算资金提取操作。如果登录综合会员的资金结算户为其开立在人行的大额户，系统弹出错误提示“会员单位为大额支付不能进行此操作！”

单击“新增”按钮，录入提取资金金额，同时可录入备注信息，单击“确定”，新增的提取资金申请状态为“新增待审核”；该综合会员的另一操作人员对状态为“新增待审核”的申请信息进行复核操作。选中要复核的记录，单击“审核”按钮，同意复核即单击“确定”，被复核过的记录状态变为“应履行”。

二、资金提取申请/审核（代理）

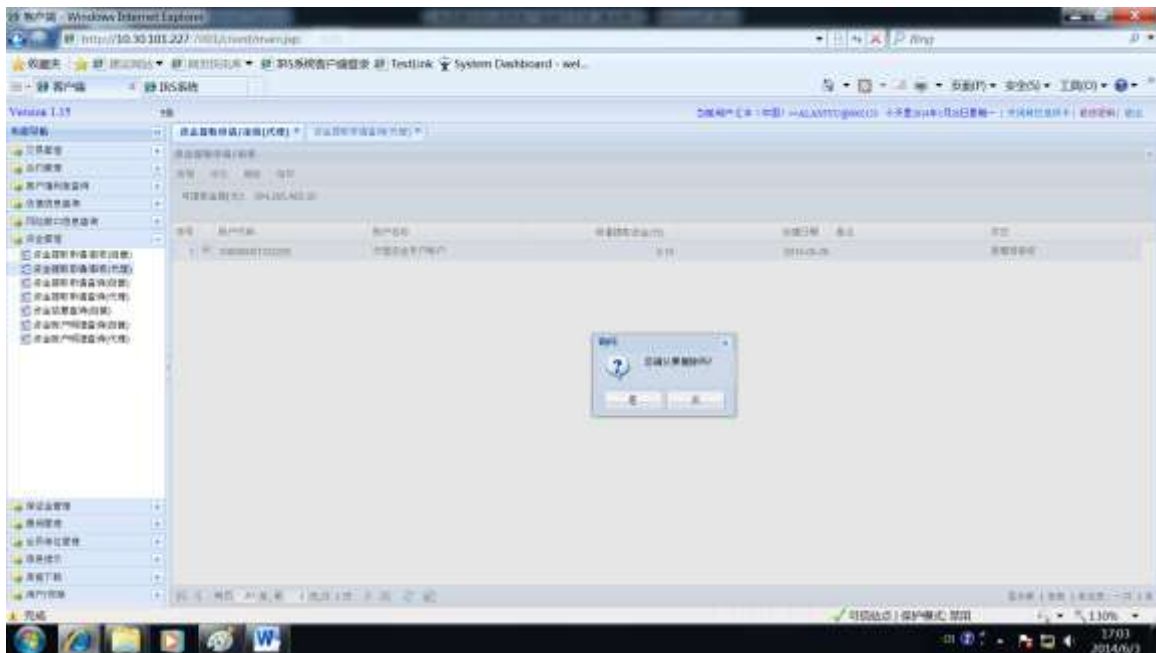
1. 新增资金提取申请



如上图，进入菜单“资金管理”—“资金提取申请审核（代理）”，该界面提供综合会员自营业务的结算资金提取操作。单击“新增”按钮，录入提取资金金额，同时可录入备注信息，单击“确定”，新增的提取资金申请状态为“新增待审核”；该综合会员的另一操作人员对状态为“新增待审核”的申请信息进行复核操作。选中要复核的记录，单击“审核”按钮，同意复核即单击“确定”，被复核过的记录状态变为“应履行”，显示在“资金提取申请查询（代理）”模块中，见下图，待资金账务系统处理完成后，状态变为“成功”，资金转入预先设置的账户中。

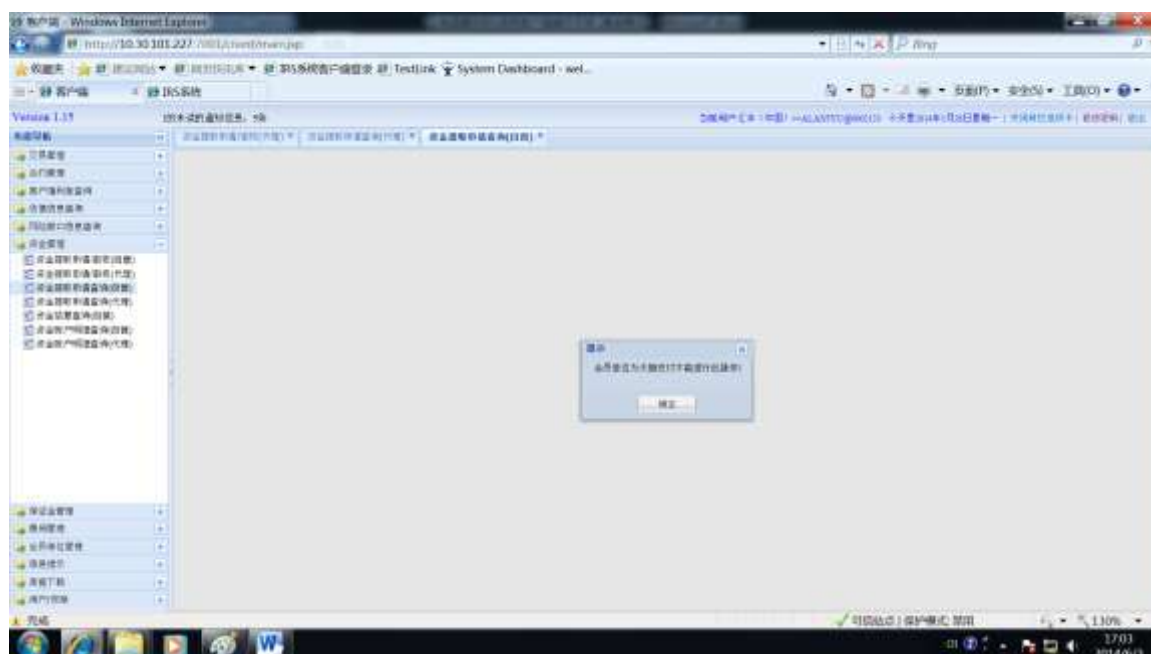


3. 删除申请操作



如上图，只能对状态为“新增待审核”的申请信息进行删除操作。选中要删除的记录，单击“删除”按钮，确认删除即单击“是”，列表中则不存在被删除的记录。

三、资金提取申请查询（自营）



如上图，进入菜单“资金管理”—“资金提取申请查询（自营）”，该界面提供资金提取的相关明细信息，可按照日期进行筛选查询。如果登录综合会员的资金结算户为其开立在人行的大额户，系统弹出错误提示“会员单位为大额支付不能进行此操作！”

四、资金提取申请查询（代理）



如上图，可以按照时间，查询资金提取申请明细。

五、待结算资金净额查询（自营）

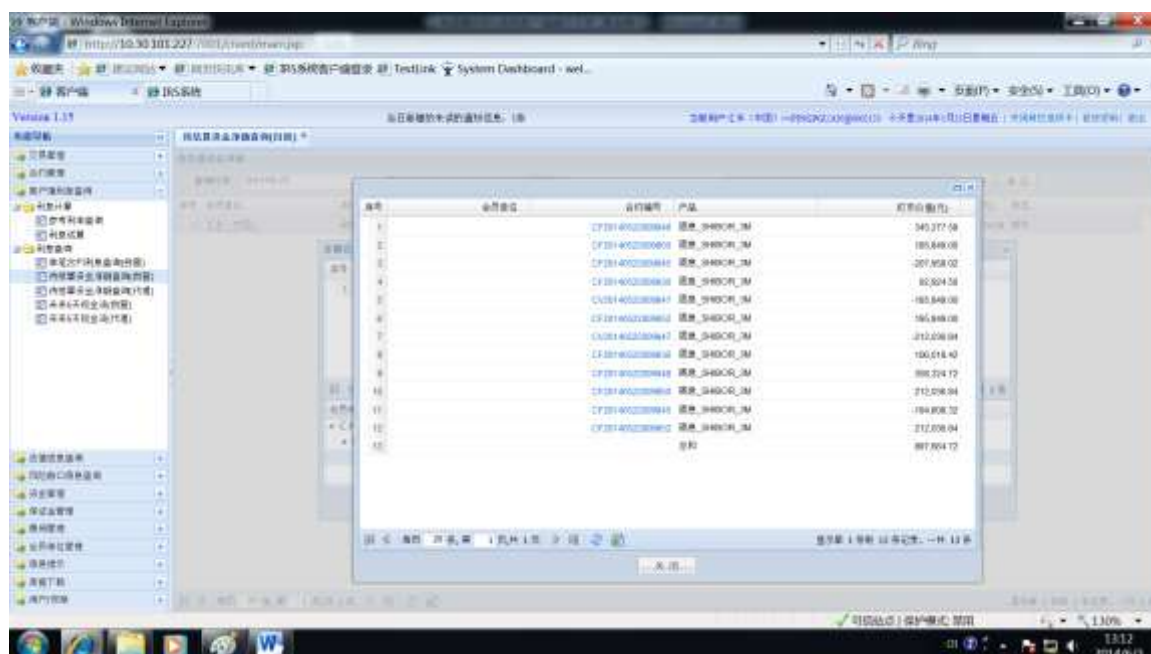


如上图，进入菜单“客户端利息查询”—“利息查询”—“待结算资金净额查询（自营）”，该界面提供综合会员每个工作日的待结算资金净额查询功能。可按照日期进行筛选查询。



如上图，单击列表中的“会员单位”链接，弹出该会员此日按照

产品类别分类的盯市信息。



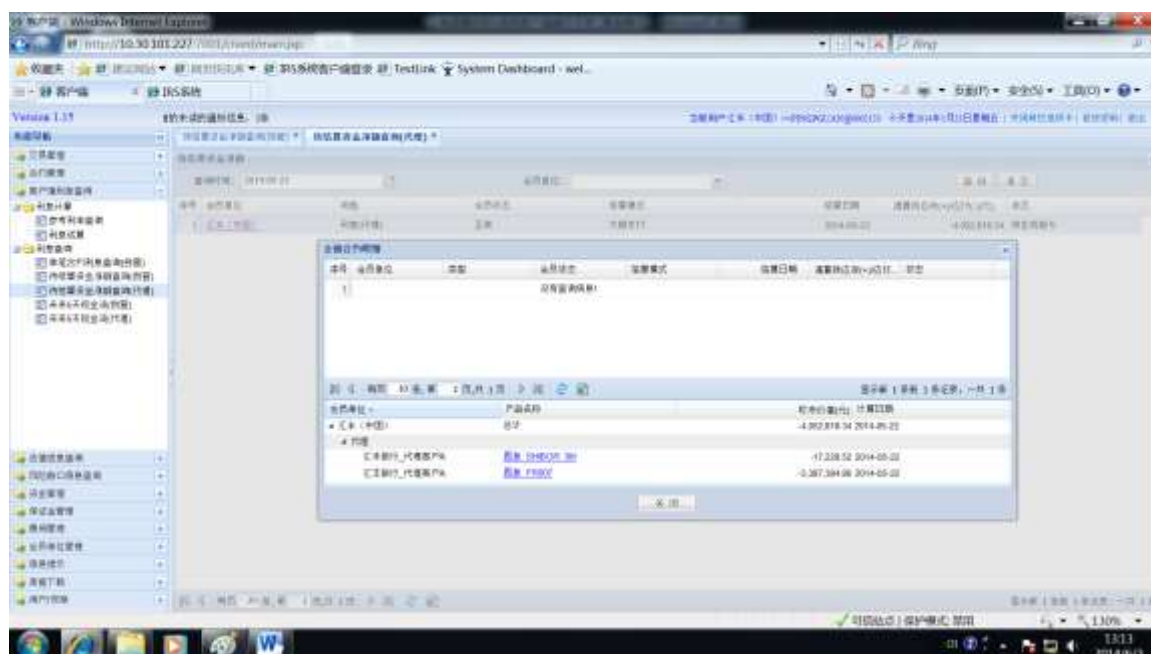
如上图，单击列表中的“产品名称”链接，弹出该会员此日此类的
的所有合约的盯市信息。

六、待结算资金净额查询（代理）

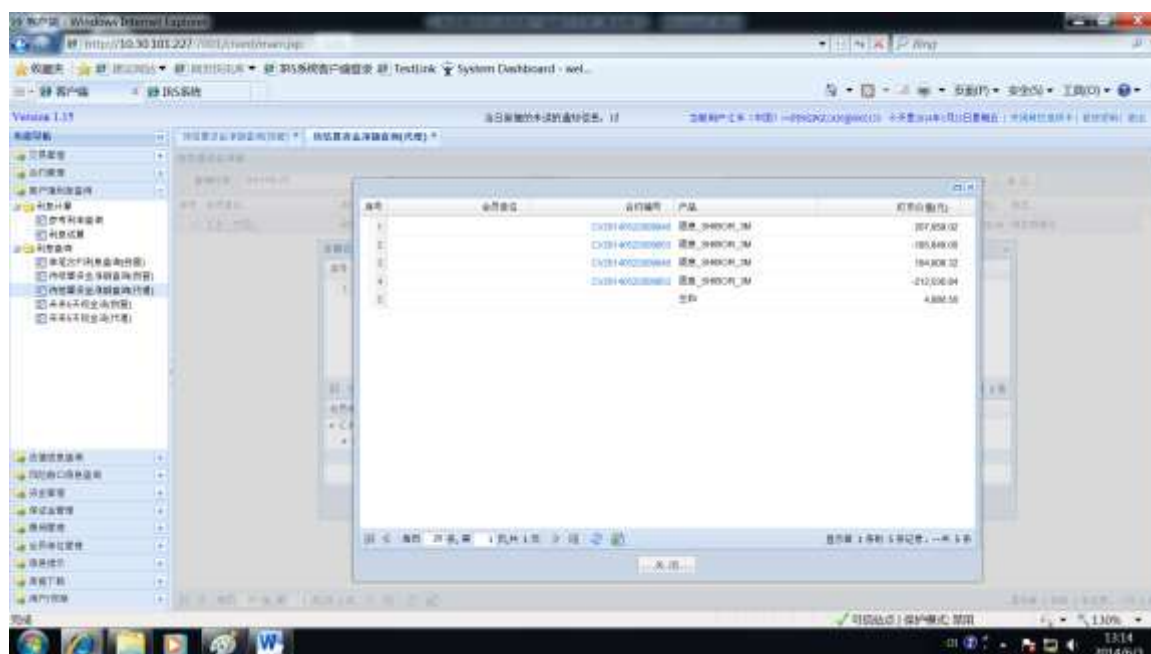


如上图，进入菜单“客户端利息查询” — “利息查询” — “待结
算资金净额查询（代理）”，该界面提供登录综合会员代理客户每个工

作日的待结算资金净额查询功能。可按照日期和客户进行筛选查询。

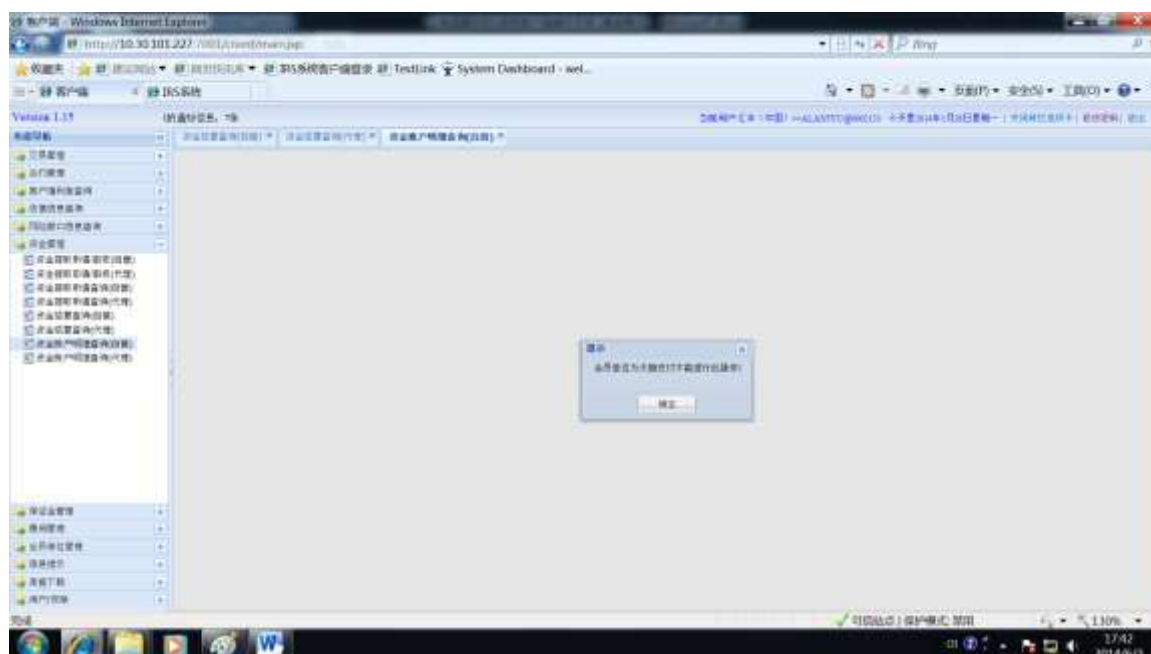


如上图，单击列表中的“会员单位”链接，弹出登录会员按照代理客户和产品类别分类的盯市明细信息。



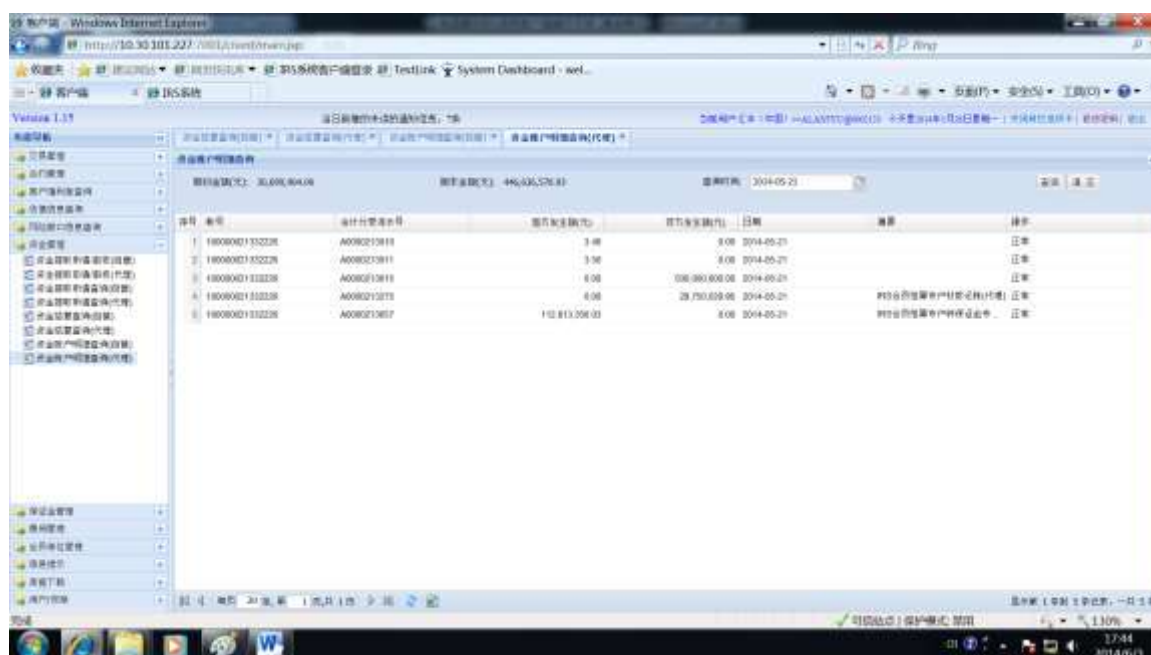
如上图，单击列表中的“产品名称”链接，弹出登录综合会员所代理的某客户此日此类的所有合约的盯市信息。

七、资金账户明细查询（自营）



如上图，进入菜单“资金管理”—“资金账户明细查询（自营）”，该界面提供资金账户明细的详细信息，可按照日期进行筛选查询。如果登录综合会员的资金结算户为其开立在人行的大额户，系统弹出错误提示“会员单位为大额支付不能进行此操作！”

八、资金账户明细查询（代理）



如上图，进入菜单“资金管理”—“资金账户明细查询（代理）”，该界面提供资金账户明细的详细信息，可按照日期进行筛选查询。

第八章 保证金管理

一、保证金提取申请/审核（自营）

1. 新增保证金申请/审核



如上图，进入菜单“保证金管理”—“保证金提取申请审核（自营）”或者“保证金提取申请审核（代理）”，该界面提供营业时间段内的保证金申请的提交操作。单击“新增”按钮，录入提取保证金金额，同时可以录入备注信息，单击“确定”，新增的提取保证金申请状态为“新增待复核”，如下图：



如上图，该会员另一操作人对“新增待复核”状态的申请信息需进行复核操作。选中要复核的记录，单击“审核”按钮，同意复核即单击“确定”，被复核过的记录状态为“应履行”。

清算基金提取须在综合业务系统内操作，详见综合业务系统客户端操作手册。

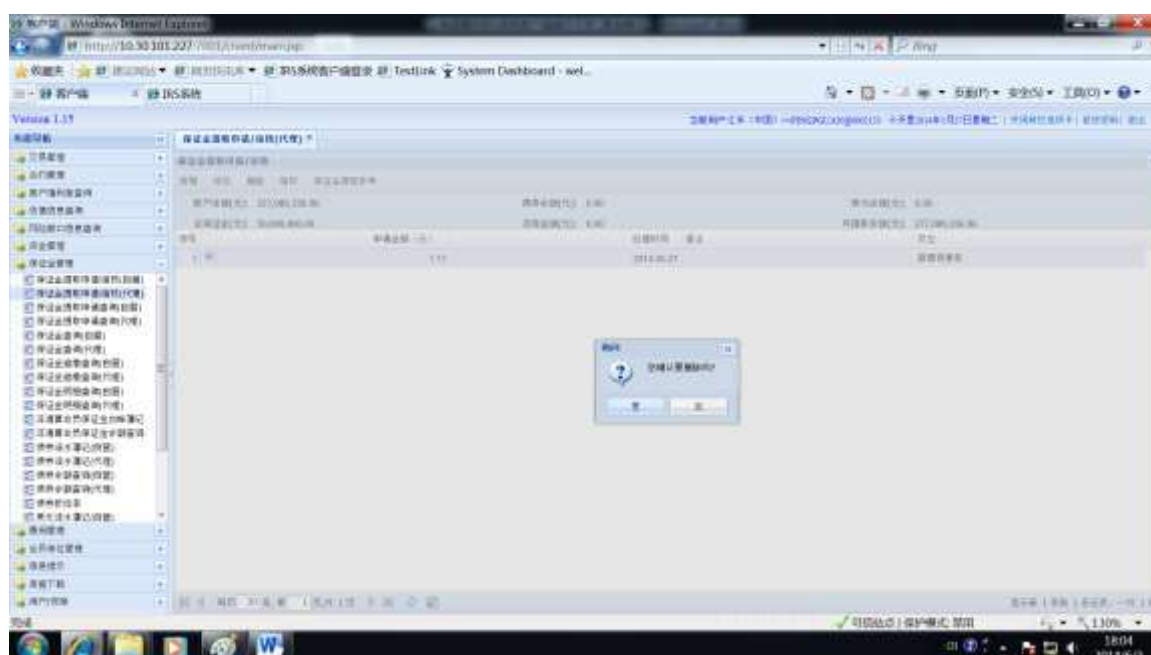
2. 修改申请操作



如上图，只能对状态为“新增待复核”的申请信息进行修改操作，且操作人为提出申请的操作人。选中要修改的记录，单击“修改”按钮，在弹出的“修改保证金提取”框中进行修改后，单击“确定”，该条记录状态为“新增待复核”，如下图：



3. 删除申请操作

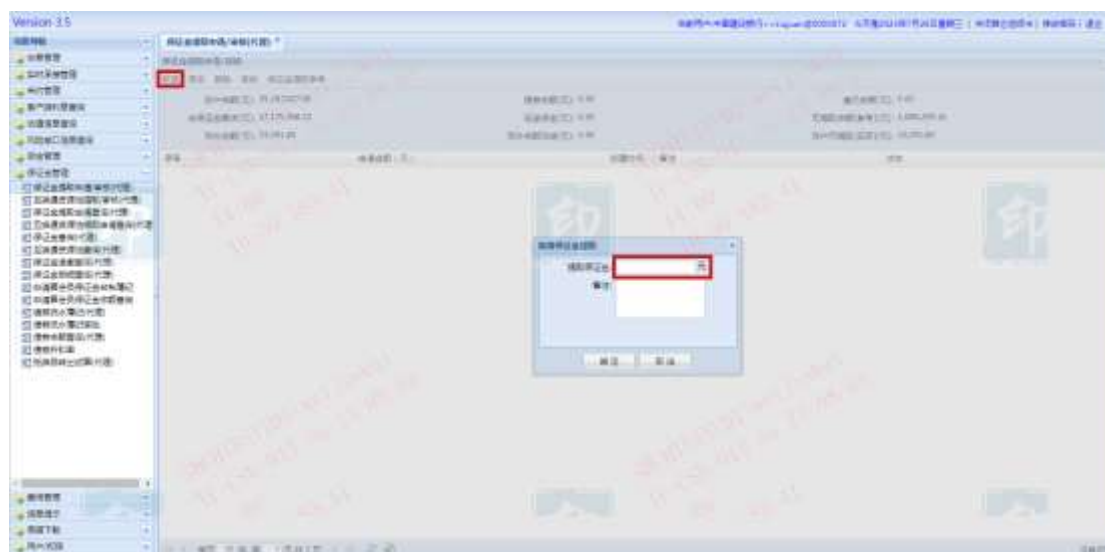


如上图，只能对状态为“新增待复核”的申请信息进行删除操作。

选中要删除的记录，单击“删除”按钮，确认删除即单击“是”，列表中则不存在被删除的记录。

二、保证金提取申请/审核（代理）

1. 新增保证金申请/审核



如上图，进入“保证金管理—保证金提取申请/审核（代理）”界面，该界面提供营业时间段内的保证金申请的提交操作。点击【新增】按钮，录入提取保证金金额，同时可以录入备注信息，点击【确定】按钮，新增的提取保证金申请状态为“新增待复核”如下图：



换另一操作员对该条信息进行“审核”操作，点击【审核】按钮，弹出的对话框点击【确定】按钮，被复核过的记录在“保证金管理—保证金提取申请查询(代理)”界面查询到的状态为“应履行”。



注：机构实际可提取金额为“账户可提取（实际）（元）”范围内的金额，“可提取（参考）（元）”仅作为参考，机构进行非清算会员保证金台账簿记维护后，可令两者保持一致。

2. 修改申请操作



如上图，只能对状态为“新增待复核”的记录进行修改操作，且操作员为提出申请的操作员。选中要修改的记录，点击【修改】按钮，在弹出的对话框中修改金额，备注信息。



然后点击【确定】按钮，弹出操作成功的对话框，点击【确定】按钮。



该条记录状态仍然为“新增待复核”。然后换另一操作员对该条信息进行“审核”操作。选中该条记录，点击【审核】按钮，弹出的对话框点击【确定】按钮，如下图：



被复核过的记录在“保证金管理—保证金提取申请查询(代理)”界面查询到的状态为“应履行”。

3. 删除申请操作

只能对状态为“新增待复核”的申请信息进行删除操作，且申请删除的操作员必须与新增操作员一致。进入“保证金管理—保证金提取申请/审核（代理）”界面，选中要删除的记录，点击【删除】按钮，弹

出的对话框中，点击【确定】按钮，如图所示：



然后弹出“操作成功”的对话框，点击【确定】按钮即可。



三、互换通资源池提取/审核（自营）

1. 新增资源池提取/审核

打开“保证金管理”菜单下的“互换通资源池提取/审核（自营）”，点击【新增】，输入金额和备注，点击【确定】（如下图）。



界面显示一条资源池提款信息，金额和备注为之前所输，状态为新增待复核。



更换账号，选中该条信息，点击审核，确认复核。



2. 修改资源池提取/审核



如上图，只能对状态为“新增待复核”的申请信息进行修改操作，且操作人为提出申请的操作人。选中要修改的记录，点击【修改】按钮，在弹出的“修改资源池提取”框中进行修改，单击“确定”，该条记录数据更新，显示“新增待复核”





3. 删除申请操作

只能对状态为“新增待复核”的申请信息进行删除操作，且操作人为提出申请的操作人。选中要删除的记录，点击【删除】按钮，在弹出的询问框中进行删除，单击“是”，该条记录被删除。

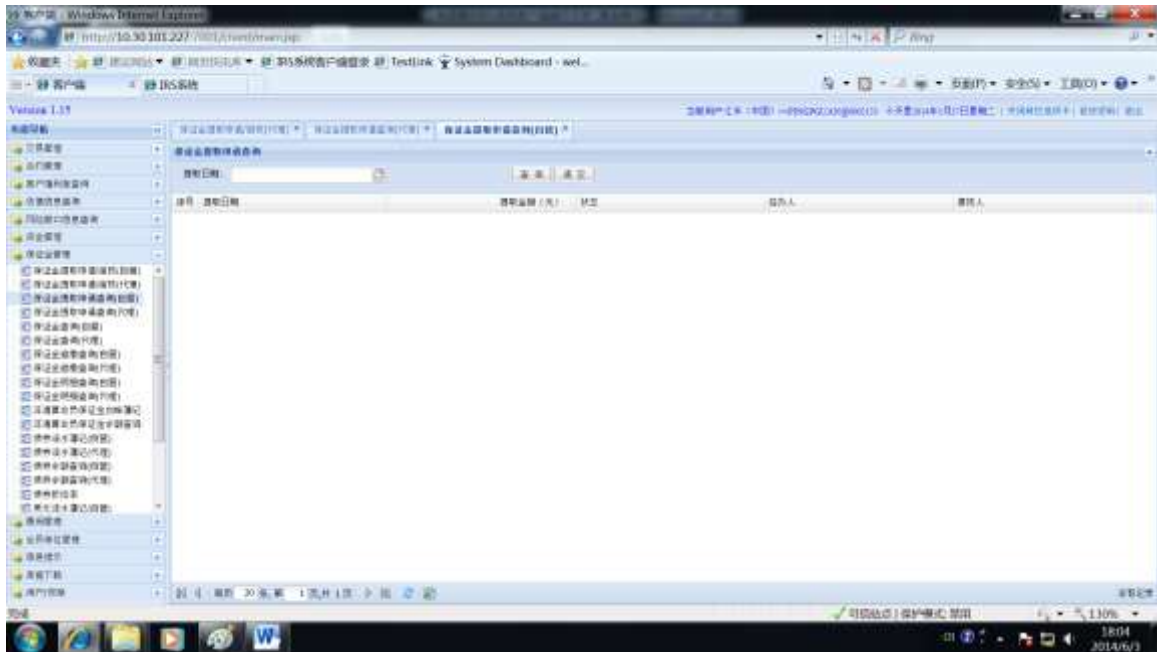


4. 互换通资源池全市场敞口占用查询

该界面可以查询到目前全市场互换通清算额度的占用情况（互换通 CCP 敞口要求）。同时可以查到各品种及全市场的互换通合约交易方向（如下图）。



四、保证金提取申请查询（自营）、保证金提取申请查询（代理）



如上图，进入菜单“保证金管理”—“保证金提取申请查询（自营）”或者“保证金提取申请查询（代理）”，该界面提供保证金提取的相关明细信息，可按照日期进行筛选查询。

五、互换通资源池提取申请查询（自营）

打开保证金管理菜单下的“互换通资源池提取申请查询(自营)”，可看到上面新增的提取申请，并可按照日期进行筛选查询。



六、日终保证金（自营）



如上图，进入菜单“保证金管理”—“日终保证金（自营）”，该界面提供会员自营交易前一日日终的保证金试算结果。只能进行查询。

七、日终保证金（代理）

券商单位	证券市场	风险敞口	最高保证金需求(元)	超限保证金需求(元)	特殊保证金需求(元)	日终保证金需求(元)	总保证金需求(元)
* 兴业银行	兴业证券	0.00	0.00	1,000,000.00	0.00	0.00	1,000,000.00
	兴业证券	-20,848,157.38	2,942,954.88	1,000,000.00	1,842,954.88	0.00	2,842,954.88
	平安证券	-92,211,177.85	5,982,287.26	2,000,000.00	0.00	0.00	2,000,000.00
	德邦证券	18,195,787.82	25,523,477.53	1,000,000.00	24,523,477.53	0.00	25,523,477.53
	长江证券	0.00	0.00	1,000,000.00	0.00	0.00	1,000,000.00
合计		-12,948,537.41	30,256,729.65	4,000,000.00	26,466,932.39	0.00	32,466,932.39

如上图，进入菜单“保证金管理”—“日终保证金（代理）”，该界面提供综合会员代理交易前一日日终的保证金试算结果。只能进行查询。

八、保证金查询（自营）

券商单位	最高保证金(元)	超限保证金(元)	特殊保证金(元)	日终保证金需求(元)	总保证金需求(元)	质押账户余额(元)	单元账户余额(元)	保证金账户余额(元)	保证金可提取金额(元)
	10,000,000.00	0.00	0.00	0.00	12,000,000.00				0.00

如上图，进入菜单“保证金管理”—“保证金查询（自营）”，该界面提供会员保证金要求与保证金余额的具体组成信息。

九、互换通资源池查询（自营）

打开保证金管理菜单下的“互换通资源池查询（自营）”，可以看到互换通资源池要求金额、互换通资源池余额、互换通资源池可提取金额。



十、保证金查询（代理）



如上图，进入菜单“保证金管理”—“保证金查询（代理）”，该界面提供登录综合会员所代理客户的保证金要求与余额的组成信息。

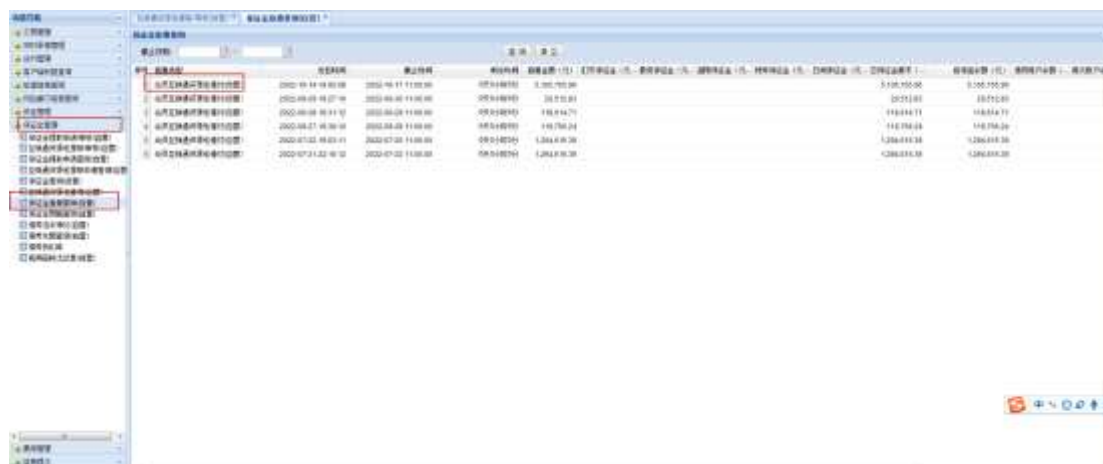
十一、保证金追缴查询（自营）



如上图，进入菜单“保证金管理”—“保证金追缴查询（自营）”，该界面提供会员的保证金追缴相关信息。可以按照日期进行筛选查询。

十二、资源池追缴查询（自营）

如下图，进入菜单“保证金管理”-“保证金追缴查询（自营）”，该界面可查询会员的资源池追缴相关信息（会员互换通资源池催付（自营））。可以按照日期进行筛选查询。



十三、保证金追缴查询（代理）



如上图，进入菜单“保证金管理”—“保证金追缴查询（代理）”，该界面提供综合会员的保证金追缴相关信息。可以按照日期进行筛选查询。

十四、保证金明细查询（自营）



如上图，进入菜单“保证金管理”—“保证金明细查询”，该界

面提供会员自营保证金账户的流水明细。可以按照日期进行筛选查询。

十五、资源池明细查询（自营）

如下图，进入菜单“保证金管理”-“保证金明细查询（自营）”，该界面可查询会员的资源池账户的流水明细。可以按照日期进行筛选查询。



十六、保证金明细查询（代理）



如上图，进入菜单“保证金管理”-“保证金明细查询（代理）”，

该界面提供综合会员代理保证金账户的流水明细。可以按照日期进行筛选查询。

十七、非清算会员保证金台账簿记

1. 新增保证金台账流水维护



日期	摘要	借方	贷方	余额	状态	备注
2012-09-28	2012-09-28 2012-09-28 2012-09-28	10,000,000.00	10,000,000.00	10,000,000.00	已清算	
2012-09-28	2012-09-28 2012-09-28 2012-09-28	10,000,000.00	10,000,000.00	10,000,000.00	已清算	
2012-09-28	2012-09-28 2012-09-28 2012-09-28	10,000,000.00	10,000,000.00	10,000,000.00	已清算	
2012-09-28	2012-09-28 2012-09-28 2012-09-28	10,000,000.00	10,000,000.00	10,000,000.00	已清算	
2012-09-28	2012-09-28 2012-09-28 2012-09-28	10,000,000.00	10,000,000.00	10,000,000.00	已清算	
2012-09-28	2012-09-28 2012-09-28 2012-09-28	10,000,000.00	10,000,000.00	10,000,000.00	已清算	
2012-09-28	2012-09-28 2012-09-28 2012-09-28	10,000,000.00	10,000,000.00	10,000,000.00	已清算	
2012-09-28	2012-09-28 2012-09-28 2012-09-28	10,000,000.00	10,000,000.00	10,000,000.00	已清算	
2012-09-28	2012-09-28 2012-09-28 2012-09-28	10,000,000.00	10,000,000.00	10,000,000.00	已清算	
2012-09-28	2012-09-28 2012-09-28 2012-09-28	10,000,000.00	10,000,000.00	10,000,000.00	已清算	

如上图，进入菜单“保证金管理”-“非清算会员保证金台账簿记”，该界面提供综合会员主动上缴保证金至其开立在上海清算所的保证金账户时进行台账簿记，簿记的总额应与实际划付的金额一致，否则系统日终核对后，会给出出错提示。单击“新增”按钮，录入增加保证金台账流水信息，包括会员单位和交易金额，如下图：

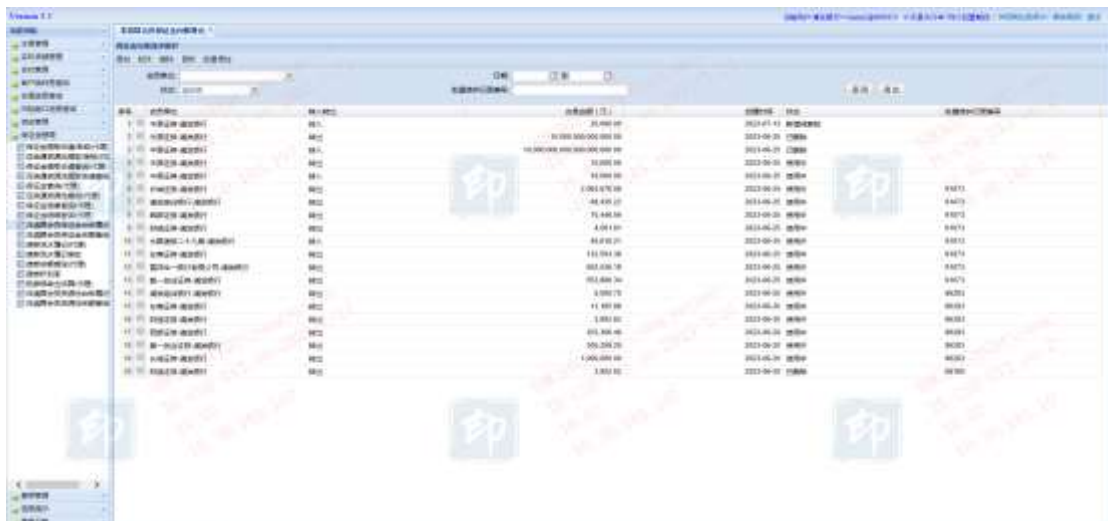


如上图，该会员另一操作人对“新增待复核”状态的申请信息需进行复核操作。选中要复核的记录，单击“复核”按钮，同意复核即单击“通过”，被复核过的记录状态应为“使用中”。

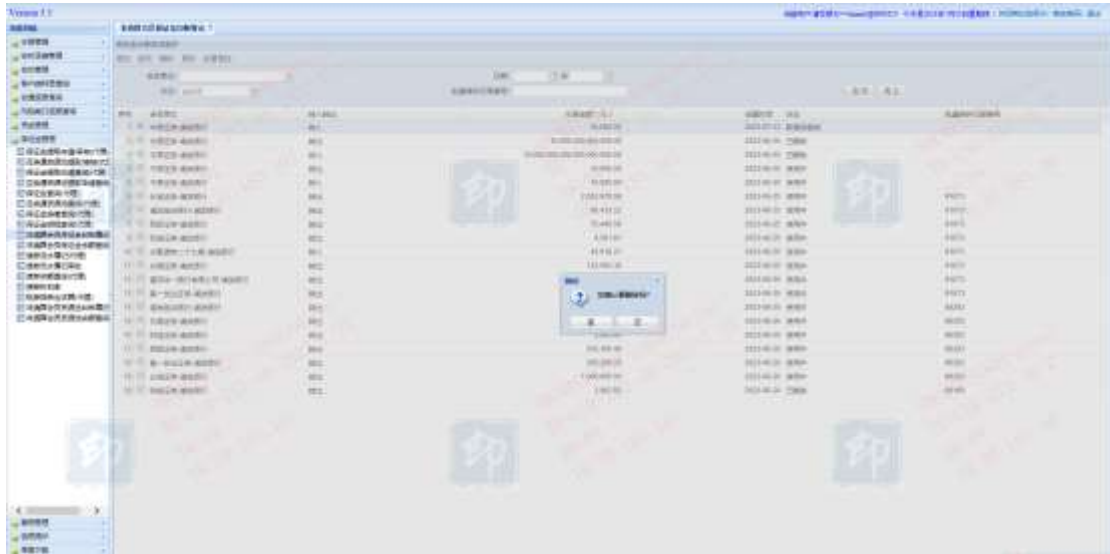
2. 修改申请操作



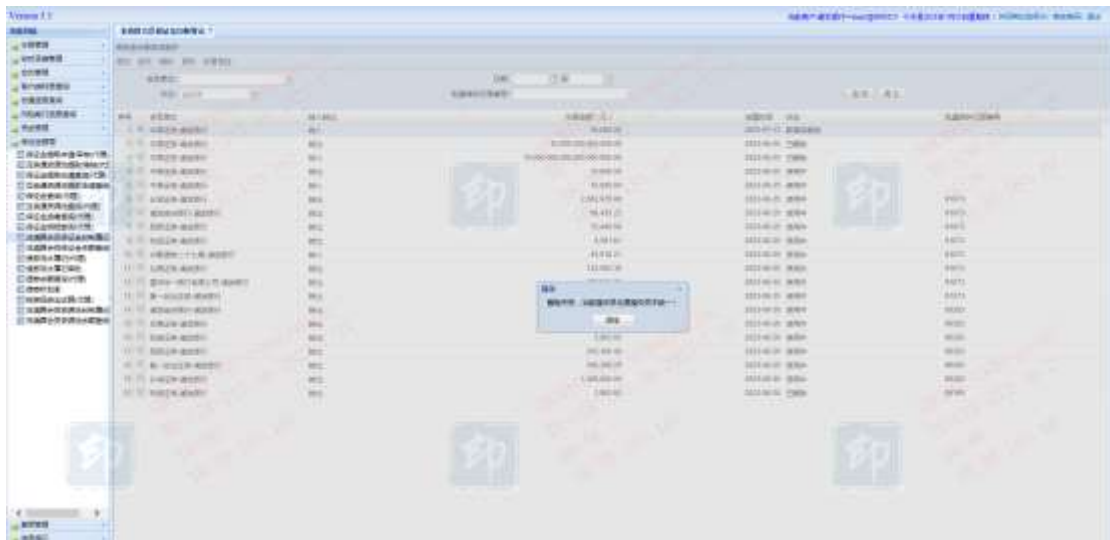
如上图，只能对状态为“新增待复核”的申请信息进行修改操作，且操作人为提出申请的操作人。选中要修改的记录，单击“修改”按钮，在弹出的“修改保证金台账流水信息”框中进行修改后，单击“确定”，该条记录状态为“新增待复核”，如下图：



3. 删除申请操作



如上图，只能对状态为“新增待复核”的申请信息进行删除操作。选中要删除的记录，单击“删除”按钮，确认删除即单击“是”，列表中的原记录状态变为“已删除”。如原申请操作人员和删除的操作人员不是同一人，系统弹出出错提示，如下图；



4. 批量增加申请操作

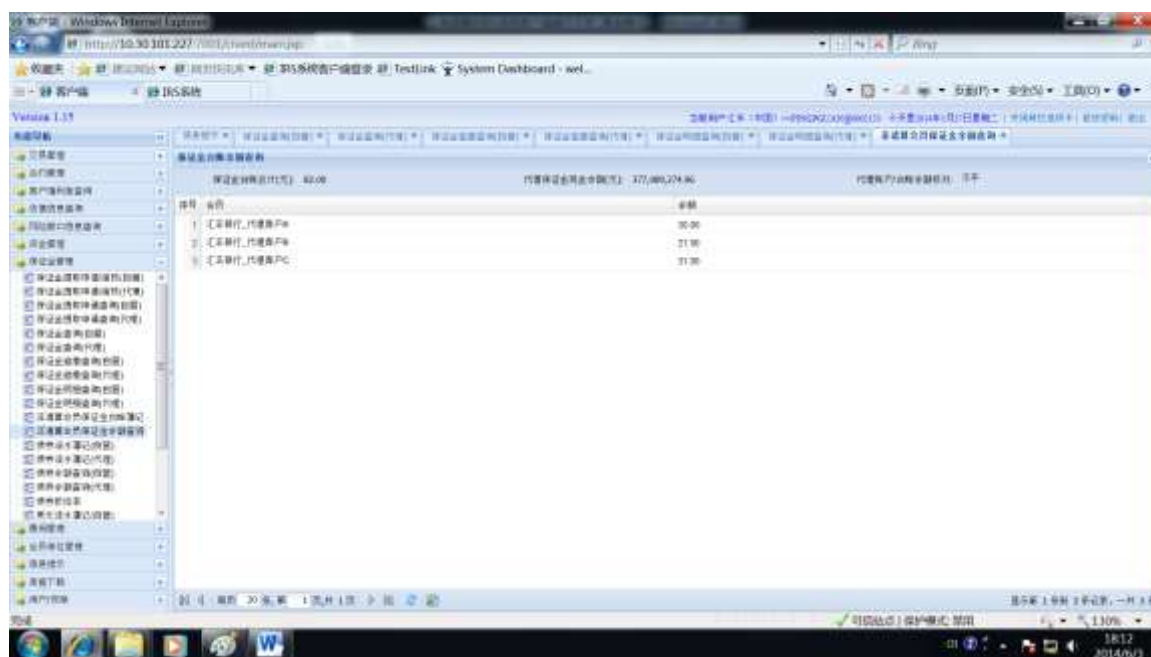


如上图，单击“复位”按钮，界面内所有信息会恢复至默认值。单击“清零”按钮，“拟提取金额”一栏内所有数值均会清零，可通过“复位”恢复。单击“仅转入”按钮，系统会将“可提取金额参考值”为正数的客户的“拟提取金额”清零，仅保留“可提取金额参考值”为负数的客户的“拟提取金额”。单击“仅转出”按钮，系统会将“可提取金额参考值”为负数的客户的“拟提取金额”清零，仅保留“可提取金额参考值”为正数的客户的“拟提取金额”。单击“确认维护”，同意维护即单击“确认”，如下图：



如上图，该会员另一操作人对“新增待复核”状态的申请信息需进行复核操作。选中要复核的记录，单击“复核”按钮，同意复核即单击“复核通过”，被复核过的记录状态应为“使用中”，单击“复核失败”，被复核过的记录状态应变为“已删除”。

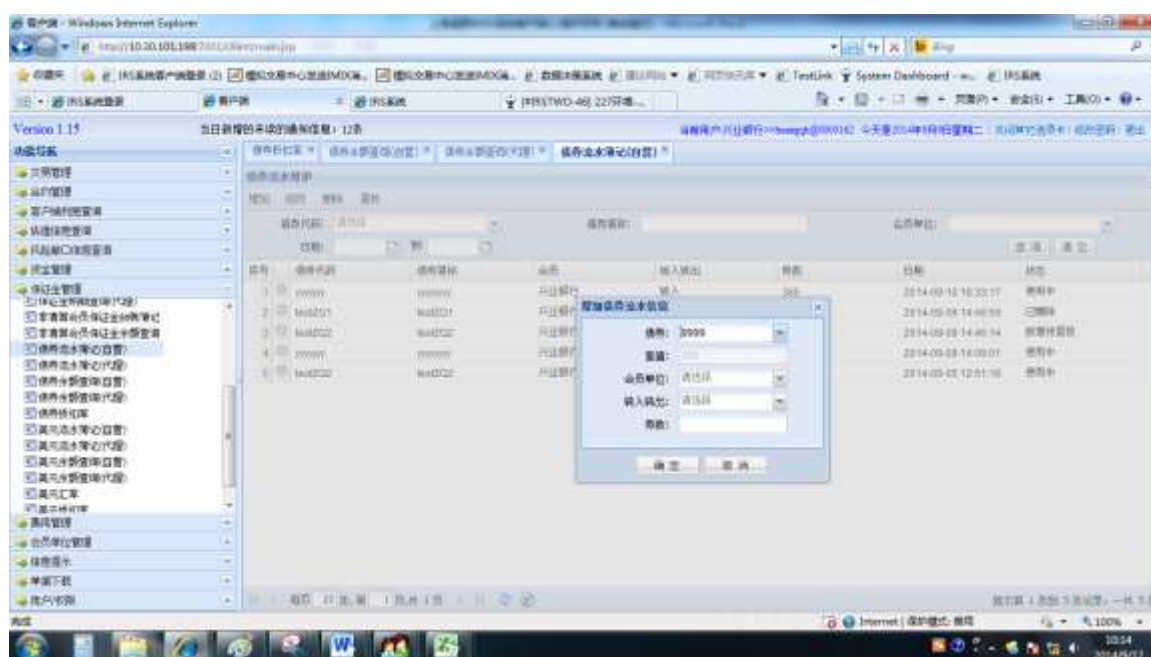
十八、非清算会员保证金余额查询



如上图，进入菜单“保证金管理”—“非清算会员保证金台账余额查询”，该界面提供综合会员的保证金台账余额查询功能。

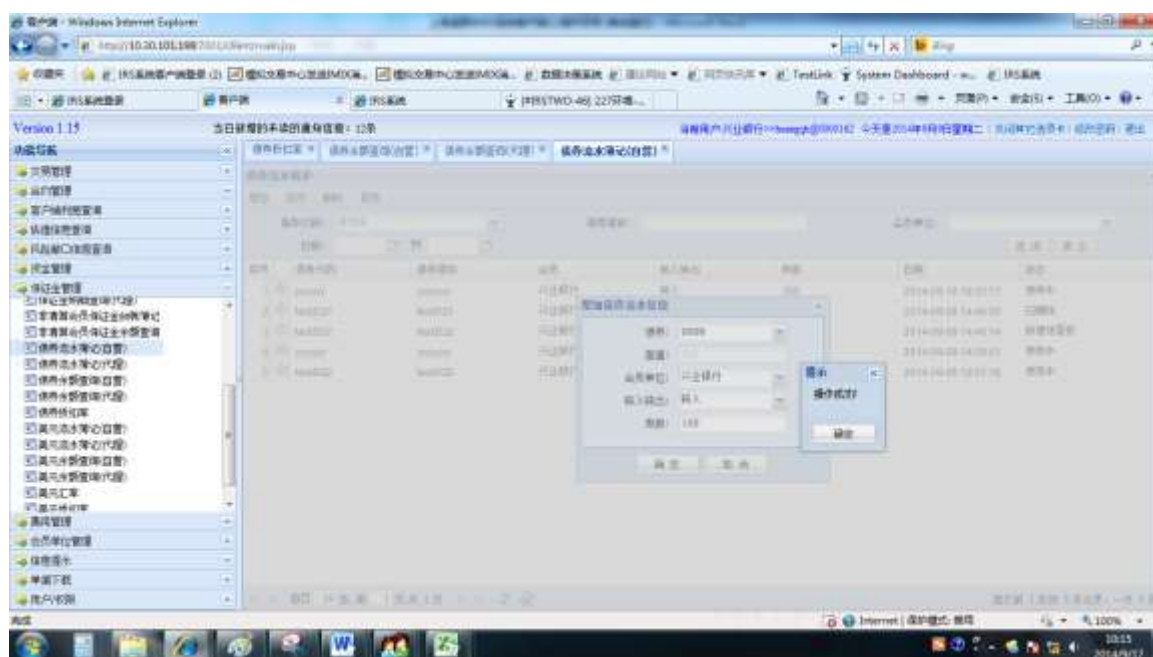
十九、债券流水簿记（自营）

1. 新增债券流水簿记

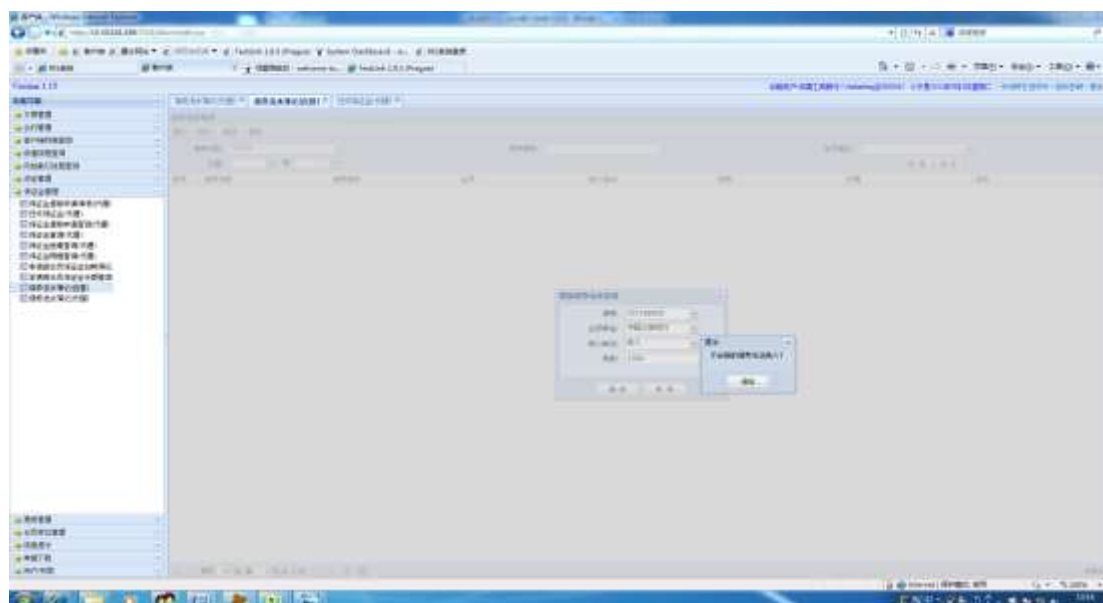


如上图，进入菜单“保证金管理”—“债券流水簿记（自营）”，

单击“新增”按钮，在弹出的对话框中填入选择债券代码（自动弹出该债券的面值）、会员单位、操作方向（转入/转出）并填写待质押债券的券数，如果待质押的债券为合格抵押品，则申请通过，申请状态为“新增待复核”，见下图。申请信息提交清算所服务端，由相关操作人员对申请进行复核、完成质押操作。



如果待转入质押的债券为不合格抵押品，则点击“确定”之后系统自动弹出对话框，说明“不合格债券无法转入”。

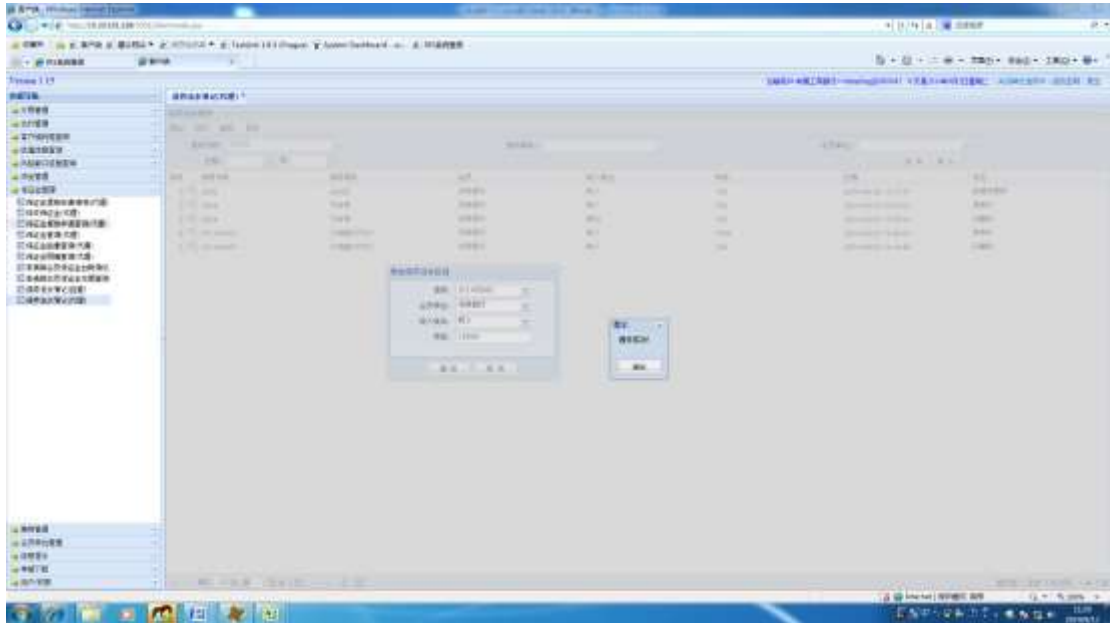


二十、债券流水簿记（代理）

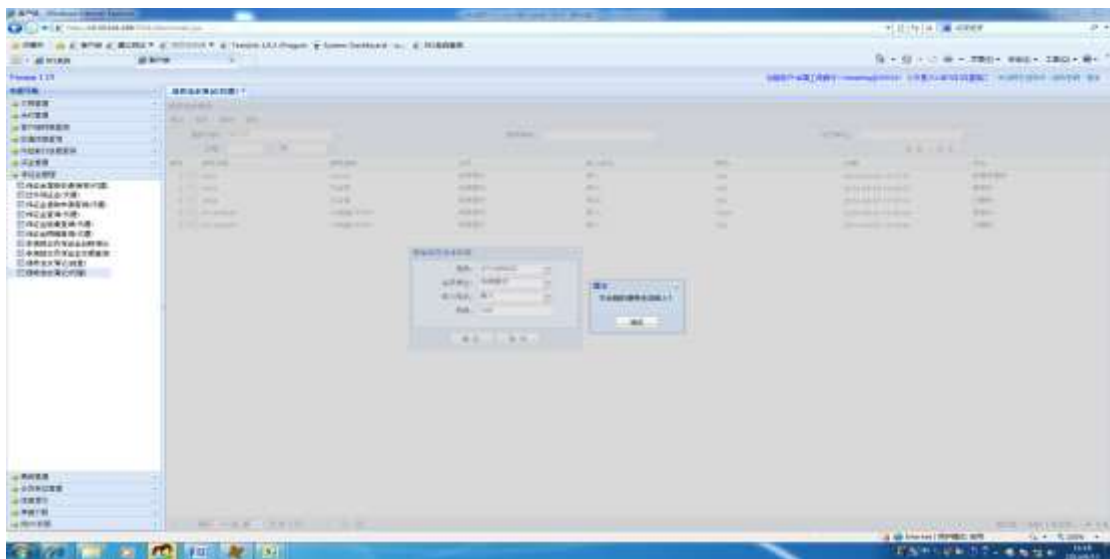
1. 新增债券流水簿记



如上图，进入菜单“保证金管理”—“债券流水簿记（代理）”，单击“新增”按钮，在弹出的对话框中填入选择债权代码、会员单位、操作方向并填写待质押债券的券数，如果待质押的债券为合格抵押品，则申请通过，申请状态为“新增待复核”，见下图。申请信息提交清算所服务端，由相关操作人员对申请进行复核、完成质押操作。



如果待转入质押的债券为不合格抵押品，则点击“确定”之后系统自动弹出对话框，说明“不合格债券无法转入”。见下图。



二十一、债券折扣率

该界面用于查询各债券对应的折扣率信息，可通过债券代码及债券简称筛选查询。如下图：



二十二、债券余额查询（自营/代理）

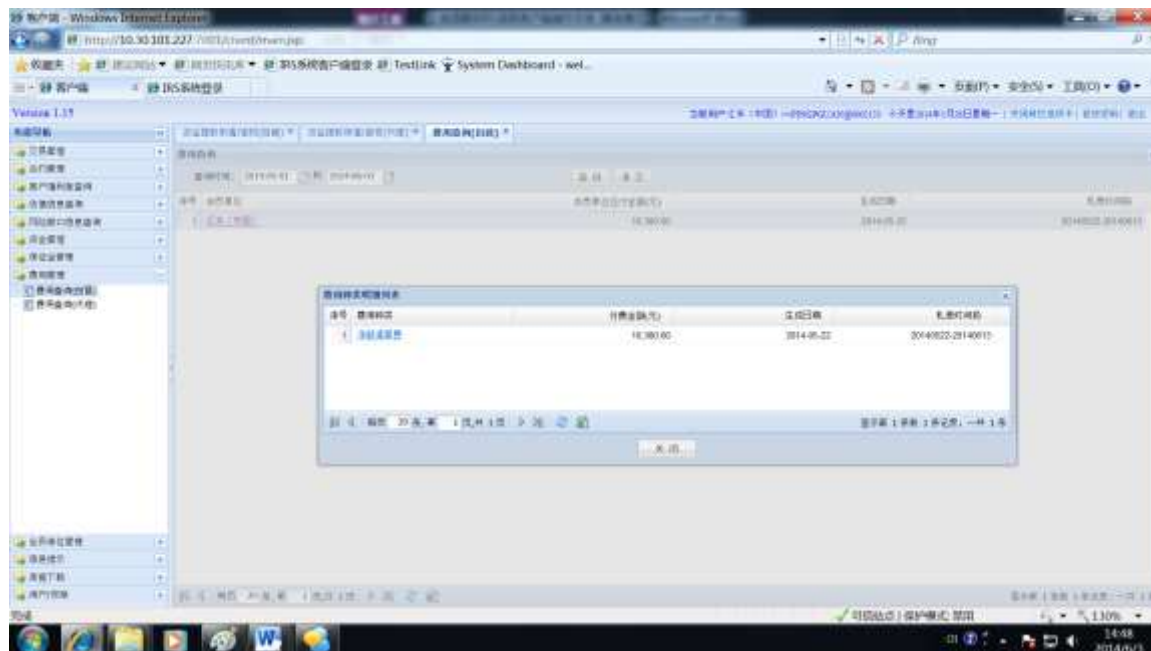
该界面用于查询各债券的余额信息，包括代码、简称、所属会员、面值、券数、集中度上限、折扣率及折扣后金额。该界面可以通过代码、简称及会员进行筛选。如图所示：



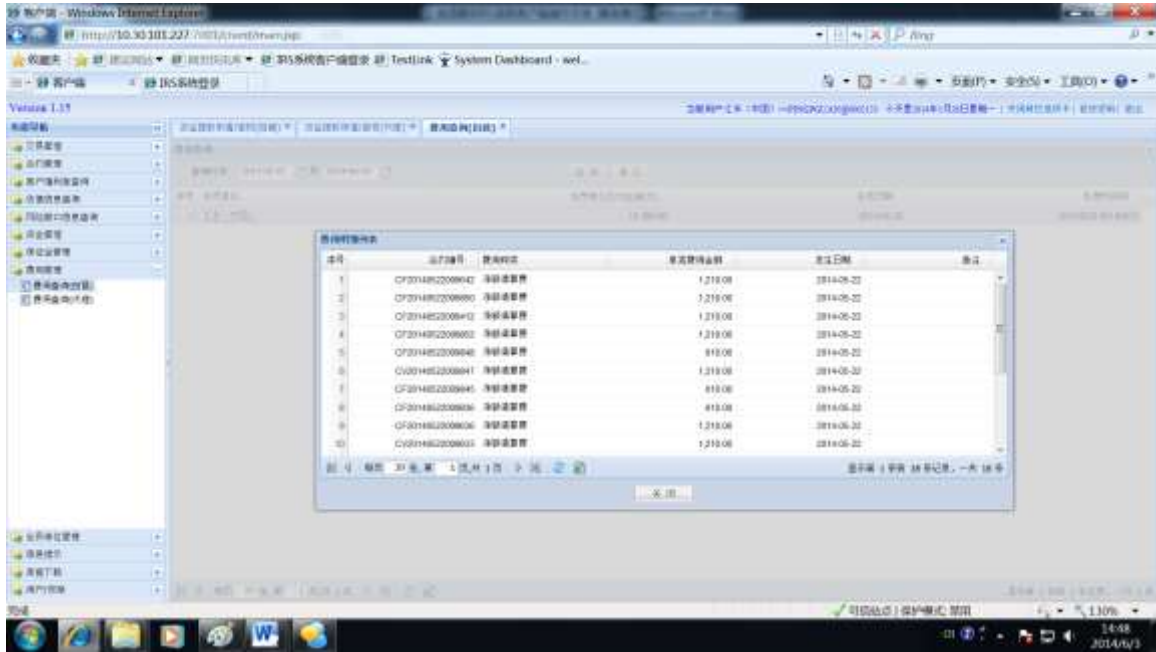
第九章 费用管理

一、费用查询

1. 费用查询（自营）

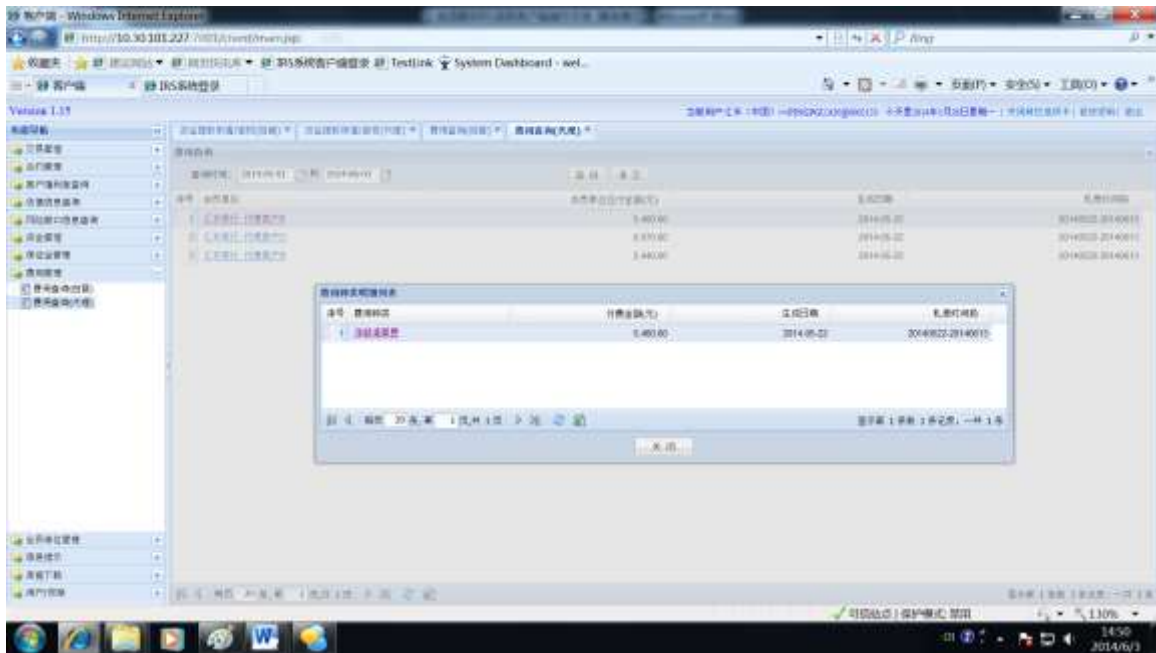


如上图，进入菜单“费用管理”—“费用查询（自营）”，该界面提供费用明细查询功能。单击列表中的“会员单位”，弹出“费用种类明细列表”，该表包含“净额清算费”、“提前终止手续费”、“清算退出手续费”和“优惠费”的单类费用汇总信息。



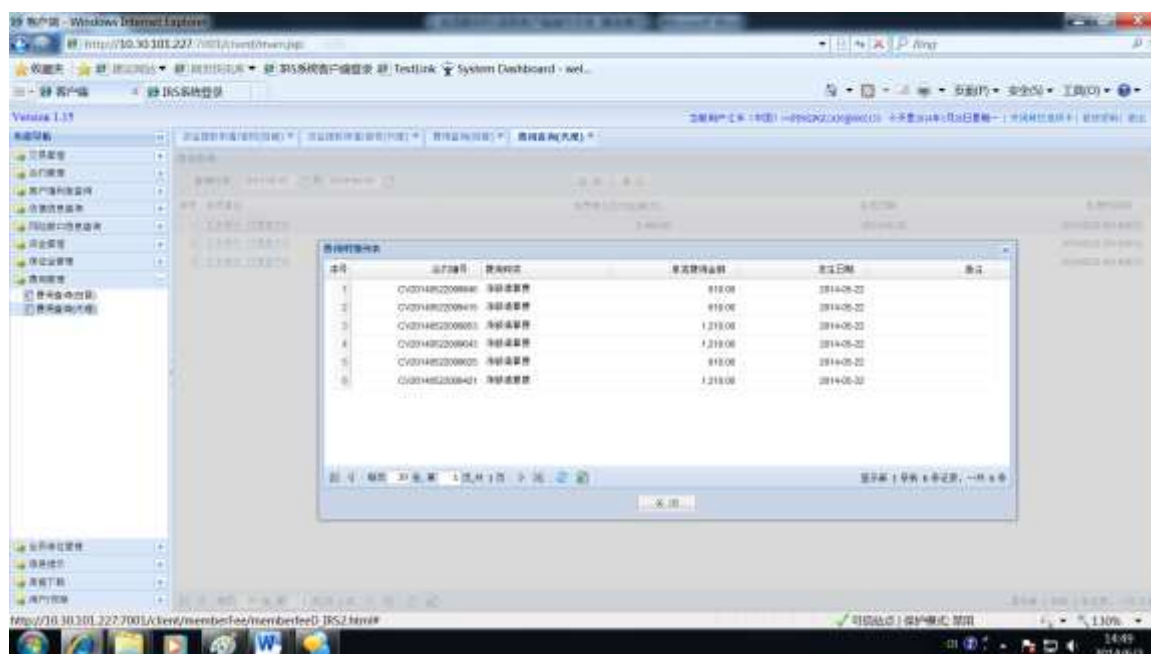
如上图，单击列表中的“费用种类”，弹出该类费用的每笔明细信息。

2. 费用查询（代理）



如上图，进入菜单“费用管理”—“费用查询（代理）”，该界面提供费用明细查询功能。单击列表中的“会员单位”，弹出“费用种类明细列表”，该表包含“净额清算费”、“提前终止手续费”、“清算

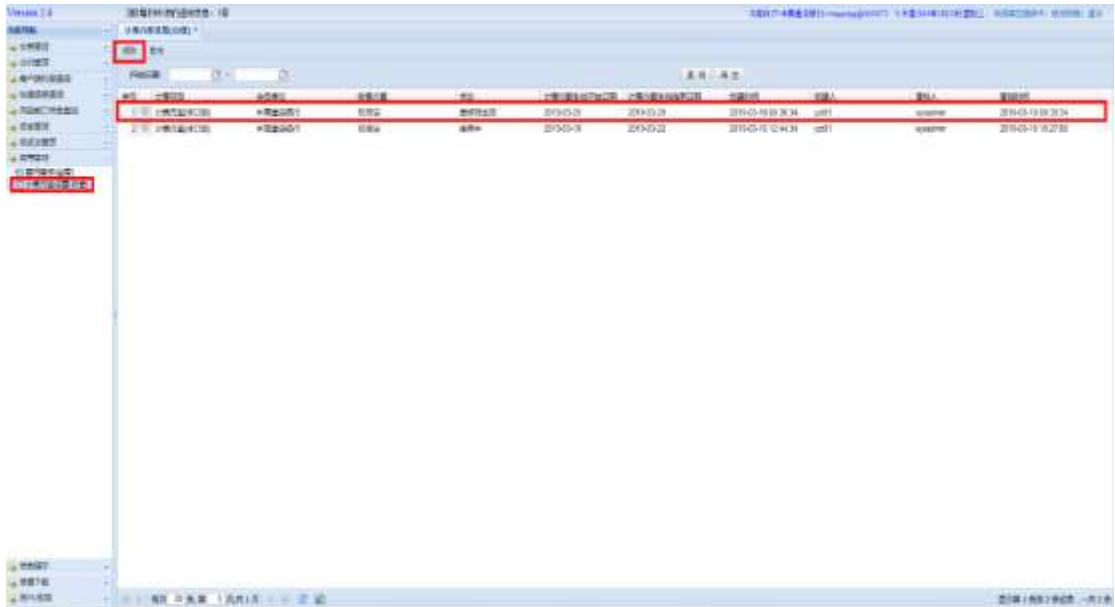
退出手续费”和“优惠费”的单类费用汇总信息。



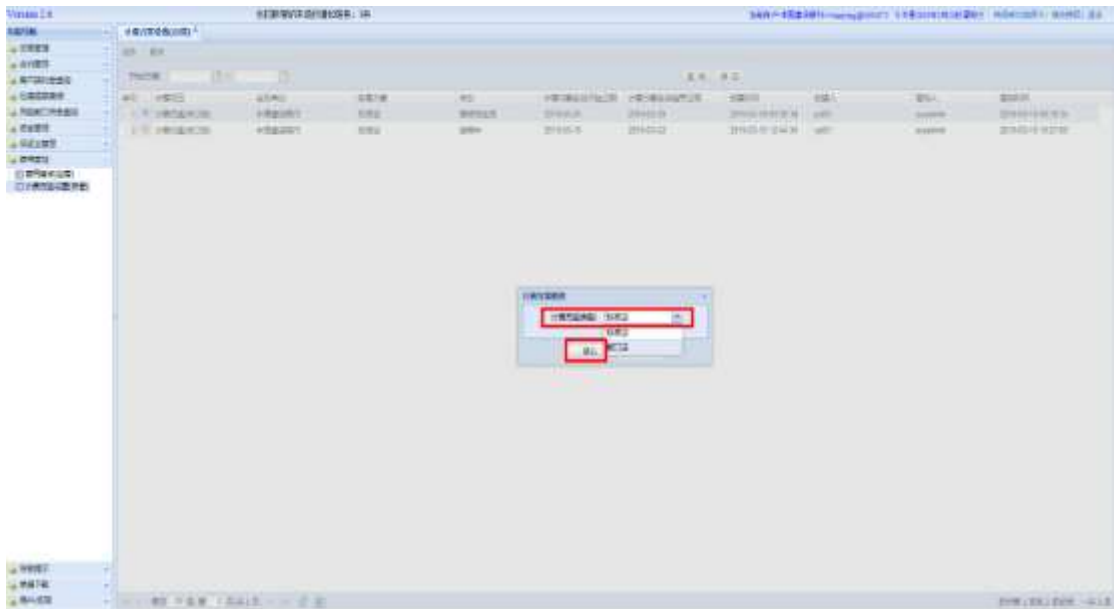
如上图，单击列表中的“费用种类”，弹出该类费用的每笔明细信息。

二、计费方案设置（自营）

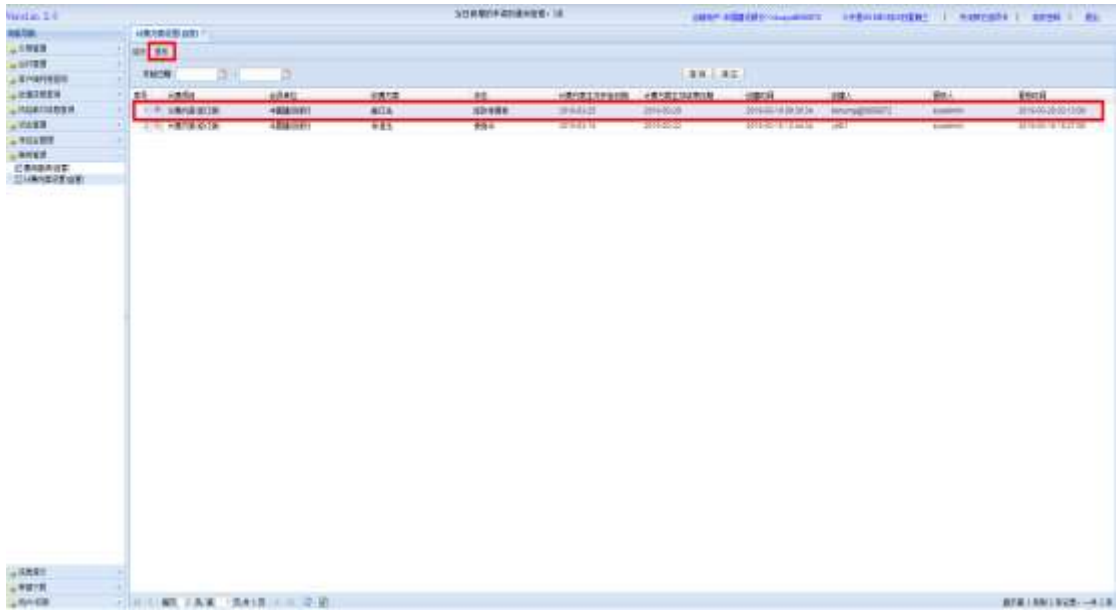
在清算所开放的时间窗口内，清算会员（自营）客户端管理员点击“费用管理”界面，选择“计费方案设置（自营）”，对下一自然年度使用的收费方案进行设置。



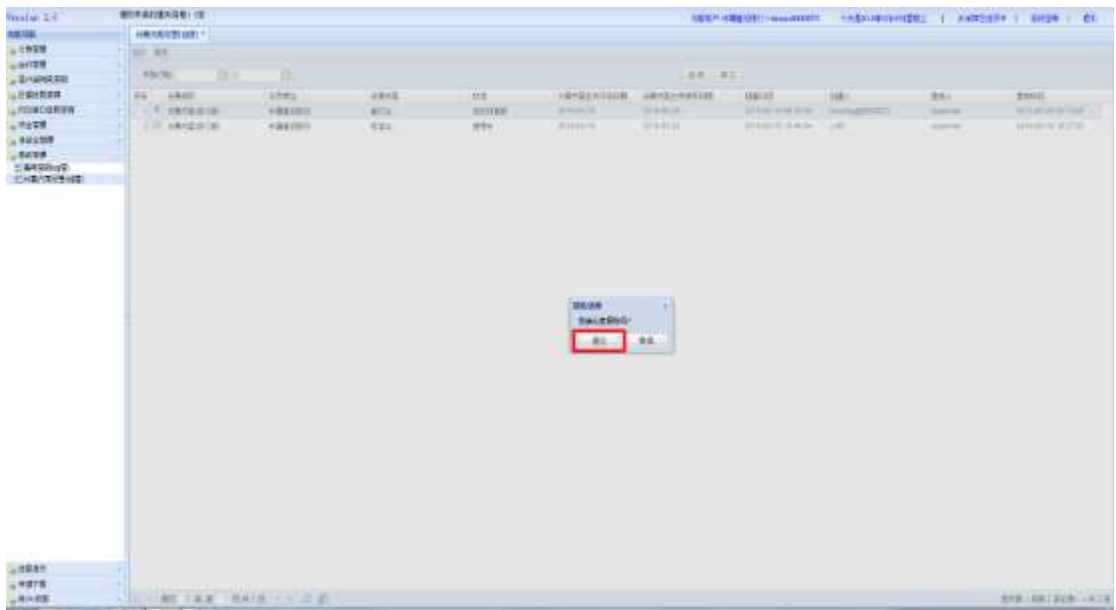
如上图，根据收费方案应用时间，利用开始日期和结束日期进行筛选，选中要设置的收费方案（默认为沿用上一年度收费方案），点击“修改”按钮，可对收费方案进行修改。选择相应的收费方案，点击“确定”。



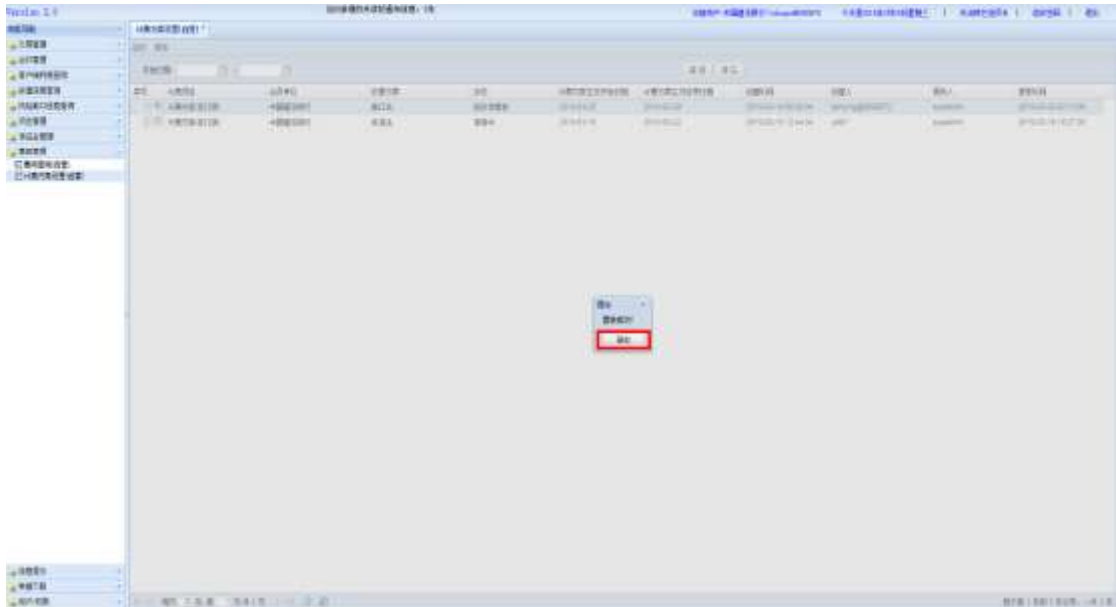
若收费方案修改成功，则该条记录为“修改待复核”状态，需另一管理员进行复核。



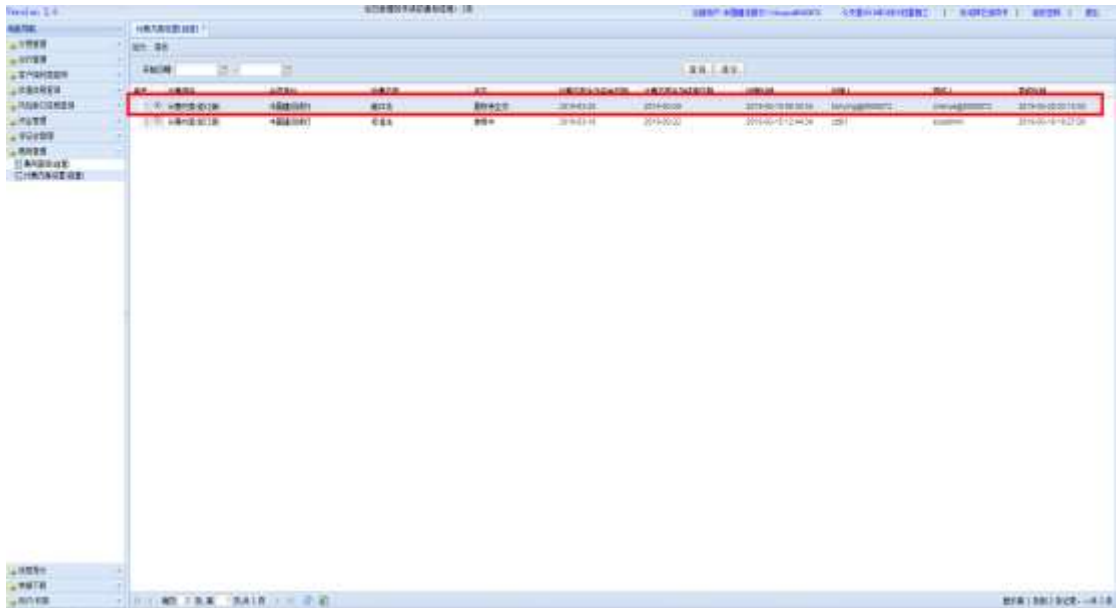
复核时，点击“复核”按钮，若确认通过，则点击“通过”；若点击“取消”，则仍可修改收费方案。再换人复核。



复核通过，则显示“复核成功”。



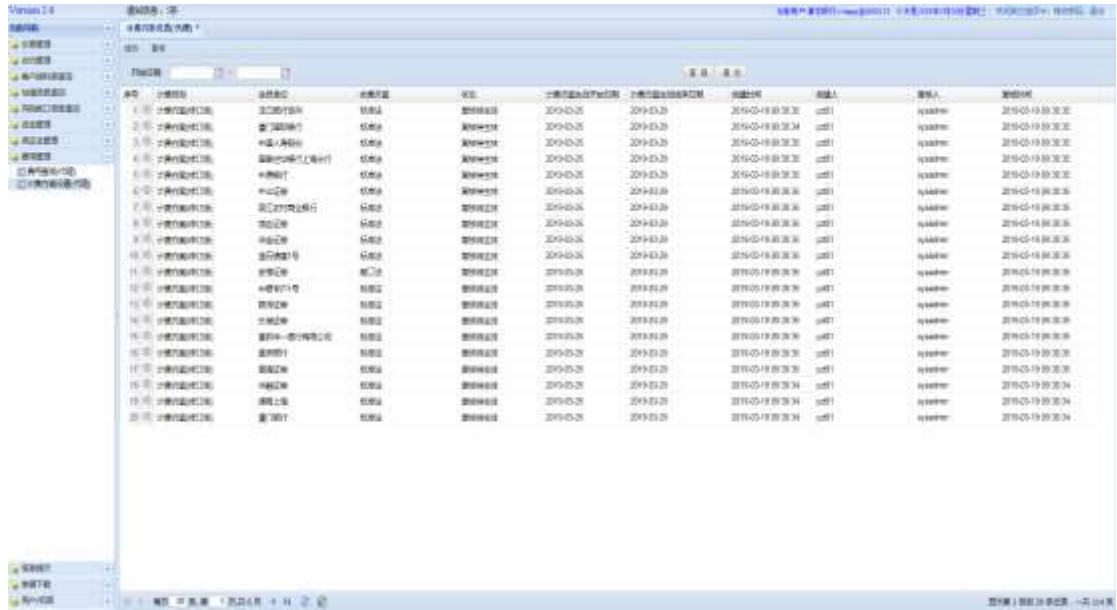
设置成功后，该条收费记录状态显示为“复核待生效”。待计费方案生效日起，所选方案正式生效。



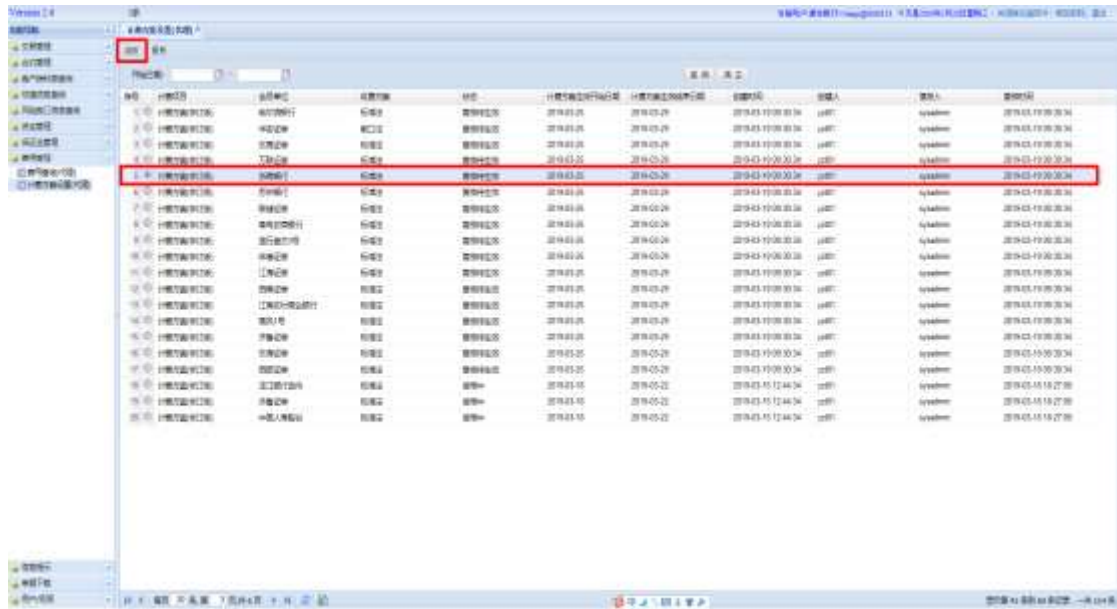
三、计费方案设置（代理）

由综合清算会员为代理的非清算会员设置下一自然年度的收费方案。在清算所开放的时间窗口内，综合清算会员客户端代理业务管理员登陆系统后，点击“计费方案设置（代理），为每一客户进行收

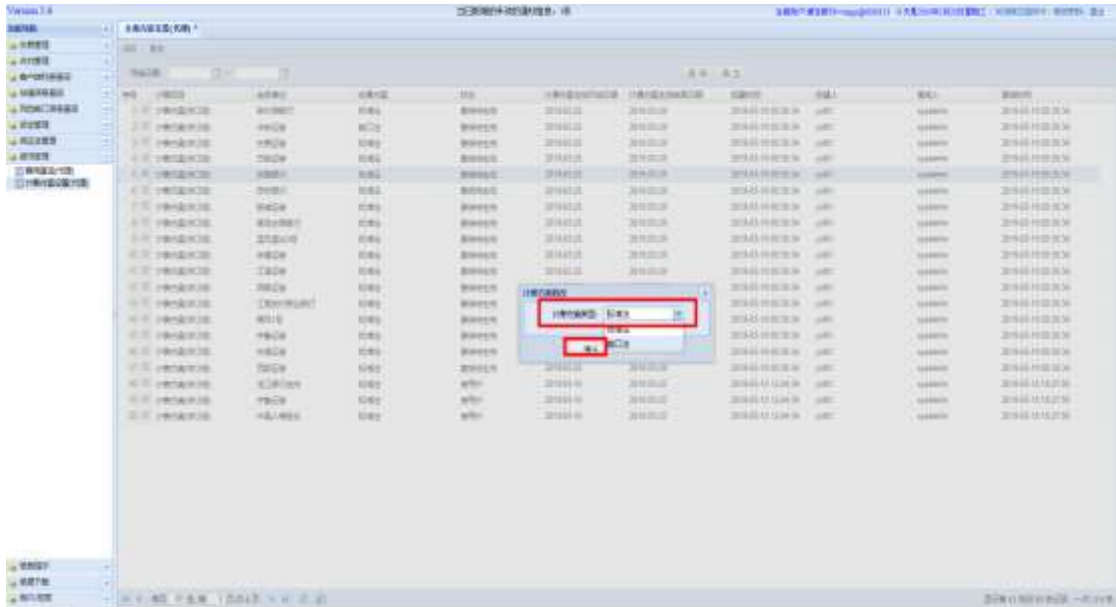
费方案的设置。



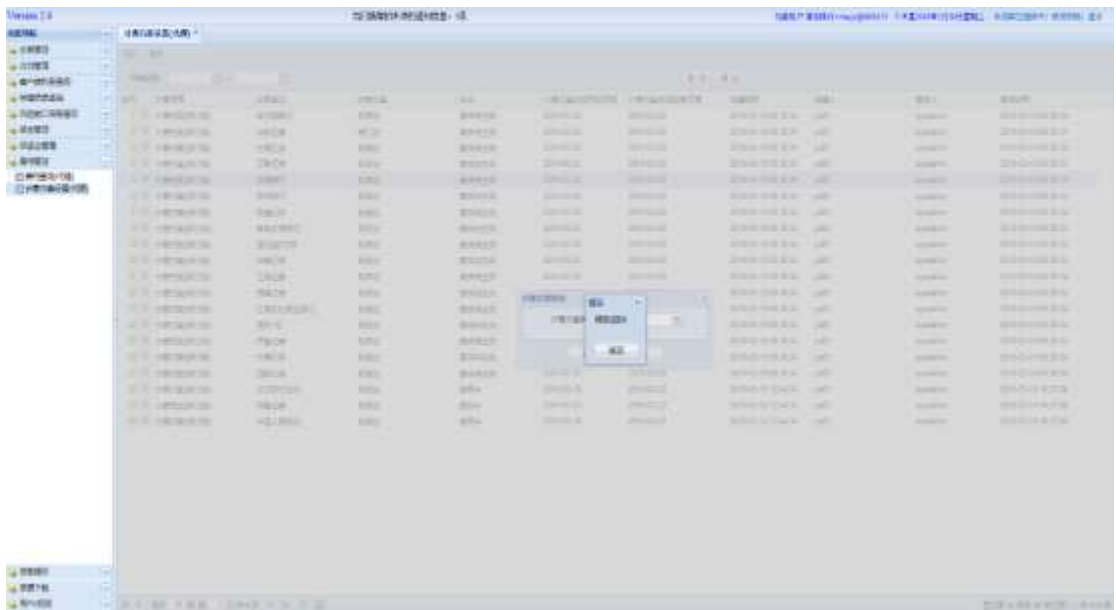
根据收费方案应用时间，利用开始日期和结束日期进行筛选，选中要设置的客户（默认为沿用上一年度收费方案），点击“修改”按钮，可对收费方案进行修改。



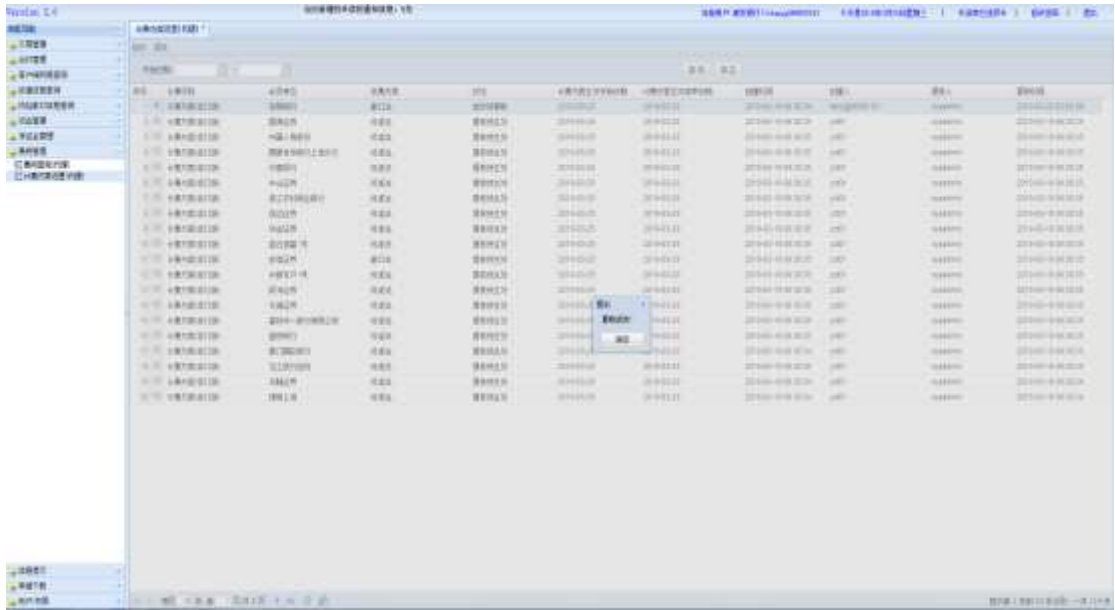
选择相应的收费方案，点击“确定”。



确定所选收费方案后，显示“修改成功”。



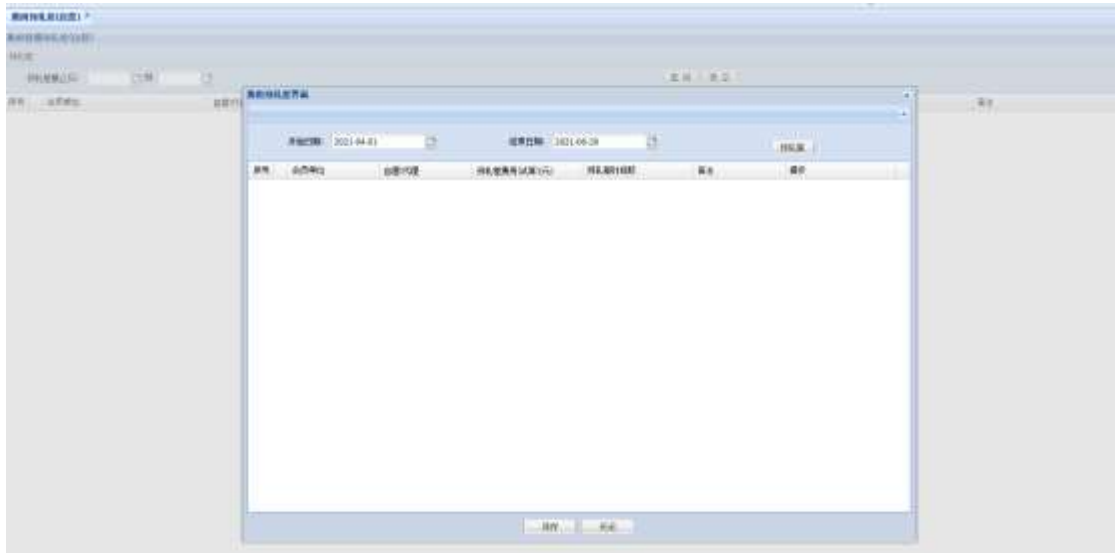
收费方案修改成功，则该条记录为“修改待复核”状态，需另一管理员进行复核。点击“复核”按钮。



设置成功后，该条收费记录状态显示为“复核待生效”。待计费方案生效日起，所选方案正式生效。

四、费用预轧差（自营）

操作员登录费用管理->费用预轧差（自营）界面。



点击左上角“预轧差”，弹出预轧差窗口，操作员选择预轧差时间段后，点击“预轧差”按钮。



系统处理成功后将试算出该时间段内自营清算会员的清算费用汇总值，如上图所示。点击“下载明细”可查看费用预轧差的明细数据；点击“保存”按钮，可将本次试算结果保存，如下图。



五、费用预轧差（代理）

操作员登录费用管理->费用预轧差（代理）界面。



点击左上角“预轧差”，弹出预轧差窗口，操作员选择拟预轧差

的会员单位（如果勾选“会员单位全选”，则显示代理所有客户的费用预轧差试算数据）和预轧差时间段后，点击“预轧差”按钮。



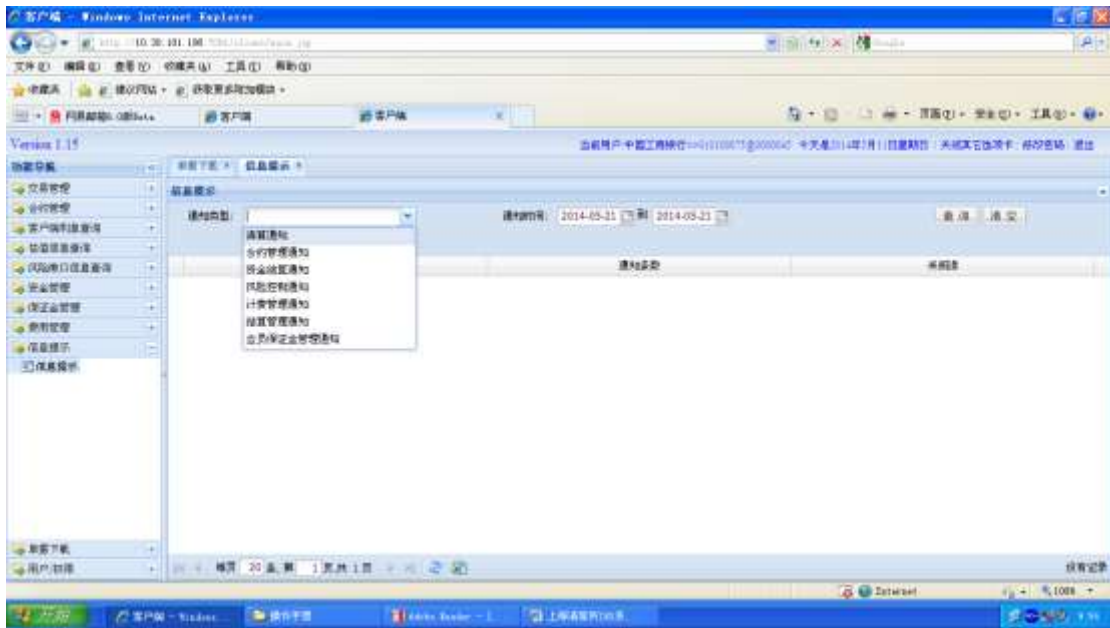
系统处理成功后将试算出该时间段内所选会员单位的清算费用汇总值，如下图所示。点击“下载明细”可查看费用预轧差的明细数据；点击“保存”按钮，可将本次试算结果保存，如下图。



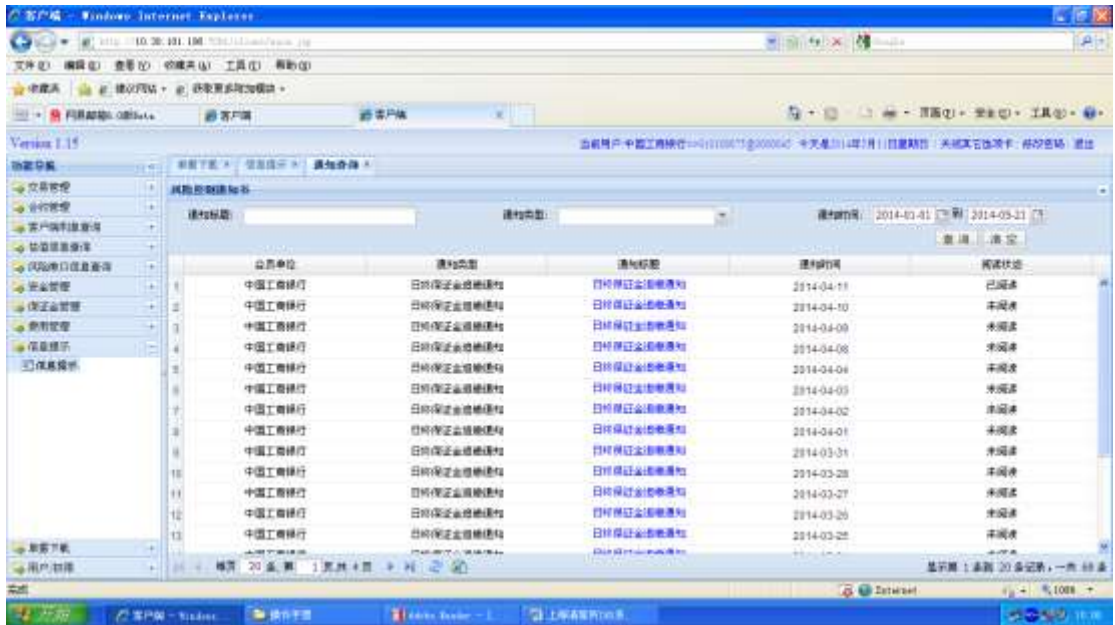


第十章 信息提示

一、信息查询



如上图，进入菜单“信息提示”—“信息提示”，该界面提供各类清算通知，可以按照通知时间和通知类型进行查询。



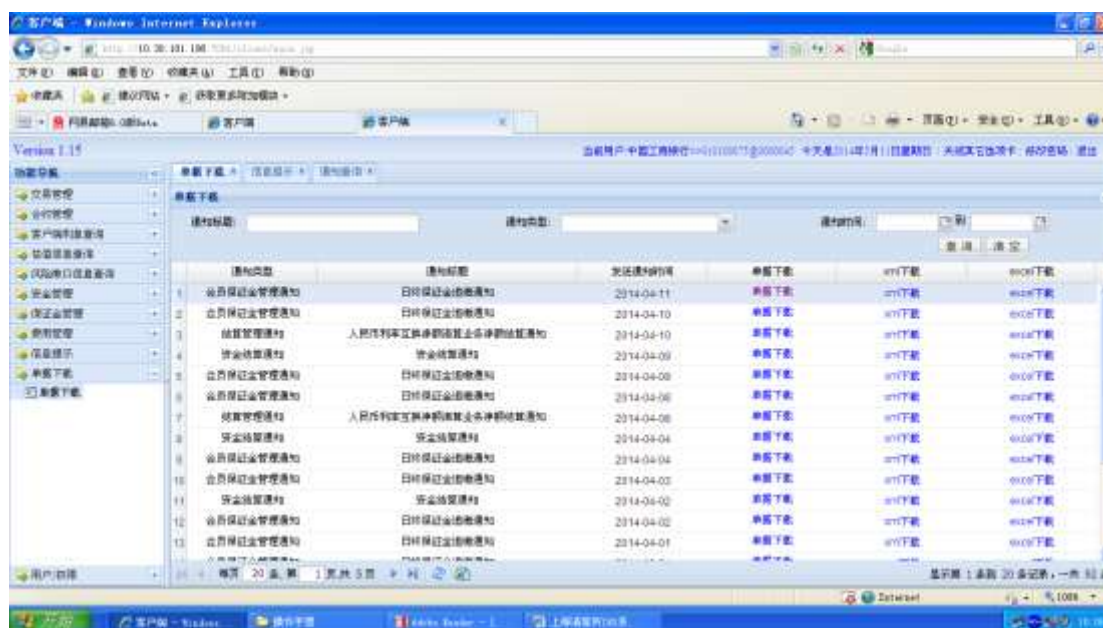
如上图，点击列表中的“通知类型”，如“会员保证金管理通知”，弹出相关日终保证金追缴通知、日终互换通资源池追缴通知等，并按照倒序排列。



如上图，单击列表中的“通知标题”弹出该条通知的详细信息。

第十一章 单据下载

一、单据下载



如上图，进入菜单“单据下载”—“单据下载”，可通过“通知标题”、“通知类型”和“通知时间”筛选出相应的通知单据，可根据“单据下载”（PDF 格式）、“xml 下载”和“excel 下载”进行操作。

包括清算通知、合约管理通知、资金结算通知、风险控制通知、计费管理通知、结算管理通知、会员保证金管理通知和日终互换通资源池追缴通知等。

第十二章 用户/权限

一、用户管理

1. 查询



如上图，进入菜单“用户 / 权限” — “用户管理”，该界面提供会员对自己操作人员进行维护的功能。包括“新增用户”、“修改用户”、“冻结用户”、“解冻用户”、“删除用户”、“初始化密码”和“复核”。

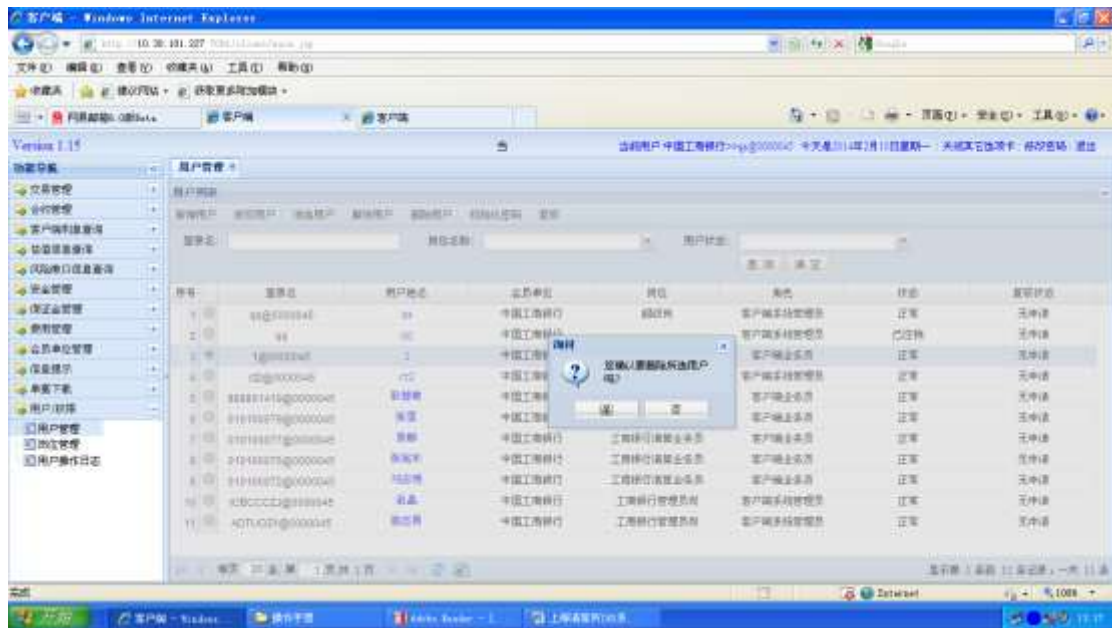
2. 新增用户



的记录只有原经办人员可以修改，修改成功以后点击“确认”，弹出操作成功提示框，同时，复核状态变为“修改待复核”，如下图：



4. 删除

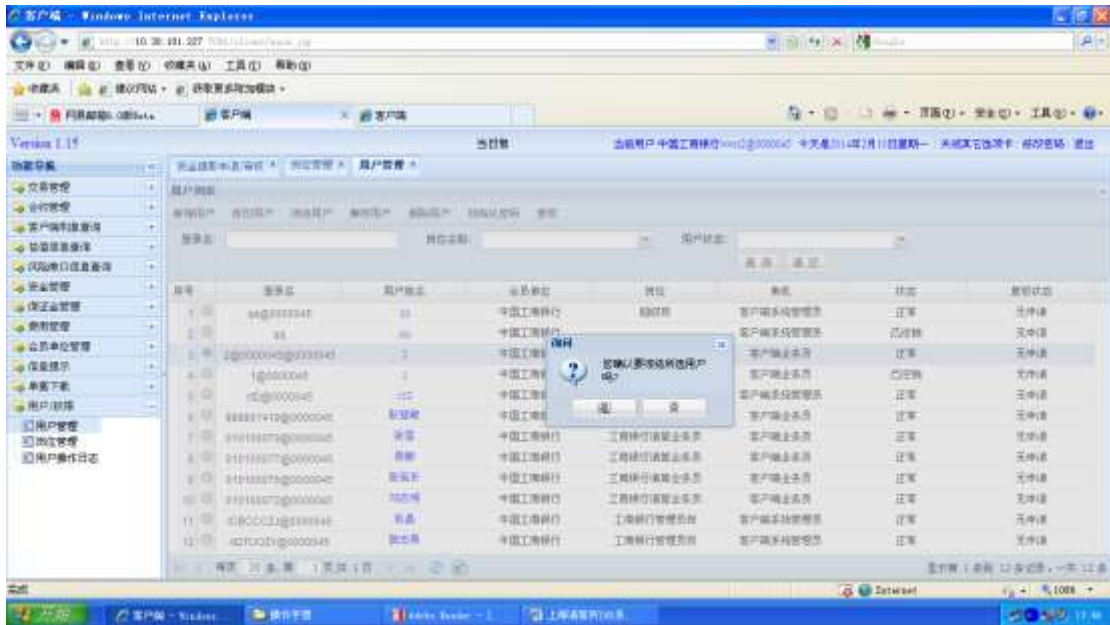


如上图，选中一条记录，单击“删除用户”按钮，弹出确认提示框，其中复核状态为“新增待复核”的记录只有原经办人员可以删除。复核状态为“新增待复核”的记录可以直接删除；复核状态为“正常”的记录需要复核，如下图：

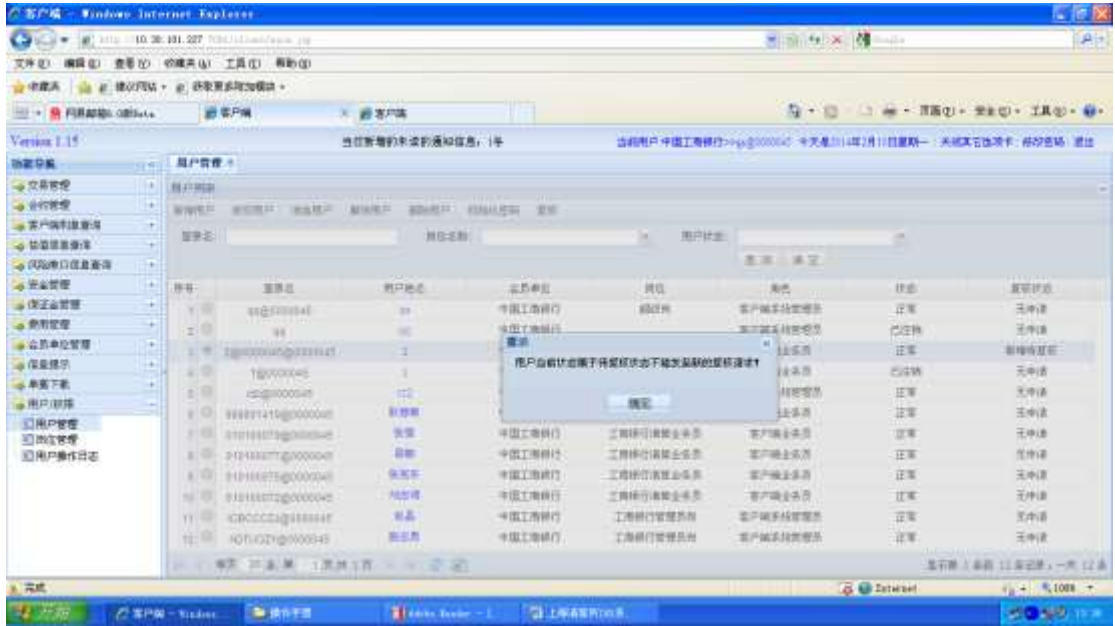


如果复核时单击“撤销”，该条记录的复核状态恢复“无申请”，若单击“复核”，该条记录的状态变成“已注销”，同时复核状态变成“无申请”。

5. 冻结



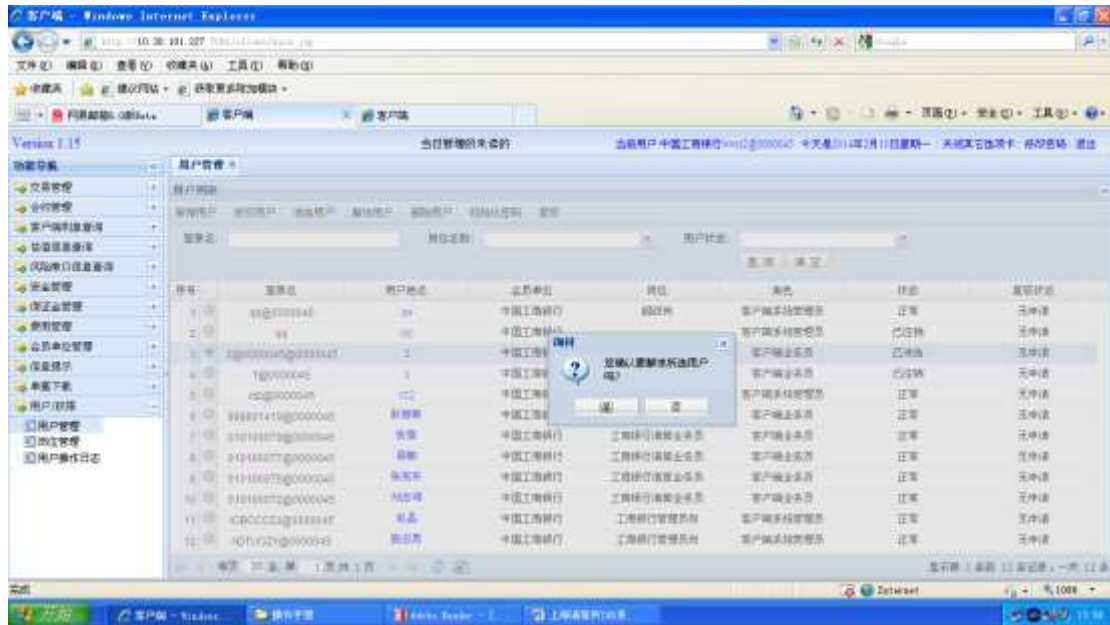
如上图，选中一条记录，单击“冻结用户”按钮，弹出确认提示框。只能对状态为“正常”，同时复核状态为“无申请”的用户记录进行冻结操作。



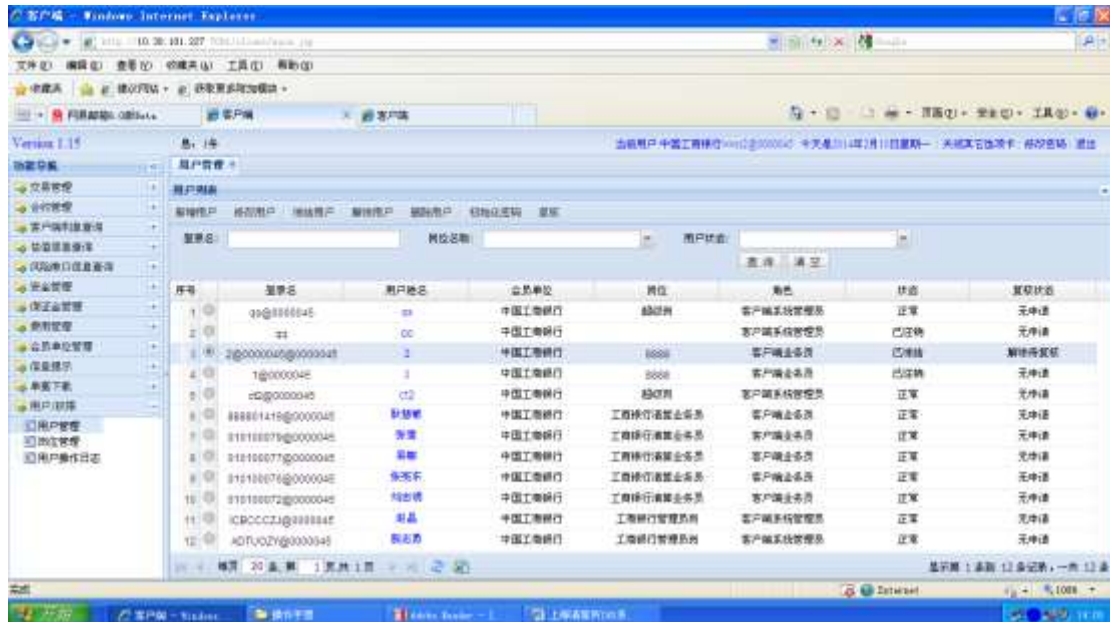
一人操作另一人复核，若复核人撤销冻结操作，必须填写撤销备注。单击“撤销”，该条记录“状态”变为“正常”，同时“复核状态”变为“无申请”；若复核人点击“复核”按钮，复核成功，则该条记录“状态”变为“已冻结”，同时“复核状态”变为“无申请”，如下图：



6. 解冻

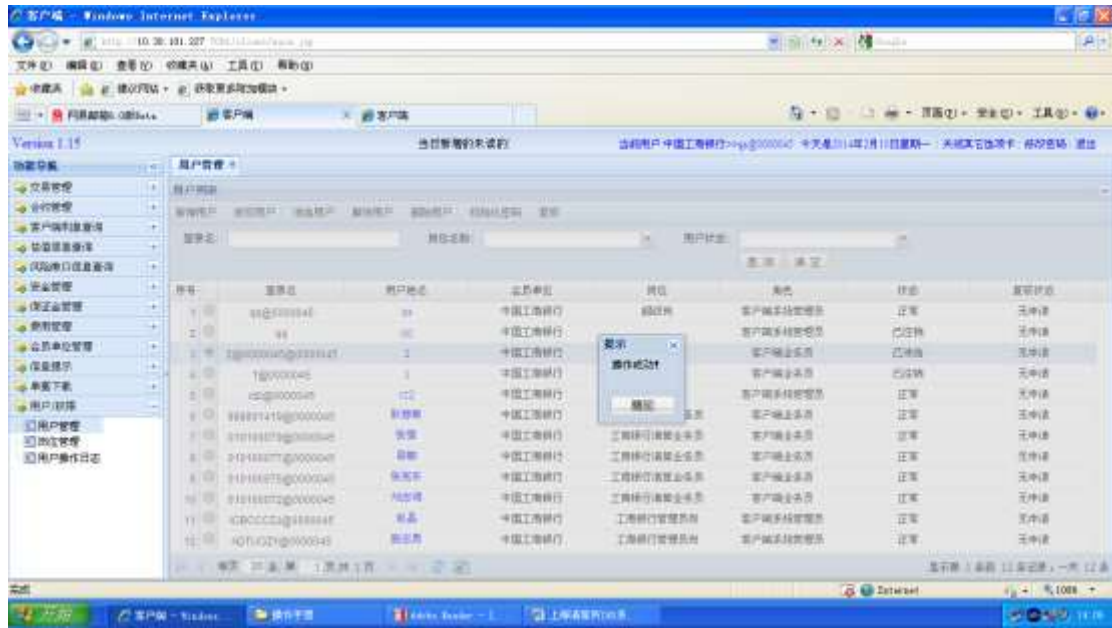


如上图，只能对状态为“已冻结”且复核状态为“无申请”的记录进行解冻操作。选中需要解冻的记录，单击“解冻用户”按钮，弹出确认提示框，单击“是”，复核状态变成“解冻待审核”，如下图：

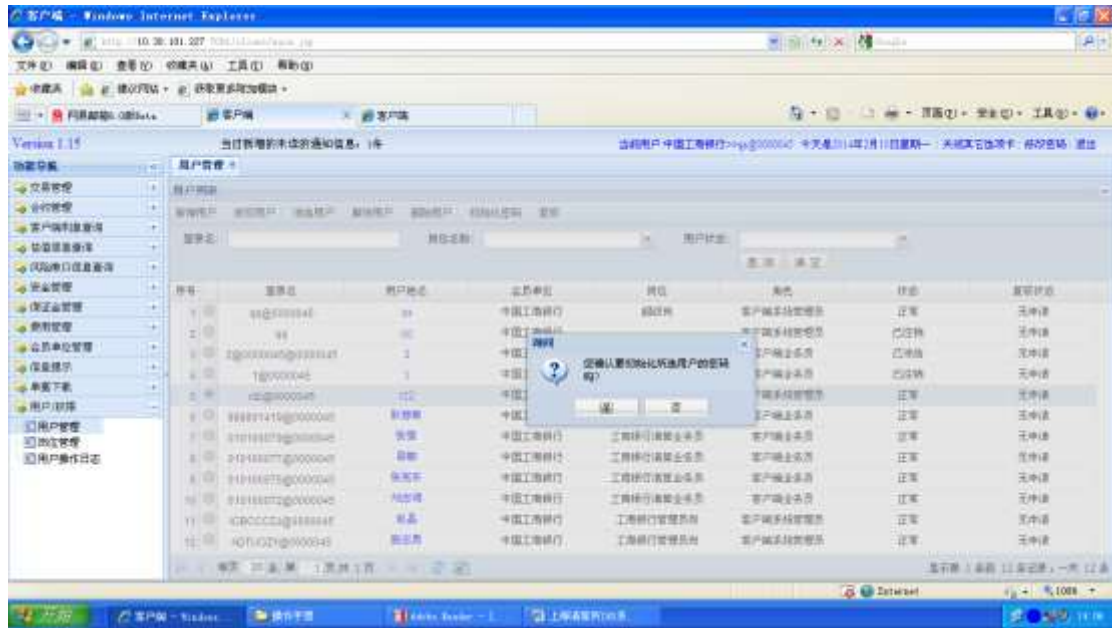


一人操作另一人复核，若复核人撤销解冻操作，必须填写撤销备注。单击“撤销”，该条记录“状态”变为“正常”，同时“复核状态”变为“无申请”；若复核人点击“复核”按钮，复核成功，则该条记

录“状态”变为“正常”，同时“复核状态”变为“无申请”，如下图：



7. 初始化密码



如上图，只能对状态为“正常”，复核状态为“无申请”的记录进行初始化密码的操作。选中需要初始化密码的记录，单击“初始化密码”按钮，弹出确认提示框，单击“是”，复核状态变成“密码重置待复核”。



如上图，一人操作另一人复核，若复核人撤销密码重置操作，必须填写撤销备注。单击“撤销”，该条记录“状态”变为“正常”，同时“复核状态”变为“无申请”；若复核人点击“复核”按钮，复核成功，则该条记录“状态”变为“正常”，同时“复核状态”变为“无申请”，如图。初始化后的用户密码为“888888”。



8. 用户属性



如上图，选择列表中的“用户姓名”，弹出用户属性提示框，供参考。

9. 强制签退



如上图，用户属性提示框提供强制签退功能，单击“强制签退”按钮，弹出操作成功提示框，登录状态由“在线”变成“离线”。

注：上海清算所为每位综合清算会员设置两名客户端系统管理员

账号，综合会员可登录客户端后自行设置客户端业务员等岗位。

二、岗位管理

1. 查询



如上图，进入菜单“用户/管理”—“岗位管理”，该界面提供对岗位的维护功能。包括“新增岗位”、“修改岗位”、“删除岗位”和“复核”等操作。

2. 新增



如上图，单击“新增岗位”弹出录入框，其中“岗位代码”、“岗位名称”和“角色”为必填项。录入岗位信息后，单击“确定”，弹出操作成功提示，及新增岗位增加到岗位列表中，状态为“申请创建”。

“申请创建”状态的岗位需要复核。



如上图，登录名应为唯一，否则系统弹出“该登录名已经存在”的提示框。

3. 修改



如上图，选中一条记录并单击“修改岗位”，弹出修改框，对“申请创建”状态的纪录做修改的需为申请操作的操作人)。修改完成以后点击“确定”，弹出操作成功的提示框。

4. 删除



如上图，可对“状态”为“申请创建”和“正常”的岗位记录进行删除操作(对“申请创建”状态的纪录做删除的需为申请操作的人)。选中需要删除的记录，单击“删除岗位”按钮：(1) 状态为“申请创建”的记录直接删除 (2) 状态为“正常”的记录需要复核，如果复核时单击“撤销”，该条记录恢复“正常状态”。

5. 岗位属性



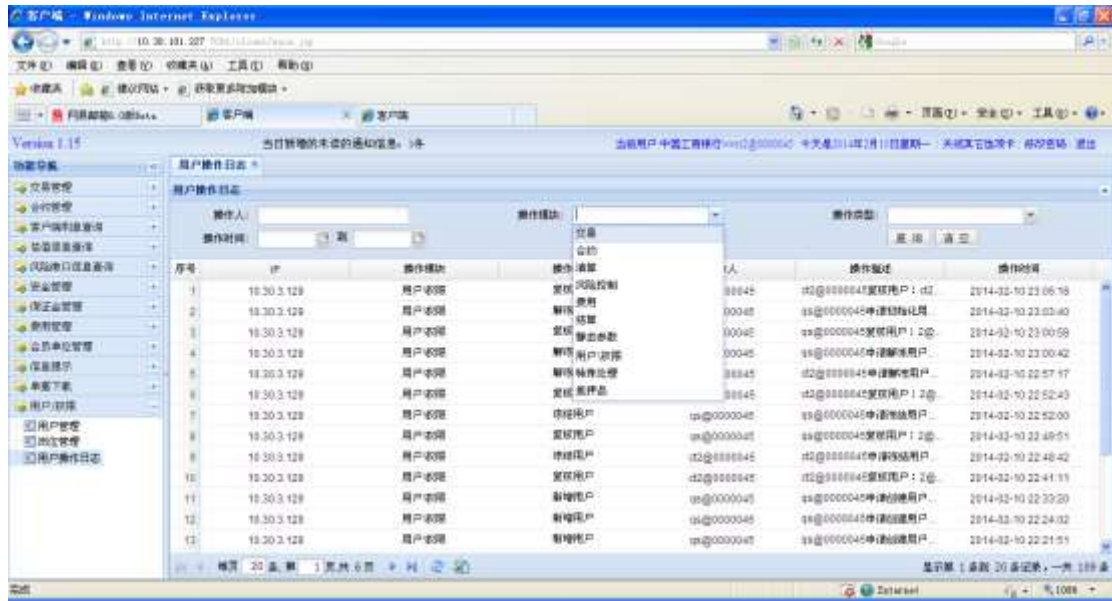
如上图，单击列表中的“岗位名城”链接，弹出“岗位属性”框。

6. 岗位权限设置



如上图，单击列表中的“岗位权限”，弹出岗位权限设置界面，该界面提供岗位权限的“提交”、“复核”和“刷新”操作。岗位权限分为“栏目权限”、“操作权限”、“产品权限”和“消息权限”，操作人可以通过勾选相应权限对“已生效”的岗位权限做新增或者删除调整，

三、用户操作日志



如上图，进入菜单“用户 / 权限” — “用户操作日志”，该界面提供操作日志的明细。可按照操作人、操作模块、操作类型和操作时间进行查询。

第十三章 合约压缩

一、客户端合约压缩申请

(一) 手动压缩申请

单一机构和若干机构页面、操作相同。申请页面如下图：提供多个查询条件，填写对应的一个或多个查询条件，点击查询，在查询结果中显示出对应条件下的结果。

序号	合约编号	交易编号	清算类型	产品名称	名义本金(元)	远期交付方	远期交付方代理	净息交付方	净息交付方代理	币种
1	CF20160418219652	IRS20160413000130	净结清款	国债_FR007	20000000	马来亚上寿交	交通银行	星展中国		人民币
2	CV20160418219658	IRS20160413000154	净结清款	国债_FR007	20000000	浦发银行		马来亚上寿交	交通银行	人民币
3	CV20160418219648	IRS20160413000019	净结清款	国债_FR007	50000000	星展中国		马来亚上寿交	交通银行	人民币
4	CV20160418219645	IRS20160413000232	净结清款	国债_FR007	30000000	广发银行		马来亚上寿交	交通银行	人民币
5	CV20160418219650	IRS20160413000182	净结清款	国债_FR007	20000000	浦发银行		马来亚上寿交	交通银行	人民币
6	CF20160418219644	IRS20160413000217	净结清款	国债_FR007	100000000	马来亚上寿交	交通银行	星展中国		人民币
7	CV20160418219638	IRS20160413000236	净结清款	国债_FR007	30000000	广发银行		马来亚上寿交	交通银行	人民币
8	CV20160418219637	IRS20160413000483	净结清款	国债_FR007	100000000	广发银行		马来亚上寿交	交通银行	人民币
9	CF20160418219641	IRS20160413000464	净结清款	国债_FR007	100000000	马来亚上寿交	交通银行	浦发银行		人民币
10	CV20160418219640	IRS20160413000357	净结清款	国债_SHBOR_3M	100000000	广发银行		马来亚上寿交	交通银行	人民币
11	CF20160418219627	IRS20160413000577	净结清款	国债_FR007	30000000	马来亚上寿交	交通银行	大华银行(中国)		人民币
12	CF20160418219621	IRS20160413000568	净结清款	国债_FR007	50000000	马来亚上寿交	交通银行	广发银行		人民币

1. 合约压缩申请

单一机构合约压缩申请可以分为两种方式：勾选合约点击“合约压缩申请”、通过导入 excel 申请。均支持批量申请。勾选合约点击“合约压缩申请”：勾选上图列表中的序号，或者通过左下角选择本页全选/全部全选，点击合约压缩申请。 导入 excel：点击页面上方“下载导入模板”，下载 excel 模板，并填入数据。点击“导入合约压缩申请”，在弹出的文件选择框里选中已填数据并保存的 excel。

2. 合约编号

点击合约编号弹出支付现金流详细信息，如下图：

序号	合约编号	名义本金(万元)	开始日期	结束日期	计息天数	利率确认	支付日期	浮动利率(%)	SPS
1	CF201604192198	2,000	2016-04-14	2016-04-21	7	2016-04-13		2.5000	0
2	CF201604192198	2,000	2016-04-21	2016-04-28	7	2016-04-20		2.4000	0
3	CF201604192198	2,000	2016-04-28	2016-05-05	7	2016-04-27		3.0800	0
4	CF201604192198	2,000	2016-05-05	2016-05-12	7	2016-05-04		3.0800	0
5	CF201604192198	2,000	2016-05-12	2016-05-19	7	2016-05-11	6.33801796790408		0
6	CF201604192198	2,000	2016-05-19	2016-05-26	7	2016-05-18	6.35987370485192		0
7	CF201604192198	2,000	2016-05-26	2016-06-02	7	2016-05-25	5.72381509908031		0
8	CF201604192198	2,000	2016-06-02	2016-06-09	7	2016-06-01	5.20875303339395		0
9	CF201604192198	2,000	2016-06-09	2016-06-16	7	2016-06-08	5.05866276308804		0
10	CF201604192198	2,000	2016-06-16	2016-06-23	7	2016-06-15	4.87204115492195		0
11	CF201604192198	2,000	2016-06-23	2016-06-30	7	2016-06-22	4.91563501190114		0
12	CF201604192198	2,000	2016-06-30	2016-07-07	7	2016-06-29	4.88382185321609		0
13	CF201604192198	2,000	2016-07-07	2016-07-14	7	2016-07-06	4.87097974166858		0
14	CF201604192198	2,000	2016-07-14	2016-07-21	7	2016-07-13	4.87148704884824		0

3.交易编号

点击“交易编号”弹出委托交易明细，如下图：

交易信息	
交易编号:	RS20160413000130
交易产品:	国债_FR007
提交清算日期:	2016-04-19
交易成交日:	2016-04-13
币种:	人民币
计息天数调整:	实际天数调整
交易处理状态:	已确认(正常)
国债方信息	浮动方信息
国债方合约号:	CF20160419219852
国债支付方:	马航五上海交通银行
国债支付周期:	季
国债利率(%):	2.7600
国债计息方式:	单利
国债计息基准:	ACT/365
交易中心编号:	RS20160413000130
申请清算方式:	净额清算
交易起息日:	2016-04-14
交易到期日:	2021-04-14
名义本金(万元):	2,000
支付日营业日规则:	按国债的T+1营业日规则
交易前续来源:	交易中心
浮动方合约号:	CV20160419219854
浮动支付方:	华夏中国
浮动支付周期:	季
浮动利率调整周期:	周
浮动计息方式:	复利
浮动计息基准:	ACT/365

4.申请驳回

合约申请被系统驳回的情况如下：合约申请截止、到期日不合规、当天进入清算的交易。

(二) 自动化压缩申请

申请页面如下图：提供多个查询条件，填写对应的一个或多个查询条件。

二、单一/若干机构合约压缩申请复核

(一) 手动压缩复核



The screenshot shows a software window titled '合约压缩申请复核(单一机构)'. It features a search bar at the top with fields for '批次编号' (Batch Number), '合约编号' (Contract Number), and '交易编号' (Transaction Number). Below the search bar is a table with columns: '序号' (Serial Number), '申请日期' (Application Date), '批次编号' (Batch Number), '合约编号' (Contract Number), '交易编号' (Transaction Number), '会员名称' (Member Name), '代理会员单位' (Agent Member Unit), '有效对手方' (Valid Counterparty), '有效对手方代码' (Valid Counterparty Code), and '申请状态' (Application Status). The table contains three rows of data, all with an application date of '2016-05-05' and a status of '合约压缩' (Contract Compression).

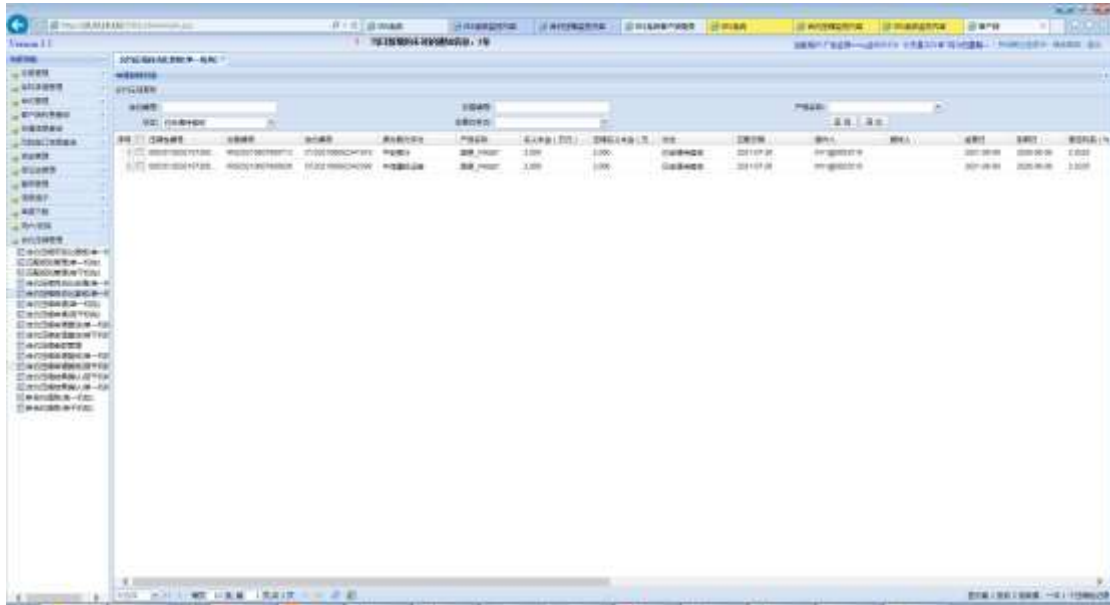
申请合约压缩之后进入申请复核，页面列表展示出所有未经复核、复核通过、复核未通过的合约。勾选合约，点击复核，弹出复核备注，如下图，填写备注，点击通过/不通过/取消。通过：合约压缩申请通过，不通过：合约压缩申请废弃，取消：合约压缩申请待复核。



申请人与复核人不能为同一人

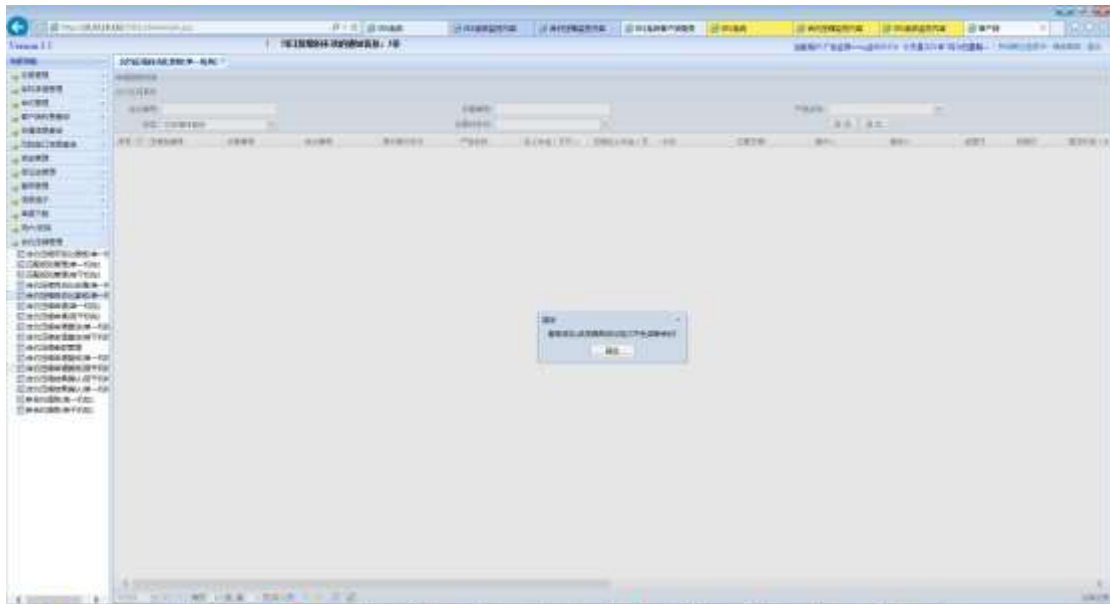
(二) 自动化压缩复核

申请自动化合约压缩之后进入复核页面，页面列表展示出所有未经复核、复核通过、复核未通过的合约。



勾选合约，可在左下方下拉菜单选择“待提交申请”、“已申请待复核”、“已申请待导入”，点击左上角“合约压缩复核”。

弹出复核备注，如下图，填写备注，点击通过/不通过/取消。通过：合约压缩申请通过，不通过：合约压缩申请废弃，取消：合约压缩申请待复核。



三、匹配规则管理



1.修改

申请合约压缩，每个批次系统自动为其生成一条默认匹配规则。
勾选规则，点击修改，修改各项匹配参数后，点击确定。

2.复核

待有“复核”权限的操作人员复核并确认，状态更改为已使用，使用中的匹配规则不允许修改

3.压缩规则

单一机构的合约压缩规则：



若干机构的匹配规则：

若干机构匹配规则设置

批次编号: SCH2016050600X

匹配类型: 原交易对手匹配 非原交易对手匹配 新合约生成匹配

生成新合约上限数量: 0

确认 取消

四、合约压缩申请查询

合约压缩申请查询(单一机构)

申请列表

合约编号: 交易编号: 批次编号:

总行单位: 产品品种: 申请状态:

申请日期: 2016-05-01 2016-11-02

查询 清空

申请日期	申请机构	原交易对手方	合约批次号	交易编号	合约编号	合约压缩日期	匹配规则	新生成合约
2016-05-05 09:22:40	马来亚上海交通银行	东亚中国	SCH20160505001	IRS20160413000156	CF20160419219651	2016-05-06	不生或新合约	0
2016-05-05 09:22:40	马来亚上海交通银行	星展中国	SCH20160505001	IRS20160413000104	CF20160419219655	2016-05-06	不生或新合约	0
2016-05-05 09:07:30	马来亚上海交通银行	中国银行	SCH20160505001	IRS20160418000206	CF20160419220065	2016-05-06	不生或新合约	0

填写上图的筛选条件，点击“查询”，查询出对应条件的合约压缩申请。点“清空”，清楚所有的查询条件。若查询条件为空，则查出所有申请。

五、合约压缩参数管理

序号	会员单位	批次编号	限制类型	状态	经办人	复核人	备注	创建时间	结束时间
1	马丰亚上海交通	SCH2016050300X	市场风险限额限制	使用中	sysadmin	sysadmin		2016-05-03 09:10:56	2016-05-03 18:17:48
2	马丰亚上海交通	SCH2016050300X	估值与估值差设置	使用中	sysadmin	sysadmin		2016-05-03 09:10:56	2016-05-03 18:17:48
3	马丰亚上海交通	SCH2016050300X	合约压缩净额限制	使用中	sysadmin	sysadmin		2016-05-03 09:10:56	2016-05-03 18:17:48
4	马丰亚上海交通	SCH2016050600X	市场风险限额限制	使用中	sysadmin	sysadmin		2016-05-06 09:49:50	2016-05-06 16:31:05
5	马丰亚上海交通	SCH2016050600X	估值与估值差设置	使用中	sysadmin	sysadmin		2016-05-06 09:49:50	2016-05-06 16:31:05
6	马丰亚上海交通	SCH2016050600X	合约压缩净额限制	使用中	sysadmin	sysadmin		2016-05-06 09:49:50	2016-05-06 16:31:05

合约压缩参数设置只针对若干批次压缩。每申请一个批次的合约压缩，系统自动为该批次分配三条默认限制，客户端操作员可以修改数据。每个批次有三项参数，分别为：市场风险限额限制、合约压缩净额区间、估值与估值差设置。系统根据匹配规则得到一条压缩结果，再验算是否合乎合约压缩参数的要求，若符合，则压缩成功，否则失败。

1. 修改压缩参数

设置参数的操作：勾选对应的批次号的参数序号，点击修改，在弹出框中填写各项参数，点击确认，状态修改为修改待复核。

2. 复核

待有复核权限的操作员，复核通过，该条限制状态变为“已生效”，否则为“废弃”。

3. 修改页面

估值提交与估值差设置：提供了批量修改的功能，下载模板，按模板格式填写数据，保存之后点击浏览，在文件选择框中选中文件，点击导入，并保存即可。

估值提交与估值偏差设置

合约压缩批次编号: SCH2016051000X 限制类型: 估值与估值偏差设置

请选择导入文件: 浏览... 下载模板 导入

序号	交易编号	合约编号	估值	清算所估值
----	------	------	----	-------

估值偏离价差:

保存 取消

净额区间限制

合约压缩批次编号: SCH2016051000X

限制类型: 合约压缩净额区间

支付总限制:

收取总限制:

保存 取消

六、新合约提取

合约批次号	合约编号	合约压缩申请机构	匹配状态	压缩一级状态	压缩二级状态	名义本金(万元)	固定利率(%)	净息参考利率
SCH2016051000X	CF20160510224798	马来亚上海交通银行	新合约	合约压缩处理中	合约压缩生成	1,200	2.6300	国债_FR007
SCH2016051000X	CV20160510224797	马来亚上海交通银行	新合约	合约压缩处理中	合约压缩生成	3,200	2.5800	国债_FR007
SCH2016051000X	CF20160510224796	马来亚上海交通银行	新合约	合约压缩处理中	合约压缩生成	5,900	2.5720	国债_FR007
SCH2016051000X	CV20160510224795	马来亚上海交通银行	新合约	合约压缩处理中	合约压缩生成	560	2.4128	国债_FR007
SCH2016051000X	CF20160510224794	马来亚上海交通银行	新合约	合约压缩处理中	合约压缩生成	2,560	2.4847	国债_FR007
SCH2016051000X	CF20160510224793	马来亚上海交通银行	新合约	合约压缩处理中	合约压缩生成	2,400	2.5834	国债_FR007
SCH2016051000X	CV20160510224792	马来亚上海交通银行	新合约	合约压缩处理中	合约压缩生成	4,400	2.5814	国债_FR007
SCH2016051000X	CF20160510224791	马来亚上海交通银行	新合约	合约压缩处理中	合约压缩生成	10,000	2.3750	国债_FR007
SCH2016051000X	CF20160510224790	马来亚上海交通银行	新合约	合约压缩处理中	合约压缩生成	1,600	2.6204	国债_FR007
SCH2016051000X	CV20160510224789	马来亚上海交通银行	新合约	合约压缩处理中	合约压缩生成	3,600	2.6299	国债_FR007
SCH2016051000X	CV20160510224788	马来亚上海交通银行	新合约	合约压缩处理中	合约压缩生成	30	3.1501	国债_FR007
SCH2016051000X	CF20160510224787	马来亚上海交通银行	新合约	合约压缩处理中	合约压缩生成	5,030	2.3001	国债_FR007
SCH2016051000X	CF20160510224786	马来亚上海交通银行	新合约	合约压缩处理中	合约压缩生成	4,400	2.5435	国债_FR007
SCH2016051000X	CV20160510224785	马来亚上海交通银行	新合约	合约压缩处理中	合约压缩生成	5,400	2.5010	国债_FR007
SCH2016051000X	CV20160510224784	马来亚上海交通银行	新合约	合约压缩处理中	合约压缩生成	11,000	2.3812	国债_FR007
SCH2016051000X	CF20160510224783	马来亚上海交通银行	新合约	合约压缩处理中	合约压缩生成	16,000	2.3852	国债_FR007

单一机构和若干机构操作相同。在合约压缩规则中允许生成新合约的压缩批次有可能会生成新合约，新合约提取主要用于查询生成的新合约。输入查询条件，点击查询。

七、合约压缩结果确认

单一机构和若干机构操作相同。

序号	合约压缩批次编号	申请机构	申请日期	合约笔数	原合约压缩笔数	部分压缩笔数	生成新合约笔数	原合约名义本金总量(万元)	利率
1	SCH2016050301	马来亚上海交通银行	2016-05-05	1	0	0	0	2,000	

1. 查询

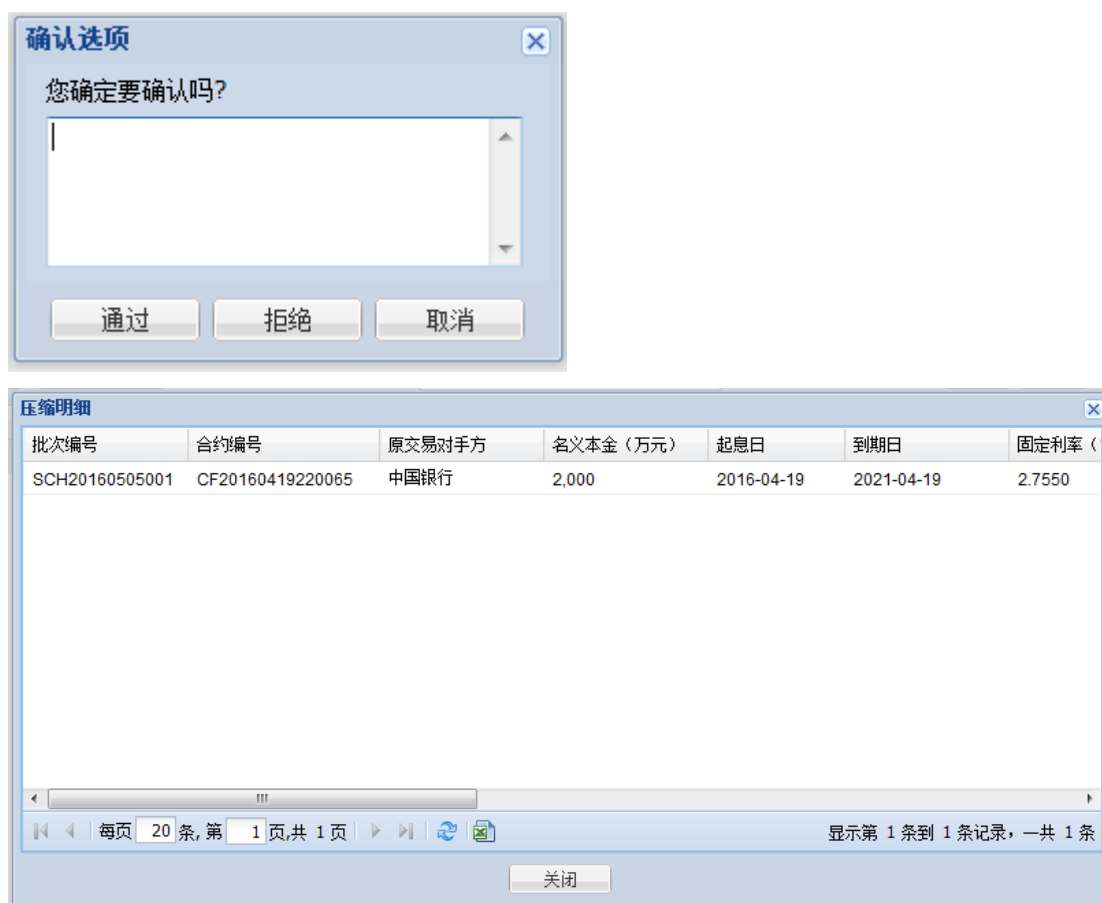
提供申请时间、批次编号的查询条件。

2. 合约压缩结果确认

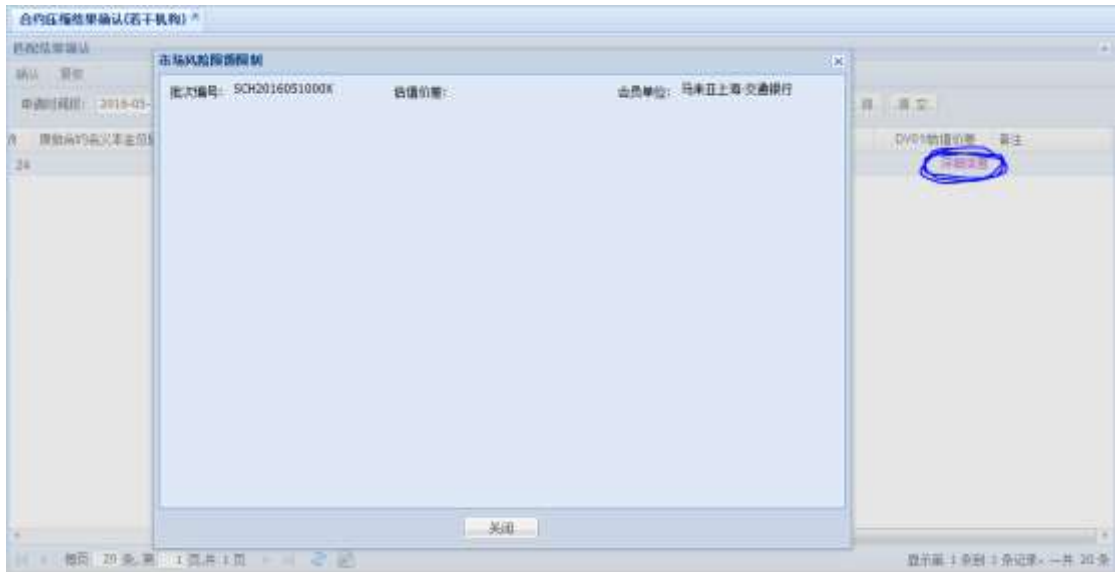
合约压缩结束后，产生压缩结果，待客户端操作员确认是否同意压缩结果。勾选压缩结果序号，点击确认，并填写确认理由，点击通过/拒绝。

3. 合约压缩结果确认复核

待有复核权限的操作员复核通过/拒绝。如果客户端未对结果进行确认，系统在某个时段执行任务时，会自动确认。点击“合约压缩批次”，弹出框为该批次的压缩明细。



只有若干机构有 DV01 估值差的弹框：



八、客户端合约压缩可视化

如下图，界面显示合约压缩所有批次的处理情况/结果。左上方“当前处理状态”显示最新批次状态，包括未申请、未复核、已复核、压缩处理中、压缩处理完成，可链接至其他画面。正上方匹配规则可筛选下方列表显示批次，包括无/不生成新合约/生成新合约。

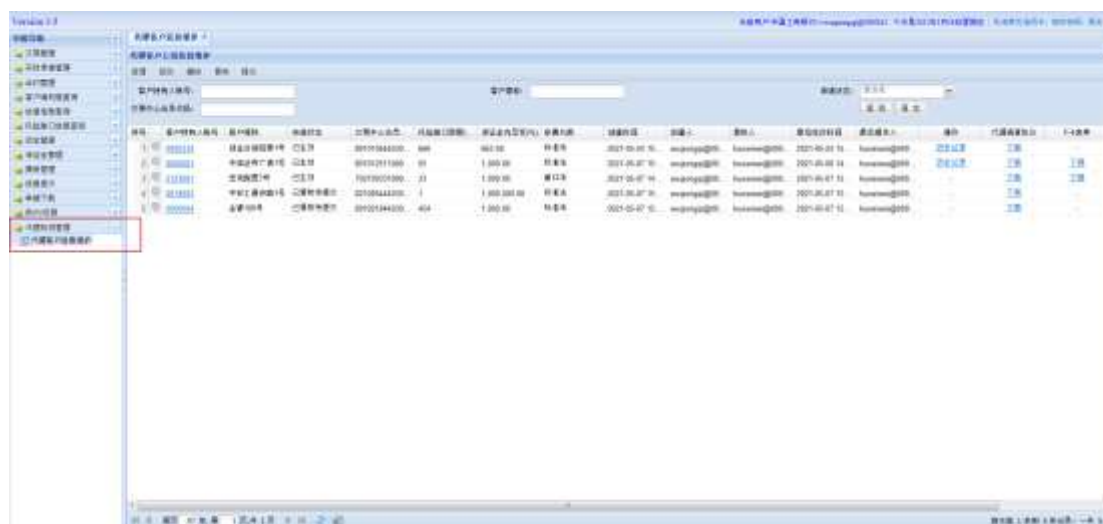
批次编号	处理状态	匹配规则	合约数量	提交申请笔数	提交名义本金(万元)	压缩名义本金(万元)
1. SCH2016051000K	未申请	无	0	0	0	0
2. SCH2016051000K	未复核	无	0	0	0	0
3. SCH2016051000K	已复核	无	0	0	0	0
4. SCH2016051000K	压缩处理中	无	0	0	0	0

下方列表显示要素包括：压缩批次、处理状态、匹配规则、合约压缩结果、提交申请笔数、提交名义本金、压缩名义本金。

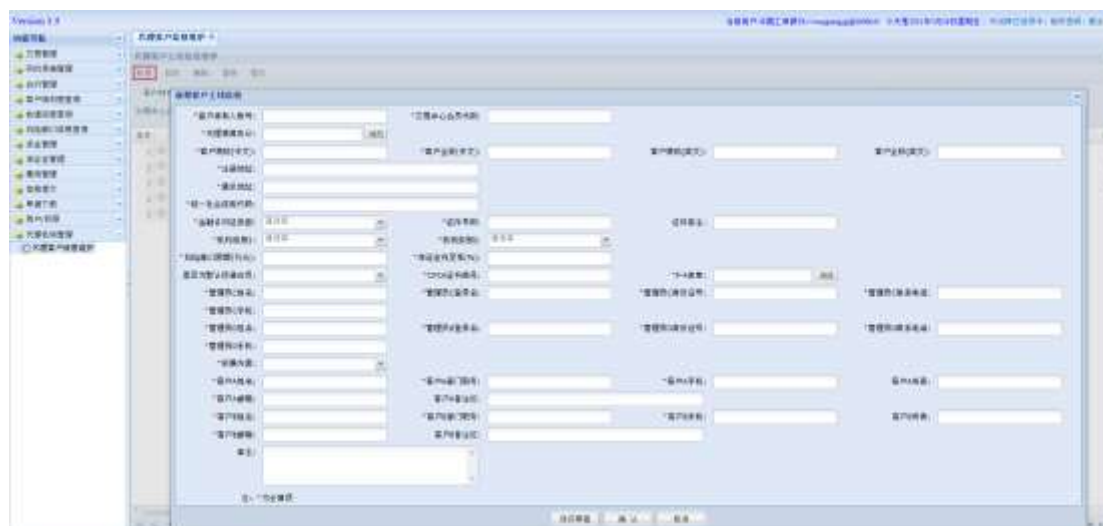
第十四章 代理客户线上化（综合清算会员代理业务功能）

一、代理客户信息维护-新增

具有“新增客户信息”权限的操作员进入客户端，点击代理机构管理->代理客户信息维护，出现如下界面：



点击“新增”按钮，弹出新增客户所需的信息。



依次录入新增客户的持有人账号（上海清算所非清算会员账号）、交易中心会员代码（21 位码）、客户简称、客户全称、客户其他相关信息以及上传代理清算协议、F-4 表单（或有）等。相关字段输入格式如下：

(在此界面中, 带有 ‘*’ 的为必填项)

输入要素	必填项	填写规范	备注
持有人账号	是	7 位数字	输入非清算会员持有人账号 (7 位) 后, 提示该客户是否为一对多客户。新增 1v1 客户及新增 1v3 及以上客户时, 管理员相关信息等会自动置灰。 一对多客户需与 IRS 系统已有客户简称保持一致。
交易中心会员代码	是	21 位码	一对多客户需与 IRS 系统已有客户简称保持一致
代理清算协议	是	上传格式支持 pdf、jpg、png、jpeg、zip、7z, 文件不超过 50M	
客户简称 (中文)	是	汉字、数字、字母, 半角符号, 不能有空格, 最大长度为 50	一对多客户需与 IRS 系统已有客户简称保持一致
客户全称 (中文)	是	汉字、数字、字母, 半角符号, 不能有空格, 最大长度为 50	一对多客户需与 IRS 系统已有客户简称保持一致
客户简称 (英文)	否	汉字、数字、字母, 半角符号, 不能有空格, 最大长度为 50	可选填, 不做强制要求
客户全称 (英文)	否	汉字、数字、字母, 半角符号, 不能有空格, 最大长度为 50	可选填, 不做强制要求
注册地址	是	汉字、数字、字母, 半角符号, 不能有空格, 最大长度为 200	
通讯地址	是	汉字、数字、字母, 半角符号, 不能有空格, 最大长度为 200	
金融许可证类型	是	不可编辑, 可选择	
证件号码	是	数字、字母, 不可有空格, 最大长度 50	填写金融许可证证件号码
证件备注	否	汉字、数字、字母, 不能有空格, 最大长度为 200	如存在给定金融许可证类型以外的其他类别, 可以选择填在此处, 填写证件号码
机构类别 1	是	可选择, 不可编辑	
机构类别 2	是	可选择, 不可编辑	
风险敞口限额 (万元)	是	正整数	
保证金充足率 (%)	是	非负两位小数	

是否为默认综清会员	否	可选择，不可编辑	新增 1v1 客户和新增 1v2 客户必填	
CFCA 证书串号	否	汉字、数字、字母，半角符号，不能有空格	新增 1v2 客户必填	
F-4 表单	否	上传格式支持 pdf、jpg、png、jpeg、zip、7z，文件不超过 50M	新增 1v2 客户必填	
收费方案	是	可选择，不可编辑	置灰则无需填写	
管理员信息	姓名	是	汉字、英文、数字、字母，无空格，最大长度为 20	新增 1v2 客户需填写，且内容需与 F-4 表单保持一致
	登录名	是	英文字母或英文字母加数字，并区分大小写，最大长度为 12	新增 1v2 客户需填写，且内容需与 F-4 表单保持一致
	身份证号	是	数字，最多 18 位	新增 1v2 客户需填写，且内容需与 F-4 表单保持一致
	联系电话	是	数字，最多 20 位	新增 1v2 客户需填写，且内容需与 F-4 表单保持一致
	手机	是	数字最多 20 位	新增 1v2 客户需填写，且内容需与 F-4 表单保持一致
客户人员信息	姓名	是	汉字、英文、数字、字母，无空格，最大长度为 20	
	部门职务	是	字符最多 20 位	
	手机	是	数字最多 20 位	
	传真	否	数字和 ‘-’ 最多 20 位	
	邮箱	是	必须含有 ‘@’，且不能以 ‘@’ 开头，最多 50 位	
	备注	否	字符最多 200 位	
备注	否	字符最多 200 位		

系统自动根据输入的持有人账号判断是否为一对多客户，并根据一对多客户的不同情形调整待输入的内容。具体情况如下：

(1) 新增一对二客户

认”按钮，显示新增成功。



点击“确定”按钮，当前新增页面消失，回到主界面可以看到已新增的客户，新增客户状态为“新增待复核”。（如果只填写部分信息，可以点击“保存草稿”保存当前界面内容，后续可点击“修改”按钮继续补充新增客户信息）



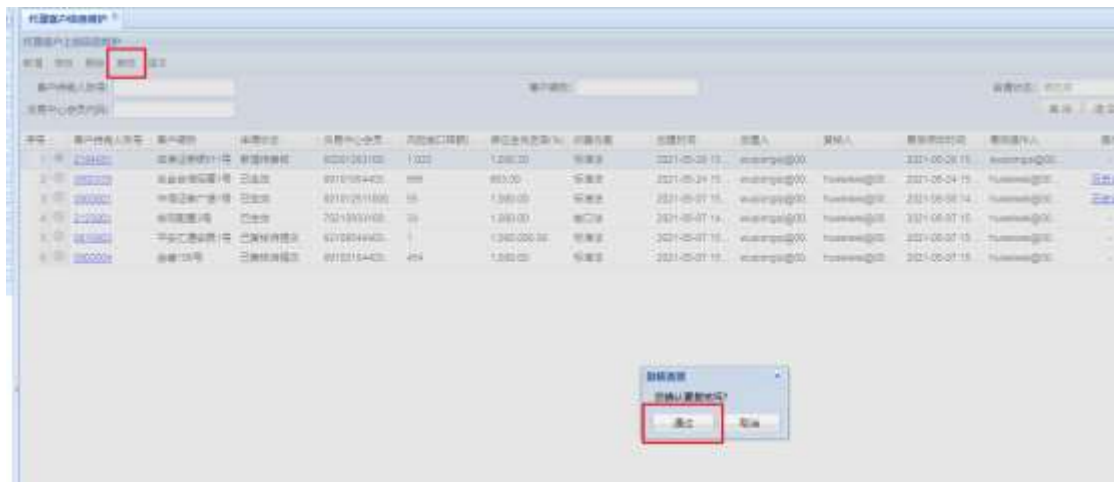
“新增待复核”记录仍可再次修改，修改后变为“修改待复核”。

二、代理客户信息维护-复核

具有“复核客户信息”权限的操作员登录客户端，进入代理机构管理->代理客户信息维护界面，对“新增待复核”、“修改待复核”的客户信息进行复核查看，确认无误后，选中该条客户信息，点击“复核”。



点击“复核”后如下图所示，点击“通过”，提示“复核成功”。



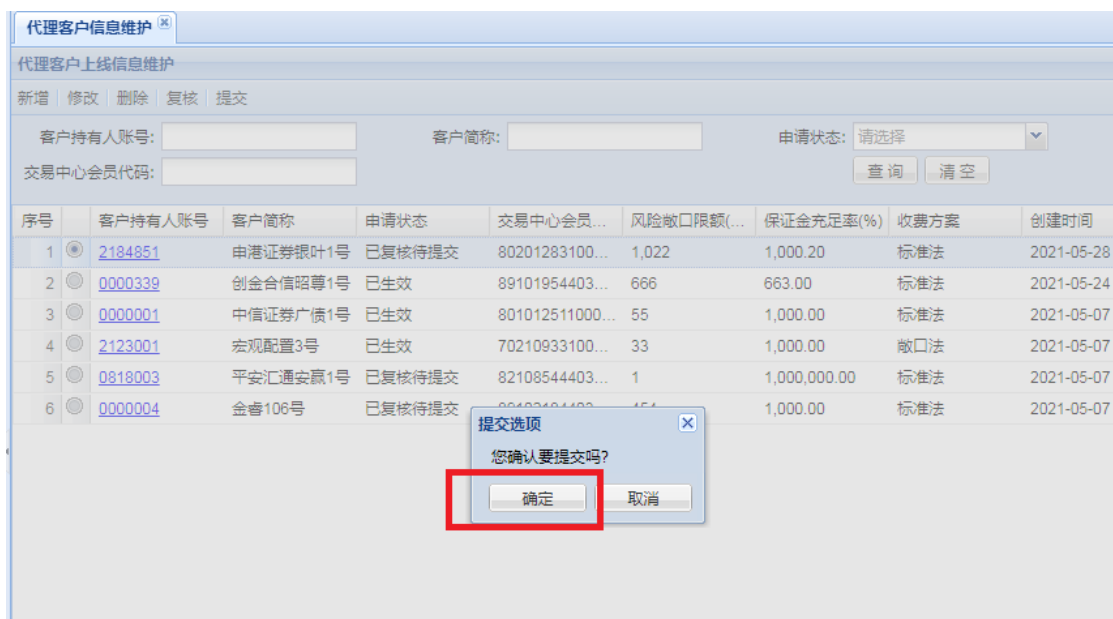
复核通过后该条客户信息状态为“已复核待提交”。“已复核待提交”的客户信息仍可再次修改并复核。

三、代理客户信息维护-提交

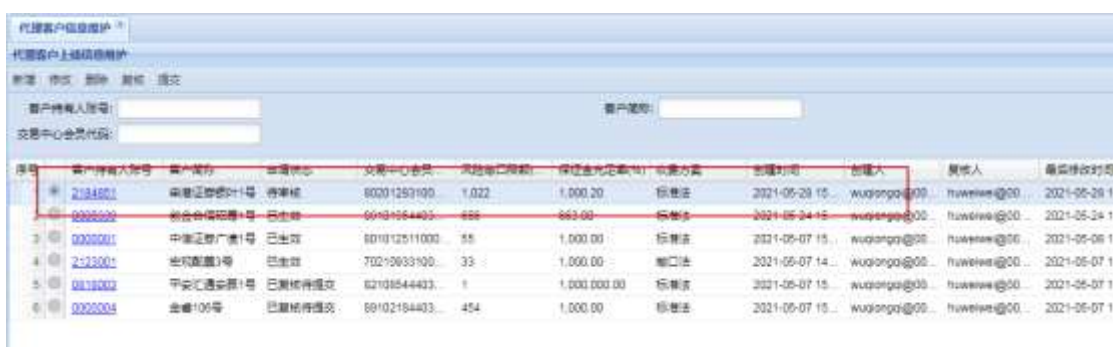
具有“提交客户信息”权限的操作员，可对“已复核待提交”记录进行提交，点击“提交”按钮。



点击“提交”按钮后，出现如图所示弹窗：



点击“确定”按钮后，主界面中新增客户信息状态为“待审核”，如下图所示：



此时该条新增客户信息已提交至上海清算所，等待清算所工作人员审核。

四、代理客户信息维护-修改

(一) 客户记录被清算所退回

经清算所工作人员审核未通过时，新增客户信息将被退回至客户端，客户信息申请状态为“已退回”，如图所示。操作员可以点击“历史记录”（超链接），查看该条记录被退回的原因。历史记录按退回时间倒序排列。

序号	客户姓名	证件类型	证件号码	证件类型	证件有效期	证件类型	证件类型	证件类型	证件类型	证件类型	证件类型	证件类型	证件类型	证件类型	证件类型	
1	220021	身份证	000010011000	身份证	1.000.00	身份证	2021-05-24 15:00	身份证	2021-05-24 15:00	身份证	2021-05-24 15:00	身份证	2021-05-24 15:00	身份证	2021-05-24 15:00	身份证
2	220021	身份证	000010011000	身份证	1.000.00	身份证	2021-05-24 15:00	身份证	2021-05-24 15:00	身份证	2021-05-24 15:00	身份证	2021-05-24 15:00	身份证	2021-05-24 15:00	身份证
3	220021	身份证	000010011000	身份证	1.000.00	身份证	2021-05-24 15:00	身份证	2021-05-24 15:00	身份证	2021-05-24 15:00	身份证	2021-05-24 15:00	身份证	2021-05-24 15:00	身份证
4	220021	身份证	000010011000	身份证	1.000.00	身份证	2021-05-24 15:00	身份证	2021-05-24 15:00	身份证	2021-05-24 15:00	身份证	2021-05-24 15:00	身份证	2021-05-24 15:00	身份证
5	220021	身份证	000010011000	身份证	1.000.00	身份证	2021-05-24 15:00	身份证	2021-05-24 15:00	身份证	2021-05-24 15:00	身份证	2021-05-24 15:00	身份证	2021-05-24 15:00	身份证
6	220021	身份证	000010011000	身份证	1.000.00	身份证	2021-05-24 15:00	身份证	2021-05-24 15:00	身份证	2021-05-24 15:00	身份证	2021-05-24 15:00	身份证	2021-05-24 15:00	身份证

具有“修改客户信息”权限的操作员选中待修改的客户信息，点击“修改”，出现下图所示界面，依据退回原因及界面提示修改相关项后，点击“确认”后，显示“修改成功”。主界面该客户信息申请状态变更为“修改待复核”。

(二) 对新增客户信息进行修改

具有“修改客户信息”权限的操作员可以对申请状态为“草稿”、

“新增待复核”、“修改待复核”、“已复核待提交”的客户信息进行修改，修改后，该条记录申请状态变更为“修改待复核”。

序号	客户持有人账号	客户名称	申请状态	交易中心会员	风险敞口限额	保证金充足率(%)	融券方式	创建时间	创建人	复核人	最后修改时间	最后修改人	操作	代理费费率
1	2101051	申港证券锦叶1号	修改待复核	802012831000	1,022	1,000.20	标准法	2021-05-28 15:...	wuqiang@00...	huweiw@00...	2021-05-21 15:...	wuqiang@00...	删除	2.00
2	0001329	国金证券锦叶1号	已生效	801012544030	666	663.00	标准法	2021-05-24 15:...	wuqiang@00...	huweiw@00...	2021-05-24 15:...	huweiw@00...	删除	2.00
3	0001001	中信证券广信1号	已生效	801012511000	55	1,000.00	标准法	2021-05-07 15:...	wuqiang@00...	huweiw@00...	2021-05-09 15:...	huweiw@00...	删除	2.00
4	2123001	宏源证券3号	已生效	702109331000	33	1,000.00	标准法	2021-05-07 14:...	wuqiang@00...	huweiw@00...	2021-05-07 15:...	huweiw@00...	删除	2.00
5	0018003	平安汇通中融1号	已复核待提交	821065444030	1	1,000,000.00	标准法	2021-05-07 15:...	wuqiang@00...	huweiw@00...	2021-05-07 15:...	huweiw@00...	删除	2.00
6	0001004	金普106号	已复核待提交	891021844030	454	1,000.00	标准法	2021-05-07 15:...	wuqiang@00...	huweiw@00...	2021-05-07 15:...	huweiw@00...	删除	2.00

上述“修改待复核”的客户信息，待复核并提交后，将重新提交至上海清算所，等待清算所工作人员审核。

五、代理客户信息维护-删除

对于申请状态为“新增待复核”、“修改待复核”、“已复核待提交”、“已退回”的代理客户信息，可以做删除操作。

具有“删除客户信息”权限的操作员选中要做删除操作的客户信息，点击“删除”按钮。

序号	客户持有人账号	客户名称	申请状态	交易中心会员	风险敞口限额	保证金充足率(%)	融券方式	创建时间	创建人	复核人	最后修改时间	最后修改人	操作	代理费费率
1	2101051	申港证券锦叶1号	待审核	802012831000	1,022	1,000.20	标准法	2021-05-28 15:...	wuqiang@00...	huweiw@00...	2021-05-28 15:...	huweiw@00...	删除	2.00
2	0001329	国金证券锦叶1号	已删除	801012544030	666	663.00	标准法	2021-05-24 15:...	wuqiang@00...	wuqiang@00...	2021-05-24 15:...	wuqiang@00...	删除	2.00
3	0001001	中信证券广信1号	已生效	801012511000	55	1,000.00	标准法	2021-05-07 15:...	wuqiang@00...	huweiw@00...	2021-05-07 15:...	huweiw@00...	删除	2.00
4	2123001	宏源证券3号	已生效	702109331000	33	1,000.00	标准法	2021-05-07 14:...	wuqiang@00...	huweiw@00...	2021-05-07 15:...	huweiw@00...	删除	2.00
5	0018003	平安汇通中融1号	已复核待提交	821065444030	1	1,000,000.00	标准法	2021-05-07 15:...	wuqiang@00...	huweiw@00...	2021-05-07 15:...	huweiw@00...	删除	2.00
6	0001004	金普106号	已复核待提交	891021844030	454	1,000.00	标准法	2021-05-07 15:...	wuqiang@00...	huweiw@00...	2021-05-07 15:...	huweiw@00...	删除	2.00

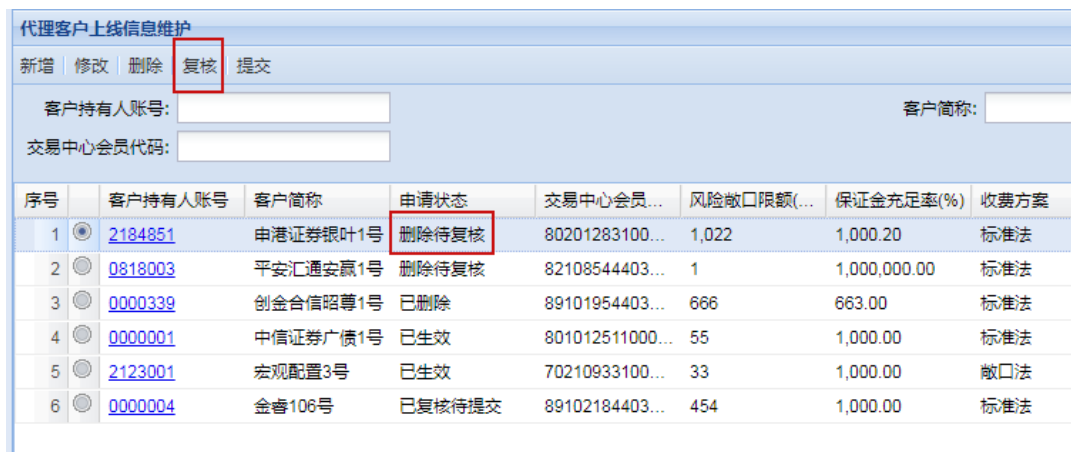
弹出下图窗口，点击“确定”，提示“删除成功”。



此时主界面中新增客户信息状态为“删除待复核”，见下图。



具有“复核客户信息”权限的操作员登录客户端，点击代理机构管理->代理信息维护，选中刚刚要删除的客户信息，点击“复核”。



弹出下图所示弹窗，点击“通过”，提示“复核通过”。



此时该条客户申请信息状态为“已删除”，见下图。



对于申请状态为“草稿”的客户信息可直接删除，无需复核。