

附件

## 人民币外汇交易中央对手清算业务 收费方案

### 一、清算费

清算费 = 基本费 + 清算金额 × 清算费率。不同清算品种的清算金额如下表：

清算品种		清算金额
外汇即期、外汇远期		交易本金金额（人民币）
外汇掉期	近端	近端本金金额（人民币）× 0.5
	远端	远端本金金额（人民币）× 0.5
外汇期权（含组合）		交易本金金额（人民币）

外汇即期交易包括因外汇期权全额行权生成的外汇即期交易。外汇期权组合交易按组合内每笔交易分别计算清算费。不同期限的清算费率如下表：

期限/存续时长	清算费率（单位：百万分之一）
即期	1.2
一周以内（含）	1.2
一周至一个月	3
一个月至三个月	5
三个月至六个月	5
六个月至一年	5
一年至五年	5

外汇掉期交易清算费率由远端交易期限决定。

对于清算退出的交易，按照存续时长适用不同清算费率，其

余交易按照交易期限适用不同清算费率。对于存续期间清算退出的交易收取 100 元/笔基本费（清算退出处理费），其余交易维持原状免收基本费。对于存续期间清算退出的交易于清算退出日计算清算费并计入当期费用，其余交易于清算日计算清算费并计入当期费用。

## 二、非现金担保品管理费

清算参与者非现金担保品管理费的年化费用为担保品有效余额的 0.1%，计价单位为人民币元，逐日计算，按季度征收，公式如下：

每日非现金担保品管理费（折人民币）=当日非现金担保品有效余额（USD）\*当日人民币对美元汇率中间价\*0.1%/365