

附件

跨境外汇交易中央对手清算 业务指南

银行间市场清算所股份有限公司

《跨境外汇交易中央对手清算业务指南》目录

一、	基本概念.....	6
1.1	清算与结算.....	6
1.1.1	清算 (Clearing)	6
1.1.2	结算 (Settlement)	6
1.1.3	中央对手清算 (Central Clearing)	6
1.1.4	中央对手方 (CCP)	7
1.1.5	跨境外汇交易中央对手清算业务	7
1.1.6	合约替代	7
1.1.7	清算会员制度与清算参与者	7
1.1.8	协议与规则	8
1.2	风险管理.....	9
1.2.1	风险管理委员会	9
1.2.2	保证金	9
1.2.3	清算限额	10
1.2.4	清算基金	10
1.2.5	风险准备金	11
1.3	账户管理.....	11
1.3.1	资金结算账户	11
1.3.2	保证金账户	12
1.3.3	清算基金账户	12
二、	清算参与者管理.....	13
2.1	普通清算会员业务参与申请.....	13
2.1.1	首次申请普通清算会员资格和业务资格	13
2.1.2	普通清算会员 (A 类) 申请增加业务资格.....	15
2.1.3	普通清算会员 (B 类和 C 类) 申请增加业务资格.....	16
2.2	综合清算会员业务参与申请.....	16
2.2.1	跨境外汇综合清算会员资格申请及代理业务申请	16
2.2.2	上海清算所综合清算会员资格申请及业务申请	18
2.2.3	综合清算会员申请增加自营业务资格	19
2.3	客户业务参与申请.....	19
2.4	跨境外汇清算业务参与者信息变更.....	20
2.4.1	清算会员信息变更	20
2.4.2	客户信息变更	21
2.5	跨境外汇清算业务参与者资格退出.....	22
2.5.1	清算会员退出跨境外汇清算业务资格和会员资格	22
2.5.2	客户退出跨境外汇清算业务	23

2.6	因违规被上海清算所终止相关资格.....	24
2.7	业务开展准备.....	24
2.7.1	签订清算协议.....	24
2.7.2	指定或开立账户.....	25
2.7.3	申报清算限额.....	25
2.7.4	交纳保证金和清算基金.....	27
2.7.5	业务培训.....	28
三、	跨境外汇交易中央对手清算业务.....	29
3.1	跨境外汇交易中央对手清算业务要素规定.....	29
3.2	日间清算处理.....	29
3.3	日终清算处理.....	31
3.4	结算处理.....	32
3.4.1	保证金结算处理.....	32
3.4.2	资金结算处理.....	33
3.5	清算基金操作.....	37
3.6	违约处置相关规定.....	38
3.6.1	违约判定.....	38
3.6.2	违约处置流程.....	39
3.6.3	运营性违约.....	39
3.6.4	违约中止.....	40
3.6.5	永久性违约.....	40
3.6.6	违约损失的弥补.....	41
3.6.7	风险准备资源使用.....	41
3.6.8	违约处置专家组.....	42
3.6.9	违约处罚.....	43
3.7	业务应急操作.....	43
3.7.1	适用范围.....	44
3.7.2	办理流程.....	44
3.7.3	注意事项.....	45
3.7.4	联系方式.....	45
3.8	节假日处理.....	46
3.9	跨境外汇交易中央对手清算业务相关公式.....	46
3.9.1	最低保证金.....	46
3.9.2	变动保证金.....	47
3.10	收费方案.....	48
四、	跨境外汇清算业务相关账户信息和计息周期规则.....	49
4.1	外汇本金结算账户信息.....	49
4.2	人民币保证金账户信息和缴款路径（大额支付系统）.....	49

4.3 外币保证金账户信息和缴款路径.....	50
4.4 清算基金账户信息和缴款路径.....	51
4.4.1 人民币清算基金账户信息和缴款路径（大额支付系统）	51
4.4.2 美元清算基金账户信息和缴款路径	52
4.5 费用账户信息.....	53
4.5.1 人民币费用收取账户	53
4.5.2 美元费用收取账户	53
附表	
上海清算所普通清算会员资格申请书.....	56
上海清算所清算会员基础信息表.....	57
上海清算所跨境外汇交易中央对手清算业务申请信息表.....	62
上海清算所跨境外汇交易中央对手清算业务印鉴卡.....	65
关于上海清算所跨境外汇交易中央对手清算业务预留印鉴的使用说明.....	66
法人代表委托授权书.....	67
上海清算所综合类清算会员资格申请书.....	68
上海清算所跨境外汇交易中央对手清算代理业务申请信息表.....	69
上海清算所跨境外汇交易中央对手清算代理业务印鉴卡.....	72
关于上海清算所跨境外汇交易中央对手清算代理业务预留印鉴的使用说明...	73
上海清算所跨境外汇交易中央对手清算代理业务客户信息表.....	75
上海清算所跨境外汇交易中央对手清算会员信息变更登记表.....	77
上海清算所跨境外汇交易中央对手清算业务非清算会员信息（变更）登记（报 备）表	79
上海清算所跨境外汇交易中央对手清算业务清算资格退出申请表.....	80
上海清算所跨境外汇交易中央对手清算业务清算会员资格终止申请书.....	81
上海清算所跨境外汇交易中央对手清算业务应急指令书.....	82

前言

为便于市场参与者理解和参与跨境外汇交易中央对手清算业务（以下简称跨境外汇清算业务），进一步明确跨境外汇清算业务操作流程，确保跨境外汇清算业务顺利开展，银行间市场清算所股份有限公司（以下简称上海清算所）制定了《跨境外汇交易中央对手清算业务指南》（以下简称本指南或《业务指南》）。

本指南适用于上海清算所开展的跨境外汇清算业务。

一、基本概念

1.1 清算与结算

清算与结算是金融市场交易后处理的两个主要环节。

1.1.1 清算 (Clearing)

清算的概念有广义和狭义之分。广义的清算，是指交易后处理过程，即交易匹配确认、支付或交割权利义务等的计算、结算指令的发送、债权债务的清讫和到账确认；狭义的清算，仅指对交易双方债权债务计算的处理过程。本指南所指的清算或清算业务是指广义的清算。

1.1.2 结算 (Settlement)

结算是指完成交易双方债权债务的清讫和到账确认的过程。

1.1.3 中央对手清算 (Central Clearing)

中央对手清算是指清算参与者将其达成的交易提交上海清算所，由上海清算所进行交易匹配确认、计算清算参与者债权债务、发送结算指令、清讫债权债务的处理过程。上海清算所建立清算会员制度、保证金制度等风险控制机制，并承担担保履约的责任。

1.1.4 中央对手方（CCP）

中央对手方是指介入一个或多个市场中已成交合约的交易双方之间，成为每个卖方的买方和每个买方的卖方，并据此确保履行所有敞口合约的单位。

1.1.5 跨境外汇交易中央对手清算业务

跨境外汇清算业务为位于中华人民共和国境内的机构（以下简称“境内机构”）与位于中华人民共和国境外及香港、澳门、台湾地区的机构（以下简称“境外机构”）之间进行的外币对即期外汇交易提供中央对手清算服务。

1.1.6 合约替代

合约替代是指通过中央对手方充当买方的卖方、卖方的买方建立两个新合约，据此清偿买卖双方之间的初始债务。

1.1.7 清算会员制度与清算参与者

上海清算所跨境外汇清算业务采用分层清算的方式来实现，即清算会员制度。跨境外汇清算业务的清算参与者分为清算会员和非清算会员（或称客户）。

清算会员分为普通清算会员、综合清算会员、特殊清算会员。普通清算会员仅为其自营业务办理跨境外汇清算业务；综合清算会员既可为自营业务办理跨境外汇清算业务，也可接受客户委托

代理其办理跨境外汇清算业务；特殊清算会员指上海清算所批准参与跨境外汇清算业务的其他清算会员。清算会员需与上海清算所签署《中央对手方清算协议》（以下简称“《清算协议》”）。

非清算会员不具备清算会员资格，需通过综合清算会员间接参与跨境外汇清算业务，与综合清算会员签订《代理非清算会员清算协议》，并向上海清算所登记备案。

1.1.8 协议与规则

《清算协议》是指上海清算所与清算会员签订的、用以明确清算会员资格以及双方在跨境外汇清算业务上权利义务关系的法律文本。市场参与者在申请成为清算会员时应签订《清算协议》。市场参与者在会员更名的情况下，应重新签订《清算协议》或采取上海清算所认可的方式向上海清算所告知更名的事实并继续承担所有已签署协议的权利和义务。

《代理非清算会员清算协议》是综合清算会员与其代理的客户签订的、用以约定综合清算会员代理客户参与跨境外汇清算业务时双方的权利义务关系的法律文本。该协议文本应包含上海清算所拟定的必备条款。客户参与跨境外汇清算业务前，综合清算会员应将与客户签订的《代理非清算会员清算协议》交上海清算所备案。

业务规则是指为规范开展跨境外汇清算业务，防范清算风险，提高清算效率，维护参与主体合法权益，根据国家法律法规和部

门规章制定的，并经主管部门批准的，需跨境外汇清算业务参与各方共同遵守的文件。

1.2 风险管理

上海清算所的风险管理体系包括风险管理委员会、清算会员、保证金、清算基金、逐日盯市、回归测试和压力测试、风险准备金、违约处置等制度，形成有效计量、监测、管理和处置潜在风险的制度保障，确保在市场正常波动与极端情况下，均有足够的风险准备资源覆盖中央对手清算业务的潜在风险，阻断风险的扩散，确保场外金融市场的稳定运行。

1.2.1 风险管理委员会

风险管理委员会由上海清算所内部专家和上海清算所特聘的来自监管机构、学术界和市场机构的风险管理专家组成，负责风险管理各项制度和重要事项审议和审批的议事机构。

1.2.2 保证金

跨境外汇清算业务保证金是清算会员向上海清算所缴纳的现金，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、超限保证金和特殊保证金。

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。

超限保证金：超限保证金是根据实际额度占用情况计算的保

证金，当实际清算净额（单日占用额度总额）超出清算限额时上海清算所有权要求清算会员交纳超限保证金。

特殊保证金：特殊保证金是当发生清算会员盯市亏损过大等特殊情况时，上海清算所向清算会员追加的保证金要求。

保证金要求：保证金要求是清算参与者参与跨境外汇清算业务所需要交纳的保证金资产总额。上海清算所为清算会员计算保证金要求。清算会员应根据上海清算所的规定按时、足额交纳保证金。

1.2.3 清算限额

清算限额是上海清算所以对清算参与者进行风险控制的一项参数，用于计算清算会员的保证金要求或清算基金。清算会员自行测算清算限额，向上海清算所申报或调整，上海清算所给予协助。上海清算所有权根据业务情况调整清算参与者的清算限额。

1.2.4 清算基金

跨境外汇清算业务的清算基金是清算会员参与跨境外汇清算业务时交纳的现金资产，是跨境外汇清算业务风险准备资源的重要组成部分，用以弥补跨境外汇清算业务违约时违约清算会员保证金资产不足而产生的可能的损失。

上海清算所收取的清算基金总额等于压力测试结果。压力测试会计算在不同压力场景下最大的两家清算会员同时违约产生

的额外损失，该额外损失等于两家清算会员在同一压力场景下的损失与两家清算会员保证金金额的差额。压力测试结果等于不同场景下计算结果的最大值。每个清算会员应交纳的清算基金，依据该清算会员日常清算净额或清算限额计算其清算基金总额的分摊比例。

上海清算所向清算会员支付清算基金利息，按季结息。

1.2.5 风险准备金

风险准备金是上海清算所根据主营业务收入的一定比例提取的专项资金，用于弥补清算会员重大违约损失以及与上海清算所金融市场清算业务活动有关的重大风险事故损失。

1.3 账户管理

1.3.1 资金结算账户

指清算会员为参与跨境外汇清算业务而指定或开立的外汇资金结算账户，用于办理跨境外汇清算业务中涉及到的资金结算。清算会员在申请参与跨境外汇清算业务时，可授权外汇结算银行对指定的资金结算账户进行直接借记或贷记处理。

清算会员通过上海清算所指定的外汇结算银行办理外币资金结算。上海清算所和清算会员在外汇结算银行开立外汇资金结算账户，清算会员可选择在外汇结算银行指定的境内分支行或海外分支行开户。

1.3.2 保证金账户

用于管理和核算清算会员缴纳的保证金。上海清算所为每个清算会员开立保证金账户。

1.3.3 清算基金账户

用于管理和核算清算会员缴纳的清算基金。上海清算所为每个清算会员开立清算基金账户。

二、清算参与者管理

上海清算所跨境外汇清算业务实行清算会员制度，跨境外汇清算业务参与者分为普通清算会员、综合清算会员、特殊清算会员和非清算会员（或称客户）。本章主要介绍清算会员申请或变更、参与跨境外汇清算业务申请或变更应办理的业务开展或变更应做的工作。其中，参与跨境外汇清算业务的准备工作包括：申请成为上海清算所清算会员；签订《清算协议》；综合清算会员还需向上海清算所提供全部代理非清算会员清算协议备案；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；缴纳清算会员资格费；业务人员参与培训并获得相应业务资格证书等。

2.1 普通清算会员业务参与申请

2.1.1 首次申请普通清算会员资格和业务资格

非上海清算所清算会员，符合上海清算所规定条件的，可申请成为上海清算所普通清算会员，并申请跨境外汇清算业务资格。申请机构需要符合的基本条件如下：

- （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）达到上海清算所规定的参与跨境外汇清算业务的内部

评级标准；

（4）相关业务管理制度、风险管理制度、技术系统能够支持跨境外汇清算业务（自营清算）的开展；

（5）取得相关业务经营资格；

（6）具有 3 名以上已获得上海清算所培训资格证书的自营清算业务在岗人员；

（7）遵守监管机构的有关规定，在申请普通清算会员资格之前的两年内无重大违法、违规记录，未发生重大风险管理违规违约事件；

（8）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持续经营能力的措施或行政或司法程序。

申请机构需提交的书面材料如下：

- A. 上海清算所普通清算会员资格申请书；
- B. 上海清算所清算会员基础信息表；
- C. 最新经年检的法人营业执照复印件（境内机构适用）；
- D. 组织机构代码证复印件（境内机构适用）；
- E. 机构法人许可证复印件（境内机构适用）；
- F. 机构法人资格证明材料（境外机构适用）；
- G. 相关业务资格批复文件复印件；
- H. 最近两个会计年度经审计的财务报告；
- I. 上海清算所跨境外汇交易中央对手清算业务申请信息

表；

- J. 上海清算所跨境外汇交易中央对手清算业务印鉴卡；
- K. 申请机构已单方完成签署的《清算协议》（一式四份）；
- L. 法人代表委托授权书及身份证明材料；
- M. 上海清算所要求补充提供的其他材料。

上述材料均需加盖公章或附有权签字人签字，同时协议需附有法人签章。上海清算所根据申请机构的情况，可能要求补充提供相关证明材料。上海清算所将在收到完整申请资料后，及时审核并反馈结果。

2.1.2 普通清算会员（A类）申请增加业务资格

上海清算所A类普通清算会员，可以向上海清算所直接申请参与跨境外汇清算业务。需提交的书面材料包括：

- A. 上海清算所跨境外汇交易中央对手清算业务申请信息表；
- B. 上海清算所跨境外汇交易中央对手清算业务印鉴卡；
- C. 法人代表委托授权书及身份证明材料；
- D. 上海清算所要求补充提供的其他材料。

上述材料均需加盖公章或附有权签字人签字。上海清算所在收到完整申请资料后，于30个工作日内完成审核并反馈结果。

2.1.3 普通清算会员（B类和C类）申请增加业务资格

上海清算所B类和C类普通清算会员，可以向上海清算所申请变更会员资格并参与跨境外汇清算业务。需提交的书面材料包括：

A. 上海清算所普通清算会员资格申请书；
B. 上海清算所跨境外汇交易中央对手清算业务申请信息表；

C. 上海清算所跨境外汇交易中央对手清算业务印鉴卡；

D. 法人代表委托授权书及身份证明材料；

E. 上海清算所要求补充提供的其他材料。

上述材料均需加盖公章或附有权签字人签字。上海清算所在收到完整申请资料后，于30个工作日内完成审核并反馈结果。

普通清算会员申请新增清算业务涉及清算会员资格调整的，上海清算所将在反馈结果中明确清算会员资格变化及清算会员资格费调整情况。

2.2 综合清算会员业务参与申请

2.2.1 跨境外汇综合清算会员资格申请及代理业务申请

符合上海清算所规定的清算会员，可申请成为跨境外汇综合清算会员。成为跨境外汇综合清算会员的基本条件包括：

（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，未达到上海清算所规定的要求，但出具了符合条件的担保，视同符合相应的净资产（证券公司为净资本）要求（或有）；

(3) 跨境外汇清算业务规模排名靠前；

(4) 达到上海清算所跨境外汇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) 取得相关业务经营资格；

(7) 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。

申请跨境外汇综合清算会员需提交的书面材料包括：

A. 上海清算所综合类综合清算会员资格申请书；

B. 相关业务资格批复文件复印件，并加盖公章或附有权签字人签字；

C. 上海清算所跨境外汇交易中央对手清算代理业务申请信息表；

D. 上海清算所跨境外汇交易中央对手清算代理业务印鉴卡；

E. 申请机构已单方完成签署的《清算协议》（一式四份）

F. 法人代表委托授权书及身份证明材料；

G. 上海清算所要求补充提供的其他材料。

上海清算所根据申请机构的情况，可能要求补充提供相关证明材料。产品类综合清算会员申请新的代理业务资格，无需提交《清算协议》，其他与申请跨境外汇综合清算会员所需提交材料相同。

2.2.2 上海清算所综合清算会员资格申请及业务申请

符合上海清算所规定的清算会员，可申请成为上海清算所综合清算会员。成为上海清算所综合清算会员的基本条件包括：

- （1）已成为产品类综合清算会员；
- （2）银行类金融机构最近两个会计年度期末净资产均不低于 200 亿元人民币；非银行类金融机构最近两个会计年度期末净资产均不低于 100 亿元人民币；
- （3）达到上海清算所制定的上海清算所综合清算会员内部评级标准；
- （4）上海清算所要求的其他条件。

申请成为上海清算所综合清算会员所需提交的材料，请直接联系上海清算所会员服务部 member@shclearing.com。

上海清算所综合清算会员申请新的代理业务资格，无需提交上海清算所综合类清算会员申请书和《清算协议》，其他与首次申请产品类综合清算会员所需提交材料相同。

2.2.3 综合清算会员申请增加自营业务资格

上海清算所综合清算会员及产品类综合清算会员，可以向上海清算所申请参与跨境外汇清算业务（自营）。需提交的书面材料包括：

- A. 上海清算所跨境外汇交易中央对手清算业务申请信息表；
- B. 上海清算所跨境外汇交易中央对手清算业务印鉴卡；
- C. 法人代表委托授权书及身份证明材料；
- D. 上海清算所要求补充提供的其他材料。

上述材料均需加盖公章或附有权签字人签字。上海清算所在收到完整申请资料后，于 30 个工作日内完成审核并反馈结果。

2.3 客户业务参与申请

客户可以通过综合清算会员代理参与跨境外汇清算业务。综合清算会员需在客户开展业务前将与客户完成签署的《代理非清算会员清算协议》和《上海清算所跨境外汇交易中央对手清算代理业务客户信息表》提交上海清算所备案。

有资格开展跨境外汇交易中央对手清算业务代理清算的综合清算会员名单可通过登录上海清算所官方网站查询，路径为：首页》会员服务》清算会员》清算会员名单。

2.4 跨境外汇清算业务参与者信息变更

2.4.1 清算会员信息变更

清算会员（包括普通清算会员和综合类清算会员）发生机构改制、重组、分立、合并等重大资质变更，发生机构名字、法人代表、股东、注册资金、业务人员等基本信息变更的，以及发生与所参与中央对手清算业务相关的事件，如法律纠纷、商业案件、行政处罚等，需在相关事项发生后5个工作日内填写《上海清算所跨境外汇交易中央对手清算会员信息变更登记表》，加盖有效印鉴¹，将扫描件提交上海清算所会员服务部，完成相应信息变更。

清算业务参与基本信息变更的，清算会员应在变更前填写《上海清算所跨境外汇交易中央对手清算会员信息变更登记表》并注明变更生效时间。清算会员新增跨境外汇清算业务项下的清算产品，上海清算所将于20个工作日内完成审核，并发文通知会员。

客户端管理员信息发生变更，清算会员应在变更前填写《上海清算所跨境外汇交易中央对手清算会员信息变更登记表》，加盖有效印鉴，将扫描件提交上海清算所会员服务部。

跨境外汇清算业务清算限额发生变更，清算会员应在变更前填写《上海清算所跨境外汇交易中央对手清算会员信息变更登记表》，加盖有效印鉴，将扫描件提交上海清算所会员服务部。

¹ 有效印鉴是指清算参与者在上海清算所的预留印鉴或单位法人公章。

跨境外汇清算业务印鉴发生变更，清算会员应在变更前填写《上海清算所跨境外汇交易中央对手清算业务印鉴卡》（普通清算会员适用）或《上海清算所跨境外汇交易中央对手清算代理业务印鉴卡》（综合类清算会员适用），加盖有效印鉴，将扫描件提交上海清算所会员服务部。

清算会员相关信息变更的表单，可通过登录上海清算所官方网站下载，路径为：首页》会员服务》清算会员》清算会员申请指南》相关表单；也可以致函上海清算所会员服务部索取，电子邮箱：member@shclearing.com。

2.4.2 客户信息变更

客户发生机构改制、重组、分立、合并等重大资质变更，发生机构名字、法人代表、股东、注册资金、业务人员等基本信息变更的，以及参与跨境外汇清算业务相关信息变更的，需向代理其清算的综合清算会员申请变更相关信息。综合清算会员同意该非清算会员相关申请，则由综合清算会员填写《上海清算所跨境外汇交易中央对手清算业务非清算会员信息(变更)登记(报备)表》，并提交上海清算所会员服务部，完成相应信息变更。

非清算会员可以自主更换综合清算会员，变更代理清算关系。非清算会员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个工作日内，向上海清算所报送《上海清算所跨境外汇交易中央

对手清算业务非清算会员信息（变更）登记（报备）表》备案。新选择的综合清算会员应在新代理客户生效日期前，将与客户签署的《代理非清算会员清算协议》、《上海清算所跨境外汇交易中央对手清算业务非清算会员信息（变更）登记（报备）表》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，完成非清算会员的代理清算关系变更。

2.5 跨境外汇清算业务参与者资格退出

2.5.1 清算会员退出跨境外汇清算业务资格和会员资格

2.5.1.1 清算会员退出跨境外汇清算业务资格

清算会员可自愿申请退出跨境外汇清算业务资格。申请退出清算业务资格的，需向上海清算所提交《上海清算所跨境外汇交易中央对手清算业务清算资格退出申请表》，并确保退出时与上海清算所之间已无与跨境外汇清算业务相关的债权债务关系。上海清算所在收到退出申请，确认与该会员结清与跨境外汇清算业务相关的债权债务后，在一个月内批准该清算会员退出清算业务资格且办理注销手续。清算会员未能结清其债务的，上海清算所有权依据双方签署的相关协议条款，依法依约追偿。

清算会员申请终止清算业务资格的，清算会员在跨境外汇清算业务中的清算基金应缴总额（包括其应缴纳的清算基金份额以及其应缴纳的补充清算基金份额，补充清算基金份额不大于其应缴纳的清算基金份额），自上海清算所收到清算会员书面申请的

第十个工作日起至会员资格终止日保持不变。

清算会员的清算业务资格，自注销之日起失效。清算会员可按照《保证金管理办法》和《清算基金与风险准备金管理办法》的相关规定向上海清算所申请退还保证金余额、剩余清算基金（包括应计利息）。

清算会员终止跨境外汇清算业务资格后，不影响其继续保留其他的业务资格，上海清算所将根据《清算会员管理办法》的规定，调整清算会员资格类型。

2.5.1.2 清算会员退出跨境外汇清算业务会员资格

清算会员申请退出跨境外汇清算业务资格后，应申请终止跨境外汇清算业务清算会员资格。清算会员申请终止跨境外汇清算业务清算会员资格，需提交《上海清算所跨境外汇交易中央对手清算业务清算会员资格终止申请书》，加盖法人公章或有权签字人签字，提交上海清算所。上海清算所根据《清算会员管理办法》的相关程序，办理清算会员资格终止手续后，向市场公告。

清算会员资格自注销之日起失效。

2.5.2 客户退出跨境外汇清算业务

客户有权向代理其清算的综合清算会员申请退出跨境外汇清算业务。综合清算会员同意该客户申请，并确认该客户与并上海清算所结清跨境外汇清算业务下产生的所有债务后，向上海清算所提交《上海清算所跨境外汇交易中央对手清算业务非清算

会员信息（变更）登记（报备）表》进行报备。

综合清算会员有权直接终止其代理的非清算会员业务资格，并向上海清算所进行登记报备。

2.6 因违规被上海清算所终止相关资格

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《清算会员管理办法》和相关规则（包括但不限于业务规则、业务指南、操作规程、办法、通知、公告以及指引等），上海清算所有权限制、暂停或取消清算会员参与跨境外汇交易中央对手清算业务的资格。情节严重的，有权直接取消其清算会员资格。上海清算所决定终止清算会员资格的，由上海清算所办理注销，并就双方未了结的债权债务、未支付的清算业务相关费用等进行追索。

清算会员资格自注销之日起失效。

2.7 业务开展准备

2.7.1 签订清算协议

市场参与者类型	普通清算会员	综合清算会员	客户
协议名称	《清算协议》	《清算协议》	与综合清算会员签订《代理非清算会员清算协议》，并由综合清算会员报备上海清算所

2.7.2 指定或开立账户

2.7.2.1 资金结算账户

业务开展前，清算会员应在跨境外汇清算业务外汇结算银行开立外币资金结算账户，进行跨境外汇清算业务的资金结算。清算会员可选择在外汇结算银行指定的境内分支行或海外分支行开户。

上海清算所向各清算会员告知上海清算所开立在结算银行的资金结算账户信息。

2.7.2.2 保证金账户

保证金账户用于管理和核算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。

2.7.2.3 清算基金账户

清算基金账户用于管理和核算清算会员交纳的清算基金。账户开立后的次一工作日，上海清算所向清算会员发送清算基金账户开户通知书。

2.7.3 申报清算限额

2.7.3.1 清算会员限额申报与调整

清算会员跨境外汇清算业务的清算限额由清算会员自行测算，并向上海清算所进行申报。清算会员申报清算限额时，应向上海清算所提交《上海清算所跨境外汇交易中央对手清算业务申

请信息表》，就限额申报进行相关说明。说明应包括但不限于以下内容：清算会员相关业务开展基本情况，限额申报依据等。

上海清算所在收到清算会员的清算限额申报申请后，结合清算会员业务规模、财务及资信状况等因素审核确定，并及时反馈审核结果。审核通过的清算限额于次一工作日生效。

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书面申请，对调整进行相关说明。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业务实际情况，定期或不定期调整清算会员的清算限额。上海清算所主动调整清算会员清算限额的，应提前五个工作日向清算会员发送通知。

2.7.3.2 客户限额申报与调整

综合清算会员应向上海清算所提交《上海清算所跨境外汇交易中央对手清算代理业务客户信息表》，报备客户的清算限额。客户参与业务申请材料齐备，并完成相关业务开展准备工作的，登记备案有效。登记备案有效的清算限额生效日为登记备案完成次一工作日与机构报备的生效日中较晚的日期。

客户清算限额发生调整的，综合清算会员应向上海清算所提交《上海清算所跨境外汇交易中央对手清算业务非清算会员信息（变更）登记（报备）表》进行限额调整的报备。表格要素齐备，

报备限额符合风控要求的，登记备案有效。登记备案有效的清算限额生效日为登记备案完成次一工作日与机构报备的生效日中较晚的日期。

上海清算所有权根据业务实际情况，定期或不定期调整客户的清算限额。上海清算所主动调整客户清算限额的，应向其综合清算会员发送通知。

2.7.4 交纳保证金和清算基金

清算会员在参与跨境外汇清算业务前，应根据上海清算所规定，按时、足额交纳保证金和清算基金。综合清算会员应要求其代理的客户按时、足额向其交纳保证金。客户向综合清算会员交纳的保证金，属于客户所有，应仅用于履行跨境外汇清算业务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。

清算会员应在收到清算基金交纳或调整通知后的 10 个工作日内，将足额清算基金直接汇入上海清算所指定的清算基金账户。

上海清算所在处理清算会员违约处理期间，将不对非违约清算会员的清算基金应缴总额（包括其应交纳的清算基金份额以及其应交纳的补充清算基金份额）以及清算基金交纳比例进行调整。非违约清算会员的清算基金应缴总额以及应支付的清算基金交纳比例依照首个违约会员发生违约时的前一个工作日的标准确定。在任意 90 个自然日内（含），跨境外汇清算业务补充清算

基金份额的补充上限为清算会员依据上述标准确定的应交纳的清算基金份额。

2.7.5 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业务培训。通过业务培训并获得上海清算所颁发的业务资格证书的清算员及相关业务人员，方可开展相关的业务工作。

三、跨境外汇交易中央对手清算业务

3.1 跨境外汇交易中央对手清算业务要素规定

目前，上海清算所接受的跨境外汇清算业务产品如下表所示（其中，T 日表示交易日，下同）。未来根据业务发展需要增加产品种类、货币对，并另行公布。

表一：清算产品表

交易品种	货币对	结算日
外币对即期	EUR/USD、GBP/USD、USD/HKD	T+2

表二：清算产品要素表

基本要素			
对手方	清算参与者	成交类型	即期
成交时间	不限	成交日期	不限
交易货币对	EUR/USD、GBP/USD、USD/HKD	成交价格	汇率数值精确到小数点后 4 位
货币买入量	不限	货币卖出量	不限

3.2 日间清算处理

表三：跨境外汇清算业务运营时间表

日期	时间	事项
T 日	6:00	开市
	2:00 (+1)	闭市
T 日至 S-1 日 (出单日)	日间	生成日间保证金清单
	30 分钟后或上海清算所通知规定时间	日间保证金支付截止
	16:00	保证金追加截止 保证金违约判定
	22:00	生成日终保证金清单

S-1 日	11:30	生成结算清单
	12:00 前	上海清算所将 S 日所有外币资金结算明细表通知外汇结算银行
	16:00 前	美元、欧元、英镑、港币： 清算会员向外汇结算银行发出预到账通知（MT210） 注：于 S-1 日划入外汇资金的清算会员
S 日	12:00 前	美元、欧元、英镑、港币： 清算会员向外汇结算银行发出预到账通知（MT210） 注：于 S 日划入外汇资金的清算会员
	15:00 前	港币： 资金汇出指令（MT202）截止
	9:00-16:30	美元、欧元、英镑、港币： 外汇结算银行主动扣收应付资金会员账户 注：会员选择不主动向外汇结算银行发送 MT202 报文
	16:30 前	清算会员向外汇结算银行发出支付指令（MT202） 注：会员选择主动向外汇结算银行发送 MT202 报文
	16:30	美元、欧元、英镑： 资金汇出指令（MT202）截止
	16:45	美元、欧元、英镑、港币： 上海清算所只有在收到单个清算会员应划入的全部币种资金后，于 S 日 16:45 前通过 MT202 支付指令通知外汇结算银行
S+1 日	10:00	外汇结算银行发送对账单（MT950）截止时点

注：上述时间均为北京时间。

交易数据接收：清算会员于清算限额内在电子平台达成交易后，上海清算所在成交数据接收时段内（北京时间 T 日 6:00 至次日 2:00）实时逐笔接收成交数据，并实时进行合约替代。

合规性检查：上海清算所业务系统接收成交数据后，对成交数据进行要素合规性检查：一是交易双方是否均具有清算会员资质；二是成交数据是否符合跨境外汇清算业务产品要素规定。检查通过后，成交数据进入后续处理。对于未通过要素合规检查的成交数据，通过上海清算所客户端的成交数据备注栏显示其原因，供清算会员查询。

清算确认：如对交易要素持有异议，可致电清算机构进行核对查询。在清算轧差前未提出异议的，视为无异议，并清算默认

确认。

清算数据查询：清算会员实时通过客户端查询清算数据，支持以 Excel 格式导出。

3.3 日终清算处理

日终清算处理包括的环节有：净额轧差、生成保证金清单和结算清单等清算单据。

保证金清单：保证金清单包括日终保证金清单和日间保证金清单，是上海清算所和清算会员办理保证金交纳和提取的有效凭证，日终保证金清单支持以 PDF、EXCEL 格式下载或通过 SWIFT 发送，日间保证金清单支持以 PDF 格式下载。日终保证金清单每个工作日生成一次，清算会员于规定时间内完成保证金交纳和提取。日间，出现市场价格异常波动或连续节假日等特殊情况下，上海清算所有权实时重新计算特殊保证金，并向清算会员发出日间保证金清单。日间保证金清单可一日生成多次，清算会员须于规定时间内交纳。

结算清单：上海清算所日终计算各清算会员的应收付资金，依据清算轧差结果生成结算清单。结算清单是上海清算所和清算会员办理本金结算的有效凭证。清算会员可于 S-1 日 11:30 之后通过客户端查询、下载结算清单，支持 PDF、Excel、XML 格式，以及通过 SWIFT 发送。结算清单提供中文和英文两个版本，以中文表述为准。清算会员轧差结果进行核对，如数据核对无误，清

算会员即可根据结算清单准备结算资金；如数据核对不一致，清算会员应于当日通过电话等方式通知上海清算所，双方检查差异原因并根据成交记录及时进行修改，逾时上海清算所将视清算会员已核对无误。

3.4 结算处理

3.4.1 保证金结算处理

1. 日终变动保证金缴纳

上海清算所每日对清算会员进行日终变动保证金计算，清算会员可在北京时间 22:00 之后通过客户端下载保证金清单，清算会员根据收到的日终保证金清单确定每一种类的保证金追加和释放冻结金额。

保证金支付截止时点为次日 16:00。未能在规定时间内成功交纳保证金的清算参与者，构成保证金违约，按保证金违约程序处理。

2. 日间变动保证金缴纳

上海清算所触发日间保证金追缴通知后，系统自动通过上海清算所客户端向清算会员发出日间保证金实时追加提醒，并发布日间保证金清单。清算会员应根据日间保证金清单上的追加金额和保证金账户可用余额，在保证金追加截止时点前（一般为日间保证金清单发出后的 30 分钟内）将所需交纳的资金划入上海清算所相应保证金账户。未能在规定时间内成功交纳保证金的清算

会员，构成保证金违约。

3. 最低保证金调整

根据清算限额等变化，清算会员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，相应增加清算会员保证金账户可用余额。最低保证金要求调高、且清算会员保证金账户可用余额不足的，清算会员应于生效日前一个工作日北京时间 16:00 前补足保证金。

4. 保证金提取

清算会员通过客户端提交保证金账户可用余额提取申请，上海清算所于当日将可提取资金划入清算参与者指定账户。

5. 现金抵押品

保证金以美元计价，支持以人民币、美元、欧元及英镑支付，每个保证金账户（最低保证金账户和变动保证金账户）可分别支持实际生效保证金资产不超过两种货币资产，但最低保证金和变动保证金缴纳每次仅接受一个币种。各币种保证金资产折美元汇率及折扣率由上海清算所定期发布。

3.4.2 资金结算处理

上海清算所根据生成的结算清单与清算会员完成各币种的本金结算。

1. 美元、欧元、英镑清算流程

（1）S-1 日 12:00 前，上海清算所将 S 日资金结算明细表

通知外汇结算银行，外汇结算银行根据资金结算明细表得知第二天上海清算所账户应收和应付资金金额。

(2) 于 S-1 日通过 MT202 划入资金的清算会员，须于 S-1 日 16:00 之前向外汇结算银行发出预到账通知 (MT210)。

(3) 于 S 日通过 MT202 划入资金的清算会员，须于 S 日 12:00 之前向外汇结算银行发出预到账通知 (MT210)，外汇结算银行需监测当日划入的外汇资金以确保 S 日入账。

(4) 清算会员通过外汇结算银行向上海清算所支付美元、欧元、英镑资金，有以下两种方式可以自主选择：

1) 清算会员主动向外汇结算银行发送 MT202 报文。

清算会员须在 S 日 16:30 之前向外汇结算银行发出支付指令 (MT202)。外汇结算银行收到支付指令后需检查清算会员账户余额 (授信与实际头寸之和，下同)：如账户余额足够，则将清算会员的外汇资金划入上海清算所在外汇结算银行开立的外汇结算账户并实时发送 MT910 通知上海清算所；如账户余额不足，则予以拒绝，并实时用邮件和电话的方式通知上海清算所和清算会员。

2) 清算会员选择不主动发送付款报文 MT202，而授权外汇结算银行通过明细清单对清算会员账户进行主动扣收。

S 日 9:00 至 16:30，外汇结算银行检查清算会员账户余额 (实际头寸与授信之和，下同)，若账户余额足够，外汇结算银行根据上海清算所发送的明细清单主动扣收应付资金会员账户，

将外汇资金划入上海清算所开立在外汇结算银行的账户，并将清算会员的到账信息（MT910）实时通知上海清算所；若直至 16:30 账户余额依旧不足，则实时通过邮件和电话方式通知上海清算所与清算会员的交易无法完成。

（5）上海清算所只有在收到单个清算会员应划入的全部币种资金后，于 S 日 16:45 前通知外汇结算银行，将相应资金全部划入该清算会员的各币种账户。

（6）清算会员拟提取资金时，应根据外汇结算银行头寸预报金额和时点的要求于 S 日 16:00 之前向外汇结算银行发出支付指令（MT202）。

（7）S+1 日 10:00 前，外汇结算银行向上海清算所和清算会员发送对账单（MT950）。

2. 港币清算流程

（1）S-1 日 12:00 前，上海清算所将 S 日资金结算明细表通知外汇结算银行，外汇结算银行根据资金结算明细表得知第二天上海清算所账户应收和应付资金金额。

（2）于 S-1 日通过 MT202 划入资金的清算会员，须于 S-1 日 16:00 之前向外汇结算银行发出预到账通知（MT210）。

（3）于 S 日通过 MT202 划入资金的清算会员，须于 S 日 12:00 之前向外汇结算银行发出预到账通知（MT210），外汇结算银行需监测当日划入的外汇资金以确保 S 日入账。

（4）清算会员通过外汇结算银行向上海清算所支付港币资

金，有以下两种方式可以自主选择：

1) 清算会员主动向外汇结算银行发送 MT202 报文。

清算会员须在 S 日 16:30 之前向外汇结算银行发出支付指令 (MT202)。外汇结算银行收到支付指令后需检查清算会员账户余额 (授信与实际头寸之和，下同)：如账户余额足够，则将清算会员的外汇资金划入上海清算所在外汇结算银行开立的外汇结算账户并实时发送 MT910 通知上海清算所；如账户余额不足，则予以拒绝，并实时用邮件和电话的方式通知上海清算所和清算会员。

2) 清算会员选择不主动发送付款报文 MT202，而授权外汇结算银行通过明细清单对清算会员账户进行主动扣收。

S 日 9:00 至 16:30，外汇结算银行检查清算会员账户余额 (实际头寸与授信之和，下同)，若账户余额足够，外汇结算银行根据上海清算所发送的明细清单主动扣收应付资金会员账户，将外汇资金划入上海清算所开立在外汇结算银行的账户，并将清算会员的到账信息 (MT910) 实时通知上海清算所；若直至 16:30 账户余额依旧不足，则实时通过邮件和电话方式通知上海清算所与清算会员的交易无法完成。

(5) 上海清算所只有在收到单个清算会员应划入的全部币种资金后，于 S 日 16:45 前通知外汇结算银行，将相应资金全部划入该清算会员的各币种账户。

(6) 清算会员拟提取资金时，应根据外汇结算银行头寸预

报金额和时点的要求于 S 日 15:00 之前向外汇结算银行发出支付指令 (MT202)。

(7) S+1 日 10:00 前, 外汇结算银行向上海清算所和清算会员发送对账单 (MT950)。

3.5 清算基金操作

清算基金=会员清算净额日均值×清算基金比例。

清算基金比例=压力测试结果÷所有会员清算净额日均值之和。

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。

会员清算净额日均值等于前三个月每日日终会员清算净额的算术平均数。

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。

清算基金以美元计价, 支持以人民币和美元支付, 但清算基金缴纳每次仅接受一个币种。清算基金资产折美元汇率及折扣率与保证金资产保持一致。

上海清算所负责清算基金的日常管理, 对清算会员的清算基

金实行独立核算。上海清算所根据《银行间市场清算所股份有限公司清算基金与风险准备金管理办法》管理清算基金。

3.6 违约处置相关规定

3.6.1 违约判定

清算会员出现下列一项或多项事件的，构成跨境外汇清算业务违约：

资金结算违约：起息日当日规定时间前清算会员无法完成当天支付结算义务的，构成资金结算违约。

保证金结算违约：上海清算所发出日终保证金追加通知后规定截止时点前或发出日间保证金追加通知后规定时间内，清算会员未能完成保证金结算的，构成保证金结算违约。

清算基金或费用违约：清算会员无法在规定时间内支付清算基金或费用的，将记为清算基金或费用违约。

上海清算所认定的其他违约情形：当清算会员发生（1）解散（出于联合、合并或重组目的而发生的解散除外）；（2）监管部门启动停业整顿、托管、接管、机构重组、行政重组、撤销等风险处置措施；（3）自身或其债权人向人民法院提出重整、和解或破产清算申请；（4）通过停业、清算或申请破产的决议；（5）在其他交易、清算、结算机构发生违约事件等情形时，上海清算所有权认定为违约，将记为上海清算所认定的其他违约情形。

3.6.2 违约处置流程

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，冻结该清算会员与跨境外汇清算业务相关的所有应收资金或资产，并计收违约金，通过银行授信完成资金结算。其中，逾期方按照逾期金额和外汇结算银行公布的透支利率+3%（年化利率）计算并支付本金违约金。

3.6.3 运营性违约

若清算会员因操作失误、系统故障、短期流动性不足等而导致暂时无法履约，自清算会员被判定违约至跨境外汇清算业务规定的违约处置关键时点之前，为运营性违约阶段。

当清算会员被认定为运营性违约时，上海清算所有权采取以下措施：

1. 降低违约清算会员的清算限额或取消其交易权限并调整清算限额至 0，同时撤销其所有未成交的挂单；
2. 冻结违约清算会员保证金账户和清算基金账户；
3. 冻结违约清算会员在违约处置期²内跨境外汇清算业务的所有应收资产；
4. 根据实际违约情况，启动流动性支持机制，融入资金以完成违约处置期内应付结算义务；

²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。

5. 上海清算所将发送违约通知单（含违约金额信息）至客户端或者发送违约通知单扫描件，违约清算会员应于规定时点前，足额将违约资金、保证金划付至上海清算所；

3.6.4 违约中止

若违约清算会员于关键时点前，补足违约资金、保证金及违约金，上海清算所有权采取以下措施：

1. 恢复接受该会员的跨境外汇清算业务，调整该会员清算限额，解冻其保证金和清算基金，记录运营性违约一次；

2. 将该违约清算会员冻结的应收资产（如有）划付至违约清算会员相应账户，并偿还流动性支持机构。

3.6.5 永久性违约

违约清算会员应及时补足违约资金，未按时补足结算资金、违约保证金、违约金、清算基金、费用的，或发生上海清算所认定的其他违约情形的，上海清算所有权根据其风险管理委员会判断结果认定该会员永久性违约。

当清算会员被认定为永久性违约时，上海清算所有权采取以下措施：

1. 降低违约清算会员的清算限额或取消其交易权限并调整清算限额至 0，同时撤销其所有未成交的挂单；

2. 冻结违约清算会员开立在上海清算所的跨境外汇清算业务保证金和清算基金；

3. 通过平仓交易或出售该会员应收资产进行强制平仓；

4. 违约处置结算完成后，如所冻结的违约清算会员资产能够覆盖平仓损失、平仓相关费用以及违约金，上海清算所将剩余部分退还违约清算会员；如所冻结的违约清算会员资产不能覆盖平仓损失以及平仓相关费用的，上海清算所依照《银行间市场清算所股份有限公司清算基金与风险准备金管理办法》中规定的顺序，使用风险准备资源来弥补强行平仓后违约清算会员资产不能覆盖部分的损失；

5. 取消违约清算会员跨境外汇清算业务资格；

6. 违约处置结束后，上海清算所应向违约清算会员追偿或/和索赔。

3.6.6 违约损失的弥补

1. 融入资金的费用以及由于违约处置产生的损失等各项费用与成本，加总为违约损失。

2. 上海清算所根据《银行间市场清算所股份有限公司保证金管理办法》和《银行间市场清算所股份有限公司清算基金与风险准备金管理办法》等相关规定，使用相关风险准备资源弥补违约损失。

3.6.7 风险准备资源使用

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. 违约清算会员在涉及违约的中央对手清算业务中缴纳的保证金；

2. 违约清算会员在涉及违约的中央对手清算业务中缴纳的清算基金；

3. 不超过该违约发生前上一会计年度末上海清算所向相关清算会员公布的风险准备金总额的 10%；

4. 未发生违约的清算会员在涉及违约的中央对手清算业务中缴纳的清算基金；

5. 未违约的清算会员根据上海清算所规定补充交纳的相关中央对手清算业务清算基金；

6. 上海清算所剩余的风险准备金。

7. 其他上海清算所指定的风险准备资源。

3.6.8 违约处置专家组

1. 违约处置专家组是风险管理委员会的顾问咨询小组，上海清算所可根据实际需要或按中央对手清算业务成立 1 个或多个违约处置专家组。

2. 违约处置专家组的主要职能是提供违约处置意见并协助上海清算所进行违约处置。是否采纳上述违约处置意见，由风险管理委员会决定。

3. 违约处置专家组的成员包括：

（1）上海清算所风险管理委员会主席或其授权人担任违约处置专家组组长；

(2) 在跨境外汇清算业务的市场中具有代表性的清算会员代表；

(3) 上海清算所风险管理委员会委员；

(4) 风险管理委员会认为适合的人员。

4. 风险管理委员会按照跨境外汇清算业务规则组织和管理参与违约处置专家组的清算会员，并定期根据实际情况进行成员调整。

3.6.9 违约处罚

1. 对于运营性违约，上海清算所可依据具体情况对违约清算会员采取口头警告、书面警示、谈话提醒、限期说明情况、责令整改、要求参加培训（或考试）或更换有关人选、通报批评、公开谴责、收取违约金、上调资信因子等处罚措施。

2. 对于永久性违约，除以上所列处罚措施外上海清算所还可重新评定违约清算会员资格，根据评定结果对违约清算会员采取限制、暂停或取消参与跨境外汇清算业务资格等处罚措施。

3. 上海清算所将在违约处置过程中及违约处置完成后对违约事件开展全面调查，并向监管机构上报违约处置结果和调查结论。

3.7 业务应急操作

应急操作，是指跨境外汇清算业务清算会员因网络、系统或其他原因，无法及时通过上海清算所客户端系统提交相关操作指

令而采取的，以传真方式向上海清算所发送、要求上海清算所办理相关业务的行為。

3.7.1 适用范围

1. 无法进行保证金提款操作；2. 无法进行单据下载；3. 无法进行查询操作；4. 其他无法在营业日终止或截止时间前完成的情形。

3.7.2 办理流程

为保证跨境外汇清算业务的正常进行，清算会员客户端出现异常无法正常进行跨境外汇清算业务时，在电话通知上海清算所后，按流程启动应急操作。

1. 发送应急指令书

清算会员应及时填制应急指令书，并加盖有效印鉴，以传真方式发送至上海清算所，并与上海清算所工作人员电话沟通。

印鉴要求：应急指令书均需加盖有效印鉴（公章或预留印鉴）方可生效，指令书多过一页的需加盖骑缝章或逐页签章。

截止时间要求：为保证应急业务顺利进行，应急指令书应在跨境外汇清算业务相应操作所规定的截止时间前 30 分钟提交。

2. 电话确认指令信息

接收应急指令书后，上海清算所将核对印鉴，并致电发送指令方进行指令书信息确认。确认信息包括但不限于：应急操作要

素信息、验印中出现的异常情况。为保证信息安全、准确，上海清算所将对电话确认内容进行录音。

若在发送应急指令书 20 分钟后仍未收到上海清算所确认电话，清算会员可主动与上海清算所联系、查询。

3. 电话告知处理结果

应急业务完成后，上海清算所将操作成功或失败的结果以电话的方式告知清算会员。清算会员也可向上海清算所查询处理情况，或在客户端恢复正常后查询。

3.7.3 注意事项

1. 应急情况下，如发生由于系统故障导致无法确认应急业务内容时，可先填制应急指令书的信息查询项，于跨境外汇清算业务的截止时间前 0.5-1 小时以传真方式发送至上海清算所并电话通知。上海清算所验印无误后提供相关信息，清算会员确认应急内容后再填制应急指令书，以传真方式发送至上海清算所并电话通知。

2. 对于其他无法在营业日终止或截止时间前完成的情形，清算会员应在营业日及时致电上海清算所反映相关异常情况，上海清算所视情况进行相应处理。

3.7.4 联系方式

接收传真电话：021-63326661

应急操作电话：021-23198787

3.8 节假日处理

上海清算所完成节假日、结算日等信息确认后，于每年底通过上海清算所官网公布下一年度各货币的节假日信息。

任何货币对，若 T+1 日为美元假日，该货币对即期起息日不受影响；若 T+1 日为货币对中非美元货币的假日，该货币对即期起息日按“下一营业日”准则进行调整；若 T+1 日既为美元假日又为货币对中非美元货币的假日，该货币对即期起息日按“下一营业日”准则进行调整。

任何货币对，如果 T+2 日为美元假日或是货币对中任何一种货币的假日，即期起息日按照“下一营业日”准则进行调整。

目前，上海清算所对于涉及人民币节假日的跨境外汇交易，目前暂不处理，由国家规定调整为工作日的星期六和星期天，仍作人民币节假日处理。

3.9 跨境外汇交易中央对手清算业务相关公式

3.9.1 最低保证金

最低保证金用于弥补清算会员违规违约情况下上海清算所对其清算限额范围内头寸平仓可能产生的预计损失。最低保证金的计算方式如下：

$$\text{最低保证金要求} = nL \times \delta \times C$$

n: 即期天数;

L: 单日清算限额;

C: 资信因子;

δ : 即期汇率波动因子。

上海清算所根据市场汇率波动情况计算即期汇率变动因子, 根据资信评估结果确定会员资信变动因子。

3.9.2 变动保证金

变动保证金包括超限保证金和特殊保证金。

1. 超限保证金

超限保证金是清算会员所持头寸清算净额超出清算限额时缴纳的保证金。

超限保证金要求 = $\max((\sum_p L_{A,p} - nL) \times \delta \times \beta \times C, 0)$

其中:

$L_{A,p} = \sum_i [\text{币种 } i \text{ 在起息日 } P \text{ 的应付未付金额} * F_i * K_i]$, 该值为单日清算净额, 完成结算后按币种释放清算净额, 未完成结算的清算净额不释放, 额度释放于每天北京时间 17:00 更新;

F_i : 币种 i 对美元折算因子;

K_i : 币种 i 波动率调节因子;

β : 超限因子。

2. 特殊保证金 A

特殊保证金 A 是清算会员盯市亏损超过上海清算所设定的

盯市阈值时，上海清算所有权向清算会员收取的保证金。

日终特殊保证金 A:

$\text{Max}(-\text{Min}(0, \text{所有待结算资金折美元净额},$
不含逾期头寸的待结算资金折美元净额,
不含逾期及次日起息头寸的待结算资金折美元净额) - 盯市阈值
, 0);

日间特殊保证金 A:

$\text{Max}(-\text{Min}(0, \text{所有待结算资金折美元净额},$
不含逾期头寸的待结算资金折美元净额,
不含逾期及当日起息头寸的待结算资金折美元净额) - 盯市阈值
, 0)。

3. 特殊保证金 B

特殊保证金 B 触发事件主要包括三类：外汇市场汇率异常波动、连续假期和会员违约。当发生任一情况时，上海清算所可要求清算会员交纳特殊保证金。

3.10 收费方案

跨境外汇交易中央对手清算业务清算费率为交易名义本金的百万分之二。业务开展第一年，清算费用减半收取。

四、跨境外汇清算业务相关账户信息 和计息周期规则

4.1 外汇本金结算账户信息

银行间市场清算所股份有限公司(以下简称“上海清算所”)
(CLEARING HOUSE FINANCIAL MARKETS CO. LTD) SWIFT BIC
CODE: CHFMCNSH

美元、欧元、英镑、港币本金结算账户信息如下:

结算银行	SWIFT BIC CODE	开户机构	币种	账户名称	账号
中国建设银行	PCBCCNBJ GPS	上海分行 第五支行	美元	银行间市场清算所股份有限公司	31050166360000 002750
			欧元	银行间市场清算所股份有限公司	31050166360000 002751
			英镑	银行间市场清算所股份有限公司	31050166360000 002754
			港币	银行间市场清算所股份有限公司	31050166360000 002759

4.2 人民币保证金账户信息和缴款路径（大额支付系统）

人民币保证金(包括人民币变动保证金和人民币最低保证金)
缴款路径如下:

收款人开户行行号	9092900000007
收款人开户行名称	银行间市场清算所
收款人账号	通过上海清算所客户端查询,其菜单为:“资金管理-结算资金管理”,参见“资金账户账号”一栏
收款人名称	通过上海清算所客户端查询,其菜单为:“资金管理-结算资金管理”,参见“资金账户名称”一栏

人民币保证金（包括人民币最低保证金和人民币变动保证金）
按季度结息，结息日为 3 月 20 日、6 月 20 日、9 月 20 日
和 12 月 20 日，付息日如遇节假日则顺延。

4.3 外币保证金账户信息和缴款路径

美元、欧元及英镑保证金（包括最低保证金和变动保证金）
账户信息和缴款路径如下：

交纳路径	账户类型	BIC CODE	行名	币种	账户名称	收款账号
建行系统内（全国）	保证金账户	PCBCCNBJG PS	上海分行 第五支行	美元	银行间市场清算所股份有限公司	31050166360000000492
				欧元	银行间市场清算所股份有限公司	310501663600000002755
				英镑	银行间市场清算所股份有限公司	310501663600000002756

境内外币支付系统

发报行		会员行 BIC	
收报行		PCBCCNBJXXX	
报文正文			
Status	Tag	Field Name	格式规定
M	20	业务编号	N/A
M	21	NONREF	N/A
M	32A	起息日、币种、金额	起息日/币种/金额
M	52A	发起行行号	会员行 BIC
M	53A	发起清算行号	
M	54A	接收清算行号	
M	58A	接受行行号	
M	72	附言	/F85/清算所 BIC（11 位字符）+清算所收款账号
M = Mandatory			
注： N/A 代表该栏位无格式规定，N/A（TBA）代表该栏位需视实际情况而定			

境外代理行

发报行		会员行 BIC	
收报行		会员行境外账户行 BIC	
报文正文			
Status	Tag	Field Name	格式规定
M	20	Transaction Reference Number	N/A
M	21	Related Reference	N/A
O	13C	Time Indication	N/A
M	32A	Value Date, Currency Code, Amount	起息日/币种/金额
M	52A	Ordering Institution	会员行 BIC
O	53A	Sender's Correspondent	N/A
O	54A	Receiver's Correspondent	N/A
O	56A	Intermediary	美元：CHASUS33XXX
			欧元：DEUTDEFFXXX
			英镑：MIDLGB22XXX
M	57A	Account With Institution	PCBCCNBJGPS
M	58A	Beneficiary Institution	清算所收款账号+清算所 BIC
O	72	Sender to Receiver Information	N/A
M = Mandatory, O = Optional			
注： N/A 代表该栏位无格式规定, N/A（TBA）代表该栏位需视实际情况而定			

美元、欧元及英镑保证金（包括最低保证金和变动保证金）按季度结息，结息日为 3 月 20 日、6 月 20 日、9 月 20 日和 12 月 20 日，付息日如遇节假日则顺延。在计息周期中，需要提取最低保证金时，请提前三天通知上海清算所。

4.4 清算基金账户信息和缴款路径

4.4.1 人民币清算基金账户信息和缴款路径（大额支付系统）

人民币清算基金账户信息和缴款路径如下：

收款人开户行行号	909290000007
收款人开户行名称	银行间市场清算所
收款人账号	通过上海清算所客户端查询，其菜单为：“资金管理-结算资金管理”，参见“资金账户账号”一栏
收款人名称	通过上海清算所客户端查询，其菜单为：“资金管理-结算资金管理”，参见“资金账户名称”一栏

4.4.2 美元清算基金账户信息和缴款路径

美元清算基金账户信息和缴款路径如下：

交纳路径	账户类型	BIC CODE	行名	币种	账户名称	收款账号
建行系统内 (全国)	保证金账户	PCBCCN BJGPS	上海分行 第五支行	美元	银行间市场清算 所股份有限公司	31050166360 000000492

境内外币支付系统

发报行		会员行 BIC	
收报行		PCBCCNBJXXX	
报文正文			
Status	Tag	Field Name	格式规定
M	20	业务编号	N/A
M	21	NONREF	N/A
M	32A	起息日、币种、金额	起息日/币种/金额
M	52A	发起行行号	会员行 BIC
M	53A	发起清算行号	
M	54A	接收清算行号	
M	58A	接受行行号	
M	72	附言	/F85/清算所 BIC（11 位字符）+清算所收款账号
M = Mandatory			
注： N/A 代表该栏位无格式规定，N/A（TBA）代表该栏位需视实际情况而定			

境外代理行

发报行		会员行 BIC	
收报行		会员行境外账户行 BIC	
报文正文			
Status	Tag	Field Name	格式规定
M	20	Transaction Reference Number	N/A
M	21	Related Reference	N/A
O	13C	Time Indication	N/A
M	32A	Value Date, Currency Code, Amount	起息日/币种/金额
M	52A	Ordering Institution	会员行 BIC
O	53A	Sender's Correspondent	N/A
O	54A	Receiver's Correspondent	N/A
O	56A	Intermediary	美元：CHASUS33XXX
M	57A	Account With Institution	PCBCCNBJGPS
M	58A	Beneficiary Institution	清算所收款账号+清算所 BIC
O	72	Sender to Receiver Information	N/A
M = Mandatory, O = Optional			
注： N/A 代表该栏位无格式规定, N/A（TBA）代表该栏位需视实际情况而定			

美元清算基金按季度结息, 结息日为 3 月 20 日、6 月 20 日、9 月 20 日和 12 月 20 日, 付息日如遇节假日则顺延。在计息周期中, 需要提取清算基金时, 请提前三天通知上海清算所。

4.5 费用账户信息

4.5.1 人民币费用收取账户

收款人开户行行号	909290000007
收款人开户行名称	银行间市场清算所
收款人账号	1011220000200
收款人名称	应收跨境外汇清算费款项户 (人民币)
附言	20xx 年第 x 季度跨境外汇清算费用

4.5.2 美元费用收取账户

银行间市场清算所股份有限公司 (以下简称“上海清算所”)

(CLEARING HOUSE FINANCIAL MARKETS CO. LTD) SWIFT BIC
CODE: CHFMCNSH

结算银行	SWIFT BIC CODE	开户 机构	币种	账户名称	账号
中国建设银行	PCBCCN BJGPS	上海分行 第五支行	美元	银行间市场清算 所股份有限公司	3105016636 0000002750

附表

A-1-1. 上海清算所普通清算会员资格申请书

A-1-2. 上海清算所清算会员基础信息表

A-2. 上海清算所跨境外汇交易中央对手清算业务申请信息表

A-3. 上海清算所跨境外汇交易中央对手清算业务印鉴卡

A-4. 法人代表委托授权书

B-1. 上海清算所综合类清算会员资格申请书

B-2. 上海清算所跨境外汇交易中央对手清算代理业务申请信息
表

B-3. 上海清算所跨境外汇交易中央对手清算代理业务印鉴卡

B-4. 上海清算所跨境外汇交易中央对手清算代理业务客户信息
表

C-1. 上海清算所跨境外汇交易中央对手清算会员信息变更登记

表

C-2. 上海清算所跨境外汇交易中央对手清算业务非清算会员信息（变更）登记（报备）表

D-1. 上海清算所跨境外汇交易中央对手清算业务清算资格退出申请表

D-2. 上海清算所跨境外汇交易中央对手清算业务清算会员资格终止申请书

E-1. 上海清算所跨境外汇交易中央对手清算业务应急指令书

F-1. 上海清算所跨境外汇交易中央对手清算业务账户信息

上海清算所普通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跨境外汇交易中央对手清算业务的清算会员资格。

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、本单位在相关业务的开展情况

（简要介绍申请单位参与外汇市场各项业务基本情况、参与上海清算所集中清算等业务的情况）。

三、本单位关于参与上海清算所跨境外汇交易中央对手清算业务的初步规划

（简要介绍成为上海清算所清算会员后，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）

我单位成为上海清算所清算会员后，将严格遵守贵公司的会员管理规定及有关业务规则，服从贵公司的清算会员管理，积极配合清算会员工作，认真履行清算会员义务。我单位承诺申请通过后按照双方协商议定的清算会员资格费标准（一次性注册费*万元（如有），会员年费*万元）执行。有违反贵公司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：

A-1-2

上海清算所清算会员基础信息表

申请机构基本信息			
申请机构全称	(中文)		
	(英文)		
申请机构简称	(中文)		
	(英文)		
清算会员账号			
电子平台用户代码			
注册地址			
注册资本	(万元)	法定代表人	
企业法人营业执照号 (境内机构适用)		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	☐ 银行金融机构 ☐ 非银行金融机构 ☐ 非金融机构		
	☐ 政策性银行 ☐ 国有商业银行 ☐ 股份制商业银行 ☐ 城市商业银行 ☐ 农村商业银行 ☐ 外资银行 ☐ 信用社 ☐ 证券公司 ☐ 基金公司 ☐ 年金 ☐ 保险公司 ☐ 财务公司 ☐ 信托公司 ☐ 央企 ☐ 一般企业 ☐ 境外金融机构 ☐ 境外非金融机构		
法人营业执照号码 (境内机构适用)			
金融许可证号码 (境内机构适用)			
组织机构代码证号码 (境内机构适用)			
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)					
银行类申请机构财务信息(境外机构无需填写)						
序号	指标	20XX年/末	20XX年/末	备注		
1	资本充足率	%	%	资本净额/风险加权资产总额×100%		
2	核心一级资本充足率	%	%	核心一级资本净额/风险加权资产总额×100%		
3	资本积累率	%	%	(年末所有者权益-年初所有者权益)/年初所有者权益×100%		
4	人民币超额准备金比例	%	%	人民币超额准备金/各项存款×100%		
5	人民币资产流动性比例	%	%	人民币流动性资产余额/流动性负债余额×100%		
6	存贷款比例	%	%	各项贷款/各项存款×100%		
7	拆入资金比例	%	%	拆入资金/各项存款×100%		
8	不良贷款比例	%	%	不良贷款余额/发放贷款和垫款总额×100%		
9	拨备覆盖率	%	%	贷款减值准备/不良贷款余额×100%		
10	正常类贷款迁徙率	%	%	期初正常类贷款向下迁徙金额/(期初正常类贷款余额-期初正常类贷款期间减少金额)×100%		
11	关注类贷款迁徙率	%	%	期初关注类贷款向下迁徙金额/(期初关注类贷款余额-期初关注类贷款期间减少金额)×100%		
12	平均净资产收益率	%	%	净利润/期初期末净资产平均余额×100%		
13	平均总资产收益率	%	%	净利润/期初期末总资产平		

				均余额×100%
14	成本收入比例	%	%	业务及管理费/营业收入×100%
15	注册资本	亿元	亿元	合并报表口径
16	资产总额	亿元	亿元	
17	净资产	亿元	亿元	
18	营业收入	亿元	亿元	
19	净利润	亿元	亿元	
证券公司类申请机构财务信息（境外机构无需填写）				
序号	指标	20XX年/末	20XX年/末	备注
1	净资产	亿元	亿元	母公司口径
2	净资产/各项风险准备之和	%	%	
3	净资产/净资产	%	%	
4	净资产/负债	%	%	
5	净资产/负债	%	%	
6	自营权益类证券及证券衍生品/净资产	%	%	
7	自营固定收益类证券/净资产	%	%	
8	平均净资产收益率	%	%	净利润/期初和期末净资产平均余额×100%
9	平均总资产收益率	%	%	净利润/期初和期末总资产平均余额×100%
10	未分配利润率	%	%	未分配利润/净资产×100%
11	注册资本	亿元	亿元	合并报表口径
12	资产总额	亿元	亿元	
13	净资产	亿元	亿元	
14	营业收入	亿元	亿元	
15	净利润	亿元	亿元	
财务公司类申请机构财务信息（境外机构无需填写）				
序号	指标	20XX年/末	20XX年/末	备注

1	资本充足率	%	%	资本净额/风险加权资产总额×100%
2	资产流动性比例	%	%	流动性资产/流动性负债×100%
3	存贷款比例	%	%	各项贷款/各项存款×100%
4	拆入资金比例	%	%	拆入资金/各项存款×100%
5	不良贷款比例	%	%	不良贷款/各项贷款×100%
6	贷款损失准备充足率	%	%	贷款实际计提准备/贷款应提准备×100%
7	不良资产率	%	%	不良信用风险资产/信用风险资产×100%
8	资产损失准备充足率	%	%	信用风险资产实际计提准备/信用风险资产应提准备×100%
9	担保比例	%	%	担保风险敞口/资本总额×100
10	平均净资产收益率	%	%	净利润/期初期末净资产平均余额×100%
11	平均总资产收益率	%	%	净利润/期初期末总资产平均余额×100%
12	短期投资比例	%	%	短期投资/资本总额×100%
13	长期投资比例	%	%	长期投资/资本总额×100%
14	注册资本	亿元	亿元	合并报表口径
15	资产总额	亿元	亿元	
16	净资产	亿元	亿元	
17	营业收入	亿元	亿元	
18	净利润	亿元	亿元	

申请机构承诺事项：

我单位保证提供的所有信息真实、完整、准确。

法人代表或授权代表签章：

单位公章：

日期：

经办人：

电话：

日期：

注：1. 请在电子版上填写后打印、签字、盖章；
2. 清算会员账号为申请机构在上海清算所系统中的持有人账号；
3. 上述数据填写，如无备注要求，均根据合并报表口径填写，并精确至小数点后两位。如对财务指标含义有疑问，请联系风险管理部021-23198967；
fuyunzhou@shclearing.com。

上海清算所跨境外汇交易中央对手清算业务 申请信息表

清算会员全称：(中文)_____ (英文)_____

清算会员简称：(中文)_____ (英文)_____

清算会员账号：_____ 电子平台用户代码：_____

1. 申请机构人员信息						
姓名	部门 职务	培训证书编号	手机	传真	Email	职责
2. 客户端管理员信息						
姓名	登录 名	身份证号	培训证书编号		手机	
CFCA证书串号						
注： 1. 客户终端管理员必须是两人或两人以上； 2. “登录名”：请填写英文字母或英文字母加数字，并区分大小写； 3. “CFCA 证书串号”：请填写以“041”开头的证书串号，例如：041@712345678-X@shchcs@000000001；						
3. 指定或开立账户的信息						
开立本金结算账户信息						
外币	开户行名称					
	SWIFT BIC CODE					
指定保证金收款账户信息						
保证金缴纳币种信息						
最低保证金		人民币 ☐	美元 ☐	欧元 ☐	英镑 ☐	
变动保证金		人民币 ☐	美元 ☐	欧元 ☐	英镑 ☐	
美元 保证金	开户行	中文				
		英文				

		SWIFT BIC CODE	
	账号		
	说明		(中间行SWIFT BIC CODE或其他)
欧元 保证金	开户行	中文	
		英文	
		SWIFT BIC CODE	
	账号		
	说明		(中间行SWIFT BIC CODE或其他)
英镑 保证金	开户行	中文	
		英文	
		SWIFT BIC CODE	
	账号		
	说明		(中间行SWIFT BIC CODE或其他)
人民币 保证金	户名		
	行号		
	账号		
指定清算基金收款账户信息			
清算基金缴纳币种		人民币 ☐ 美元 ☐	
美元	开户行	中文	
		英文	
		SWIFT BIC CODE	
	账号		
	说明		(中间行SWIFT BIC CODE或其他)
人民币	户名		
	行号		
	账号		
4. 清算限额申请 填写相应的清算限额申请信息。			
清算限额 (美元)			
申报说明			

5. SWIFT单据接收 如需通过SWIFT接收单据，请提供SWIFT BIC CODE。	
SWIFT BIC CODE	
6. 费用缴纳币种 人民币 ☐ 美元 ☐	
7. 增值税专用发票信息采集表（境内会员适用） 增值税一般纳税人信息	
单位名称	
纳税人识别号	
地址、电话	
开户行及账号	
专票寄送地址	
专票寄送地址	
收件人	
邮编	
联系人电话/手机	
法人代表或授权代表签章： 单位公章：	
经办人： 电话： 日期：	
注：1. 请在电子版上填写后打印、签字、盖章。 2. 清算会员账号为申请机构在上海清算所系统中的持有人账号。 3. 申请机构人员信息至少填写5人，在职责中注明是分管领导（公司部门以上领导），业务主管（公司部门负责人）、操作联系人、业务联系人、风控联系人；5人中应至少有一名分管领导、一名业务主管、操作、业务、风控联系人各一名，一人可有多项职责；有变更及时报备。	

上海清算所跨境外汇交易中央对手清算业务印鉴卡

清算会员 全称			清算会员账号	
地址			邮编	
联系人			电话	
印模或签字样：（请清晰居中盖章）				
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/更换跨境外汇交易中央对手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。

开户单位加盖公章或有权签字人签字 年 月 日	原预留印鉴章 年 月 日
---------------------------	-----------------

- 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. 送存或更换印鉴卡，都应加盖会员单位法人公章，境外机构可提供有权签字人签字；
 4. 清算会员账号为清算会员在上海清算所系统中的持有人账号。

关于上海清算所跨境外汇交易中央对手清算业务 预留印鉴的使用说明

本印鉴卡预留印鉴可用上海清算所跨境外汇交易中央对手清算业务的以下情形：

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. 账户信息变更

会员机构账户信息如发生变更的，需填写会员账户信息情况表，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）客户端无法下载单据需申请单据应急导出；
- （2）客户端无法提交保证金提款信息需申请保证金应急提款；
- （3）应急操作流程中列明的其他情形。

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 证书用于上海清算所跨境外汇交易中央对手清算业务的，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

会员机构参与上海清算所跨境外汇交易中央对手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。

法人代表授权委托书

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跨境外汇交易中央对手清算业务相关手续。

授权经办人员 1 姓名：

授权经办人员身份证明文件号码：

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明文件号码：

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明复印件)

附：授权经办人员联系方式

姓名	座机	手机	传真	电邮

上海清算所综合类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跨境外汇交易中央对手清算业务的综合清算会员资格。

一、本单位概况及业务开展情况

介绍本单位开展跨境外汇交易中央对手清算业务的基本情况(从事该业务的时间、开展情况、所获相关奖励等)；

为满足开展跨境外汇交易中央对手清算业务的需要，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。

二、本单位参与跨境外汇交易中央对手清算业务代理清算的初步规划

介绍目前本单位针对跨境外汇交易中央对手清算业务代理清算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跨境外汇交易中央对手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；

介绍本单位参与跨境外汇交易中央对手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；

为满足开展跨境外汇交易中央对手清算业务的需要，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它事项。

四、承诺事项（范例）

我单位参与跨境外汇交易中央对手清算代理清算业务后，将严格遵守贵公司针对该业务相关规则，认真履行该业务相关义务，积极拓展该业务代理清算市场。我单位承诺申请通过后按照双方协商议定的清算会员资格费标准（一次性注册费*万元（如有），会员年费*万元）执行。有违反贵公司有关该业务规定的，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：

上海清算所跨境外汇交易中央对手清算代理业务 申请信息表

综合清算会员全称：(中文)_____ (英文)_____

综合清算会员简称：(中文)_____ (英文)_____

综合清算会员账号：_____ 电子平台用户代码：_____

1. 申请机构人员信息						
姓名	部门职务	培训证书编号	手机	传真	Email	职责

2. 客户端管理员信息				
姓名	登录名	身份证号	培训证书编号	手机

CFCA证书串号	
----------	--

注：1. 客户终端管理员必须是两人或两人以上；
 2. “登录名”：请填写英文字母或英文字母加数字，并区分大小写；
 3. “CFCA 证书串号”：请填写以“041”开头的证书串号，例如：041@712345678-X@shchcs@000000001；

3. 指定或开立账户的信息			
代理业务本金结算账户信息			
外币	开户行名称		
	SWIFT BIC CODE		
代理业务保证金收款账户信息			
美元 保证金	开户行	中文	
		英文	
		SWIFT BIC CODE	

	账号		
	说明		(中间行SWIFT BIC CODE或其他)
欧元 保证金	开户行	中文	
		英文	
		SWIFT BIC CODE	
	账号		
	说明		(中间行SWIFT BIC CODE或其他)
英镑 保证金	开户行	中文	
		英文	
		SWIFT BIC CODE	
	账号		
	说明		(中间行SWIFT BIC CODE或其他)
人民币 保证金	户名		
	行号		
	账号		
4. 代理清算限额申请 填写相应的代理清算限额申请信息。			
代理清算限额 (美元)			
申报说明			
5. 增值税专用发票信息采集表(境内会员适用) 增值税一般纳税人信息			
单位名称			
纳税人识别号			
地址、电话			
开户行及账号			
专票寄送地址			
专票寄送地址			
收件人			
邮编			
联系人电话/手机			
法人代表或授权代表签章： 单位公章：			

经办人：

电话：

日期：

注：1. 请在电子版上填写后打印、签字、盖章。

2. 清算会员账号为申请机构在上海清算所系统中的持有人账号。

3. 申请机构人员信息至少填写 5 人，在职责中注明是分管领导（公司部门以上领导），业务主管（公司部门负责人）、操作联系人、业务联系人、风控联系人；5 人中应至少有一名分管领导、一名业务主管、操作、业务、风控联系人各一名，一人可有多项职责；有变更及时报备。

B-3

上海清算所跨境外汇交易中央对手清算代理业务 印鉴卡

综合清算会员 全称		综合清算会员账号	
地址		邮编	
联系人		电话	
印模或签字样：（请清晰居中盖章）			
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_____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。

开户单位加盖公章或有权签字人签字 年 月 日	原预留印鉴章 年 月 日
---------------------------------	-----------------------

- 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. 送存或更换印鉴卡，都应加盖会员单位法人公章，境外机构可提供有权签字人签字。
 4. 清算会员账号为清算会员在上海清算所系统中的持有人账号。

关于上海清算所跨境外汇交易中央对手清算 代理业务预留印鉴的使用说明

本印鉴卡预留印鉴可用上海清算所跨境外汇交易中央对手清算代理业务的以下情形：

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. 客户端管理员信息变更

会员机构如需变更客户端管理员信息的，需填写客户端管理员申请表，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. 账户信息变更

会员机构账户信息如发生变更的，需填写会员账户信息情况表，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；
- （5）应急操作流程中列明的其他情形。

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 证书用于上海清算所跨境外汇交易中央对手清算业务的，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

会员机构参与上海清算所跨境外汇交易中央对手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。

B-4

上海清算所跨境外汇交易中央对手清算代理业务 客户信息表

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 账号			
1. 申请机构基本信息			
客户全称			
客户简称			
客户账号			
电子平台用户代码			
注册地址			
通讯地址			
法人营业执照号码 (境内机构适用)			
金融许可证号码 (境内机构适用)			
组织机构代码证号码 (境内机构适用)			
客户机构类别 (首次报备填写)	☐ 银行金融机构 ☐ 非银行金融机构 ☐ 非金融机构 ☐ 非法人产品		
	☐ 政策性银行 ☐ 国有商业银行 ☐ 股份制商业银行 ☐ 城市商业银行 ☐ 农村商业银行 ☐ 外资银行 ☐ 信用社 ☐ 证券公司 ☐ 基金公司 ☐ 年金 ☐ 保险公司 ☐ 财务公司 ☐ 信托公司 ☐ 央企 ☐ 一般企业 ☐ 境外金融机构 ☐ 境外非金融机构 ☐ 非法人产品		
2. 清算限额等风控参数申请			
客户清算限额 (折美元)			
生效日期			
3. 账户信息			
保证金缴纳币种信息			

最低保证金	人民币 ☐ 美元 ☐ 欧元 ☐ 英镑 ☐				
变动保证金	人民币 ☐ 美元 ☐ 欧元 ☐ 英镑 ☐				
保证金账户信息					
美元 保证金	开 户 行	中文			
		英文			
		SWIFT BIC CODE			
	账号				
	说明		(中间行SWIFT BIC CODE或其他)		
人民币 保证金	付款开户行行号				
	付款开户行名称				
	付款账号				
	付款人名称				
欧元 保证金	开 户 行	中文			
		英文			
		SWIFT BIC CODE			
	账号				
	说明		(中间行 SWIFT BIC CODE 或其他)		
英镑 保证金	开 户 行	中文			
		英文			
		SWIFT BIC CODE			
	账号				
	说明		(中间行 SWIFT BIC CODE 或其他)		
4. 客户人员信息					
姓名	部门职务	手机	传真	Email	备注
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。					
经办人: _____ 电话: _____ 手机: _____ E-mail: _____					
注: 1. 请在电子版上填写后打印、签字、盖章; 2. 客户联系人员信息至少填写 2 人, 并提供准确、完整的联系方式; 3. 综合清算会员账号为综合清算会员在上海清算所系统中的持有人账号; 4. 客户账号为客户在上海清算所系统中的持有人账号。					

上海清算所跨境外汇交易中央对手清算 会员信息变更登记表

清算会员名称 (全称)			
业务类型	☐ 自营 ☐ 代理		
变更项目	☐ 申请机构人员信息 ☐ 客户端管理员信息 ☐ 账户信息 ☐ 清算限额 ☐ 费用发票寄送信息 ☐ 其他 (_____)		
变更前信息			
变更后信息			
变更生效时间			
变更情况说明			
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清算会员管理和业务规则规定的，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	

备注：清算会员发生以下情况的，需在 5 个工作日内填写本表，加盖有效印鉴后提交上海清算所会员服务部：

- (1) 机构改制、重组、分立、合并等重大资质变更；
- (2) 发生机构法人代表、股东、注册资金、业务人员等基本信息变更的；
- (3) 发生与所参与中央对手清算业务相关的事件，如法律纠纷、商业案件、行政处罚等。

C-2

上海清算所跨境外汇交易中央对手清算业务 非清算会员信息（变更）登记（报备）表

综合清算会员全称_____

综合清算会员代客业务印章

综合清算会员账号_____

变更报备信息	
客户全称	
客户简称	
客户账号	
变更项目	☐ 申请机构基本信息 ☐ 清算限额 ☐ 代客关系 ☐ 账户信息 ☐ 客户人员信息 ☐ 其他（_____）
变更前信息	
变更后信息	
变更生效日期	
变更情况说明	
注： 1. 请在电子版上填写后打印、盖章； 2. 综合清算会员账号为综合清算会员在上海清算所系统中的持有人账号； 3. 客户账号为客户在上海清算所系统中的持有人账号。	

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

上海清算所跨境外汇交易中央对手清算业务 清算资格退出申请表

清算会员名称 (全称)			
是否同时申请终止 清算会员资格	☐ 是 ☐ 否		
说明			
承诺事项			
1. 我单位自愿提出上述申请，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清算会员管理和业务规则规定的，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	

备注：勾选同时申请终止清算会员资格的，需提交《上海清算所跨境外汇交易中央对手清算业务清算会员资格终止申请书》。

上海清算所跨境外汇交易中央对手清算业务 清算会员资格终止申请书

银行间市场清算所股份有限公司：

我公司已仔细阅读并充分理解贵公司关于清算会员资格及跨境外汇交易中央对手清算业务所有相关规定。

现我公司因（陈述理由），谨此向贵公司申请终止（清算会员资格类型）清算会员资格，同意依据相关规定办理清算会员终止事项，同时保证在清算会员资格正式终止之前，已终止与贵公司的跨境外汇交易中央对手清算业务，并已结清所有债权债务关系。

（普通清算会员自营头寸，会员资格费、清算费等相关费用，保证金和清算基金等相关风险准备资源的结清情况；综合清算会员代理头寸已结清或代理关系已转移的情况，可在本申请书中详述或另附说明材料）。

特此申请。

（申请机构全称）

（加盖公章）（境内机构适用）

或经有权签字人签字（境外机构适用）

***年**月**日

上海清算所跨境外汇交易中央对手清算业务 应急指令书

传真指令编号：_____（请从 001 开始自行编制）

应急指令要求（必填）	☐ 保证金提款 ☐ 单据导出 ☐ 信息查询（ ☐ 账户余额 ☐ 风控检查状态 其它信息：_____） ☐ 其它 _____				
应急内容（必填）	选择	转出账户账号		转入账户账号	
	资金	转出账户名称		转入账户名称	
	划拨	划拨金额（大写）		划拨金额（小写）	
	填写	其它应急指令具体操作要求：			
填写说明： 1. 资金划拨： 请按格式填写转出转入账户账号、账户名称、划拨金额并注明币种；若预先预留的收款账户为唯一的收款账户，转入账户信息可不填。 2. 单据导出： 请注明单据名称、时间范围、接收电子邮箱地址（必须通过电子渠道发送的单据）。 3. 信息查询： 请注明查询信息内容。 以上所有应急指令，若综合清算会员办理代理业务，需注明客户账号、客户简称					

指令发送方保证：所发送的应急指令书内容真实、准确、完整、有效。

指令发送方账号：

指令发送方简称：

有效印鉴（预留印鉴或公章）：

发送日期： 年 月 日

指令发送方电话：

指令发送方联系人：

指令发送方传真号码：

填表说明

一. 通用说明

(一) 传真指令编号：由指令发送方按当日顺序自行编制，从 001、002 开始依次类推，当天不重复。

(二) 综合清算会员办理代理业务应急操作时，必须注明客户账户和客户简称。

(三) 填写必须清晰，不得涂改。

(四) 上海清算所接收传真电话：021-63326661。

二. 具体业务说明

(一) 资金划拨

1. 请按格式填写转出转入账户账号、账户名称、划拨金额并注明币种。
2. 若预先预留的收款账户为唯一的收款账户，转入账户信息可不填。

(二) 单据导出

1. 单据范围包括资金清算单据、资金结算单据、保证金单据、SFTP 文件等。
2. 应急情况下，对于必须通过电子渠道发送的单据（如 SFTP 文件），上海清算所可提供邮件发送渠道。
3. 请注明单据名称、时间范围、接收电子邮箱地址（如需）

(三) 信息查询

请注明查询信息内容。