

标准利率互换集中清算系统操作手册 (会员终端)

目录

1	前言	3
1.1	概述	3
1.2	内容简介	3
2	用户与权限管理	5
2.1	用户登录	5
2.2	密码修改	5
2.3	用户管理	6
2.4	机构证书管理	13
3	实时监测	16
3.1	实时风控查询	16
4	基础信息查询	18
4.1	合约信息查询	18
4.2	公告信息查询	19
4.3	持仓限额查询	20
4.4	费用参数查询	22
4.5	结算价查询	22
4.6	利息清单查询	23
4.7	当月可交割合约信息查询	24
5	统计查询	26
5.1	交易数据查询	26
5.2	历史持仓查询	27
5.3	交割持仓查询	28
5.4	保证金结算清单查询	29
5.5	交割资金结算清单查询	31
5.6	季度费用单据查询	32
5.7	通知单下载	34
5.8	费用明细查询	35
5.9	其他费用查询	36
6	资金结算账户管理	38
6.1	资金提取	38
6.2	资金提取复核查询	38

1 前言

1.1 概述

本文档为上海清算所会员机构提供使用标准利率互换集中清算业务会员终端系统的使用说明。

1.2 内容简介

本文档介绍了上海清算所标准利率互换集中清算会员终端系统的主要功能和使用方法。

章节	内容
1 前言	主要介绍客户端基本情况
2 用户与权限管理	主要用于首席操作员进行用户岗位设置管理
3 实时监测	主要用于普通操作员进行实时风控监测
4 基础信息查询	主要用于普通操作员进行基础信息查询
5 统计查询	主要用于普通操作员进行统计信息查询
6 会员报价	主要用于普通操作员进行查询报价与设置报价

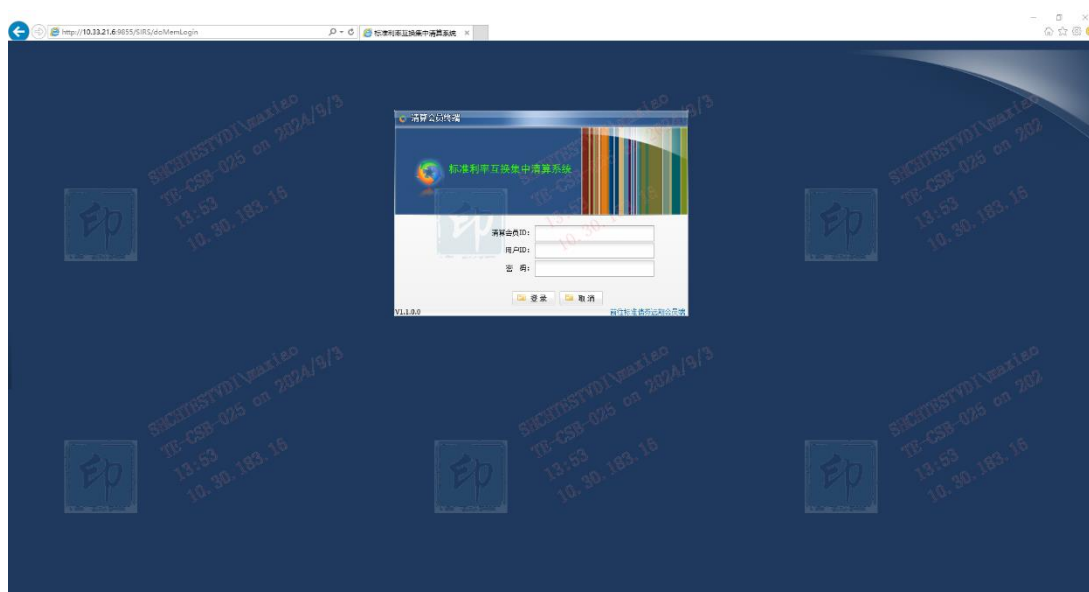
7 资金结算账户管理

主要用于普通操作员进行资金提取操作与资金提取记录查询

2 用户与权限管理

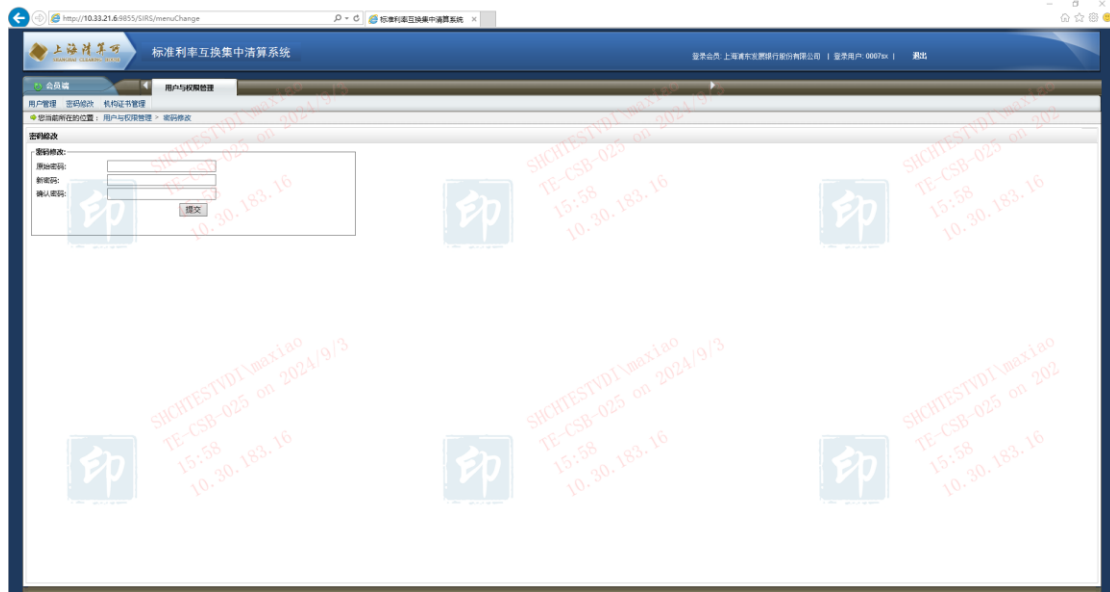
2.1 用户登录

使用 IE 浏览器进入会员端界面后，首席管理员输入：清算会员 ID、用户 ID、密码。点击登录，选择正确的证书，即登录会员端界面。点击取消，可清空清算会员 ID、用户 ID、密码框中的数据。（登录界面可点击链接前往标准债券远期会员端）



2.2 密码修改

1. 若修改密码，点击“用户与权限管理”>“密码修改”进行操作。输入原始密码、新密码和确认密码后，点击提交完成操作。



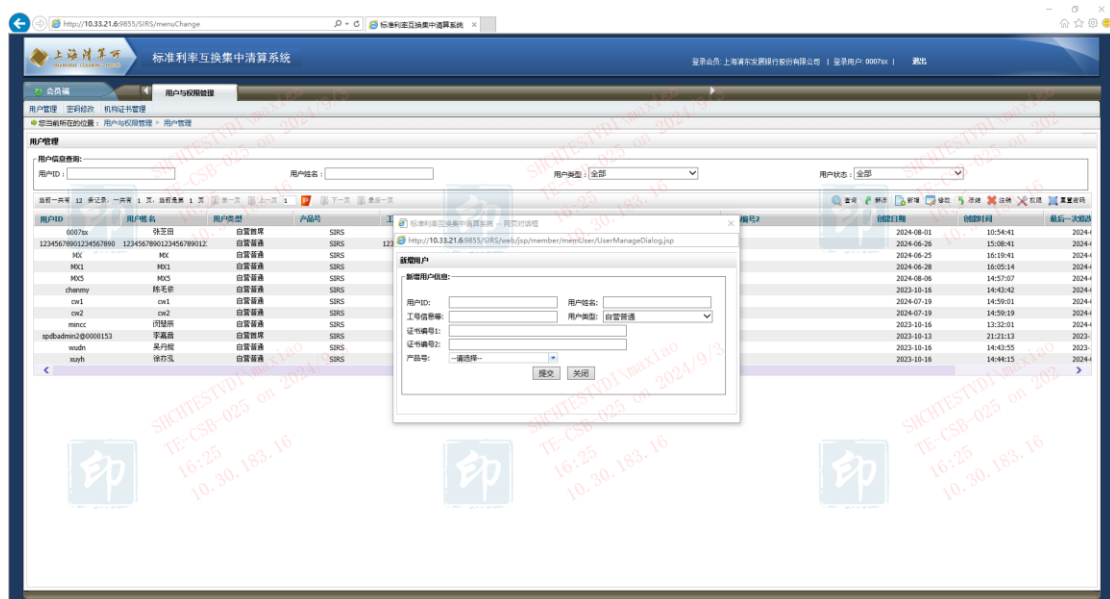
2.3 用户管理

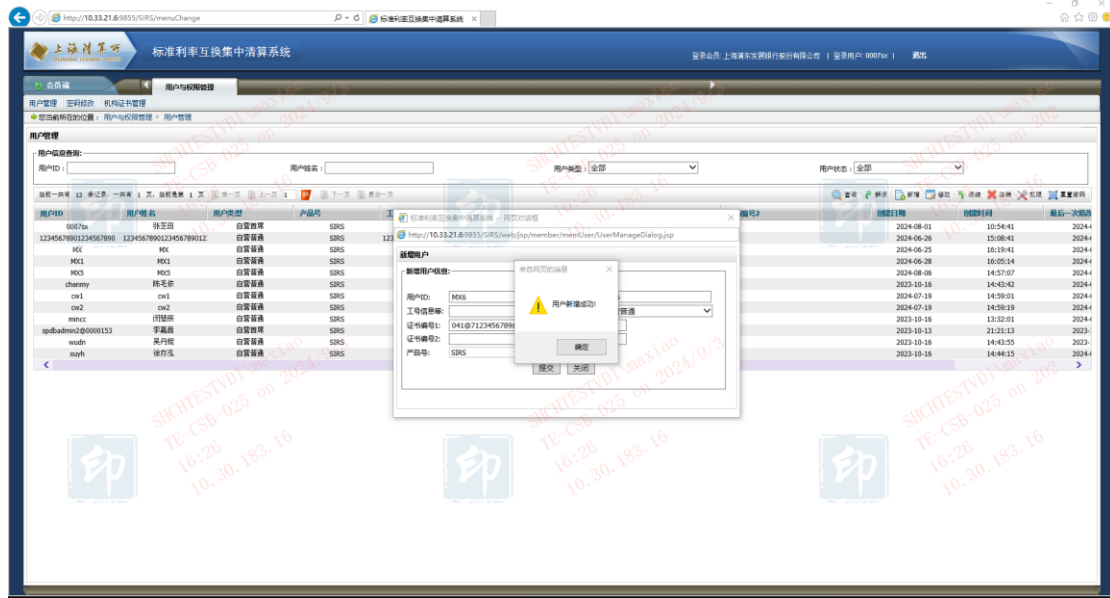
打开页面：“用户与权限管理” > “用户管理”（仅首席用户可打开）。

1. 查询：

点击查询，可显示现有所有普通和首席操作员，也可输入条件筛选后查询。支持用户 ID、用户姓名模糊查询，用户类型、用户状态下拉框选择查询。

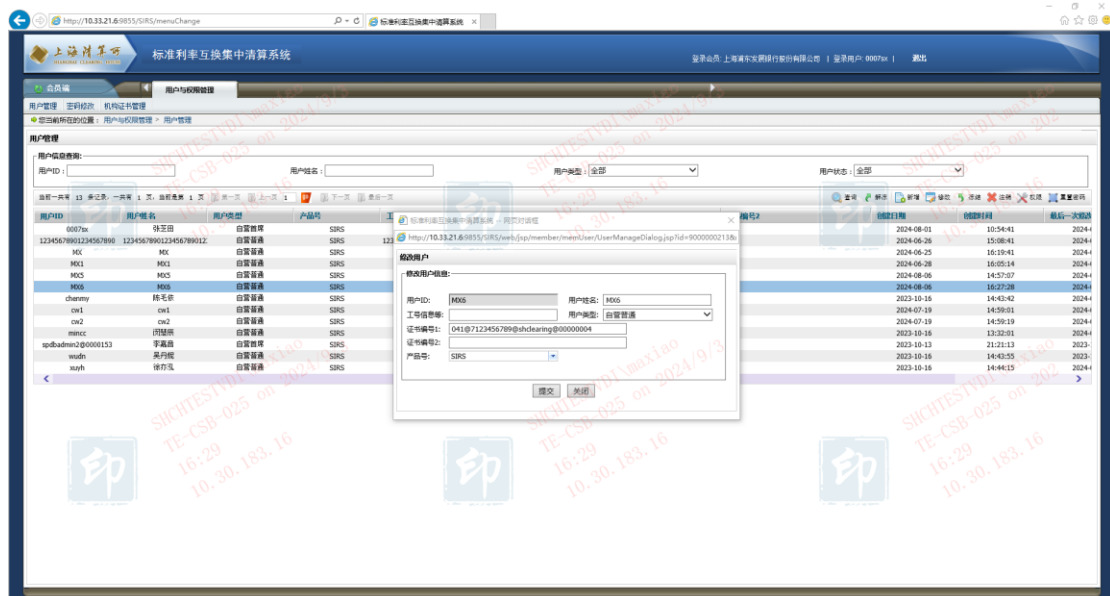
点击新增键后，输入用户 ID（必填）、用户姓名（必填）、工
息等（选填），点击提交，提示普通用户新增成功。

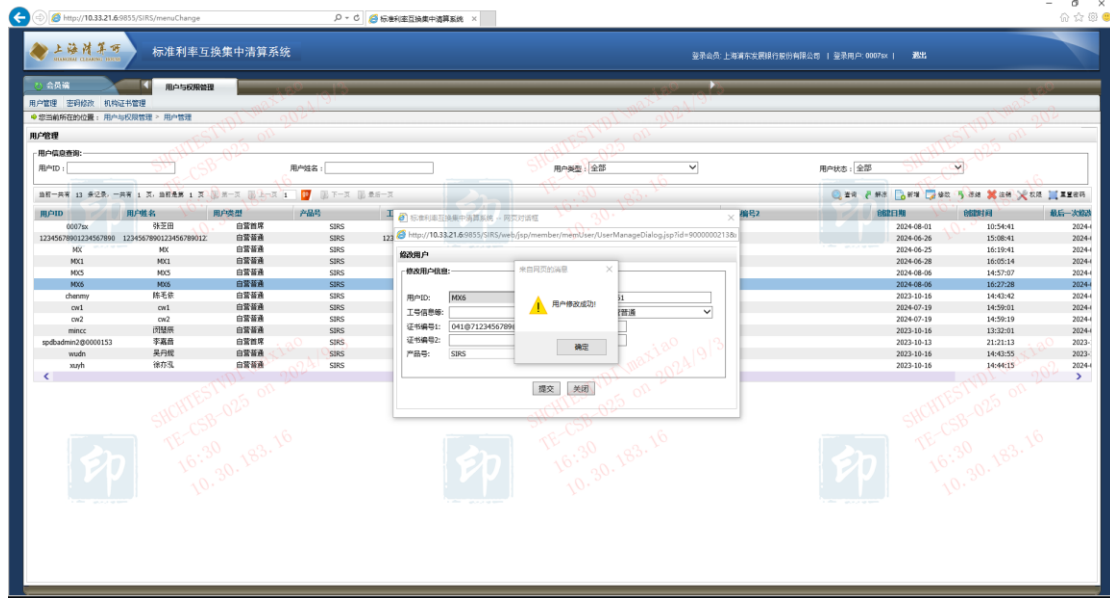




3. 修改:

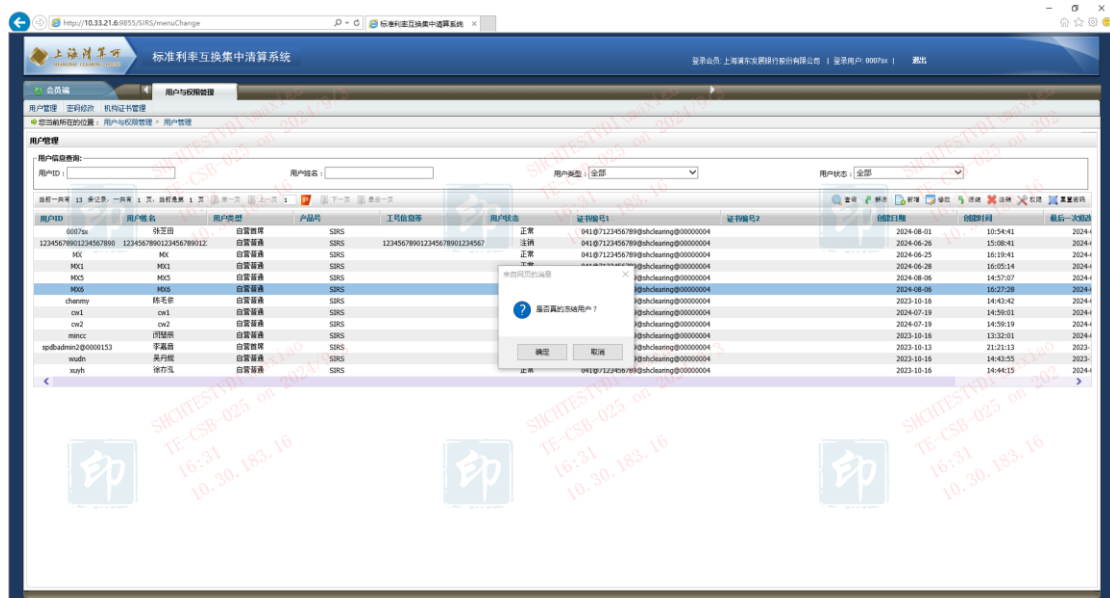
选择一条用户状态为非注销的用户信息，点击修改键可编辑其用户姓名和工号信息等内容，点击提交，提示用户修改成功。

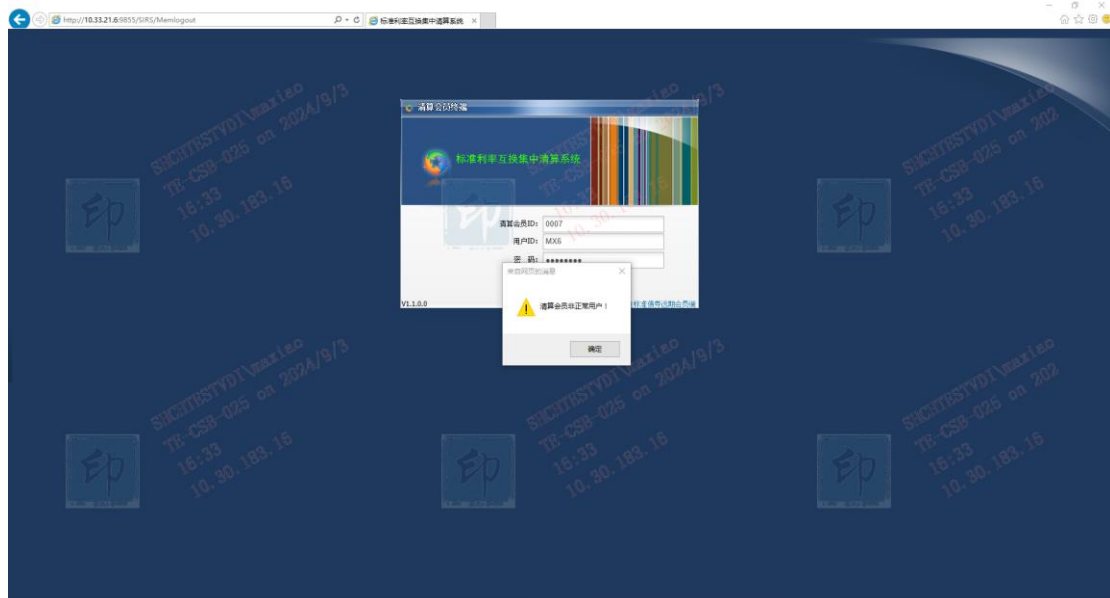




4. 冻结：

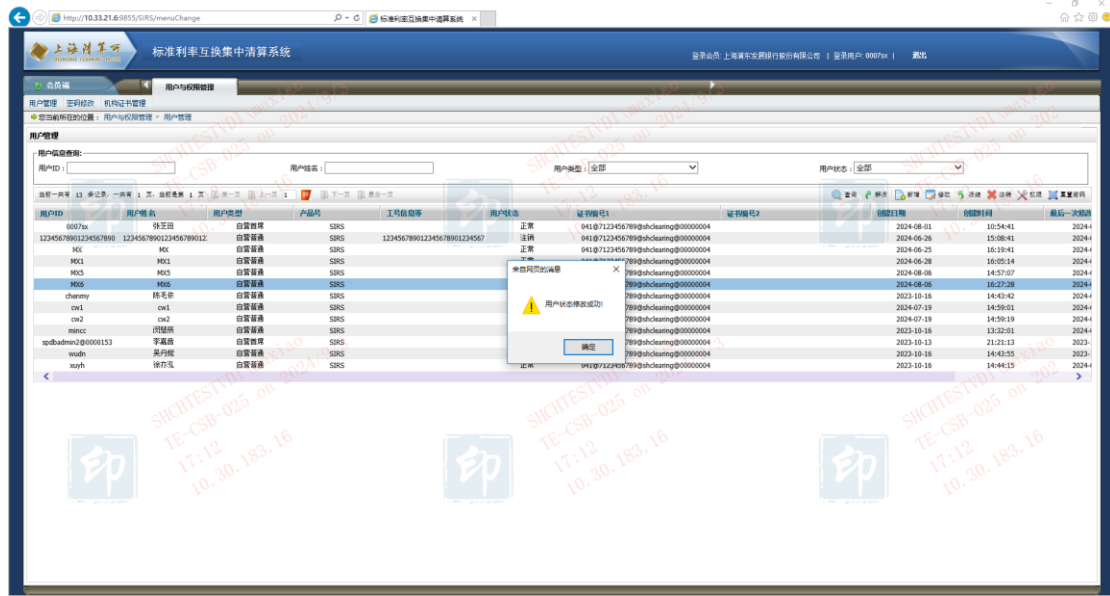
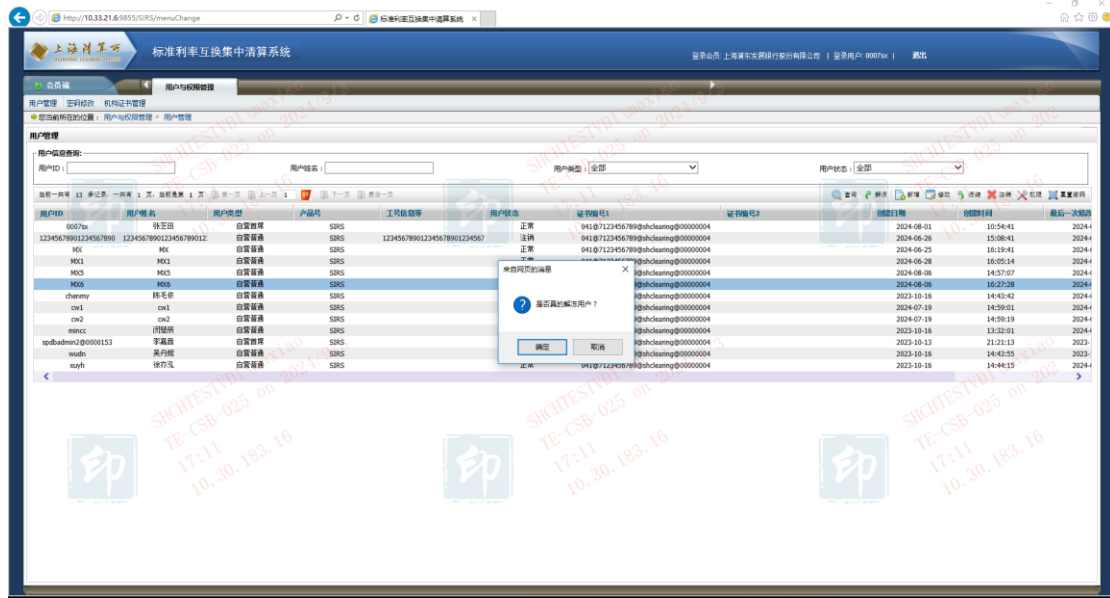
选择一条用户状态为正常的用户信息，点击冻结键后系统提示“是否真的冻结用户？”，点击确定键即完成冻结操作。冻结用户将无法登录，提示非正常用户，登录失败，解冻后可恢复正常登录。





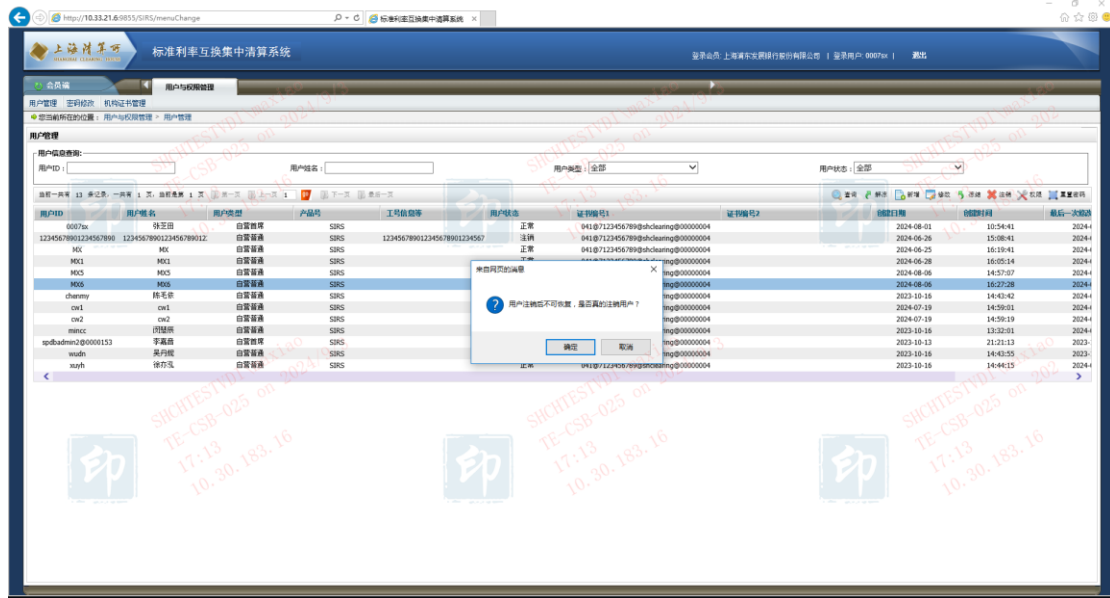
5. 解冻:

选择一条用户状态为冻结的用户信息，点击解冻键后系统提示“是否真的解冻该用户？”，点击确认键后提示“用户状态修改成功”。



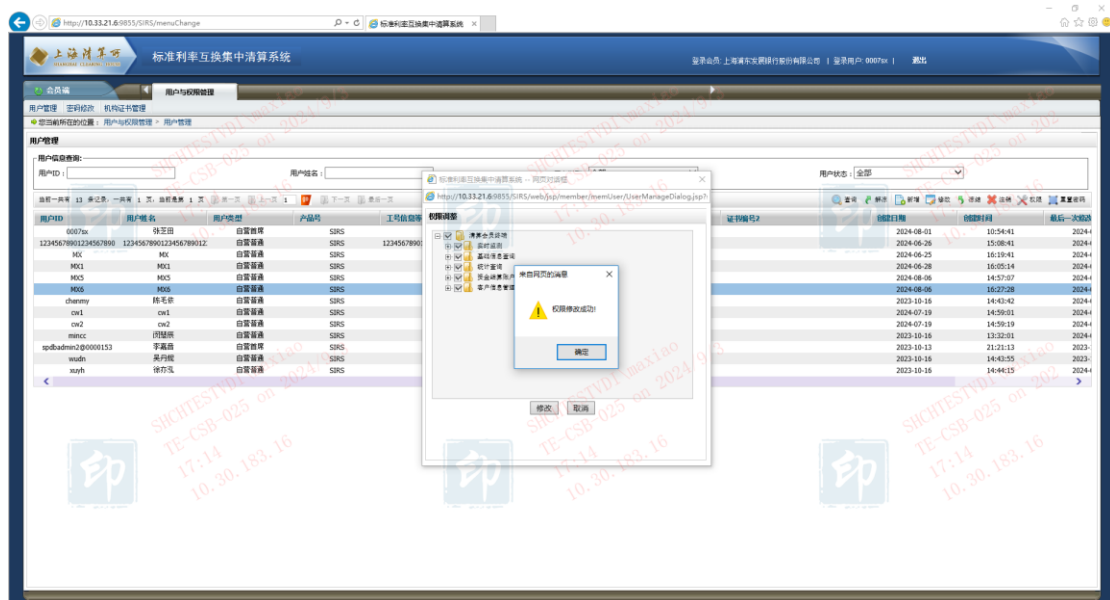
6. 注销:

选择一条状态为非注销的用户信息，系统提示“用户注销后不可恢复，是否真的注销用户？”，点击确认键后，提示用户状态修改成功，则该用户将注销无法登录。



7. 权限：

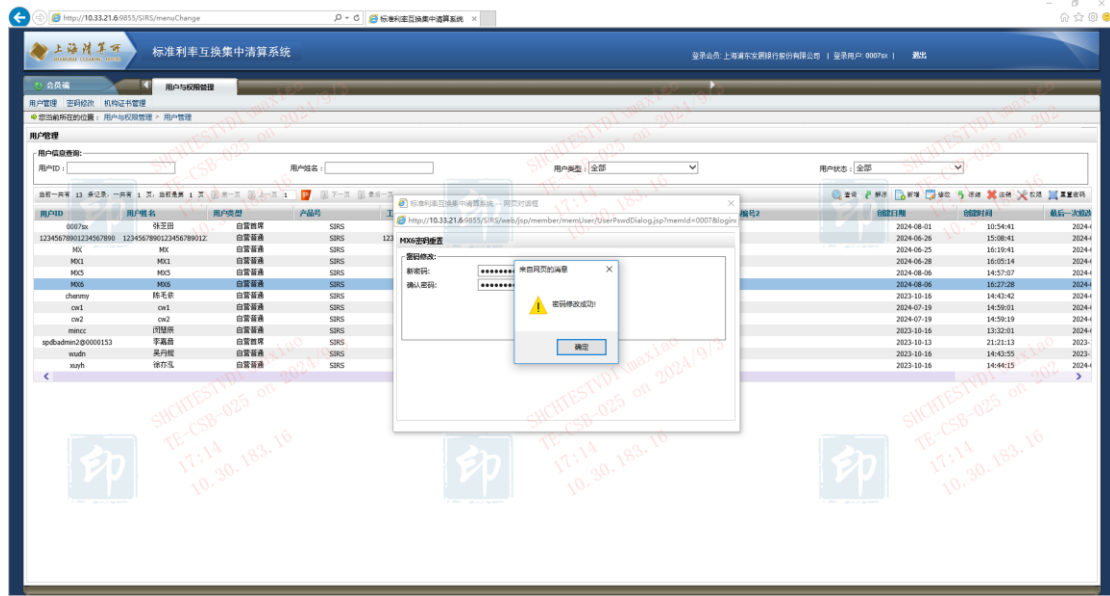
选择一条普通会员信息条目，点击权限，对需要开通的权限打勾，点击修改键，系统提示“权限修改成功”，完成权限分配操作。



8. 重置密码：

选择一条需要重置密码的普通会员信息，点击重置密码键，

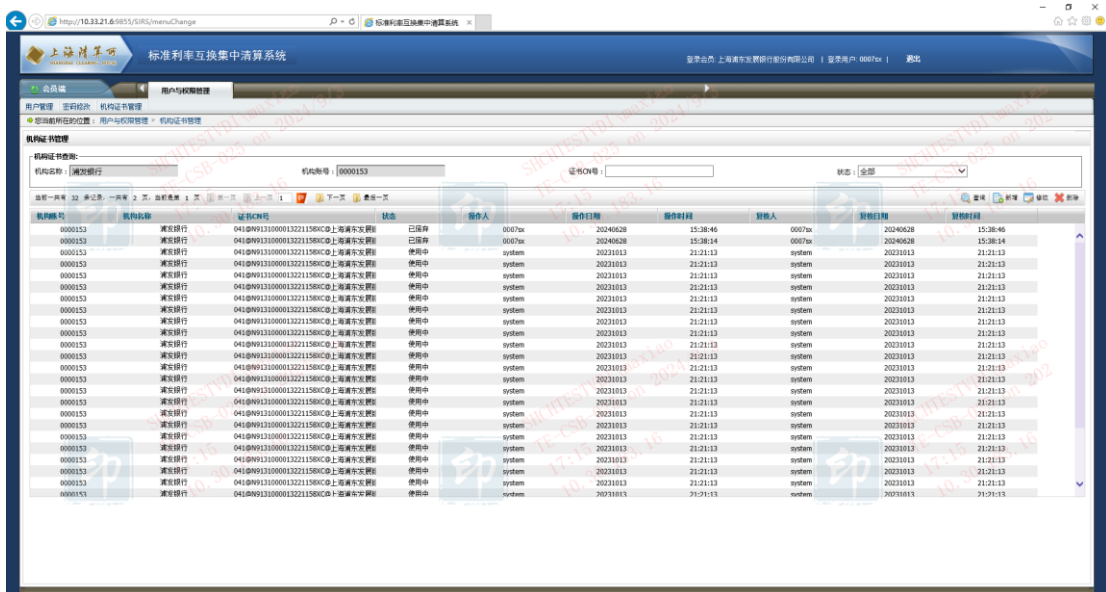
输入新密码、确认密码（密码为 8 位到 10 位），点击提交键，系统提示“修改密码成功”，则该普通会员密码重置成功。



2.4 机构证书管理

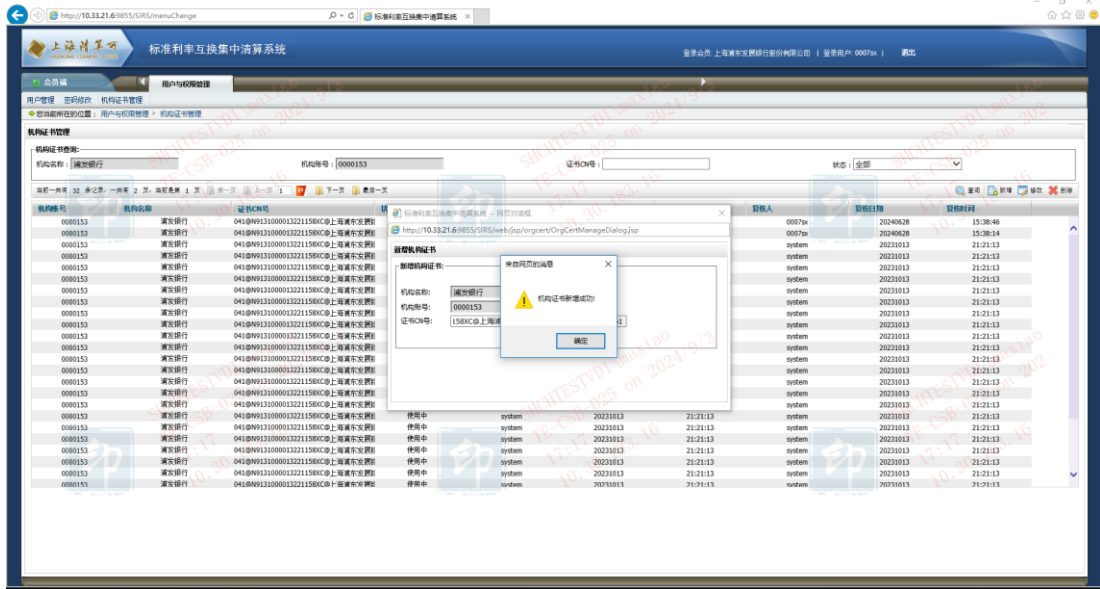
1. 查询：

点击查询，即可查询机构证书信息。



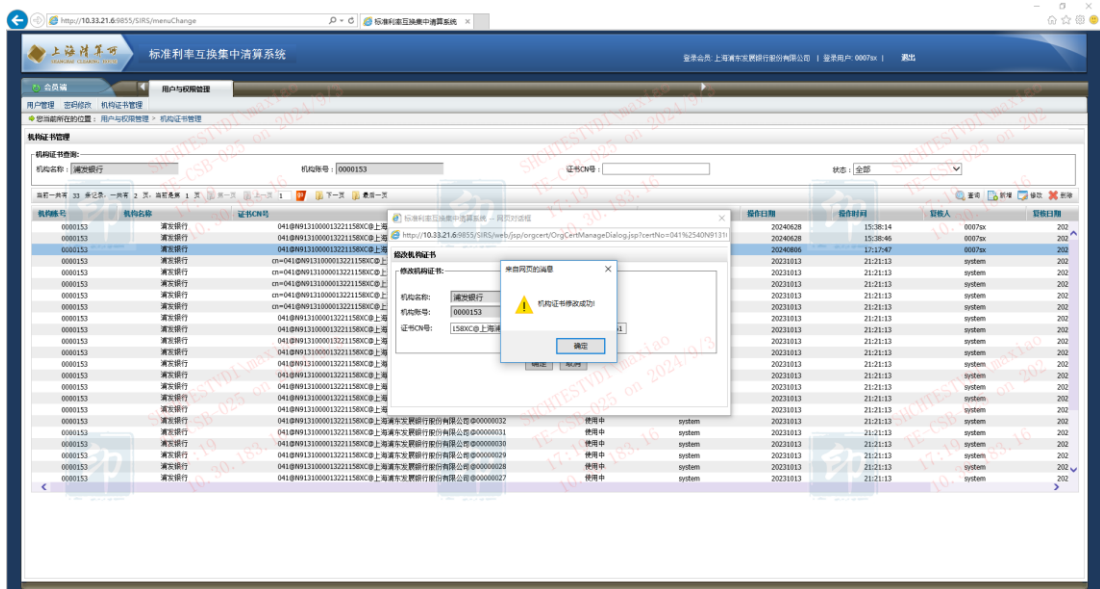
2. 新增:

点击新增键后, 输入机构名称 (默认), 机构账号 (默认)、证书 CN 号, 点击提交, 提示机构证书新增成功。



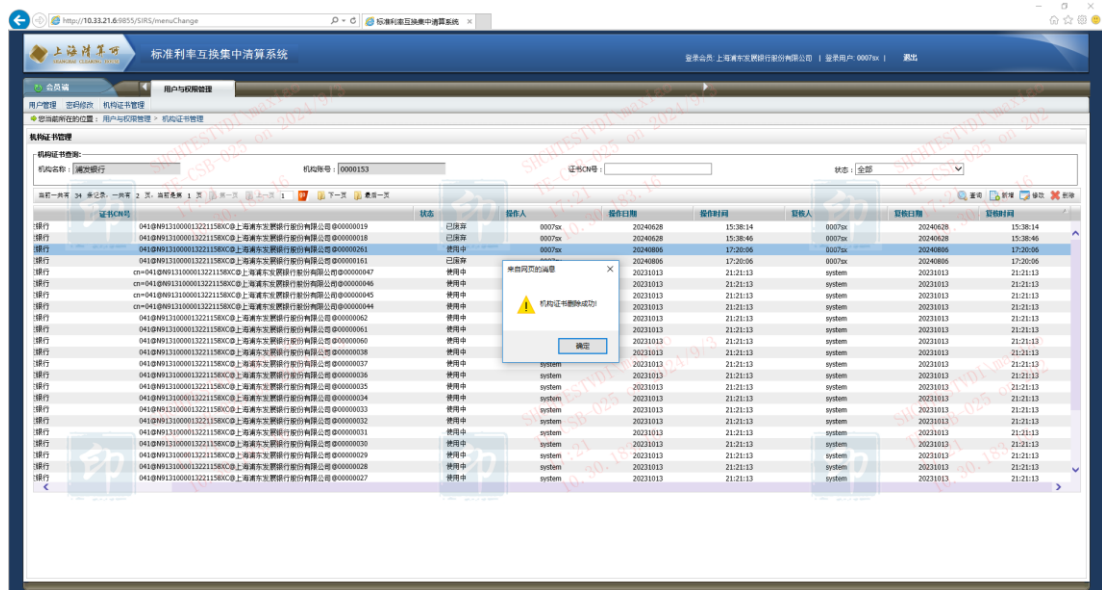
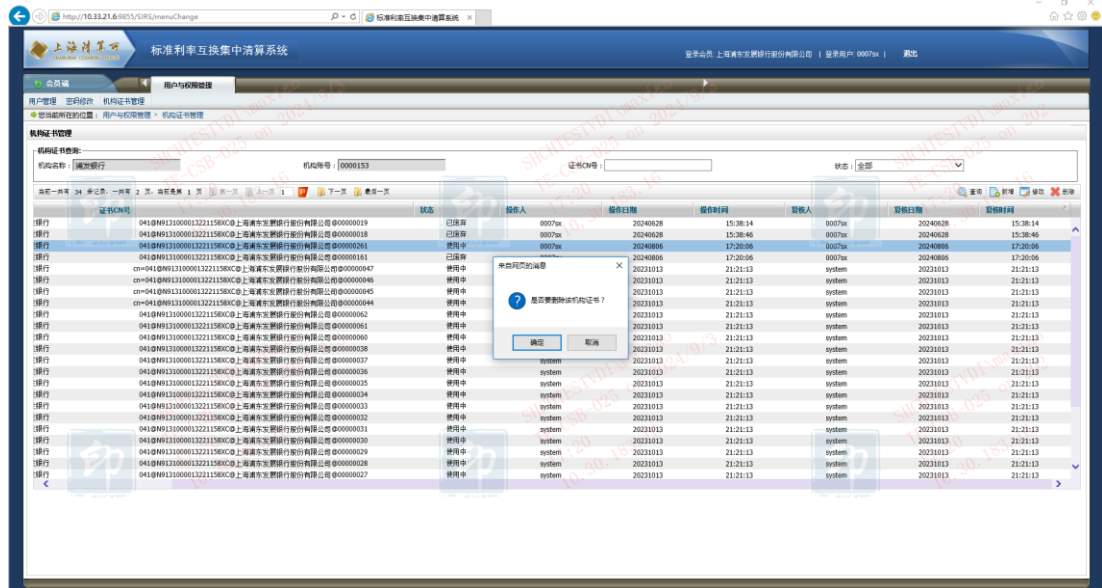
3. 修改:

选择一条用户状态为使用中的机构证书, 点击修改键可编辑其证书 CN 号, 点击提交, 提示机构证书修改成功。



4. 删除：

点击删除键，删除机构证书。

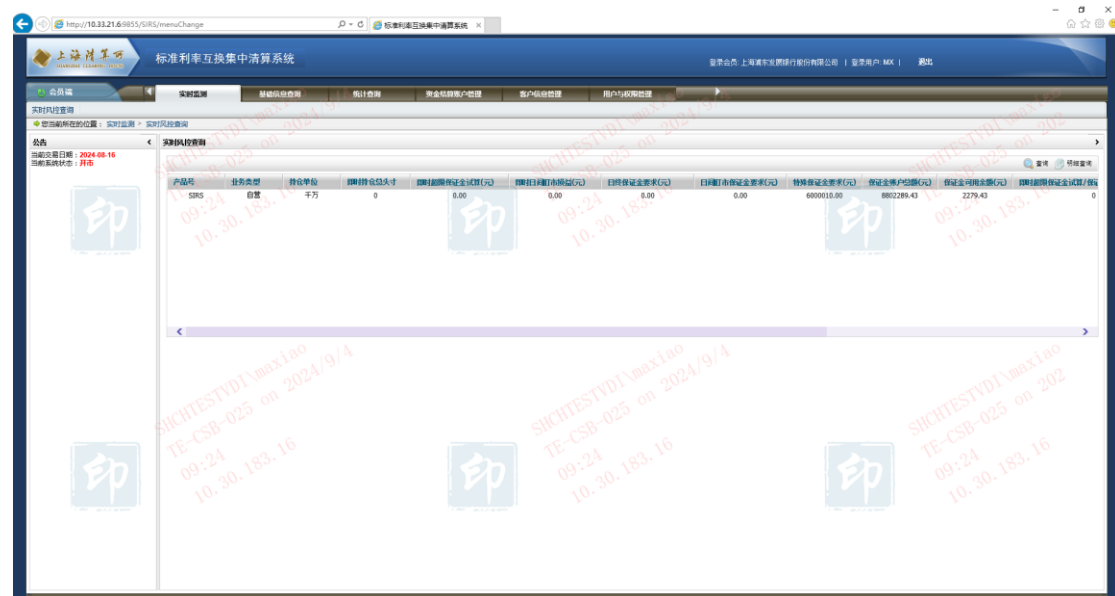


3 实时监测

3.1 实时风控查询

1. 查询：

点击查询键，即可查询出实时风控信息。



The screenshot shows the 'Standard Interest Rate Interchange Central Clearing System' (标准利率互换集中清算系统) interface. The 'Real-time Risk Control Query' (实时风控查询) tab is selected. The interface displays a table with the following columns: Product Code (产品号), Business Type (业务类型), Counterparty (对手方), Counterparty Name (对手方名称), Counterparty Risk Rating (对手方风险评级), Counterparty Risk Rating Description (对手方风险评级描述), Counterparty Risk Rating Date (对手方风险评级日期), Counterparty Risk Rating Validity (对手方风险评级有效期), Counterparty Risk Rating Status (对手方风险评级状态), Counterparty Risk Rating Reason (对手方风险评级原因), Counterparty Risk Rating Action (对手方风险评级行动), Counterparty Risk Rating Result (对手方风险评级结果), Counterparty Risk Rating Comment (对手方风险评级备注), and Counterparty Risk Rating Date (对手方风险评级日期).

产品号	业务类型	对手方	对手方名称	对手方风险评级	对手方风险评级描述	对手方风险评级日期	对手方风险评级有效期	对手方风险评级状态	对手方风险评级原因	对手方风险评级行动	对手方风险评级结果	对手方风险评级备注	对手方风险评级日期
SHR0	自营	千万		0.00		0.00		0.00		0.00		0.00	0.00

2. 明细查询：

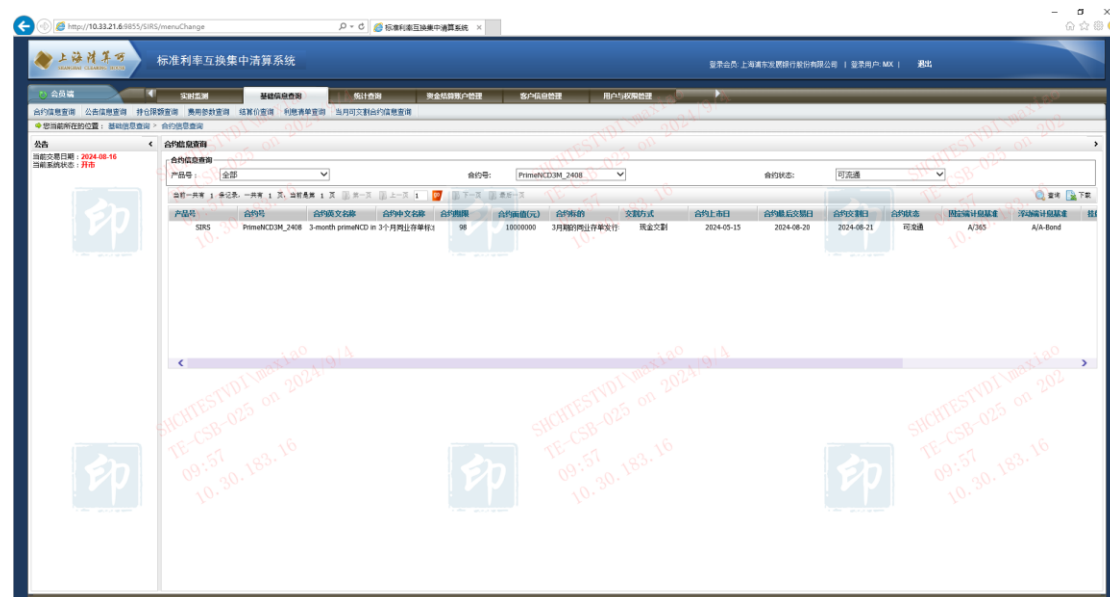
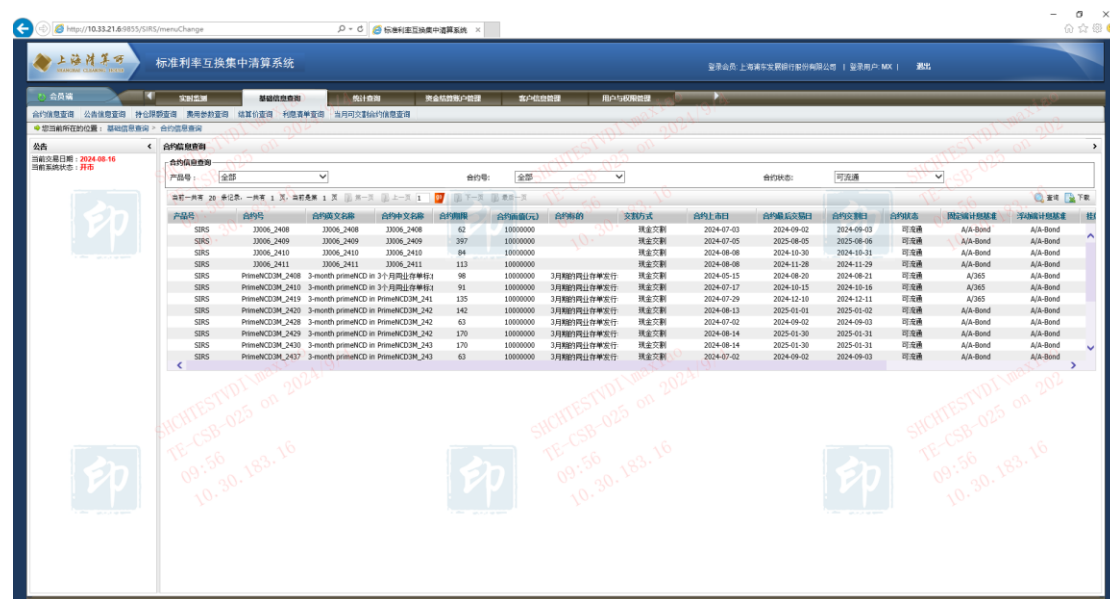
点击明细查询键，即可查询实时风控明细。

4 基础信息查询

4.1 合约信息查询

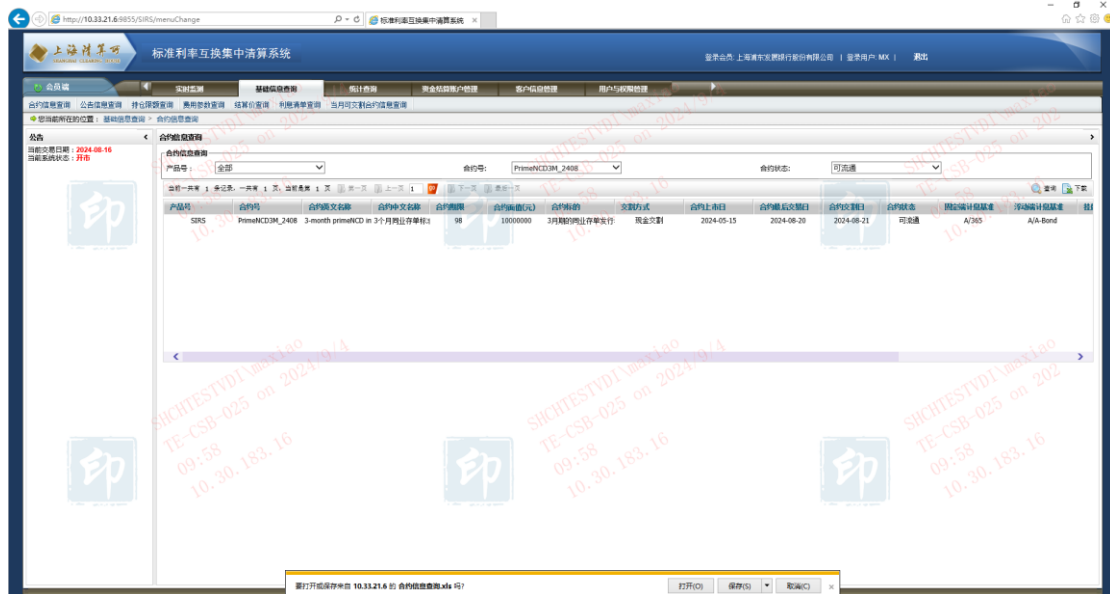
1. 查询：

选择筛选条件点击查询，可查询合约信息。支持产品号与合约号、合约状态下拉框条件选择查询。



2. 下载:

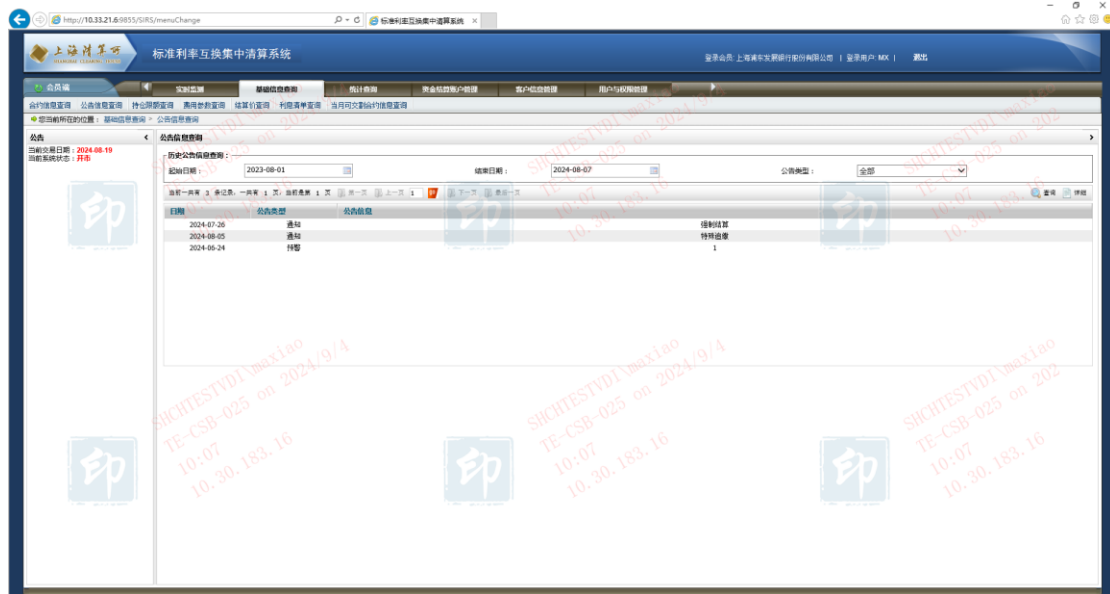
点击下载键即可下载查询出的合约信息:



4.2 公告信息查询

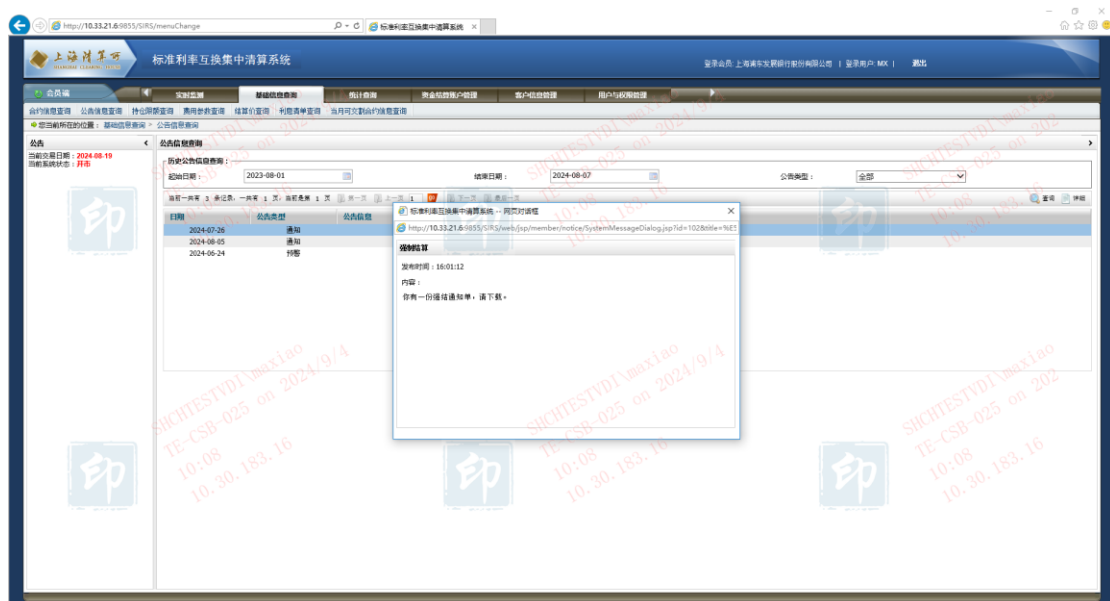
1. 查询:

输入需要查询的开始日期、结束日期、公告类型，点击查询，则可查询该时间段内公告信息。



2. 详细:

选择需要查看的公告信息条目，点击详细键，即可察看发布时间和内容。



4.3 持仓限额查询

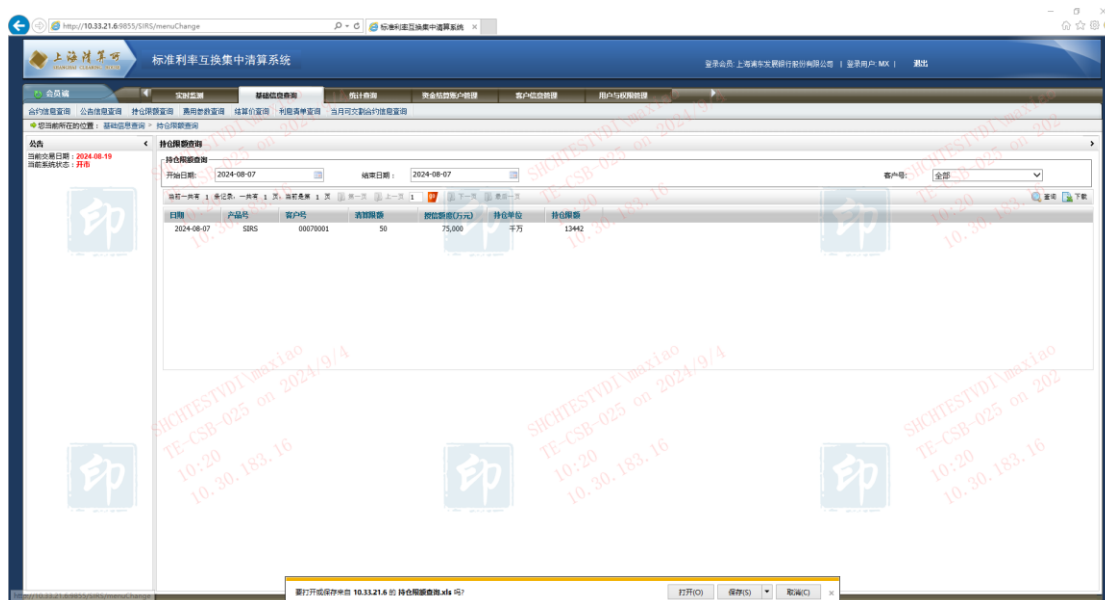
1. 查询:

输入需要查询的开始日期和结束日期，下拉框选择客户号，点击查询键，即可查询该时间段内客户的持仓限额。



2. 下载:

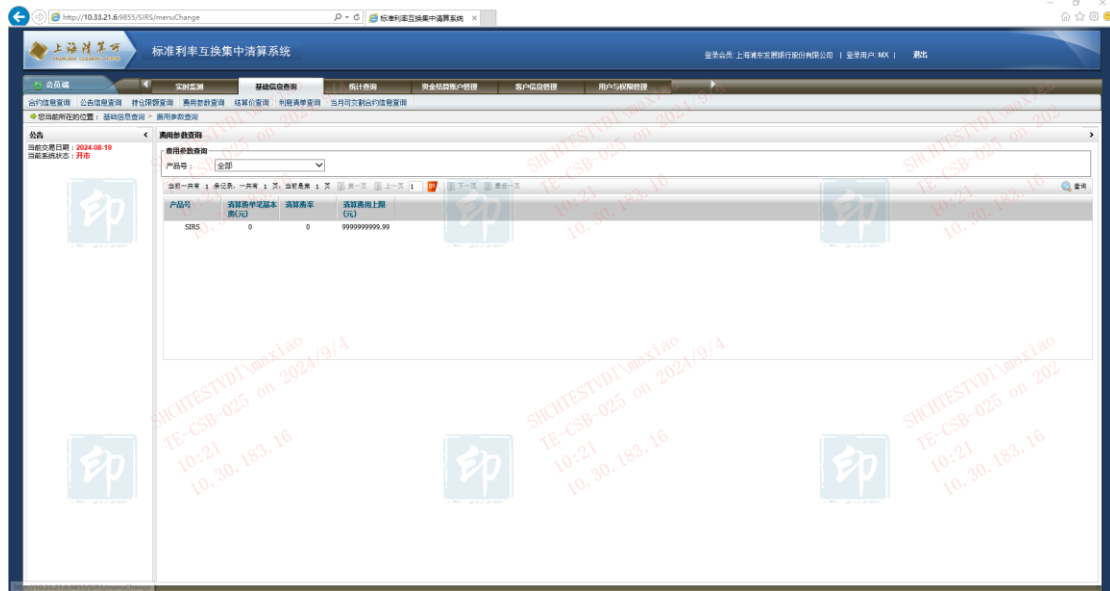
点击下载键即可下载查询出的持仓限额:



4.4 费用参数查询

1. 查询：

下拉框选择产品号，点击查询，即可查询出对应产品的费用参数。



4.5 结算价查询

1. 查询：

选择需要查询的日期和产品号，点击查询键，即可查询出该日期各个合约的结算价。

日期	产品号	合约号	价格单位	结算价
2024-08-07	SRIS	2006_2408	%	1.8000
2024-08-07	SRIS	2006_2409	%	1.8000
2024-08-07	SRIS	2006_2410	%	2.1500
2024-08-07	SRIS	2006_2411	%	2.1500
2024-08-07	SRIS	PrimaNCDSM_2408	%	1.9000
2024-08-07	SRIS	PrimaNCDSM_2410	%	1.9000
2024-08-07	SRIS	R013M_2410	%	1.9000
2024-08-07	SRIS	PrimaNCDSM_2408	%	3.7131
2024-08-07	SRIS	PrimaNCDSM_2437	%	2.5872
2024-08-07	SRIS	PrimaNCDSM_2438	%	3.7131
2024-08-07	SRIS	PrimaNCDSM_2502	%	1.9000
2024-08-07	SRIS	PrimaNCDSM_2506	%	1.9000
2024-08-07	SRIS	R013M_2408	%	1.9000

2. 下载:

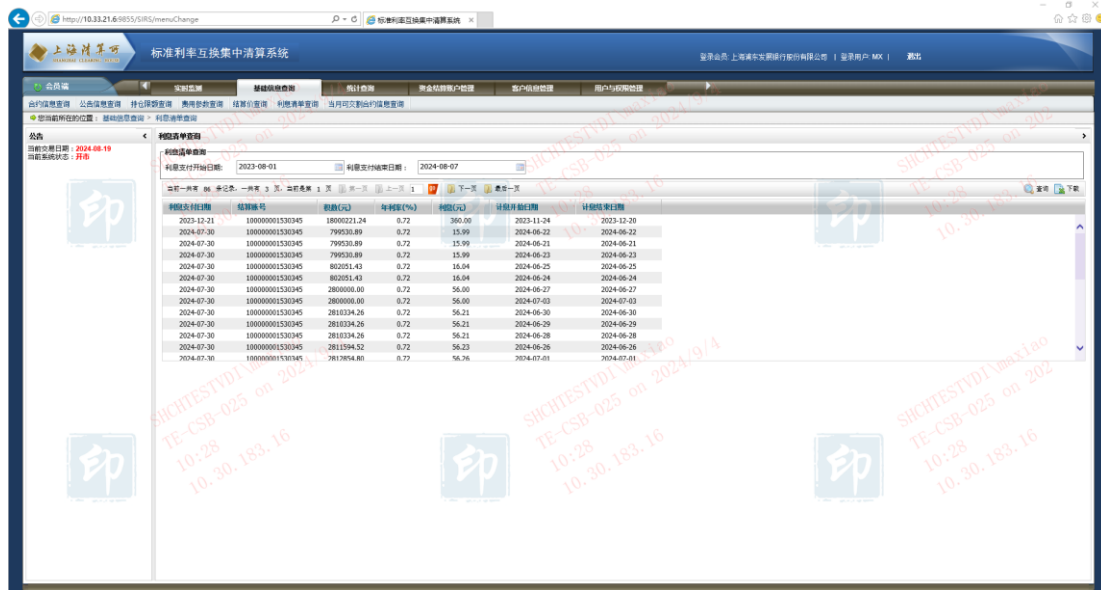
点击下载键即可下载查询出的结算价:

4.6 利息清单查询

1. 查询:

选择需要查询的利息支付开始日期和结束日期, 点击查询键, 即

可查询出利息清单。



标准利率互换集中清算系统

当前交易日期: 2024-08-19
当前系统状态: 开市

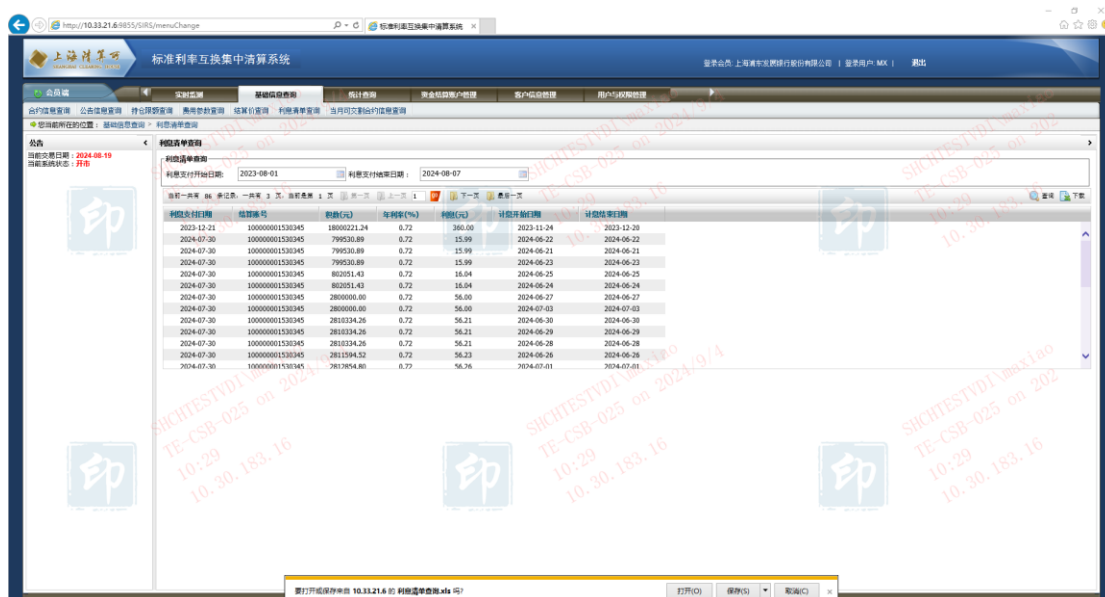
利息清单查询

利息支付开始日期: 2023-08-01
利息支付结束日期: 2024-08-07

利息支付日期	结算编号	数量(元)	年利率(%)	利息(元)	计划开始日期	计划结束日期
2023-12-21	100000001530345	18000221.24	0.72	380.00	2023-11-24	2023-12-20
2024-07-30	100000001530345	799530.89	0.72	15.99	2024-06-22	2024-06-22
2024-07-30	100000001530345	799530.89	0.72	15.99	2024-06-21	2024-06-21
2024-07-30	100000001530345	799530.89	0.72	15.99	2024-06-23	2024-06-23
2024-07-30	100000001530345	802051.43	0.72	16.04	2024-06-25	2024-06-25
2024-07-30	100000001530345	802051.43	0.72	16.04	2024-06-24	2024-06-24
2024-07-30	100000001530345	2800000.00	0.72	56.00	2024-06-27	2024-06-27
2024-07-30	100000001530345	2800000.00	0.72	56.00	2024-07-03	2024-07-03
2024-07-30	100000001530345	2810334.26	0.72	56.21	2024-06-30	2024-06-30
2024-07-30	100000001530345	2810334.26	0.72	56.21	2024-06-29	2024-06-29
2024-07-30	100000001530345	2810334.26	0.72	56.21	2024-06-28	2024-06-28
2024-07-30	100000001530345	2811994.52	0.72	56.23	2024-06-26	2024-06-26
2024-07-30	100000001530345	2817854.80	0.72	56.36	2024-07-01	2024-07-01

2. 下载:

点击下载键即可下载查询出的利息清单:



标准利率互换集中清算系统

当前交易日期: 2024-08-19
当前系统状态: 开市

利息清单查询

利息支付开始日期: 2023-08-01
利息支付结束日期: 2024-08-07

利息支付日期	结算编号	数量(元)	年利率(%)	利息(元)	计划开始日期	计划结束日期
2023-12-21	100000001530345	18000221.24	0.72	380.00	2023-11-24	2023-12-20
2024-07-30	100000001530345	799530.89	0.72	15.99	2024-06-22	2024-06-22
2024-07-30	100000001530345	799530.89	0.72	15.99	2024-06-21	2024-06-21
2024-07-30	100000001530345	799530.89	0.72	15.99	2024-06-23	2024-06-23
2024-07-30	100000001530345	802051.43	0.72	16.04	2024-06-25	2024-06-25
2024-07-30	100000001530345	802051.43	0.72	16.04	2024-06-24	2024-06-24
2024-07-30	100000001530345	2800000.00	0.72	56.00	2024-06-27	2024-06-27
2024-07-30	100000001530345	2800000.00	0.72	56.00	2024-07-03	2024-07-03
2024-07-30	100000001530345	2810334.26	0.72	56.21	2024-06-30	2024-06-30
2024-07-30	100000001530345	2810334.26	0.72	56.21	2024-06-29	2024-06-29
2024-07-30	100000001530345	2810334.26	0.72	56.21	2024-06-28	2024-06-28
2024-07-30	100000001530345	2811994.52	0.72	56.23	2024-06-26	2024-06-26
2024-07-30	100000001530345	2817854.80	0.72	56.36	2024-07-01	2024-07-01

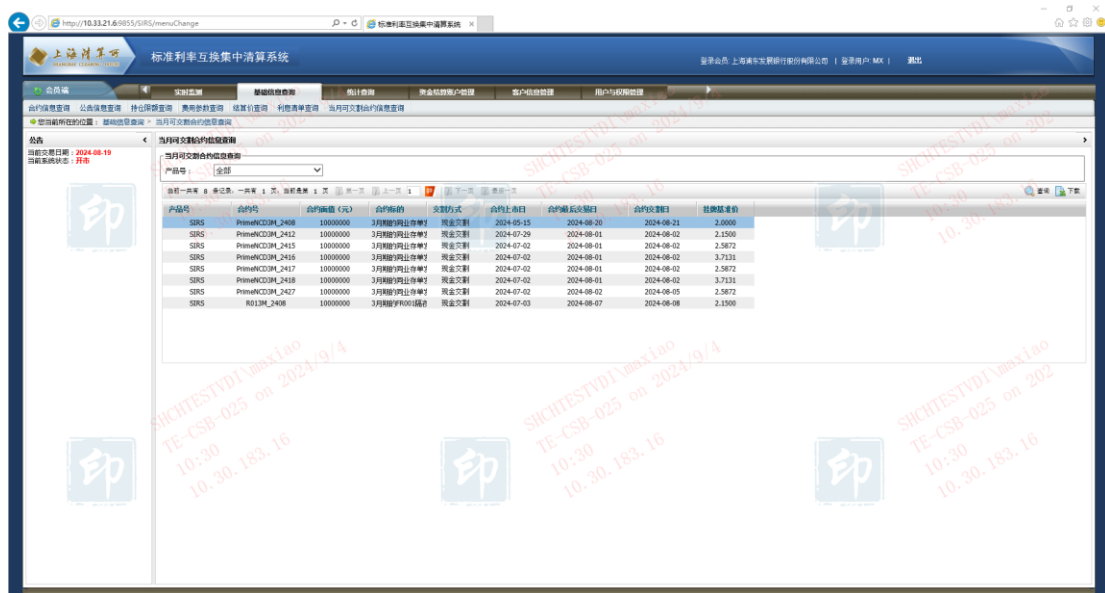
要打印或保存当前 10.33.21.6 的 利息清单数据吗?

打印(P) 保存(S) 取消(C)

4.7 当月可交割合约信息查询

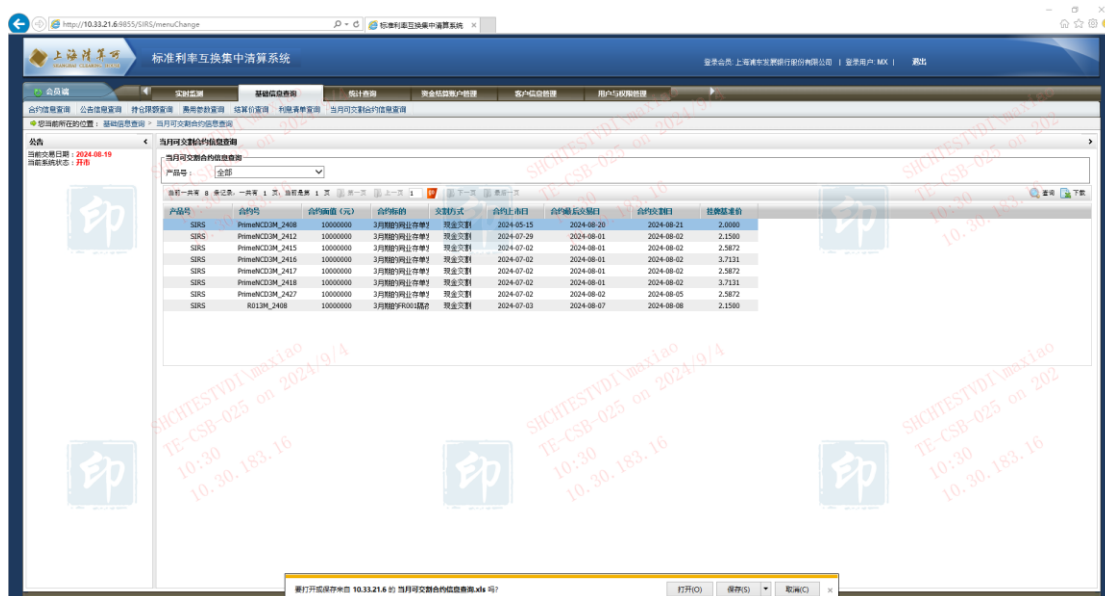
1. 查询:

选择需要查询的产品号，点击查询键，即可查询出当月可交割合约信息。



2. 下载:

点击下载键即可下载查询出的当月可交割合约信息:



5 统计查询

5.1 交易数据查询

1. 查询：

输入需要查询的开始日期、结束日期，下拉框选择产品号，即可查询出相应的交易数据记录。



客户号	客户中文名称	交易日期	成交行	产品号	合约号	产品名称	单位	数量	金额	买卖方向
00070001	浦发银行	IRS20231128700001	2023-11-28	SIRS	PrimeKCD3M_2403	%	2.8433	4万	1	卖
00070001	浦发银行	IRS20231128700002	2023-11-28	SIRS	PrimeKCD3M_2402	%	2.6300	4万	1	卖
00070001	浦发银行	IRS20231128700004	2023-11-28	SIRS	PrimeKCD3M_2402	%	2.6300	4万	1	买
00070001	浦发银行	IRS20231128700012	2023-11-28	SIRS	PrimeKCD3M_2403	%	2.6400	4万	1	买
00070001	浦发银行	IRS20231129700001	2023-11-29	SIRS	PrimeKCD3M_2401	%	2.8180	4万	1	买
00070001	浦发银行	IRS20231129700003	2023-11-29	SIRS	PrimeKCD3M_2401	%	2.8150	4万	1	卖
00070001	浦发银行	IRS20231201700003	2023-12-01	SIRS	PrimeKCD3M_2403	%	2.6000	4万	1	卖
00070001	浦发银行	IRS20231201700004	2023-12-01	SIRS	PrimeKCD3M_2401	%	2.6030	4万	1	买
00070001	浦发银行	IRS20231201700005	2023-12-01	SIRS	PrimeKCD3M_2403	%	2.6000	4万	1	买
00070001	浦发银行	IRS20231201700006	2023-12-01	SIRS	PrimeKCD3M_2401	%	2.6029	4万	1	卖
00070001	浦发银行	IRS20231225700004	2023-12-25	SIRS	PrimeKCD3M_2402	%	2.5400	4万	1	卖
00070001	浦发银行	IRS20231225700005	2023-12-25	SIRS	PrimeKCD3M_2402	%	2.5400	4万	1	买

2. 下载：

点击下载键即可下载查询出的交易数据：

客户号	客户中文名称	交易编号	成交日期	产品名	合约号	产品的单位	价格	产品持仓单位	数量	交易方向
00070001	浦发银行	HS20231128700001	2023-11-28	IRS	PrimeKCDM_2403	%	2.6433	千万	1	卖
00070001	浦发银行	HS20231128700002	2023-11-28	IRS	PrimeKCDM_2402	%	2.6300	千万	1	买
00070001	浦发银行	HS20231128700004	2023-11-28	IRS	PrimeKCDM_2402	%	2.6300	千万	1	买
00070001	浦发银行	HS20231128700012	2023-11-28	IRS	PrimeKCDM_2403	%	2.6400	千万	1	买
00070001	浦发银行	HS20231129700001	2023-11-29	IRS	PrimeKCDM_2401	%	2.6180	千万	1	买
00070001	浦发银行	HS20231129700003	2023-11-29	IRS	PrimeKCDM_2401	%	2.6150	千万	1	买
00070001	浦发银行	HS20231201700003	2023-12-01	IRS	PrimeKCDM_2403	%	2.6000	千万	1	买
00070001	浦发银行	HS20231201700004	2023-12-01	IRS	PrimeKCDM_2401	%	2.6030	千万	1	买
00070001	浦发银行	HS20231201700005	2023-12-01	IRS	PrimeKCDM_2403	%	2.6000	千万	1	买
00070001	浦发银行	HS20231201700006	2023-12-01	IRS	PrimeKCDM_2401	%	2.6020	千万	1	买
00070001	浦发银行	HS20231225700004	2023-12-25	IRS	PrimeKCDM_2402	%	2.5400	千万	1	买
00070001	浦发银行	HS20231225700005	2023-12-25	IRS	PrimeKCDM_2402	%	2.5400	千万	1	买

5.2 历史持仓查询

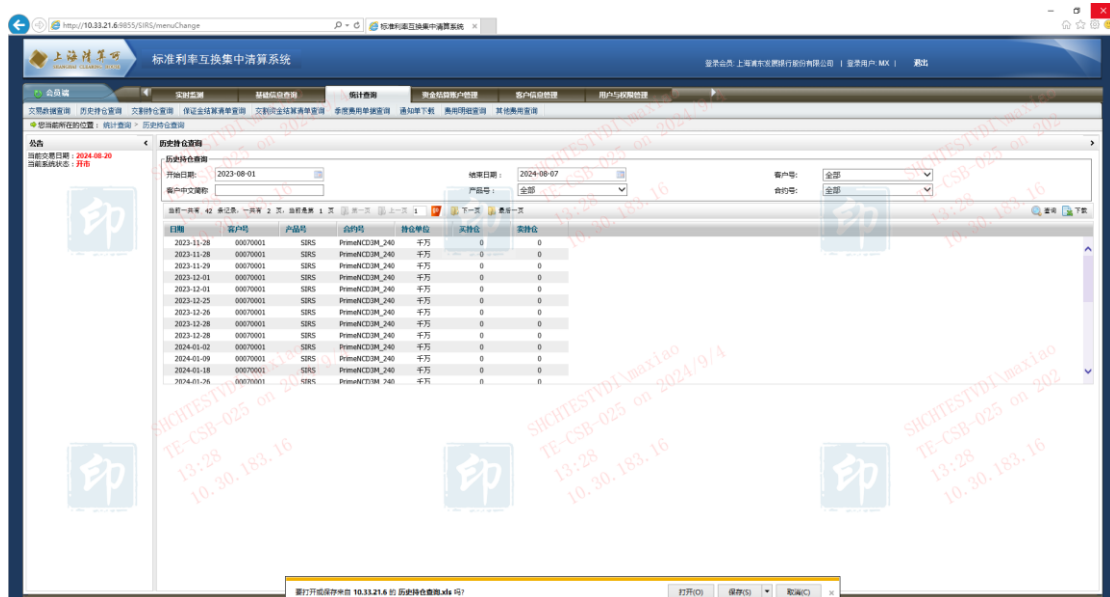
1. 查询：

选择需要查询的开始日期、结束日期，下拉框选择客户号、合约号和产品号，输入客户中文简称，点击查询键，即可查询出相应的历史持仓记录。

日期	客户号	产品名	合约号	持仓单位	实际持仓
2023-11-28	00070001	IRS	PrimeKCDM_240	千万	0
2023-11-28	00070001	IRS	PrimeKCDM_240	千万	0
2023-11-29	00070001	IRS	PrimeKCDM_240	千万	0
2023-12-01	00070001	IRS	PrimeKCDM_240	千万	0
2023-12-01	00070001	IRS	PrimeKCDM_240	千万	0
2023-12-25	00070001	IRS	PrimeKCDM_240	千万	0
2023-12-26	00070001	IRS	PrimeKCDM_240	千万	0
2023-12-28	00070001	IRS	PrimeKCDM_240	千万	0
2024-01-02	00070001	IRS	PrimeKCDM_240	千万	0
2024-01-09	00070001	IRS	PrimeKCDM_240	千万	0
2024-01-18	00070001	IRS	PrimeKCDM_240	千万	0
2024-01-26	00070001	IRS	PrimeKCDM_240	千万	0

2. 下载：

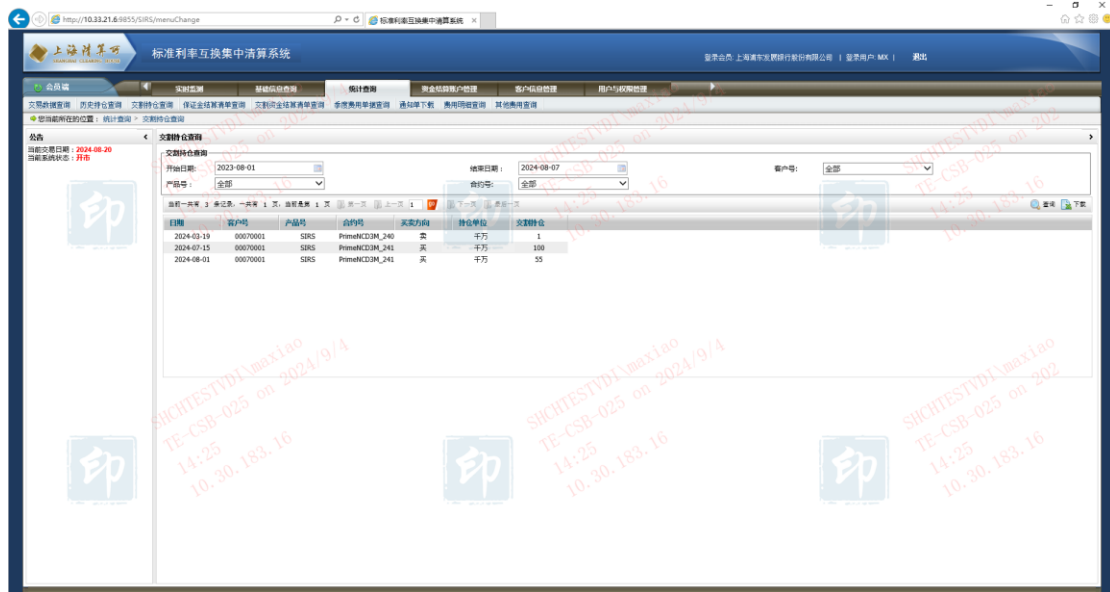
点击下载键即可下载查询出的交易数据：



5.3 交割持仓查询

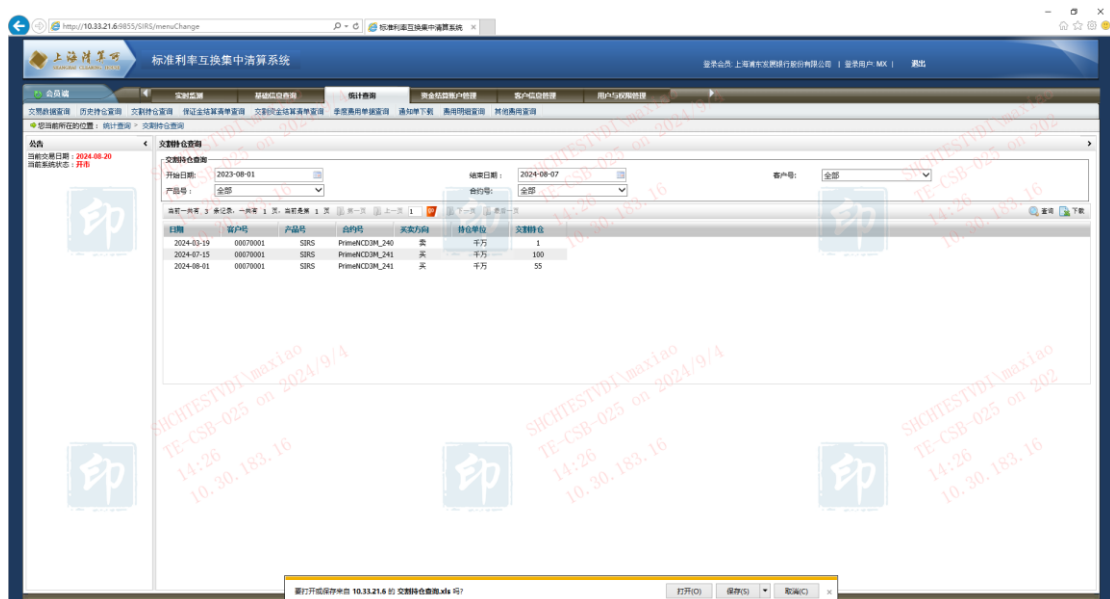
1. 查询：

选择需要查询的开始日期、结束日期，下拉框选择产品号、合约号和客户号，即可查询出相应的交割持仓记录。



2. 下载:

点击下载键即可下载查询出的交割持仓数据:



5.4 保证金结算清单查询

1. 查询:

选择需要查询的开始日期、结束日期, 点击查询键, 即可查询出

相应的保证金结算清单。



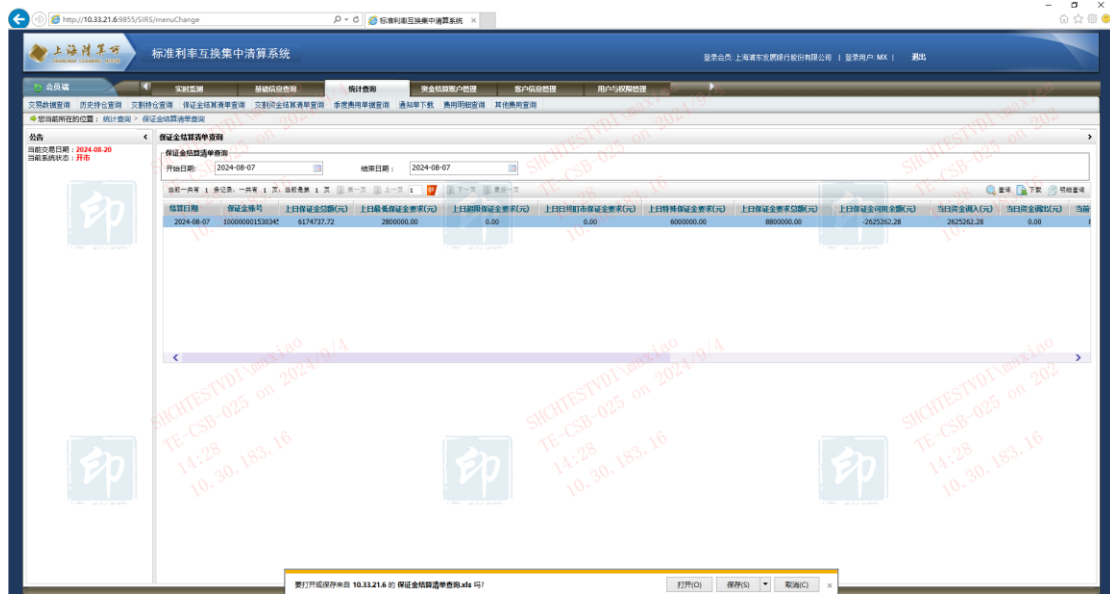
2. 明细查询:

选择需要查看的保证金结算清单条目，点击明细查询键，即可查询对应的保证金结算清单的详细内容。



3. 下载:

点击下载键即可下载查询出的保证金结算清单:



5.5 交割资金结算清单查询

1. 查询：

选择需要查询的开始日期、结束日期，下拉框选择产品号、合约号和客户号，输入客户中文简称，即可查询出相应的交割资金结算清单记录。



2. 下载：

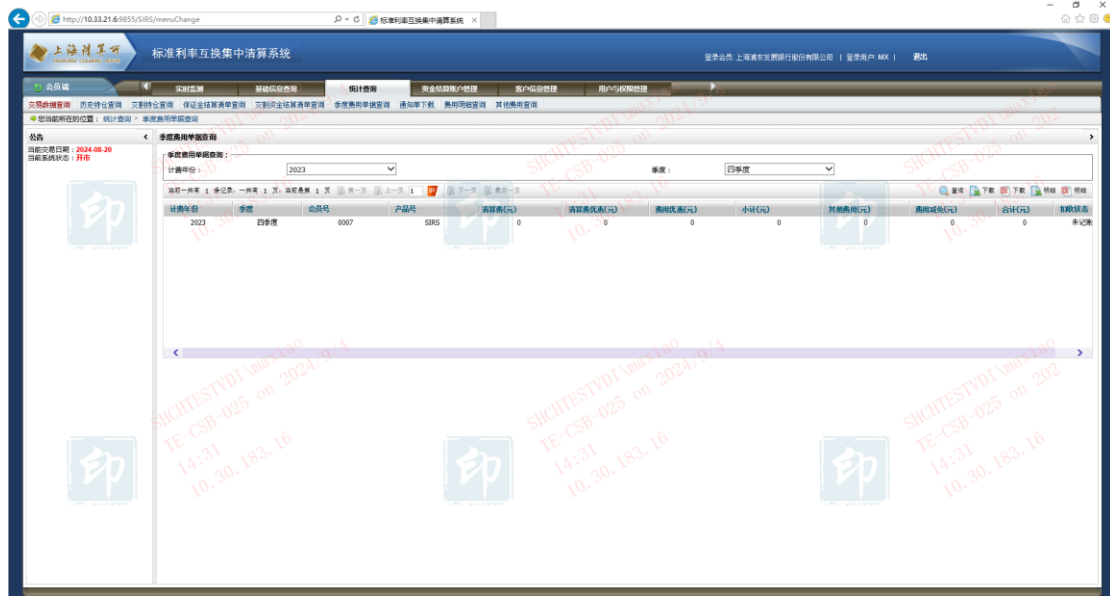
点击下载键即可下载查询出的交割资金结算清单：



5.6 季度费用单据查询

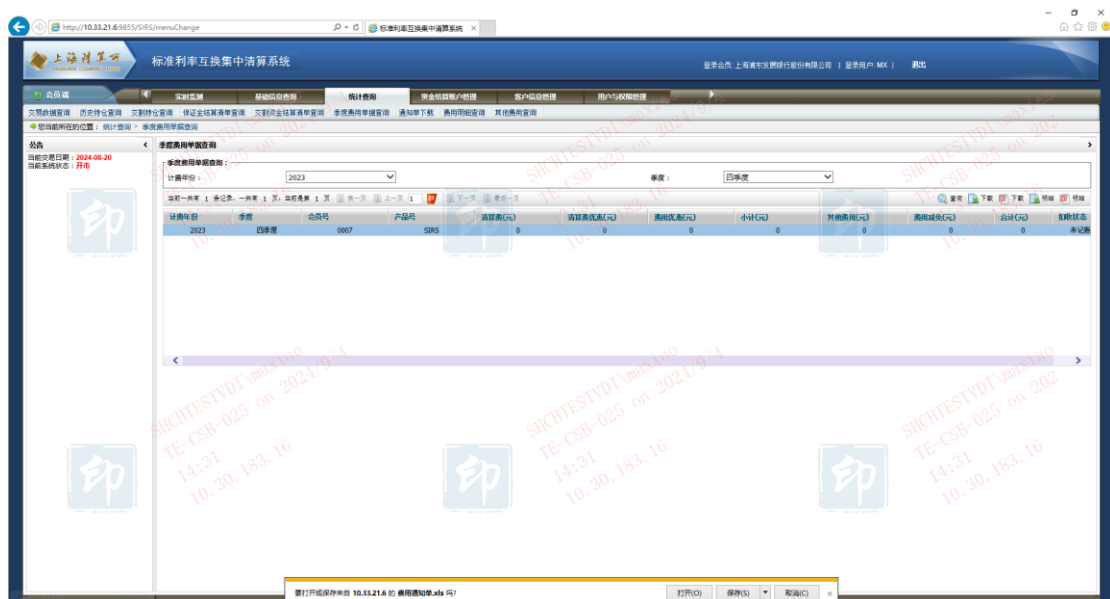
1. 查询：

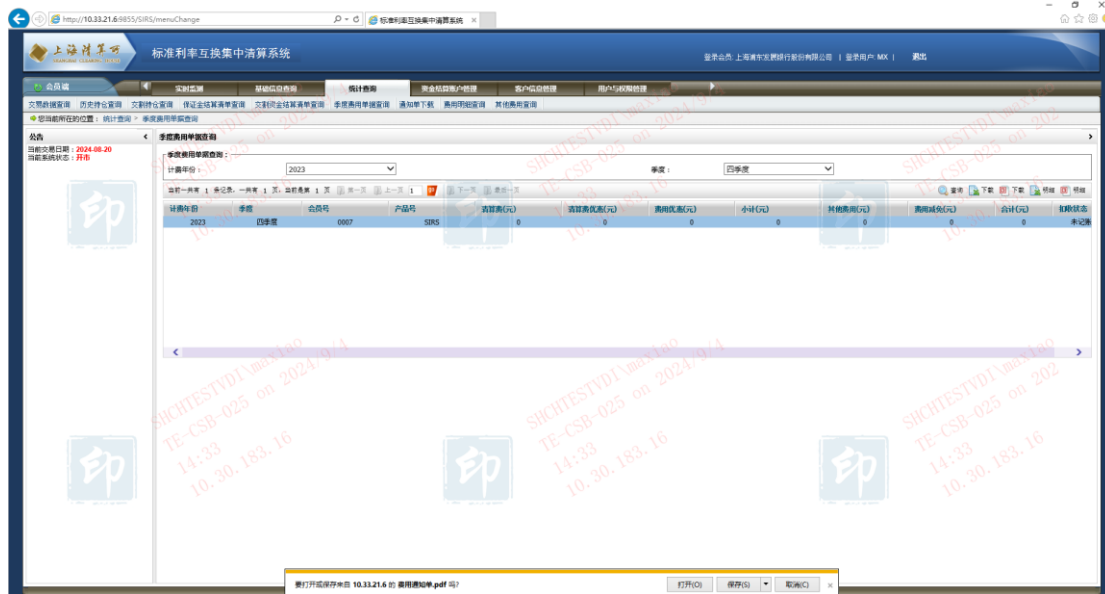
下拉框选择需要查询的计费年份和季度，即可查询出相应的季度费用记录。



2. 下载:

选择季度的费用记录条目，即可下载相应格式的季度费用清单、明细。

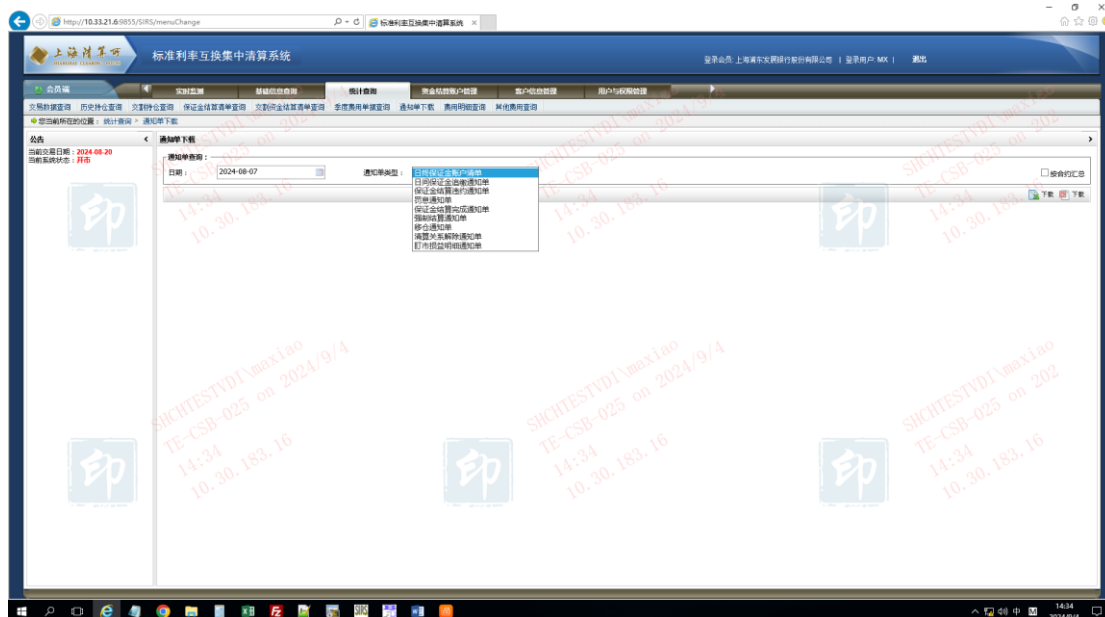


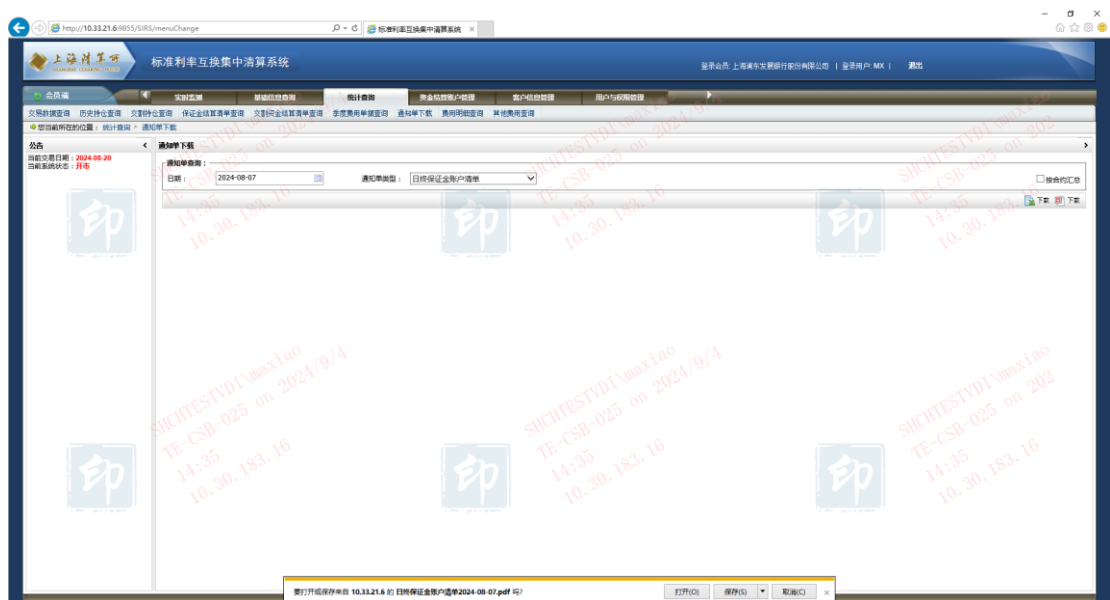
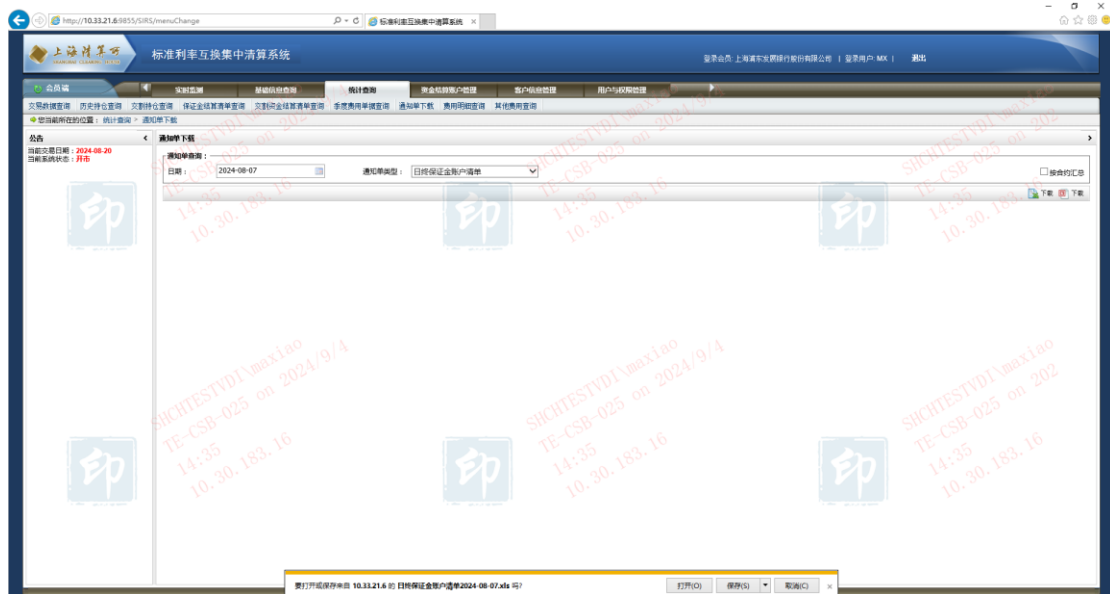


5.7 通知单下载

1. 下载：

下拉框选择需要下载的通知单类型和日期，点击下载，即可下载对应日期和通知单。

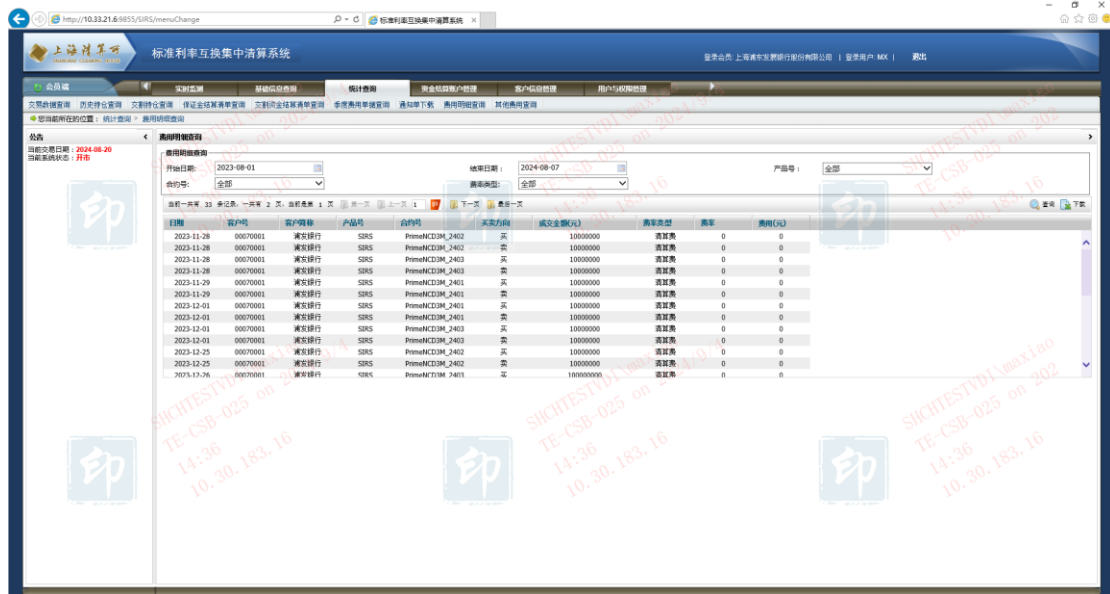




5.8 费用明细查询

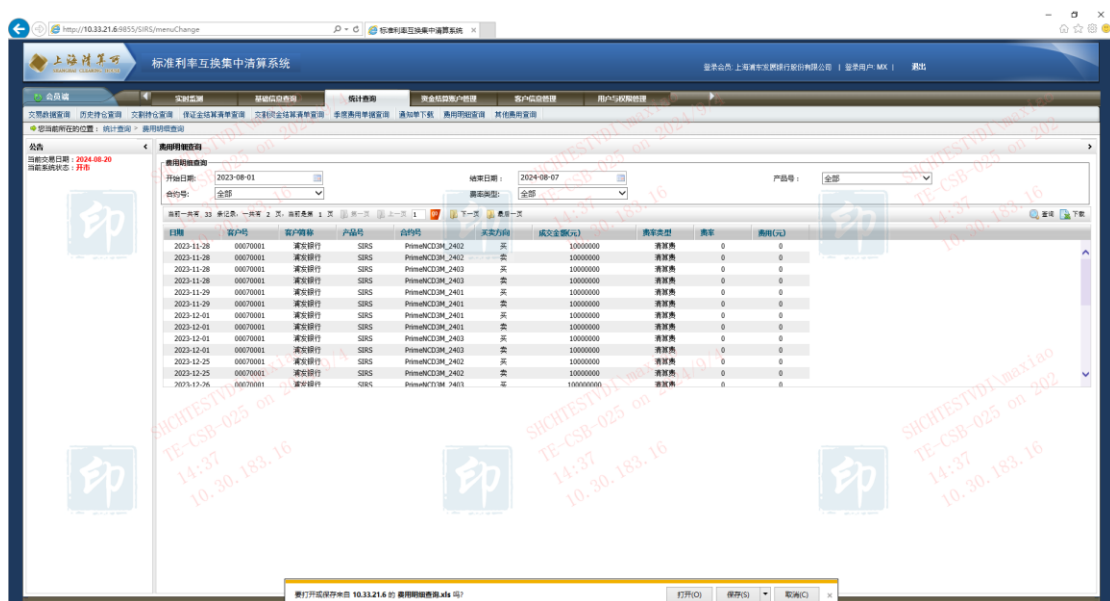
1. 查询：

选择需要查询的开始日期和结束日期，下拉框选择合约号和产品号，点击查询键，即可查询出相应时间段的费用明细。



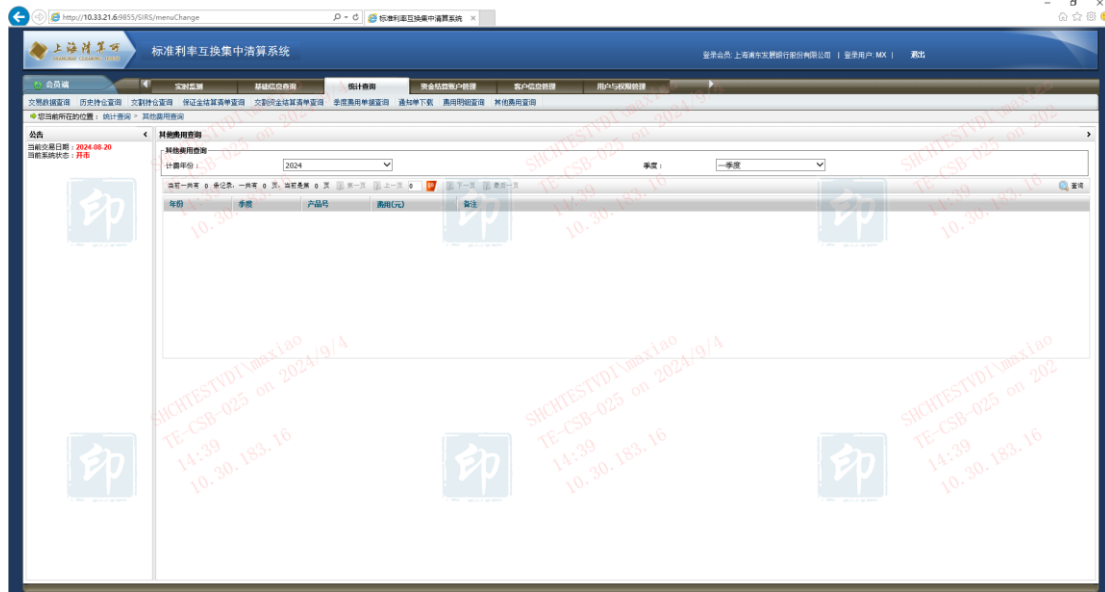
2. 下载:

点击下载键即可下载查询出的清算费明细:



5.9 其他费用查询

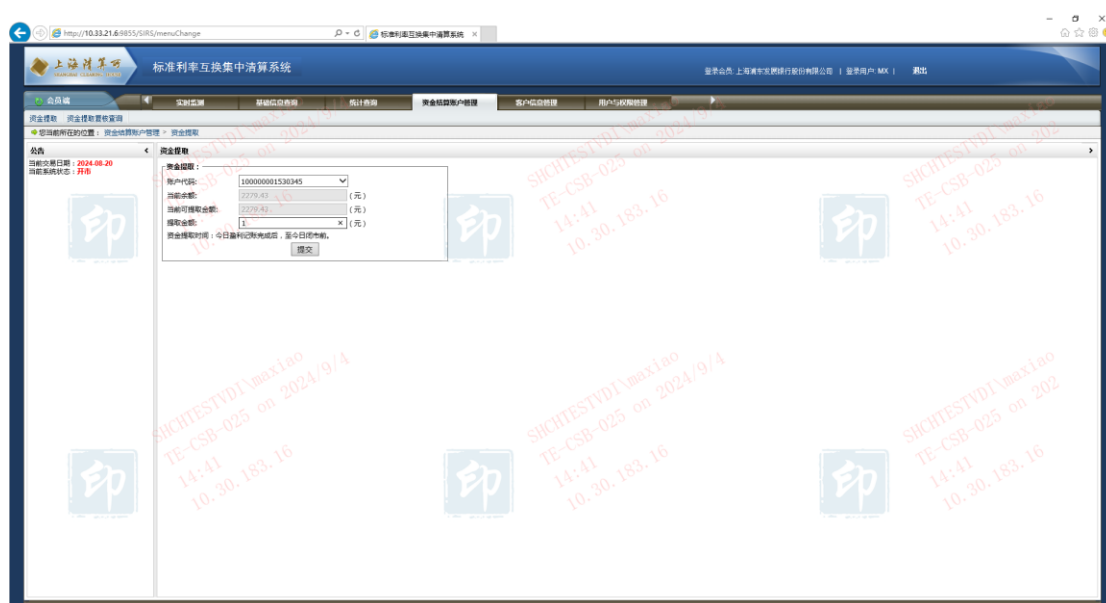
点击查询键, 即可查询相应日期的其他费用信息。



6 资金结算账户管理

6.1 资金提取

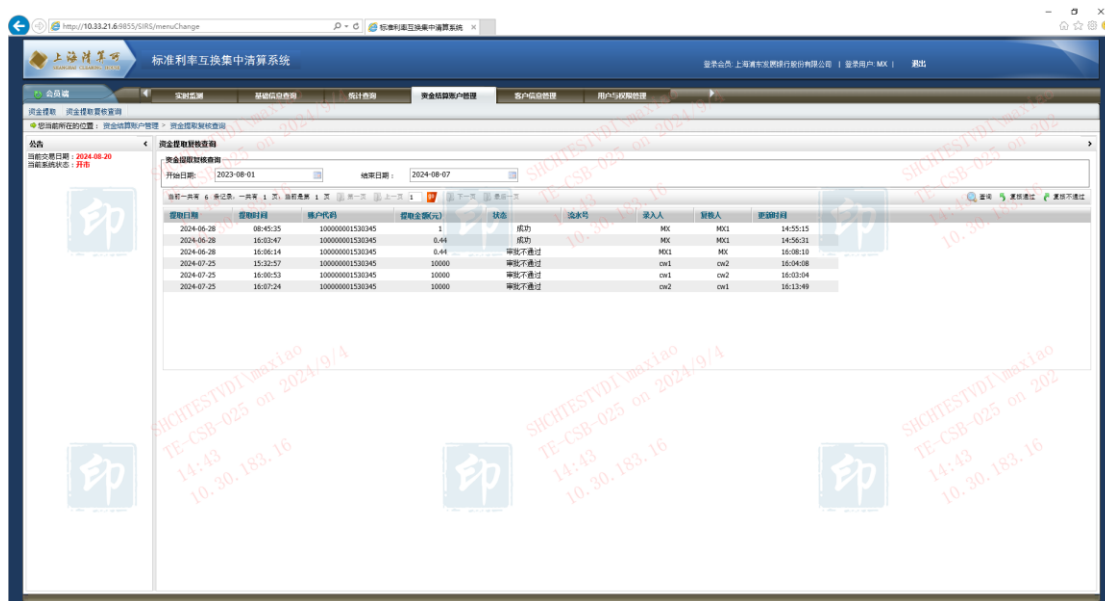
下拉框选择保证金帐号，系统自动显示当前余额，输入提取金额，点击提交键，界面提示资金提取需复核。第二名操作员在资金提取查询界面选中该条，点击复核通过完成。



6.2 资金提取复核查询

1. 查询：

选择需要查询的开始日期、结束日期，点击查询键，即可查询出相应的资金提取记录。



2. 复核通过:

选择需复核的记录条目，点击复核确认通过，（录入人不能与复核人相同），提示申请发送成功。等待资金系统进行后续处理。

