

附件 2

上海清算所信用违约互换集中清算报价详细要求

一、集中清算报价参考实体

报价参考实体分为必报参考实体和选报参考实体，具体参见《上海清算所信用违约互换集中清算报价参考实体备选清单》。

必报参考实体涵盖所有上海清算所信用违约互换集中清算的可清算参考实体。选报参考实体按两档分别选择参考实体进行双边报价。第一档应选择不少于 9 个参考实体，其中 3 个行业（综合类、公用事业和交通运输）中每个行业不少于 2 个参考实体，其余行业中应不少于 3 个行业且每个行业不少于 1 个参考实体。第二档应选择不少于 10 个参考实体，其中 3 个行业（交通运输、建筑装饰和房地产）中每个行业不少于 2 个参考实体，其余行业中不少于 4 个行业且每个行业不少于 1 个参考实体。

二、报价合约相关要素

必报参考实体的报价合约期限为 0.5 年、1 年、2 年、3 年、4 年和 5 年。

选报参考实体的报价期限为 0.5 年、1 年、2 年、3 年。

报价的合约要素参见附表。

三、报价窗口

每日报价窗口为 8:30-15:00。上海清算所信用违约互换集中清算报价团成员应在每日报价窗口内提供 1 次价格信息。

四、更新

上海清算所将根据业务发展实际情况定期或不定期更新调整上述报价要求。

附表：上海清算所信用违约互换集中清算报价要素表