

附件 4

银行间市场清算所股份有限公司集中清算
业务指南（修订部分）

A-2

V202603

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; 需与交易中心、上海清算所记录的信息保持一致)		
	(英文; 需与交易中心、上海清算所记录的信息保持一致)		
申请机构简称	(中文; 需与交易中心、上海清算所记录的信息保持一致)		
	(英文; 需与交易中心、上海清算所记录的信息保持一致)		
清算会员账号 (7 位码)			
全国银行间同业拆 借中心会员代码 (21 位码)			
注册地址			
注册资本	(万元)	法定代表人	
统一社会信用代码 (境内机构)		邮政编码	
申请材料联系人		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	☐ 特殊账户	☐ 其他特殊机构	

	☐ 存款类银行业金融机构	☐ 国有大型商业银行 ☐ 股份制商业银行 ☐ 城市商业银行 ☐ 住房储蓄银行 ☐ 民营银行 ☐ 农村商业银行 ☐ 农村合作银行 ☐ 村镇银行 ☐ 外资 法人银行 ☐ 外国及港澳台银行境内分行 ☐ 城市信 用社 ☐ 农村信用社 ☐ 农村资金互助社 ☐ 专事县 域三农贷款的贷款公司 ☐ 其他_____
	☐ 政策性银行及国家开发银行	☐ 政策性银行 ☐ 开发性金融机构
	☐ 非银行金融机构	☐ 企业集团财务公司 ☐ 信托公司 ☐ 金融租赁公司 ☐ 融资租赁公司 ☐ 金融资产管理公司 ☐ 汽车金融公 司 ☐ 金融租赁公司 ☐ 消费金融公司 ☐ 特批机构 ☐ 信用评级公司 ☐ 信用增进机构 ☐ 其他_____
	☐ 证券类金融机构	☐ 证券公司 ☐ 证券公司子公司 ☐ 期货公司 ☐ 期货 公司子公司 ☐ 其他证券类金融机构_____
	☐ 基金管理公司	☐ 公募证券投资基金管理公司 ☐ 公募证券投资基金管 理公司子公司 ☐ 其他基金管理公司_____
	☐ 保险类金融机构	☐ 保险集团（控股）公司 ☐ 财产保险公司 ☐ 人身保 险公司 ☐ 保险资产管理公司 ☐ 保险经纪公司 ☐ 其 他保险类金融机构_____
	☐ 非金融机构法人	☐ 非金融企业 ☐ 其他_____
	☐ 境内非法人产品	☐ 银行理财产品 ☐ 信托公司资管产品 ☐ 公开募集证 券投资基金 ☐ 证券公司及其子公司资管产品 ☐ 基金 管理公司及其子公司专户 ☐ 期货公司及其子公司资 管产品 ☐ 私募投资基金 ☐ 保险资管产品 ☐ 金融资产 投资公司资管产品 ☐ 其他资管产品 ☐ 其他_____

	☐ 境外机构	☐ 境外政府类机构 ☐ 境外银行业金融机构 ☐ 境外证券公司 ☐ 境外基金公司 ☐ 境外保险公司 ☐ 境外养老基金（法人） ☐ 境外机构其他中长期法人投资者 ☐ 境外非金融企业 ☐ 其他_____				
	☐ 境外非法人产品	☐ 境外商业银行非法人产品 ☐ 境外保险公司非法人产品 ☐ 境外基金管理公司非法人产品 ☐ 其他_____				
金融许可证号码	（包括 ☐ 金融业务许可证 ☐ 经营证券业务许可证 ☐ 基金管理资格证书 ☐ 保险公司法入许可证 ☐ 保险资产管理公司法入许可证 ☐ 其它）					
控股股东及控股比例						
实际控制人						
申请机构高管人员信息						
姓名	职务	电话	手机	传真	Email	
银行类申请机构财务信息						
序号	指标	20XX年/末	20XX年/末	20XX年/末	最新报告期 （20XX年第X季报或半年报）	计算公式/口径
1	资本充足率	%	%	%	%	资本净额/风险加权资产总额×100%，合并报表口径

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%，合并报表口径
3	<u>资本积累杠 杆率</u>	%	%	%	%	<u>一级资本/调整后表 内外资产余额× 100%，合并报表口径</u> <u>（年末所有者权益=</u> <u>年初所有者权益）/年</u> <u>初所有者权益×</u> <u>100%，合并报表口径</u>
4	人民币超额 准备金比例	%	%	%	%	人民币超额准备金/ 各项存款×100%， 法人口径
54	流动性比例	%	%	%	%	流动性资产余额/流 动性负债余额× 100%，合并报表口径
5	<u>流动性覆盖 率（或优质 流动性资产 充足率）</u>	%	%	%	%	<u>合格优质流动性资产/</u> <u>未来30天现金净流出量</u> <u>×100%，适用于资产规</u> <u>模不小于2000亿的银</u> <u>行；</u> <u>或优质流动性资产/短</u> <u>期现金净流出×100%，</u> <u>适用于资产规模小于</u> <u>2000亿的银行</u> <u>合并报表口径</u>
6	<u>净稳定资金 比例（资产 规模≥2000 亿银行填 写）存贷款 比例</u>	%	%	%	%	<u>可用的稳定资金/所</u> <u>需的稳定资金×</u> <u>100%，合并报表口径</u> <u>各项贷款/各项存款</u> <u>×100%，合并报表口</u> <u>径</u>

7	拆入资金比例	%	%	%	%	拆入资金/各项存款 ×100%，合并报表口径
87	不良贷款比例	%	%	%	%	不良贷款余额/发放 贷款和垫款总额× 100%，合并报表口径
98	拨备覆盖率	%	%	%	%	贷款减值准备/不良 贷款余额×100%，合 并报表口径
109	正常类贷款 迁徙率	%	%	%	%	（年初正常类贷款向下 迁徙金额+年初为正常 类贷款，报告期内转为 不良贷款并完成不良贷 款处置的金额）/年初正 常类贷款余额×100%， 法人口径
140	关注类贷款 迁徙率	%	%	%	%	（年初关注类贷款向下 迁徙金额+年初为关注 类贷款，报告期内转为 不良贷款并完成不良贷 款处置的金额）/年初关 注类贷款余额×100%， 法人口径
121	平均净资产 收益率	%	%	%	%	净利润/期初期末净 资产平均余额× 100%，合并报表口径
132	平均总资产 收益率	%	%	%	%	净利润/期初期末总 资产平均余额× 100%，合并报表口径

143	成本收入比例	%	%	%	%	业务及管理费/营业收入×100%，合并报表口径
15	注册资本—(股本)—	亿元	亿元	亿元	亿元	合并报表口径
164	资产总额	亿元	亿元	亿元	亿元	合并报表口径
175	净资产	亿元	亿元	亿元	亿元	
186	营业收入	亿元	亿元	亿元	亿元	
197	净利润	亿元	亿元	亿元	亿元	
18	关注类贷款余额	亿元	亿元	亿元	亿元	
2019	发放贷款和垫款总额资本净额	亿元	亿元	亿元	亿元	
210	最大非同业单一客户贷款集中度净利差	%	%	%	%	非同业单一客户的贷款余额/资本净额×100%，合并报表口径 生息资产平均收益率=计息负债平均成本率，合并报表口径
221	最大十家客户贷款集中度流动性覆盖率（资产规模≥2000亿银行填写）	%	%	%	%	最大十家客户贷款余额/资本净额×100%，合并报表口径 优质流动性资产/未来30日内现金净流出×100%，合并报表口径
23	净稳定资金比例（资产	%	%	%	%	可用稳定资金/所需稳定资金×100%，合

	规模≥2000 亿银行填 写)					并报表口径
24	优质流动性 资产充足率 (资产规模 ≤2000 亿 银行填写)	%	%	%	%	优质流动性资产/短 期现金净流出× 100%，合并报表口径
25	同业融资占 比	%	%	%	%	(同业拆入+卖出回 购+同业存放+同业存 单)/负债总额× 100%，合并报表口径
262	逾期 90 天 以上贷款/ 不良贷款	%	%	%	%	逾期 90 天以上贷款 余额/不良贷款余额 ×100%，合并报表口 径
273	逾期贷款/ 不良贷款	%	%	%	%	逾期贷款余额/不良 贷款余额×100%，合 并报表口径

证券公司类申请机构财务信息

序号	指标	20XX年/末	20XX年/末	20XX年/末	最新报告期 (20XX年第 X 季报或半 年报)	计算公式/口径
1	风险覆盖率 (净资产/ 各项风险准 备之和)	%	%	%	%	净资产/各项风险资 本准备之和×100%， 法人口径法人口径
2	资本杠杆率	%	%	%	%	核心净资产/表内外

	净资产/净资产					资产总额×100%，法人口径
3	净资产比例 净资产/负债	%	%	%	%	净资产/净资产×100%，法人口径
4	净资产负债率 净资产/负债	%	%	%	%	净资产/负债×100%，法人口径
5	自营权益类证券及证券衍生品/净资产	%	%	%	%	自营权益类证券及证券衍生品/净资产×100%，法人口径
6	自营非权益类证券及其衍生品/净资产 自营固定收益类证券/净资产	%	%	%	%	自营非权益类证券及其衍生品/净资产×100%，法人口径
7	流动性覆盖率	%	%	%	%	优质流动性资产/未来30日内现金净流出×100%，法人口径
8	净稳定资金率	%	%	%	%	可用稳定资金/所需稳定资金×100%，法人口径
79	平均净资产收益率	%	%	%	%	净利润/期初和期末净资产平均余额×100%，合并报表口径
810	平均总资产收益率	%	%	%	%	净利润/期初和期末总资产平均余额×

						100%，合并报表口径
911	成本收入比 例未分配利 润率	%	%	%	%	管理费用/营业收入 ×100%，合并报表口 径未分配利润/净资 产×100%，合并报表 口径
10	注册资本 (股本)	亿元	亿元	亿元	亿元	合并报表口径
112	资产总额	亿元	亿元	亿元	亿元	合并报表口径
123	净资产	亿元	亿元	亿元	亿元	
134	净资本	亿元	亿元	亿元	亿元	法人口径
145	营业收入	亿元	亿元	亿元	亿元	合并报表口径
156	净利润	亿元	亿元	亿元	亿元	合并报表口径
16	核心净资本	亿元	亿元	亿元	亿元	法人口径
17	流动性覆盖 率	%	%	%	%	优质流动性资产/未 来30日内现金净流出 ×100%，法人口径
18	净稳定资金 率	%	%	%	%	可用稳定资金/所需 稳定资金×100%，法 人口径
19	资本杠杆率	%	%	%	%	核心净资本/表内外 资产总额×100%，法 人口径
财务公司类申请机构财务信息						
序号	指标	20XX年/末	20XX年/末	20XX年/末	最新报告期 (20XX年第 X季报或半 年报)	计算公式/口径

1	资本充足率	%	%	%	%	资本净额/风险加权资产总额×100%， <u>合并报表口径</u>
2	资产流动性比例	%	%	%	%	流动性资产/流动性负债×100%， <u>合并报表口径</u>
3	存贷款比例	%	%	%	%	各项贷款/各项存款×100%， <u>合并报表口径</u>
4	拆入资金比例	%	%	%	%	拆入资金/各项存款×100%， <u>合并报表口径</u>
5	不良贷款比例	%	%	%	%	不良贷款/各项贷款×100%， <u>合并报表口径</u>
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%， <u>合并报表口径</u>
7	不良资产率	%	%	%	%	不良信用风险资产/信用风险资产×100%， <u>合并报表口径</u>
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%， <u>合并报表口径</u>
9	担保比例	%	%	%	%	担保风险敞口/资本总额×100， <u>合并报表口径</u>
10	平均净资产	%	%	%	%	净利润/期初期末净

	收益率					资产平均余额× 100%，合并报表口径
11	平均总资产 收益率	%	%	%	%	净利润/期初期末总 资产平均余额× 100%，合并报表口径
12	投资比例	%	%	%	%	投资总额/资本净额 ×100%
13	注册资本 (股本)	亿元	亿元	亿元	亿元	合并报表口径
14	资产总额	亿元	亿元	亿元	亿元	
15	净资产	亿元	亿元	亿元	亿元	
16	营业收入	亿元	亿元	亿元	亿元	
17	净利润	亿元	亿元	亿元	亿元	
其他信息采集：						
1.最新三个完整会计年度及当前年度是否存在经营、财务指标不符合监管要求或受到监管关注的情况，如有，请具体说明。						
2.最新三个完整会计年度及当前年度贵单位及分支机构是否存在重大监管处罚（含机构及其高级管理人员，重大监管处罚包括较大数额的罚款或没收违法所得，限制业务范围，责令停止接受新业务，责令停业整顿，暂扣、吊销业务许可证，取消、撤销任职资格，禁止从业等），如有，请具体说明。						
3.最新三个完整会计年度及当前年度是否存在金融管理部门评级或资质评价变更，如有，请具体说明。						
☐ 银行或财务公司						
最新央行金融机构评级属于哪个区间：						
☐ 1-3 ☐ 4-5 ☐ 6-7 ☐ 8-D						

☐ 证券公司		
最新证监会证券公司分类属于哪个区间： ☐ AAA-A ☐ BBB-B ☐ CCC-C ☐ D ☐ E		
4.最新三个完整会计年度及当前年度是否存在被其他清算结算机构、交易所判定违约或被暂停、限制、取消资质等情况，如有，请具体说明。		
5.最新三个完整会计年度及当前年度是否存在金融市场重大交易、结算失败或其他违法违规情况（包括但不限于银行间市场），如有，请具体说明。		
6.最新三个完整会计年度及当前年度是否存在公司 <u>主要股东</u> 股权被质押、标记或冻结等受限情况，如有，请提供相关信息（包括受限股权的数量及占比）， <u>并说明上述情况对贵单位经营、融资、内部治理等方面是否产生不利影响，并说明是否根据法律法规及监管要求对股东行为进行管理，例如：对质押率超 50% 股东及其派出董事的相关表决权进行限制；是否存在借款余额超出其持有的股权净值的股东且仍违规质押股权的情况，如有，是否对相关股东采取必要限制措施等。</u>		
7.最新三个完整会计年度及当前年度是否存在重大诉讼，如有，请提供相关信息。		
申请机构承诺事项：		
我单位保证提供的信息真实、完整、准确。		
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；若申请表单涉及多页的，均需加盖骑缝章。

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.法人机构应完整填写经审计的包含最近三个完整会计年度的财务数据，最新报告期（季报或半年报）的财务数据优先提供经审计或报监管部门的数据；其他机构应填写其所属法人的上述材料。

4.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 021-23194709，zhangxue@shclearing.com.cn。