附件

银行间市场清算所股份有限公司
集中清算业务指南

（外币对交易中央对手清算业务章节修订版征求意见稿）

十二、 外币对交易中央对手清算业务

12.1 外币对清算业务要素规定

可纳入外币对交易中央对手清算业务的交易包括在交易中心平台达成的外币对询价交易以及外币对撮合交易。可清算的产品包括外币对即期交易、外币对远期交易以及外币对掉期交易，支持的货币对为欧元对美元、美元对日元、美元对港币、澳元对美元、英镑对美元、美元对新加坡元、新西兰元对美元。

目前，上海清算所提供的外币对交易中央对手清算业务产品如下表所示[1]（其中，T 日表示交易日，下同）。未来，上海清算所将视业务发展需要增加或调整产品种类、货币对及期限范围，并另行公布。

表一：清算产品列表

<table>
<tr><th colspan="3">产品种类</th><th>货币对</th><th>近端结算日</th><th>远端结算日</th></tr>
<tr><td colspan="2">即期交易</td><td>Spot</td><td rowspan="4">EUR/USD,
USD/JPY,
USD/HKD,
AUD/USD,
GBP/USD,
USD/SGD,
NZD/USD</td><td>T+2 日</td><td>无</td></tr>
<tr><td rowspan="2">掉期交易</td><td>即期对远期</td><td>Spot
-Forward</td><td>T+2 日</td><td>T+F 日
（F≤1Y+2）</td></tr>
<tr><td>远期对远期</td><td>Forward1
-Forward2</td><td>T+F1 日</td><td>T+F2 日
（F2≤1Y+2）</td></tr>
<tr><td colspan="2">远期交易</td><td>Forward</td><td>无</td><td>T+F 日
（F≤1Y+2）</td></tr>
</table>

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、远期、掉期
成交日期	不限	成交时间	不限

[1]起息日及清算日落在人民币节假日的外币对交易，不纳入外币对交易中央对手清算业务。

近（远）端起息日	不限		
近（远）端交易货币对	EUR/USD、USD/JPY、USD/HKD、AUD/USD、GBP/USD、USD/SGD、NZD/USD		
近（远）端基础币种	USD、EUR、GBP、AUD、NZD	近（远）端成交价格	汇率数值精确到小数点后5位
近（远）端外币买入量	不限	近（远）端外币卖出量	不限

在选择相应货币对后，本业务清算参与者之间通过交易中心系统达成的外币对交易均通过上海清算所进行集中清算。

12.2 日间清算处理

表三：外币对清算业务运营时间表

日期	时间	事项
日间	9:30	接收前一日成交数据
	9:30-10:00	非清算会员代理关系确认
	9:30-10:30	综合清算会员代理清算确认
	9:30-11:30	合规检查
	11:30	日间保证金支付截止[2]
	15:00	前一日日终盯市损益支付截止
		前一日日终保证金追加截止
		前一日盯市返还应付资金支付截止
		综合清算会员完成保证金分配
	15:30	前一日日终盯市损益收款
	16:30	前一日盯市返还应收资金收款
	16:30	发布清算退出单（如有）
	17:00	保证金提取截止、代理保证金提取截止
	18:30	生成日终保证金清单
S-1 日	11:40 前	生成结算清单

[2] 具体日间保证金截止时间以单据为准。

日期	时间	事项
	11:40	生成外汇合并轧差结算清单（欧元、英镑、日元、澳元、港币、新加坡元、新西兰元、泰铢） 注：针对选择人民币外汇和外币对中央对手清算业务合并轧差的清算会员
	12:00 前	上海清算所将 S 日外币资金结算明细表通知外汇结算银行（除美元外）
	14:30 前	日元、澳元、新西兰元：清算会员向外汇结算银行发出预到账通知（MT210） 注：于 S 日通过外汇结算银行划入外汇资金的清算会员
	16:00 前	1.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 日通过外汇结算银行划入外汇资金的清算会员 2.清算会员日元、澳元、新加坡元、新西兰元资金汇出指令（MT202）截止[3]
	16:30	生成外汇合并轧差结算清单（人民币、美元） 注：针对选择人民币外汇和外币对中央对手清算业务合并轧差的清算会员
	17:00 前	清算所将 S 日美元资金结算明细表（外汇结算银行路径）通知外汇结算银行

[3] 对于境内外币支付系统各币种汇出截止时间，如境内外币支付系统代理结算银行有相关要求的，以境内外币支付系统代理结算银行要求为准。

日期	时间	事项
S 日 （结算日）[4]	11:00 前	1.日元、澳元、新西兰元：通过外汇结算银行结算的，清算会员向外汇结算银行发出支付指令（MT202）或由外汇结算银行主动扣收 2.日元、澳元：通过境内外币支付系统结算的，上海清算所直接扣收清算会员应付资金
	12:00 前	美元、欧元、英镑、港币、新加坡元：清算会员向外汇结算银行发出预到账通知（MT210） 注：于 S 日通过外汇结算银行划入外汇资金的清算会员
	15:00 前	1.港币：清算会员向外汇结算银行发出支付指令（MT202） 注：清算会员选择主动向外汇结算银行发送 MT202 报文 2.清算会员港币资金汇出指令（MT202）截止[5]
	15:30 前	美元、欧元、英镑、新加坡元：清算会员向外汇结算银行发出支付指令（MT202） 注：清算会员选择主动向外汇结算银行发送 MT202 报文

[4] 对于选择人民币外汇与外币对业务合并轧差的市场机构，需按人民币外汇业务结算时点和要求进行结算。
[5] 对于境内外币支付系统各币种汇出截止时间，如境内外币支付系统代理结算银行有相关要求的，以境内外币支付系统代理结算银行要求为准。

日期	时间	事项
	16:00 前	1.美元、欧元、英镑、港币、新加坡元：外汇结算银行主动扣收应付资金清算会员账户 注：清算会员选择不主动向外汇结算银行发送 MT202 报文 2.美元、欧元、英镑、港币：通过境内外币支付系统结算的，上海清算所直接扣收清算会员应付资金 3.清算会员英镑资金汇出指令（MT202）截止[6]
	10:30-16:30	上海清算所在收到清算会员应划入的全部币种资金及盯市返还应付资金后，通知外汇结算银行进行付款或通过境内外币支付系统将应收资金划入清算会员开立在境内外币支付系统的清算账户
	16:30	清算会员美元、欧元资金汇出指令（MT202）截止[7]

上海清算所系统每个工作日 9：30 接收来自交易中心的外币对交易数据，并进行后续处理。交易双方亦可通过其他符合要求的方式,将成交数据提交上海清算所进行集中清算。上海清算所获取成交数据后，实时进行风控合规检查。

本业务中，清算参与者总风险值为考虑了保证金要求、日间盯市亏损、前一日日终盯市在途资金后的总风险暴露值。

总风险值=合约组合风险敞口对应的初始保证金要求+特殊

[6] 对于境内外币支付系统各币种汇出截止时间，如境内外币支付系统代理结算银行有相关要求的，以境内外币支付系统代理结算银行要求为准。

[7] 对于境内外币支付系统各币种汇出截止时间，如境内外币支付系统代理结算银行有相关要求的，以境内外币支付系统代理结算银行要求为准。

保证金要求+max（当日日间盯市亏损金额-日内亏损阈值参数，0）+前一日日终盯市应付金额 （在途）

风控合规检查是判断待检查交易是否会引起非清算会员或清算会员的总风险值超出最大容忍阈值。根据检查结果，上海清算所对已通过代理确认或无须代理确认的交易采取相应的后续处理。具体见下表：

表四：风控合规检查结果与处理方式

检查结果	处理方式
成交双方对应的清算会员同时满足：接单后总风险值<接单前总风险值，或者接单后总风险值<保证金余额+容忍度 如成交双方任意一方为非清算会员，则代理非清算会员的综合清算会员需满足上述条件。	清算系统将该笔成交纳入后续的中央对手清算处理。
成交双方对应的清算会员任意一方不满足上述条件如成交双方任意一方为非清算会员，则代理非清算会员的综合清算会员不满足上述条件。	该笔成交进入等待队列，上海清算所将向超出方追缴保证金，保证金追缴成功后，重新将该笔交易纳入中央对手清算风控检查[8]。

外币对交易中央对手清算业务支持一对多代理关系。非清算会员原则上可选择至多三家综合清算会员代理参与本业务，且须指定本业务的一家默认综合清算会员。非清算会员在 T+1 日 9:30-10:00 通过客户端对所有待确认的代理业务交易进行代理关系确认。若非清算会员未在规定时间内确认代理关系，则系统会自动将默认综合清算会员视作当日所有未完成代理关系确认

[8]清算参与者应采取措施确保保证金缺口小于最大容忍阈值，其中包括提前完成日终保证金交纳。

交易的综合清算会员。若同一笔交易的交易双方均需代理关系确认，则须等到双方选择完成后，交易才会进入后续清算处理流程。

对于代理清算，综合清算会员须在10:30之前完成核对并通过客户端提交代理确认指令。综合清算会员可自主选择逐笔确认和默认确认中的一种代理确认方式，逐笔确认是指综合清算会员需要对非清算会员的每一笔交易进行代理确认，超过规定时间未完成代理确认的交易将不进入后续清算流程；默认确认是指综合清算会员对非清算会员的所有交易不进行代理确认，所有代理交易为默认确认。

若综合清算会员选择拒绝确认代理业务交易，该笔交易将不进入后续清算流程。若同一笔交易的交易双方为同一个综合清算会员代理，代理确认时，综合清算会员须对同一笔交易的两方分别进行代理确认方能完成对该笔交易的代理确认。

清算会员可于T+1日9:45之后通过客户端查询T日达成的通过要素检查的所有交易及其交易明细，支持以Excel和XML格式导出。

根据上述情况，交易状态包含：

a.待代理确认；b.风控检查中；c.风控检查通过； d.作废。

自营业务的买/卖方状态包含：

a.已确认。

代理业务的买/卖方状态包含：

a.待代理确认；b.代理已确认；c.代理已拒绝。

买/卖方状态备注显示买/卖方状态的详细信息，如默认确认等。

上海清算所每日对于通过要素检查及风控合规性检查的交易进行合约替代，清算会员可于 T+1 日 11:30 之后通过合约替代单查询到上海清算所当日已经完成合约替代的外币对即期、远期和掉期成交数据。合约替代单生成截止时间后，仍未通过风控检查的成交数据将无法进入中央对手清算。

上海清算所对所有通过风控检查的外币对交易于 S-1 日完成清算轧差，并于每日 11:40 前生成结算清单。清算会员可通过上海清算所客户端下载结算清单，或通过与上海清算所接口获取应收应付数据。

对于选择人民币外汇和外币对中央对手清算业务合并轧差的机构，在此基础上还将分别于 11:40 和 16:30 之后，生成上午场（含欧元、英镑、港币、日元、澳元、新加坡元、新西兰元、泰铢）以及下午场（含人民币和美元）的汇总结算清单，用于列示合并轧差后的资金收付金额。

上海清算所接收清算参与者通过交易中心终端提交的冲销交易清算退出申请。上海清算所对申请清算退出的外币对交易进行要素合规性、风险合规性检查，检查通过后于 16:30 之后发布清算退出单。

12.3 日终清算处理

结算报表包括合约替代单和结算清单。

合约替代单：指上海清算所已经完成合约替代，纳入中央对手清算的 T 日达成的成交数据，支持以 Excel 和 XML 格式下载。

结算清单：上海清算所依据清算轧差结果分别生成结算清单。外币对即期、远期和掉期交易合并轧差并生成外币对交易结算清单。结算清单提供中文和英文两个版本，以中文表述为准。结算清单支持以 PDF、Excel 和 XML 格式下载。

合并轧差结算清单：上海清算所依据人民币外汇和外币对中央对手清算业务的合并轧差结果生成合并轧差结算清单，纳入合并轧差的交易包括人民币外汇即期交易、人民币外汇远期交易、人民币外汇掉期交易、人民币外汇期权交易、外币对即期交易、外币对远期交易以及外币对掉期交易。结算清单支持以 PDF、Excel 和 XML 格式下载。

上海清算所在出单日生成和发布结算报表。清算会员在出单日单据生成时点后可通过客户端下载合约替代单和结算清单。

综合清算会员可自主选择将其自营和代理交易分开或者合并轧差结算。若选择自营、代理交易分开轧差，其结算清单将分开出单，综合清算会员操作员可在自营单据查询界面查询自营业务相关单据，可在代理单据查询界面查询代理业务相关单据；若选择自营、代理交易合并轧差，其结算清单将合并出单，且由综合清算会员操作员在自营单据查询界面下载相关单据。

12.4 结算处理

12.4.1 保证金结算处理

1. 日终保证金交纳

上海清算所于每个工作日进行清算参与者日终保证金计算，18:30 以后可供清算会员在客户端下载。对于选择人民币外汇和外币对业务保证金账户合并的机构，账户设置上保留一个人民币保证金账户和一个美元保证金账户，并在现有单据基础上新增一张汇总单据（PDF 和 Excel 格式）用于列示账户合并后的保证金收付金额。综合清算会员可为其代理业务申请保证金账户合并服务，其代理非清算会员的保证金账户合并与否设置与综合清算会员代理业务保持一致。对于申请代理业务保证金账户合并的综合清算会员，上海清算所在提供给综合清算会员的保证金单据中列明每家非清算会员合并后的保证金收付金额，综合清算会员与代理非清算会员按此金额完成保证金结算。

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金额、日终盯市损益金额以及盯市返还应收应付金额，综合清算会员可根据日终保证金清单确定非清算会员的保证金追加和释放金额、日终盯市损益金额以及盯市返还应收应付金额。

涉及最低保证金资金释放的，日终保证金清单将通过附表列示最低保证金待释放币种、待释放金额和待释放日期。最低保证

金资金（人民币和美元）释放将于 T+4 日日终完成，清算会员可于 T+5 日日间提取。

人民币日终保证金（包括最低保证金、超限保证金、特殊保证金和日终盯市损益）和盯市返还应付资金追加截止时点为次一工作日 15:00。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，按保证金违约程序处理。

综合清算会员须在完成保证金支付到账的基础上于次一工作日 15:00 前通过客户端完成对该笔保证金的分配，如未及时分配造成非清算会员保证金不足的，将视为保证金违约。

清算会员可通过以下途径交纳人民币日终保证金和盯市返还应付资金：（1）自主交纳：通过人民币大额支付系统，于当日规定时点前将保证金划入上海清算所指定的保证金账户。（2）主动扣收：清算会员可授权上海清算所主动扣收。上海清算所向大额支付系统发送即时转账报文，从清算会员开立在大额支付系统的清算账户扣划相应资金。（3）因不可抗力无法通过以上途径支付保证金时，可以通过任何可行的途径将保证金划入上海清算所指定的保证金账户。

美元保证金缴纳：清算会员应在规定时间之前将美元保证金划入上海清算所指定的保证金账户，并在 SWIFT-MT202 报文 72 附言中填写 15 位的外部账户账号，外部账户账号（美元）可在上海清算所客户端查询，其菜单为："资金账务-外部账户余额查询"，参见对应的"外部账户账号"一栏。

非清算会员应根据综合清算会员要求在规定时间内足额缴纳保证金。

2. 日间保证金交纳

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。清算会员应根据当日日间保证金清单上的追加金额和保证金账户可用余额情况，在收到日间保证金清单后的规定时间（原则上追保时间为 45 分钟）内授权上海清算所进行保证金扣收或将所需交纳的资金划入相关保证金账户。未能在规定时间内成功交纳日间保证金的清算会员，构成保证金违约。综合清算会员要求同日终。

3. 保证金主动冻结

清算会员可在每日 17:00 前自行在保证金账户进行超限保证金、特殊保证金和盯市保证金的主动冻结，综合清算会员可在每日 17:00 前在非清算会员保证金账户进行超限保证金、特殊保证金和盯市保证金的主动冻结。

4. 保证金计息

清算参与者的保证金利息直接划入其变动保证金账户。

对于选择保证金账户合并的机构，清算参与者的保证金利息直接划入其人民币、美元保证金账户。

5. 保证金提取

人民币保证金和盯市返还应收资金提取：（1）自主提取：清

算会员在17:00前通过客户端完成资金提取。（2）主动返还：对于人民币变动保证金账户，上海清算所于当日返还保证金账户内所有可用余额至清算会员的大额账户；对于人民币最低保证金账户，上海清算所于当日返还保证金账户内所有可用余额至清算会员的人民币变动保证金账户。对于选择保证金账户合并的机构，上海清算所于当日返还人民币保证金账户内所有可用余额至清算会员的大额账户。

美元保证金提取：清算会员通过客户端在17:00前提交保证金提取申请，上海清算所于当日将保证金划入清算会员指定账户。对于美元最低保证金账户，上海清算所于当日返还保证金账户内所有可用余额至清算会员的美元变动保证金账户。

综合清算会员需于当日17:00前完成代理资金提取。

6. 非清算会员保证金台账维护

上海清算所主动扣收或主动返还综合清算会员代理业务保证金的，将按照上海清算所计算的非清算会员最新保证金实际要求进行。

综合清算会员自主向其代理业务保证金账户交纳保证金的，应通过客户端将保证金先交纳至代理保证金账户，再记录非清算会员台账。交纳的保证金金额应与非清算会员保证金要求一致。

综合清算会员自主向其代理业务保证金账户提取保证金的，应通过客户端先记录非清算会员台账，再将代理保证金账户中的可用余额划入综合清算会员指定账户。

12.4.2 资金结算处理

上海清算所依据结算清单与清算会员完成各币种的本金结算。综合清算会员如选择自营资金结算与代理资金结算合并出单的，若结算资金不足将优先满足代理业务。

对于选择人民币外汇和外币对中央对手清算业务合并轧差的清算会员，上海清算所依据合并轧差结算清单，按人民币外汇业务结算时点和流程与清算会员完成各币种的本金结算。

1.美元清算流程

清算会员可选择通过结算银行或境内外币支付系统完成美元资金结算。

a.通过结算银行完成美元资金结算

（1） S-1 日 17 点前，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次一工作日上海清算所账户应该收到和付出的资金金额。

（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15:30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向上海清算所发送到账通知；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16:00前，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实时通知上海清算所；若直至16:00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）上海清算所在收到单个清算会员应划入的全部币种资金及盯市返还应付资金后，于S日16:30前通知外汇结算银行，将相应的资金全部划入该清算会员的美元账户。

（6）清算会员从其在结算银行的账户提取资金时，应根据外汇结算银行头寸预报金额和时点的要求，美元于S日16:30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。

b.通过境内外币支付系统完成美元资金结算

上海清算所通过境内外币支付系统即时转账报文与清算会员完成美元资金结算。

对于起息日应付美元的清算会员，上海清算所自 S 日 9:00 起，通过即时转账报文[9]从清算会员开立在境内外币支付系统的清算账户扣划当日应付的美元资金。清算会员确认后返回即时转账回执报文，回执内容为同意付款，在清算会员境内外币支付系统头寸充足的前提下，清算成功，境内外币支付系统通过清算回执报文将清算结果返回给清算会员。

对于起息日应收美元的清算会员，上海清算所收到当日该机构各币种的应付资金及盯市返还应付资金后，实时发送境内外币支付系统即时转账报文，将相应的美元资金划入清算会员开立在境内外币支付系统的清算账户。

2.欧元、英镑、新加坡元清算流程

清算会员可选择通过结算银行或境内外币支付系统完成欧元、英镑资金结算。

清算会员需通过结算银行完成新加坡元资金结算。

a.通过结算银行完成资金结算

（1）S-1 日 12 点前，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次一工

[9] 业务类型为 G106，业务种类为轧差净额。

作日上海清算所账户应该收到和付出的资金金额。

（2）于 S-1 日通过 MT202 划入欧元、英镑资金的清算会员，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欧元、英镑、新加坡元资金，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15:30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向上海清算所发送到账通知；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 16:00 前，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

的到账信息实时通知上海清算所；若直至16:00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）上海清算所在收到单个清算会员应划入的全部币种资金及盯市返还应付资金后，于S日16:30前通知外汇结算银行，将相应的资金全部划入该清算会员的欧元、英镑、新加坡元账户。

（6）清算会员从其在结算银行的账户提取资金时，应根据外汇结算银行头寸预报金额和时点的要求，新加坡元于S-1日16:00之前、欧元于S日16:30之前、英镑于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。

b.通过境内外币支付系统完成资金结算

上海清算所通过境内外币支付系统即时转账报文与清算会员完成资金结算。

对于起息日应付外币资金的清算会员，上海清算所自S日9:00起，通过即时转账报文[10]从清算会员开立在境内外币支付系统的清算账户扣划当日应付外币资金。清算会员确认后返回即时转账回执报文，回执内容为同意付款，在清算会员境内外币支付系统头寸充足的前提下，清算成功，境内外币支付系统通过清算回执报文将清算结果返回给清算会员。

[10] 业务类型为G106，业务种类为轧差净额。

对于起息日应收外币资金的清算会员，上海清算所收到当日该机构各币种的应付资金及盯市返还应付资金后，实时发送境内外币支付系统即时转账报文，将相应的应收资金划入清算会员开立在境内外币支付系统的清算账户。

3.日元、澳元、新西兰元清算流程

清算会员可选择通过结算银行或境内外币支付系统完成日元、澳元资金结算。

清算会员需通过结算银行完成新西兰元资金结算。

a.通过结算银行完成资金结算

（1） S-1 日 12:00 前，上海清算所将 S 日的资金结算明细表通知外汇结算银行。

（2）于 S 日划入资金的清算会员，须于 S-1 日 14:30 之前向外汇结算银行发出预到账通知（MT210）。

（3）清算会员须于 S 日 11:00 之前，通过代理行发出支付指令（MT202）将外汇资金划入其在外汇结算银行开立的外汇结算账户。外汇结算银行需监测 S 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外汇资金，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11:00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）：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将清算会员的到账信息实时通知上海清算所；如账户余额不足，则予以拒绝，并实时通过邮件和电话的方式通知上海清算所和清算会员交易无法完成。

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主动扣收。

S日11:00前，外汇结算银行检查清算会员账户余额（实际头寸和授信之和，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实时通知上海清算所；若直至11：00账户余额不足，则通过邮件和电话方式实时通知上海清算所和清算会员交易无法完成。

（5）S 日 11:00 之后，外汇结算银行应继续检查清算会员的账户余额（授信与实际头寸之和），待余额足够则完成对清算会员账户主动扣收或执行清算会员主动发送的支付指令（MT202），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实时通知上海清算所。

（6）上海清算所在收到单个清算会员应划入的全部币种资金及盯市返还应付资金后，在 11:30 前向外汇结算银行发出支付指令支付该会员应收的日元、澳元、新西兰元资金。

（7）清算会员从其在结算银行的账户提取日元、澳元、新西兰元资金时，应根据外汇结算银行头寸预报金额和时点的要求，于S-1日16:00之前向外汇结算银行发出支付指令(MT202)。

（8）外汇结算银行在S+1日10:00之前向上海清算所、清算会员发送对账单。

b.通过境内外币支付系统完成资金结算

上海清算所通过境内外币支付系统即时转账报文与清算会员完成资金结算。

对于起息日应付外币资金的清算会员，上海清算所自S日9:00起，通过即时转账报文[11]从清算会员开立在境内外币支付系统的清算账户扣划当日应付外币资金。清算会员确认后返回即时转账回执报文，回执内容为同意付款，在清算会员境内外币支付系统头寸充足的前提下，清算成功，境内外币支付系统通过清算回执报文将清算结果返回给清算会员。

对于起息日应收外币资金的清算会员，上海清算所收到当日该机构各币种的应付资金及盯市返还应付资金后，实时发送境内外币支付系统即时转账报文，将相应的应收资金划入清算会员开立在境内外币支付系统的清算账户。

4.港币清算流程

清算会员可选择通过结算银行或境内外币支付系统完成资金结算。

[11] 业务类型为G106，业务种类为轧差净额。

a.通过结算银行完成资金结算

（1） S-1 日 12 点前，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该收到和付出的资金金额。

（2） 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。

（3） 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 15:00 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向上海清算所发送到账通知；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 16:00 前，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，外汇结算银行根据当日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实时通知上海清算所；若直至16:00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。

（4）上海清算所在收到单个清算会员应划入的全部币种资金及盯市返还应付资金后，于S日16:30前通知外汇结算银行，将相应的资金全部划入该清算会员的港币账户。

（5）清算会员从其在结算银行的账户提取港币资金时，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。

（6）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。

b.通过境内外币支付系统完成资金结算

上海清算所通过境内外币支付系统即时转账报文与清算会员完成资金结算。

对于起息日应付外币资金的清算会员，上海清算所自S日9:00起，通过即时转账报文[12]从清算会员开立在境内外币支付系统的清算账户扣划当日应付外币资金。清算会员确认后返回即时转账回执报文，回执内容为同意付款，在清算会员境内外币支付系统头寸充足的前提下，清算成功，境内外币支付系统通过清算回执报文将清算结果返回给清算会员。

[12] 业务类型为G106，业务种类为轧差净额。

对于起息日应收外币资金的清算会员，上海清算所收到当日该机构各币种的应付资金及盯市返还应付资金后，实时发送境内外币支付系统即时转账报文，将相应的应收资金划入清算会员开立在境内外币支付系统的清算账户。

12.4.3 清算基金操作

清算基金=会员自营和代理风险敞口日均值×清算基金比例。

清算基金比例=压力测试结果÷所有会员风险敞口日均值之和。

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。

清算会员风险敞口日均值等于前三个月每日日终会员风险敞口的算术平均数。

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。

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。

清算会员可通过以下途径交纳清算基金：（1）自主交纳：通过人民币大额支付系统，于当日规定时点前将清算基金划入清算会员清算基金账户。（2）主动扣收：清算会员可授权上海清算所主动扣收清算基金。上海清算所向大额支付系统发送即时转账报文，从清算会员开立在大额支付系统的清算账户扣划相应资金。（3）因不可抗力无法通过以上途径支付清算基金时，可以通过任何可行的途径将清算基金划入上海清算所指定的清算基金账户。

清算基金提取：（1）自主提取：清算会员在17:00前通过客户端完成资金提取。（2）主动返还：上海清算所于当日返还清算基金账户内所有可用余额至清算会员的大额账户。

12.4.4 违约处置相关规定

违约情形发生时，通知违约清算会员了解情况。根据违约情况，冻结该清算会员与本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，未在规定时间内完成资金划付的，上海清算所有权计算和征收违约金。若为人民币资金违约的，违约金每日按照违约资金金额的1‰计收；若为外币资金违约的，违约金每日按照违约金额和外汇结算银行公布的透支利率+3%（年化利率）计收。

本业务违约处置参见本指南3.3章节相关内容以及《银行间

市场清算所股份有限公司集中清算业务违约处置指引》中的外币对交易中央对手清算业务相关规定执行。

1. 限制业务手段：上海清算所有权降低最大容忍阈值/限额以限制违约非清算会员/清算会员参与本业务。

2. 永久性违约判定：违约清算会员应及时补足违约资金，未按时补足结算资金、违约盯市保证金、违约金、清算基金、费用的，或者保证金违约清算会员连续第二次发生保证金违约的，或发生上海清算所认定的其他违约情形的，上海清算所有权认定该清算会员永久性违约。

3. 代理业务管理：

综合清算会员对其代理的非清算会员应实行先收后付，对上海清算所应实行先付后收，综合清算会员应履行对其代理的非清算会员担保交收的义务。综合清算会员应向上海清算所提交盖有综合清算会员公章或预留印鉴章的非清算会员违约通知书，以及非清算会员违约的相关记录或说明材料。上海清算所对上述材料进行形式审核。

（1） 综合清算会员发生代理清算业务违约的，应配合上海清算所进行违约调查，提供证据证明非清算会员违约的事实和金额，还应提供其他上海清算所要求的非清算会员违约相关记录，综合清算会员不得挪用任何已收取但暂未向违约非清算会员划付的资产。上海清算所有权限制或暂停违约非清算会员参与本业务。

（2） 上海清算所无法确认非清算会员违约事实的，视非清算会员为履约非清算会员。履约非清算会员应在申请截止时点前提交移仓申请，并于规定移仓期限内确定新综合清算会员（原则上未违约非清算会员应于10个工作日内确定新综合清算会员）。

（3） 违约综合清算会员有义务协助上海清算所通知履约非清算会员补足上海清算所要求的保证金。

（4） 在判定综合清算会员永久性违约后，违约清算会员应向上海清算所转移其已收未付资产和违约非清算会员额外保证金，上海清算所协助其完成履约非清算会员已清算头寸的支付结算。

（5） 若认定综合清算会员永久性违约，上海清算所对所有履约且在移仓前需满足应付资产要求（包括保证金和结算资产）的非清算会员的未清算头寸执行移仓，已清算未结算头寸不纳入移仓头寸范围。在确定新综合清算会员前的过渡期间，上海清算所将与未违约非清算会员直接进行资产收付，上海清算所在移仓生效前有权根据已清算未结算头寸计算并向非清算会员追加特殊保证金。

（6） 上海清算所对违约或移仓成功前过渡期间发生违约的非清算会员头寸执行强制平仓。上海清算所也有权对未及时提交移仓申请或超过移仓期限仍未确定新综合清算会员的非清算会员头寸进行强制平仓处理，平仓损失将并入本次会员违约处置

成本中。

（7） 移仓后，若非清算会员未能按时完成未移仓头寸结算现金支付的，视为非清算会员违约，上海清算所有权按需出售违约会员代理业务应收资产以及违约非清算会员的应收资产，相关损失将并入本次会员违约处置成本中。

4. 发生违约事件时，对于选择结算资金和保证金（含清算基金）账户均分开管理的机构，各业务单独进行违约判定和后续违约处理；如违约机构选择结算资金合并轧差和保证金账户（含清算基金）账户合并中任意一项服务，则两项业务均判定违约。需要说明的是，由于目前两项业务风险资源独立计算，因此违约处置仍分开处理。

12.5 外币对中央对手清算业务相关公式

12.5.1 初始保证金

12.5.1.1 最低保证金

最低保证金缴纳币种为人民币或美元。最低保证金的计算方式如下：

$$\text{最低保证金要求} = L \times C$$

其中：

L 为风险敞口限额；

C为会员资信因子。其中，代理业务使用综合清算会员的会

员资信因子。上海清算所根据实际情况调整会员资信因子；

12.5.1.2 超限保证金

外币对业务风险敞口基础模型为经波动率调整的期望损失值模型（ES）。

超限保证金缴纳币种为人民币。超限保证金的计算方式如下

超限保证金=Max(Max(不含 T+1 日及逾期结算头寸的风险敞口,不含逾期结算头寸的风险敞口,所有存续头寸的风险敞口)×C-L×C,0)

其中：

不含 T+1 日及逾期结算头寸的风险敞口=相应头寸的经波动率调整的ES_1+相应头寸的盯市汇兑敞口；

不含逾期结算头寸的风险敞口=相应头寸的经波动率调整的ES_2+相应头寸的盯市汇兑敞口；

所有存续头寸的风险敞口=相应头寸的经波动率调整的ES_3+相应头寸的盯市汇兑敞口；

Max(不含 T+1 日及逾期结算头寸的风险敞口,不含逾期结算头寸的风险敞口,所有存续头寸的风险敞口)为会员风险敞口；

盯市汇兑敞口用于覆盖盯市币种与本业务计价币种（USD）的货币错配风险。

L 为风险敞口限额；

C为会员资信因子。

12.5.1.3 节假日保证金调整

如遇外币对业务连续假期的情况，上海清算所将在连续假期前进行节假日保证金调整，经节假日调整的风险敞口值=未经节假日调整的风险敞口值$*\sqrt{\frac{\text{平仓期限}+\text{节假日天数}}{\text{平仓期限}}}$

12.5.2 日终盯市损益

上海清算所日终进行双向盯市损益金额计算。

日终盯市损益金额的结算币种为人民币。双向盯市仅适用于远期、掉期，即期交易不计算盯市损益。

日终盯市损益结算金额以清算参与者为出发点计算。日终盯市损益结算金额为正，体现在保证金清单的盯市应收金额一栏，清算参与者收取日终盯市损益结算资金；日终盯市损益结算金额为负，体现在保证金清单的盯市应付金额一栏，清算参与者据此支付日终盯市损益结算资金。

日终盯市损益计算方式如下：

（1）计算 T+i 日起息的远期、掉期交易的一端的盯市价值，i 大于等于 1。

$$\mathrm{P_{T+i}} = (\mathrm{T+i}\text{ 日美元净额} + \mathrm{T+i}\text{ 日非美外币净额} * F_{\mathrm{T+i}}) \times \mathrm{DF_i} * \mathrm{F_T^{USDCNY}}$$

会员应收，净额为正；会员应付，净额为负。

$\mathrm{DF_i}$为贴现率，根据当日日终上海清算所内部构造的美元即

期利率曲线进行计算；

F_{T+i}为根据当日日终的外币对即期汇率及外币对掉期曲线计算得到的非美外币的远期汇率；

F_T^{USDCNY}为美元兑人民币汇率。

（2）计算未到期头寸的盯市价值

$$V_T = \sum_{i=1} P_{T+i}$$

（3）计算双向盯市损益结算金额

T 日双向盯市损益结算金额

$$= V_T - （1 + \frac{SHIBOR_O/N * day}{360}） * V_{T-1}$$

day 等于当天到下一个工作日的自然天数；

V_{T-1}表示 T-1 日计算的经调整盯市价值（需剔除 T-1 日日终计算的第二天到期头寸盯市价值）。

双向盯市损益结算金额在计算当日的下一个工作日进行收付。

12.5.3 盯市返还应收应付金额

上海清算所将于 T 日日终计算 T+1 日到期合约（包括远期和掉期一端，不包括即期）的盯市返还金额，并于 T+1 日进行相应资金的收付。

盯市返还应收/应付金额 =|T+1 日到期合约的盯市价值之和

|清算参与者 T+1 日到期合约的盯市价值之和为正，则清算参与者需向上海清算所支付盯市返还资金；清算参与者 T+1 日到期合约的盯市价值之和为负，则上海清算所需向清算参与者支付盯市返还资金。

12.5.4 特殊保证金

特殊保证金触发事件主要包括四类：外汇市场汇率异常波动、清算参与者待交割本金金额过大、清算参与者风险敞口过大和会员违约。当发生任一情况时，上海清算所可要求清算参与者交纳特殊保证金。若多于一项的触发事件同时发生时，不同触发事件所引起的特殊保证金要求累加形成总的特殊保证金要求。

12.6 节假日处理

起息日及清算日落在人民币节假日的外币对交易，不纳入外币对交易中央对手清算业务。

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。

1. 外币对即期交易

外币对即期交易的结算日受节假日影响的主要规定如下：

（1）根据交易货币单独计算结算日，所有货币的结算日均因起息日为节假日而顺延至下一个工作日。若交易货币对各自计算的结算日不同，其结算日应顺延至共同出现的第一个工作日。

（2）外币对 T+2 交易的结算日不受 T+1 日为美元节假日的影响。

（3）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。

（4）不同交易日相同结算日的交易应轧差清算。

2. 外币对远期、掉期交易

上海清算所于每年底调整受节假日影响而不能正常清算的外币对远期、掉期交易的结算日，即：若外汇远掉期交易的结算日在交易货币对中任一货币的新公布节假日内，则结算日将顺延至下一个工作日，但若下一个工作日跨至下一月，则该结算日将提前至上一工作日。除结算日外，其他要素均不改变。

3. 年中临时节假日调整

上海清算所向市场发布涉及银行间外汇市场清算币种所属国或地区年中临时节假日调整信息。结算日调整参照年末结算日调整相关规定执行。

本业务相关结算日规则的变更与修订由上海清算所发布。

附表[13]

A-3.上海清算所集中清算业务申请信息表（自营）

B-2.上海清算所集中清算业务申请信息表（代理）

B-4.上海清算所集中清算业务非清算会员信息表（代理）

C-1.上海清算所清算会员信息变更登记表

C-2.非清算会员信息变更登记表

D-1.上海清算所集中清算业务退出申请表

[13] 上述表单电子版可在 http://www.shclearing.com.cn/scfw/qshy/zdzn/ 查询下载。若申请表单涉及多页的，均需加盖骑缝章。

A-3 V202612

上海清算所集中清算业务申请信息表（自营）

清算会员全称：（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）___

清算会员简称：（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）：_____

1. 申请业务
☐债券（☐现券 ☐质押式回购 ☐买断式回购 ☐通用回购） ☐利率互换 ☐人民币外汇（☐即期 ☐远期 ☐掉期 ☐期权 ☐T+1即期 ☐T+1掉期 ☐T+1期权☐长期限远期 ☐长期限掉期☐SGD/CNY即期 ☐NZD/CNY即期 ☐CNY/THB即期） ☐外币对（☐澳元/美元 ☐欧元/美元 ☐英镑/美元 ☐美元/港币 ☐美元/日元 ☐美元/新加坡元 ☐新西兰元/美元） ☐外汇竞价（☐人民币外汇竞价 ☐外币对竞价） ☐标准债券远期 ☐信用违约互换 ☐大宗商品衍生品 ☐其他（_____）

2. 申请机构人员信息（业务联系人）

姓名	部门职务	集中清算业务培训证书编号	手机	传真	Email	职责
						包括但不限于交易/清算结算/保证金与清算基金等
						包括但不限于交易/清算结算/保

						证金与清算基金等
						包括但不限于交易/清算结算/保证金与清算基金等
						包括但不限于交易/清算结算/保证金与清算基金等
						包括但不限于交易/清算结算/保证金与清算基金等

3.客户终端管理员信息				
姓名	登录名	身份证号	集中清算业务培训证书编号	手机

CFCA证书串号	☐共用：（请填写已有串号）
	☐新开

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；字符长度请控制在4-12个字符；

3.“CFCA证书串号”：如勾选共用，请填写以“041”开头的证书串号，例如：041@712345678-X@shchcs@00000001；如勾选新开，请下载并填写企业证书申请表https://www.shclearing.com.cn/cpyyw/czxzjzn/detail_38.html?productDocClient/d

<table>
<tr><td colspan="6">etail/40285281688bb7ba01688c9b18e30034；
4.债券及外汇竞价业务无需填写客户终端管理员信息。</td></tr>
<tr><td colspan="6">4. 指定或开立账户的信息</td></tr>
<tr><td rowspan="10">人民币资金结算账户（二选一）</td><td rowspan="3">☐开在大额支付系统的清算账户</td><td>户名</td><td colspan="3"></td></tr>
<tr><td>行号</td><td colspan="3"></td></tr>
<tr><td>账号</td><td colspan="3"></td></tr>
<tr><td rowspan="7">☐开在上海清算所的资金结算专户</td><td rowspan="4">☐新开专用账户</td><td>资金往来账号</td><td colspan="2"></td></tr>
<tr><td>资金往来账户户名</td><td colspan="2"></td></tr>
<tr><td>资金往来账户开户行行号</td><td colspan="2"></td></tr>
<tr><td>资金往来账户开户行行名</td><td colspan="2"></td></tr>
<tr><td rowspan="2">☐使用已有资金专户（同原路径）</td><td>账号</td><td colspan="2"></td></tr>
<tr><td>账户名</td><td colspan="2"></td></tr>
<tr><td colspan="6">注：如选择“开在大额支付系统的清算账户”，请填写大额账户的行号、账号、户名；如选择“开在上海清算所的资金结算专户”，请勾选开在上海清算所的对应专户，并填写用于资金往来的开在商业银行的行号、账号、户名。</td></tr>
<tr><td colspan="6">5.保证金提款路径的信息</td></tr>
<tr><td colspan="2">户名</td><td colspan="4"></td></tr>
<tr><td colspan="2">行号</td><td colspan="4"></td></tr>
<tr><td colspan="2">账号</td><td colspan="4"></td></tr>
<tr><td colspan="6">☐与人民币资金结算路径共用
（勾选则无须填写5中账号户名，视同同人民币资金结算账户，默认勾选）</td></tr>
<tr><td colspan="6">6.清算基金提款路径的信息</td></tr>
<tr><td colspan="2">户名</td><td colspan="4"></td></tr>
<tr><td colspan="2">行号</td><td colspan="4"></td></tr>
<tr><td colspan="2">账号</td><td colspan="4"></td></tr>
</table>

<table>
<tr><td colspan="6">☐与人民币资金结算路径共用
（勾选则无须填写6中账号户名，视同同人民币资金结算账户，默认勾选）</td></tr>
<tr><td colspan="6">以下信息由申请债券集中清算业务的机构填写：</td></tr>
<tr><td colspan="2">清算基金路径选择</td><td colspan="4">☐主动扣收　　☐主动返还</td></tr>
<tr><td colspan="6">注：如资金结算账户选择“开在大额支付系统的清算账户”，则可选择清算基金主动扣收及主动返还，须填写以上内容，清算基金主动扣收路径同人民币资金结算路径；如资金结算账户选择“开在上海清算所的资金结算专户”，则不提供清算基金主动扣收及主动返还的服务，无需填写以上内容。</td></tr>
<tr><td colspan="6">以下信息由申请人民币外汇交易中央对手清算业务的机构填写：</td></tr>
<tr><td colspan="6">本金结算账户信息</td></tr>
<tr><td rowspan="13">外币</td><td>会员 SWIFT BIC CODE</td><td colspan="4"></td></tr>
<tr><td rowspan="5">美元</td><td colspan="4">☐外汇结算银行（☐中国银行 ☐建设银行 ☐工商银行）
☐关系人账号（选填[14]）_____</td></tr>
<tr><td rowspan="4">☐境内外币支付系统</td><td>直参行行号</td><td></td></tr>
<tr><td>直参行行名</td><td></td></tr>
<tr><td>账号</td><td></td></tr>
<tr><td>户名</td><td></td></tr>
<tr><td rowspan="5">欧元</td><td colspan="4">☐外汇结算银行（☐工商银行）</td></tr>
<tr><td rowspan="4">☐境内外币支付系统</td><td>直参行行号</td><td></td></tr>
<tr><td>直参行行名</td><td></td></tr>
<tr><td>账号</td><td></td></tr>
<tr><td>户名</td><td></td></tr>
<tr><td rowspan="4">日元</td><td colspan="4">☐外汇结算银行（☐工商银行）</td></tr>
<tr><td rowspan="3">☐境内外币支付系统</td><td>直参行行号</td><td></td></tr>
<tr><td>直参行行名</td><td></td></tr>
<tr><td>账号</td><td></td></tr>
</table>

[14] 如选择结算银行为中国银行，此项必填。

			户名	
	港币	□外汇结算银行（□工商银行）		
		□境内外币支付系统	直参行行号	
			直参行行名	
			账号	
			户名	
	澳元	□外汇结算银行（□工商银行）		
		□境内外币支付系统	直参行行号	
			直参行行名	
			账号	
			户名	
	英镑	□外汇结算银行（□工商银行）		
		□境内外币支付系统	直参行行号	
			直参行行名	
			账号	
			户名	
	新加坡元	□外汇结算银行（□中国银行） □关系人账号_____		
	新西兰元	□外汇结算银行（□工商银行）		
	泰铢	□外汇结算银行（□中信银行） □关系人账号_____		
人民币	□主动扣收			

保证金账户信息			
保证金交纳币种信息			
最低保证金	人民币□　　美元□		
变动保证金	人民币□　　美元□　　（目前只能选人民币）		
美元保证金	开户行	名称	
		SWIFT	

<table>
<tr><td rowspan="3"></td><td></td><td>BIC CODE</td><td colspan="2"></td></tr>
<tr><td colspan="2">账号</td><td colspan="2"></td></tr>
<tr><td colspan="2">中间行 SWIFT BIC CODE</td><td colspan="2"></td></tr>
<tr><td colspan="3">人民币保证金路径选择</td><td colspan="2">☐主动返还　　☐主动扣收（☐含最低保证金）</td></tr>
<tr><td colspan="3">清算基金路径选择</td><td colspan="2">☐主动返还　　☐主动扣收</td></tr>
<tr><td colspan="3">清算费用路径选择</td><td colspan="2">☐主动扣收（☐与人民币资金结算路径共用）</td></tr>
<tr><td colspan="5">以下信息由申请外币对交易中央对手清算业务的机构填写：</td></tr>
<tr><td colspan="5">外币本金结算账户信息</td></tr>
<tr><td colspan="3">机构SWIFT BIC CODE</td><td colspan="2"></td></tr>
<tr><td rowspan="5">美元</td><td colspan="2">☐外汇结算银行</td><td colspan="2">☐中国银行（关系人账号：_____）
☐建设银行　☐工商银行</td></tr>
<tr><td rowspan="4">☐境内外币支付系统</td><td>直参行行号</td><td></td></tr>
<tr><td>直参行行名</td><td></td></tr>
<tr><td>账号</td><td></td></tr>
<tr><td>户名</td><td></td></tr>
<tr><td rowspan="5">欧元</td><td colspan="2">☐外汇结算银行</td><td colspan="2">☐工商银行</td></tr>
<tr><td rowspan="4">☐境内外币支付系统</td><td>直参行行号</td><td></td></tr>
<tr><td>直参行行名</td><td></td></tr>
<tr><td>账号</td><td></td></tr>
<tr><td>户名</td><td></td></tr>
<tr><td rowspan="5">日元</td><td colspan="2">☐外汇结算银行</td><td colspan="2">☐工商银行</td></tr>
<tr><td rowspan="4">☐境内外币支付系统</td><td>直参行行号</td><td></td></tr>
<tr><td>直参行行名</td><td></td></tr>
<tr><td>账号</td><td></td></tr>
<tr><td>户名</td><td></td></tr>
<tr><td rowspan="2">港币</td><td colspan="2">☐外汇结算银行</td><td colspan="2">☐工商银行</td></tr>
<tr><td colspan="2">☐境内外币支付系</td><td>直参行行号</td><td></td></tr>
</table>

<table>
<tr><td rowspan="3"></td><td rowspan="3">统</td><td>直参行行名</td><td></td></tr>
<tr><td>账号</td><td></td></tr>
<tr><td>户名</td><td></td></tr>
<tr><td rowspan="5">澳元</td><td>☐外汇结算银行</td><td>☐工商银行</td><td></td></tr>
<tr><td rowspan="4">☐境内外币支付系统</td><td>直参行行号</td><td></td></tr>
<tr><td>直参行行名</td><td></td></tr>
<tr><td>账号</td><td></td></tr>
<tr><td>户名</td><td></td></tr>
<tr><td rowspan="5">英镑</td><td>☐外汇结算银行</td><td>☐工商银行</td><td></td></tr>
<tr><td rowspan="4">☐境内外币支付系统</td><td>直参行行号</td><td></td></tr>
<tr><td>直参行行名</td><td></td></tr>
<tr><td>账号</td><td></td></tr>
<tr><td>户名</td><td></td></tr>
<tr><td>新加坡元</td><td>☐外汇结算银行</td><td colspan="2">☐中国银行（关系人账号：_____）</td></tr>
<tr><td>新西兰元</td><td>☐外汇结算银行</td><td colspan="2">☐工商银行</td></tr>
<tr><td colspan="4">保证金账户信息</td></tr>
<tr><td colspan="4">保证金交纳币种信息</td></tr>
<tr><td colspan="3">最低保证金</td><td>人民币☐　　美元☐</td></tr>
<tr><td colspan="3">变动保证金</td><td>人民币☐　　美元☐　（目前只能选人民币）</td></tr>
<tr><td rowspan="4">美元
保证金</td><td rowspan="2">开户行</td><td>名称</td><td rowspan="2"></td></tr>
<tr><td>SWIFT BIC CODE</td></tr>
<tr><td colspan="2">账号</td><td></td></tr>
<tr><td colspan="2">中间行SWIFT BIC CODE</td><td></td></tr>
<tr><td colspan="3">人民币保证金路径选择</td><td>☐主动返还　　☐主动扣收（☐含最低保证金）</td></tr>
<tr><td colspan="3">清算基金路径选择</td><td>☐主动返还　　☐主动扣收</td></tr>
<tr><td colspan="3">清算费用路径选择</td><td>☐主动扣收（☐与人民币资金结算路径共用）</td></tr>
<tr><td colspan="4">以下信息由申请外汇合并轧差和保证金（含清算基金）账户合并服务的机构填写：</td></tr>
</table>

<table>
<tr><td rowspan="19">☐合并轧差</td><td colspan="4">☐与人民币外汇交易中央对手清算业务结算路径共用
（默认勾选，如不勾选，则须重新填写下面本金结算信息）</td></tr>
<tr><td rowspan="5">美元</td><td colspan="3">☐外汇结算银行（☐中国银行☐建设银行☐工商银行）
☐关系人账号（选填[15]）_____</td></tr>
<tr><td rowspan="4">☐境内外币支付系统</td><td>直参行行号</td><td></td></tr>
<tr><td>直参行行名</td><td></td></tr>
<tr><td>账号</td><td></td></tr>
<tr><td>户名</td><td></td></tr>
<tr><td rowspan="5">欧元</td><td colspan="3">☐外汇结算银行（☐工商银行）</td></tr>
<tr><td rowspan="4">☐境内外币支付系统</td><td>直参行行号</td><td></td></tr>
<tr><td>直参行行名</td><td></td></tr>
<tr><td>账号</td><td></td></tr>
<tr><td>户名</td><td></td></tr>
<tr><td rowspan="5">日元</td><td colspan="3">☐外汇结算银行（☐工商银行）</td></tr>
<tr><td rowspan="4">☐境内外币支付系统</td><td>直参行行号</td><td></td></tr>
<tr><td>直参行行名</td><td></td></tr>
<tr><td>账号</td><td></td></tr>
<tr><td>户名</td><td></td></tr>
<tr><td rowspan="5">港币</td><td colspan="3">☐外汇结算银行（☐工商银行）</td></tr>
<tr><td rowspan="4">☐境内外币支付系统</td><td>直参行行号</td><td></td></tr>
<tr><td>直参行行名</td><td></td></tr>
<tr><td>账号</td><td></td></tr>
<tr><td>户名</td><td></td></tr>
<tr><td rowspan="3">澳元</td><td colspan="3">☐外汇结算银行（☐工商银行）</td></tr>
<tr><td rowspan="2">☐境内外币支付系统</td><td>直参行行号</td><td></td></tr>
<tr><td>直参行行名</td><td></td></tr>
</table>

[15] 如选择结算银行为中国银行，此项必填。

<table>
<tr><td rowspan="12"></td><td></td><td></td><td>账号</td><td></td></tr>
<tr><td></td><td></td><td>户名</td><td></td></tr>
<tr><td rowspan="5">英镑</td><td colspan="3">☐外汇结算银行（☐工商银行）</td></tr>
<tr><td rowspan="4">☐境内外币支付系统</td><td>直参行行号</td><td></td></tr>
<tr><td>直参行行名</td><td></td></tr>
<tr><td>账号</td><td></td></tr>
<tr><td>户名</td><td></td></tr>
<tr><td>新加坡元</td><td colspan="3">☐外汇结算银行（☐中国银行）
☐关系人账号_____</td></tr>
<tr><td>新西兰元</td><td colspan="3">☐外汇结算银行（☐工商银行）</td></tr>
<tr><td>泰铢</td><td colspan="3">☐外汇结算银行（☐中信银行）
☐关系人账号_____</td></tr>
<tr><td rowspan="3">人民币
(☐主动扣收)</td><td>户名</td><td colspan="2"></td></tr>
<tr><td>行号</td><td colspan="2"></td></tr>
<tr><td>账号</td><td colspan="2"></td></tr>
<tr><td rowspan="12">☐保证金（含清算基金）账户合并</td><td colspan="4">☐与人民币外汇交易中央对手清算业务保证金结算路径共用
（默认勾选，如不勾选，则须重新填写下面账户信息）</td></tr>
<tr><td rowspan="3">人民币保证金结算路径
（大额支付系统清算账户）</td><td>户名</td><td colspan="2"></td></tr>
<tr><td>行号</td><td colspan="2"></td></tr>
<tr><td>账号</td><td colspan="2"></td></tr>
<tr><td rowspan="3">清算基金结算路径
（大额支付系统清算账户）</td><td>户名</td><td colspan="2"></td></tr>
<tr><td>行号</td><td colspan="2"></td></tr>
<tr><td>账号</td><td colspan="2"></td></tr>
<tr><td rowspan="4">美元保证金提款路径</td><td>会员 SWIFT CODE</td><td></td></tr>
<tr><td>开户行 SWIFT CODE</td><td></td></tr>
<tr><td>账号</td><td></td></tr>
<tr><td>中间行 SWIFT CODE</td><td></td></tr>
<tr><td>☐主动扣收和返还设置</td><td colspan="4">☐人民币保证金主动扣收 ☐人民币保证金主动返还</td></tr>
</table>

<table>
<tr><td colspan="3"></td><td>☐清算基金主动扣收　　☐清算基金主动返还</td></tr>
<tr><td colspan="4">以下信息由申请外汇竞价清算业务的机构填写：</td></tr>
<tr><td colspan="4">☐人民币外汇竞价交易清算账户　　☐外币对竞价交易清算账户</td></tr>
<tr><td colspan="3">会员SWIFT BIC CODE</td><td></td></tr>
<tr><td colspan="3">缴费币种类型</td><td>☐人民币　　☐美元</td></tr>
<tr><td rowspan="4">人民币[16]</td><td colspan="2">开户行行号</td><td></td></tr>
<tr><td colspan="2">开户行名称</td><td></td></tr>
<tr><td colspan="2">收款账户账号</td><td></td></tr>
<tr><td colspan="2">收款账户名称</td><td></td></tr>
<tr><td rowspan="5">美元</td><td rowspan="2">开户行名称</td><td>（中文）</td></tr>
<tr><td>（英文）</td></tr>
<tr><td colspan="2">开户行账号</td><td>（申请机构开立在开户行的账户信息，下同）</td></tr>
<tr><td colspan="2">开户行 SWIFT BIC CODE</td><td></td></tr>
<tr><td colspan="2">中间行 SWIFT BIC CODE</td><td></td></tr>
<tr><td rowspan="5">港币</td><td colspan="2" rowspan="2">开户行名称</td><td>（中文）</td></tr>
<tr><td>（英文）</td></tr>
<tr><td colspan="2">开户行账号</td><td></td></tr>
<tr><td colspan="2">开户行 SWIFT BIC CODE</td><td></td></tr>
<tr><td colspan="2">中间行 SWIFT BIC CODE</td><td></td></tr>
<tr><td rowspan="5">日元</td><td colspan="2" rowspan="2">开户行名称</td><td>（中文）</td></tr>
<tr><td>（英文）</td></tr>
<tr><td colspan="2">开户行账号</td><td></td></tr>
<tr><td colspan="2">开户行 SWIFT BIC CODE</td><td></td></tr>
<tr><td colspan="2">中间行 SWIFT BIC CODE</td><td></td></tr>
</table>

[16]人民币支付路径只支持人民币大额支付系统。

欧元	开户行名称	（中文）
		（英文）
	开户行账号	
	开户行 SWIFT BIC CODE	
	中间行 SWIFT BIC CODE	
英镑	开户行名称	（中文）
		（英文）
	开户行账号	
	开户行 SWIFT BIC CODE	
	中间行 SWIFT BIC CODE	
林吉特	开户行名称	（中文）
		（英文）
	开户行账号	
	开户行 SWIFT BIC CODE	
	中间行 SWIFT BIC CODE	
卢布	开户行名称	（中文）
		（英文）
	开户行账号	
	开户行 SWIFT BIC CODE	
	中间行 SWIFT BIC CODE	
新西兰元	开户行名称	（中文）
		（英文）
	开户行账号	
	开户行 SWIFT BIC CODE	
	中间行 SWIFT BIC CODE	
瑞士法郎	开户行名称	（中文）
		（英文）
	开户行账号	
	开户行 SWIFT BIC CODE	

	中间行 SWIFT BIC CODE	
澳大利亚元	开户行名称	（中文）
		（英文）
	开户行账号	
	开户行 SWIFT BIC CODE	
	中间行 SWIFT BIC CODE	
加拿大元	开户行名称	（中文）
		（英文）
	开户行账号	
	开户行 SWIFT BIC CODE	
	中间行 SWIFT BIC CODE	
新加坡元	开户行名称	（中文）
		（英文）
	开户行账号	
	开户行 SWIFT BIC CODE	
	中间行 SWIFT BIC CODE	

7.清算限额申请

根据申请业务的类型，填写相应的清算限额申请信息。

利率互换	风险敞口限额申请量	
标准债券远期	清算限额申请量	
债券集中清算业务	债券净额风险敞口限额	
	通用回购可融出限额	
人民币外汇交易中央对手清算	风险敞口限额（美元）	
外币对交易中央对手清算	风险敞口限额（美元）	

外汇竞价	人民币外汇清算限额（美元）	
	外币对清算限额（美元）	
信用违约互换	风险敞口限额申请量	
大宗商品衍生品	清算限额申请量	
其他（_____）		
申报说明		

8. 持仓限额申请（仅大宗商品衍生品业务填写）

请根据实际业务参与情况，申报持仓限额

序号	限额种类	申请限额（手）	序号	限额种类	申请限额（手）

9.增值税发票信息（清算会员）

首次申请参与业务的机构需按以下通知要求提交增值税发票信息

https://www.shclearing.com.cn/cpyyw/czxzjzn/detail_38.html?productDocClient/detail/40285281760dfdc801761c0671f810bf

单位公章： 日期： 若申请表单涉及多页的，均需加盖骑缝章。

上海清算所集中清算业务申请信息表（代理）

综合清算会员全称：（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）
综合清算会员简称：（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）
综合清算会员账号（7 位码）：_____
全国银行间同业拆借中心会员代码（21 位码）：_____

1.申请业务

☐债券（☐现券 ☐质押式回购 ☐买断式回购 ☐通用回购）
☐利率互换 ☐人民币外汇（☐即期 ☐远期 ☐掉期 ☐期权 ☐T+1即期 ☐T+1掉期 ☐T+1期权 ☐长期限远期 ☐长期限掉期 ☐SGD/CNY即期 ☐NZD/CNY即期 ☐CNY/THB即期）
☐外币对（☐澳元/美元 ☐欧元/美元 ☐英镑/美元 ☐美元/港币 ☐美元/日元 ☐美元/新加坡元 ☐新西兰元/美元）
☐标准债券远期 ☐信用违约互换 ☐大宗商品衍生品
☐其他（_____）

2.申请机构人员信息（业务联系人）

姓名	部门职务	集中清算业务培训证书编号	手机	传真	Email	职责

3.客户终端管理员信息

姓名	登录名	身份证号	集中清算业务培训证书编号	手机

CFCA证书串号	☐共用：（请填写已有串号）
	☐新开

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；字符长度请控制在 4-12 个字符；
3.“CFCA 证书串号”：如勾选共用，请填写以“041”开头的证书串号，例如：041@712345678-X@shchcs@00000001；如勾选新开，请下载并填写企业证书申请表 https://www.shclearing.com.cn/cpyyw/czxzjzn/detail_38.html?productDocClient/d

<table>
<tr><td colspan="6">etail/40285281688bb7ba01688c9b18e30034。</td></tr>
<tr><td colspan="6">4. 指定或开立账户的信息</td></tr>
<tr><td rowspan="9">人民币资金结算账户（二选一）</td><td rowspan="3">☐开在大额支付系统的清算账户</td><td>户名</td><td colspan="2"></td></tr>
<tr><td>行号</td><td colspan="2"></td></tr>
<tr><td>账号</td><td colspan="2"></td></tr>
<tr><td rowspan="6">☐开在上海清算所的资金结算专户</td><td rowspan="4">☐新开专用账户</td><td>资金往来账号</td><td></td></tr>
<tr><td>资金往来账户户名</td><td></td></tr>
<tr><td>资金往来账户开户行行号</td><td></td></tr>
<tr><td>资金往来账户开户行行名</td><td></td></tr>
<tr><td rowspan="2">☐使用已有资金专户（同原路径）</td><td>账号</td><td></td></tr>
<tr><td>账户名</td><td></td></tr>
<tr><td colspan="6">注：如选择“开在大额支付系统的清算账户”，请填写大额账户的行号、账号、户名；如选择“开在上海清算所的资金结算专户”，请勾选开在上海清算所的对应专户，并填写用于资金往来的开在商业银行的行号、账号、户名。</td></tr>
<tr><td colspan="6">5.保证金提款路径的信息</td></tr>
<tr><td colspan="4">户名</td><td colspan="2"></td></tr>
<tr><td colspan="4">行号</td><td colspan="2"></td></tr>
<tr><td colspan="4">账号</td><td colspan="2"></td></tr>
<tr><td colspan="6">☐与人民币资金结算路径共用
（勾选则无须填写 5 中账号户名，视同同人民币资金结算账户，默认勾选）</td></tr>
<tr><td colspan="6">以下信息由申请人民币外汇交易中央对手清算业务的机构填写：</td></tr>
<tr><td colspan="6">本金结算账户信息</td></tr>
<tr><td rowspan="8">外币</td><td>会员 SWIFT BIC CODE</td><td colspan="4"></td></tr>
<tr><td rowspan="5">美元</td><td colspan="4">☐外汇结算银行（☐中国银行☐建设银行☐工商银行）
☐关系人账号（选填[17]）_____</td></tr>
<tr><td rowspan="4">☐境内外币支付系统</td><td>直参行行号</td><td></td></tr>
<tr><td>直参行行名</td><td></td></tr>
<tr><td>账号</td><td></td></tr>
<tr><td>户名</td><td></td></tr>
<tr><td rowspan="3">欧元</td><td colspan="4">☐外汇结算银行（☐工商银行）</td></tr>
<tr><td rowspan="3">☐境内外币支付系统</td><td>直参行行号</td><td></td></tr>
<tr><td>直参行行名</td><td></td></tr>
<tr><td>账号</td><td></td></tr>
</table>

[17] 如选择结算银行为中国银行，此项必填。

<table>
<tr><td rowspan="19"></td><td></td><td></td><td>户名</td><td></td></tr>
<tr><td rowspan="5">日元</td><td colspan="3">☐外汇结算银行（☐工商银行）</td></tr>
<tr><td rowspan="4">☐境内外币支付系统</td><td>直参行行号</td><td></td></tr>
<tr><td>直参行行名</td><td></td></tr>
<tr><td>账号</td><td></td></tr>
<tr><td>户名</td><td></td></tr>
<tr><td rowspan="5">港币</td><td colspan="3">☐外汇结算银行（☐工商银行）</td></tr>
<tr><td rowspan="4">☐境内外币支付系统</td><td>直参行行号</td><td></td></tr>
<tr><td>直参行行名</td><td></td></tr>
<tr><td>账号</td><td></td></tr>
<tr><td>户名</td><td></td></tr>
<tr><td rowspan="5">澳元</td><td colspan="3">☐外汇结算银行（☐工商银行）</td></tr>
<tr><td rowspan="4">☐境内外币支付系统</td><td>直参行行号</td><td></td></tr>
<tr><td>直参行行名</td><td></td></tr>
<tr><td>账号</td><td></td></tr>
<tr><td>户名</td><td></td></tr>
<tr><td rowspan="5">英镑</td><td colspan="3">☐外汇结算银行（☐工商银行）</td></tr>
<tr><td rowspan="4">☐境内外币支付系统</td><td>直参行行号</td><td></td></tr>
<tr><td>直参行行名</td><td></td></tr>
<tr><td>账号</td><td></td></tr>
<tr><td>户名</td><td></td></tr>
<tr><td>新加坡元</td><td colspan="3">☐外汇结算银行（☐中国银行）
☐关系人账号_____</td></tr>
<tr><td>新西兰元</td><td colspan="3">☐外汇结算银行（☐工商银行）</td></tr>
<tr><td>泰铢</td><td colspan="3">☐外汇结算银行（☐中信银行）
☐关系人账号_____</td></tr>
<tr><td>人民币</td><td colspan="4">☐主动扣收</td></tr>
<tr><td colspan="5">保证金账户信息</td></tr>
<tr><td colspan="5">保证金交纳币种信息</td></tr>
<tr><td colspan="5">最低保证金　　☐人民币　　☐美元</td></tr>
<tr><td colspan="5">变动保证金　　☐人民币　　☐美元（目前只能选人民币）</td></tr>
<tr><td rowspan="4">美元
保证金</td><td rowspan="2">开户行</td><td>名称</td><td colspan="2"></td></tr>
<tr><td>SWIFT BIC CODE</td><td colspan="2"></td></tr>
<tr><td>账号</td><td colspan="3"></td></tr>
<tr><td>中间行SWIFT BIC CODE</td><td colspan="3"></td></tr>
<tr><td colspan="2">人民币保证金路径选择</td><td colspan="3">☐主动返还　　☐主动扣收（☐含最低保证金）</td></tr>
<tr><td colspan="2">清算费用路径选择</td><td colspan="3">☐主动扣收（☐与人民币资金结算路径共用）</td></tr>
<tr><td colspan="5">以下信息由申请外币对交易中央对手清算业务的机构填写：</td></tr>
</table>

本金结算账户信息				
外币	会员SWIFT BIC CODE			
	美元	☐外汇结算银行	☐中国银行 （关系人账号：_____） ☐建设银行 ☐工商银行	
		☐境内外币支付系统	直参行行号	
			直参行行名	
			账号	
			户名	
	欧元	☐外汇结算银行	☐工商银行	
		☐境内外币支付系统	直参行行号	
			直参行行名	
			账号	
			户名	
	日元	☐外汇结算银行	☐工商银行	
		☐境内外币支付系统	直参行行号	
			直参行行名	
			账号	
			户名	
	港币	☐外汇结算银行	☐工商银行	
		☐境内外币支付系统	直参行行号	
			直参行行名	
			账号	
			户名	
	澳元	☐外汇结算银行	☐工商银行	
		☐境内外币支付系统	直参行行号	
			直参行行名	
			账号	
			户名	
	英镑	☐外汇结算银行	☐工商银行	
		☐境内外币支付系统	直参行行号	
			直参行行名	
			账号	
			户名	
	新加坡元	☐外汇结算银行	☐中国银行 （关系人账号：_____）	
	新西兰元	☐外汇结算银行	☐工商银行	
保证金账户信息				

<table>
<tr><td colspan="5">保证金交纳币种信息</td></tr>
<tr><td colspan="5">最低保证金 ☐人民币 ☐美元</td></tr>
<tr><td colspan="5">变动保证金 ☐人民币 ☐美元 （目前只能选人民币）</td></tr>
<tr><td rowspan="4">美元保证金</td><td rowspan="2">开户行</td><td>名称</td><td colspan="2"></td></tr>
<tr><td>SWIFT BIC CODE</td><td colspan="2"></td></tr>
<tr><td colspan="2">账号</td><td colspan="2"></td></tr>
<tr><td colspan="2">中间行 SWIFT BIC CODE</td><td colspan="2"></td></tr>
<tr><td colspan="3">人民币保证金
路径选择</td><td colspan="2">☐主动返还 ☐主动扣收（☐含最低保证金）</td></tr>
<tr><td colspan="3">清算费用路径选择</td><td colspan="2">☐主动扣收（☐与人民币资金结算路径共用）</td></tr>
<tr><td colspan="5">以下信息由申请外汇合并轧差和保证金账户合并服务的机构填写：</td></tr>
<tr><td rowspan="12">☐合并轧差</td><td colspan="4">☐与人民币外汇交易中央对手清算业务结算路径共用
（默认勾选，如不勾选，则须重新填写下面本金结算信息）</td></tr>
<tr><td rowspan="5">美元</td><td colspan="3">☐外汇结算银行（☐中国银行☐建设银行☐工商银行）
☐关系人账号（选填[18]）_____</td></tr>
<tr><td rowspan="4">☐境内外币支付系统</td><td>直参行行号</td><td></td></tr>
<tr><td>直参行行名</td><td></td></tr>
<tr><td>账号</td><td></td></tr>
<tr><td>户名</td><td></td></tr>
<tr><td rowspan="5">欧元</td><td colspan="3">☐外汇结算银行（☐工商银行）</td></tr>
<tr><td rowspan="4">☐境内外币支付系统</td><td>直参行行号</td><td></td></tr>
<tr><td>直参行行名</td><td></td></tr>
<tr><td>账号</td><td></td></tr>
<tr><td>户名</td><td></td></tr>
<tr><td rowspan="4">日元</td><td colspan="3">☐外汇结算银行（☐工商银行）</td></tr>
<tr><td rowspan="3">☐境内外币支付系统</td><td>直参行行号</td><td></td></tr>
<tr><td>直参行行名</td><td></td></tr>
<tr><td>账号</td><td></td></tr>
</table>

[18] 如选择结算银行为中国银行，此项必填。

<table>
<tr><td rowspan="19"></td><td></td><td></td><td>户名</td><td></td></tr>
<tr><td rowspan="5">港币</td><td colspan="3">☐外汇结算银行（☐工商银行）</td></tr>
<tr><td rowspan="4">☐境内外币支付系统</td><td>直参行行号</td><td></td></tr>
<tr><td>直参行行名</td><td></td></tr>
<tr><td>账号</td><td></td></tr>
<tr><td>户名</td><td></td></tr>
<tr><td rowspan="5">澳元</td><td colspan="3">☐外汇结算银行（☐工商银行）</td></tr>
<tr><td rowspan="4">☐境内外币支付系统</td><td>直参行行号</td><td></td></tr>
<tr><td>直参行行名</td><td></td></tr>
<tr><td>账号</td><td></td></tr>
<tr><td>户名</td><td></td></tr>
<tr><td rowspan="5">英镑</td><td colspan="3">☐外汇结算银行（☐工商银行）</td></tr>
<tr><td rowspan="4">☐境内外币支付系统</td><td>直参行行号</td><td></td></tr>
<tr><td>直参行行名</td><td></td></tr>
<tr><td>账号</td><td></td></tr>
<tr><td>户名</td><td></td></tr>
<tr><td>新加坡元</td><td colspan="3">☐外汇结算银行（☐中国银行）
☐关系人账号_____</td></tr>
<tr><td>新西兰元</td><td colspan="3">☐外汇结算银行（☐工商银行）</td></tr>
<tr><td>泰铢</td><td colspan="3">☐外汇结算银行（☐中信银行）
☐关系人账号_____</td></tr>
<tr><td rowspan="3">人民币
(☐主动扣收)</td><td>户名</td><td colspan="2"></td></tr>
<tr><td>行号</td><td colspan="2"></td></tr>
<tr><td>账号</td><td colspan="2"></td></tr>
<tr><td rowspan="4">☐保证金（含清算基金）账户合并</td><td colspan="4">☐与人民币外汇交易中央对手清算业务保证金结算路径共用（默认勾选，如不勾选，则须重新填写下面账户信息）</td></tr>
<tr><td colspan="2" rowspan="3">人民币保证金结算路径
（大额支付系统清算账户）</td><td>户名</td><td></td></tr>
<tr><td>行号</td><td></td></tr>
<tr><td>账号</td><td></td></tr>
</table>

	美元保证金提款路径	会员 SWIFT CODE	
		开户行 SWIFT CODE	
		账号	
		中间行 SWIFT CODE	
□主动扣收和返还设置	□人民币保证金主动扣收 □人民币保证金主动返还		

6.清算限额申请

根据申请业务的类型，填写相应的清算限额申请信息。

利率互换	风险敞口限额申请量	
标准债券远期	清算限额申请量	
债券集中清算业务	债券净额风险敞口限额	
	通用回购可融出限额	
人民币外汇交易中央对手清算	风险敞口限额（美元）	
外币对交易中央对手清算	风险敞口限额（美元）	
外汇竞价	人民币外汇清算限额（美元）	
	外币对清算限额（美元）	
信用违约互换	风险敞口限额申请量	
大宗商品衍生品	清算限额申请量	
其他（_____）		
申报说明		

7.持仓限额申请（仅大宗商品衍生品业务填写）

请根据实际业务参与情况，申报持仓限额

序号	限额种类	申请限额（手）	序号	限额种类	申请限额（手）

8.轧差方式

仅由选择外汇中央对手清算业务的机构勾选
以下信息由申请人民币外汇交易中央对手清算业务的机构填写：
☐自营代理分开轧差（默认）　☐自营代理合并轧差
以下信息由申请外币对交易中央对手清算业务的机构填写：
☐自营代理分开轧差（默认）　☐自营代理合并轧差
单位公章： 日期： 若申请表单涉及多页的，均需加盖骑缝章。

上海清算所集中清算业务非清算会员信息表（代理）

<table>
<tr><td>业务名称</td><td colspan="3">☐债券（☐现券 ☐质押式回购 ☐买断式回购 ☐通用回购）
☐人民币外汇（☐即期 ☐远期 ☐掉期 ☐期权 ☐T+1即期 ☐T+1掉期 ☐T+1期权 ☐长期限远期 ☐长期限掉期 ☐SGD/CNY即期 ☐NZD/CNY即期 ☐CNY/THB即期）☐外币对（☐澳元/美元 ☐欧元/美元 ☐英镑/美元 ☐美元/港币 ☐美元/日元 ☐美元/新加坡元 ☐新西兰元/美元）
☐利率互换 ☐标准债券远期 ☐信用违约互换
☐大宗商品衍生品 ☐其他（_____）</td></tr>
<tr><td>综合清算会员全称</td><td></td><td rowspan="3">综合清算会员代理业务印鉴</td><td rowspan="3"></td></tr>
<tr><td>综合清算会员持有人账号（7位码）</td><td>需填写债券净额综合清算会员账号</td></tr>
<tr><td>综合清算会员编码</td><td>仅大宗商品衍生品业务需填写</td></tr>
<tr><td colspan="4">1.申请机构基本信息（非清算会员）</td></tr>
<tr><td>非清算会员全称</td><td colspan="3">（中文；需与交易中心、上海清算所记录的信息保持一致）</td></tr>
<tr><td>非清算会员全称</td><td colspan="3">（英文；需与交易中心、上海清算所记录的信息保持一致）</td></tr>
<tr><td>非清算会员简称</td><td colspan="3">（中文；需与交易中心、上海清算所记录的信息保持一致）</td></tr>
<tr><td>非清算会员简称</td><td colspan="3">（英文；需与交易中心、上海清算所记录的信息保持一致）</td></tr>
<tr><td>非清算会员账号（非清算会员持有人账号，7位码）</td><td colspan="3"></td></tr>
<tr><td>全国银行间同业拆借中心会员代码（21位）</td><td colspan="3"></td></tr>
</table>

<table>
<tr><td>注册地址</td><td colspan="2"></td></tr>
<tr><td>通讯地址</td><td colspan="2"></td></tr>
<tr><td>统一社会信用代码
（境内机构）</td><td colspan="2"></td></tr>
<tr><td>金融许可证号码</td><td colspan="2">（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□保险公司法人许可证□保险资产管理公司法人许可证□其它）</td></tr>
<tr><td rowspan="4">非清算会员机构类别
（首次报备填写）</td><td>□特殊账户</td><td>□其他特殊机构</td></tr>
<tr><td>□存款类银行业金融机构</td><td>□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_____</td></tr>
<tr><td>□政策性银行及国家开发银行</td><td>□政策性银行 □开发性金融机构</td></tr>
<tr><td>□非银行金融机构</td><td>□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_____</td></tr>
</table>

	☐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 _____	
2.清算限额等风控参数申请			
□利率互换代理业务			
非清算会员风险敞口限额			
生效日期			
保证金充足率[19]（%）			
生效日期			
□信用违约互换业务			
非清算会员风险敞口限额			
生效日期			
保证金充足率[20]（%）			
生效日期			
□标准债券远期代理业务			
非清算会员清算限额（千万）		非清算会员容忍度（元）	
生效日期			
□债券集中清算代理业务[21]			
□债券净额业务			

[19]若该栏位空缺，则上海清算所默认设置为 100%。
[20]若该栏位空缺，则上海清算所默认设置为 100%。
[21]若仅申请债券净额业务权限，则仅需要填写债券净额业务栏目下的非清算会员风险敞口限额和保证金充足率；若仅申请通用回购业务权限，则仅需要填写通用回购栏目下的通用回购可融资总额上限、通用回购可融出总额上限、通用回购可融出限额和通用回购可融出限额容忍度；若同时申请债券净额和通用回购业务权限，则上述参数均需要填写。

非清算会员风险敞口限额	
保证金充足率[22]	
□通用回购业务	
非清算会员可融资总额上限	
非清算会员可融出总额上限	
非清算会员可融出限额	
非清算会员可融出限额容忍度	
非清算会员清算限额初始设置/调整说明：	
□人民币外汇交易中央对手清算代理业务	
非清算会员风险敞口阈值（美元）	
非清算会员风险敞口容忍度（选填）	
生效日期	
□外币对交易中央对手清算代理业务	
非清算会员风险敞口阈值（美元）	
非清算会员风险敞口容忍度（选填）	
生效日期	
□大宗商品衍生品中央对手清算代理业务	

[22]若该栏位空缺，则上海清算所默认设置为 100%。

非清算会员清算限额						
持仓限额	序号	限额种类	申请限额（手）	序号	限额种类	申请限额（手）

3.业务操作权限申请（仅债券、外汇业务填写）	
代理确认方式（债券净额业务）	☐逐笔确认　　☐超限确认　　☐默认全部确认
代理确认方式（人民币外汇交易中央对手清算业务）	☐逐笔确认　　☐默认全部确认
代理确认方式（外币对交易中央对手清算业务）	☐逐笔确认　　☐默认全部确认
注：非清算会员的代理确认方式由综合清算会员进行设置。	

4.账户信息（仅外汇业务填写）			
以下信息由申请人民币外汇交易中央对手清算业务的机构填写：			
保证金交纳币种信息			
最低保证金	人民币☐　　美元☐		
变动保证金	人民币☐　　美元☐　（目前只能选人民币）		
保证金账户信息			
美元保证金	开户行	名称	
		SWIFT BIC CODE	
	账号		
	中间行 SWIFT BIC CODE		
	综清 SWIFT BIC CODE		

<table>
<tr><td rowspan="10">人民币
保证金</td><td colspan="2">付款路径选择</td><td>☐主动扣收（☐最低保证金账户☐变动保证金账户）</td></tr>
<tr><td colspan="2">付款开户行行号</td><td></td></tr>
<tr><td colspan="2">付款开户行名称</td><td></td></tr>
<tr><td colspan="2">付款账号</td><td></td></tr>
<tr><td colspan="2">付款人名称</td><td></td></tr>
<tr><td colspan="2">提款路径选择</td><td>☐主动返还（变动保证金账户）
☐与付款路径共用</td></tr>
<tr><td colspan="2">提款开户行行号</td><td></td></tr>
<tr><td colspan="2">提款开户行名称</td><td></td></tr>
<tr><td colspan="2">提款账号</td><td></td></tr>
<tr><td colspan="2">提款人名称</td><td></td></tr>
<tr><td colspan="4">以下信息由申请外币对交易中央对手清算业务的机构填写：</td></tr>
<tr><td colspan="4">保证金交纳币种信息</td></tr>
<tr><td colspan="2">最低保证金</td><td colspan="2">人民币☐　　美元☐</td></tr>
<tr><td colspan="2">变动保证金</td><td colspan="2">人民币☐　　美元☐　（目前只能选人民币）</td></tr>
<tr><td colspan="4">保证金账户信息</td></tr>
<tr><td rowspan="5">美元
保证金</td><td rowspan="2">开户行</td><td>名称</td><td></td></tr>
<tr><td>SWIFT BIC CODE</td><td></td></tr>
<tr><td colspan="2">账号</td><td></td></tr>
<tr><td colspan="2">中间行 SWIFT BIC CODE</td><td></td></tr>
<tr><td colspan="2">综清 SWIFT BIC CODE</td><td></td></tr>
<tr><td rowspan="4">人民币
保证金</td><td colspan="2">付款路径选择</td><td>☐主动扣收（☐最低保证金账户☐变动保证金账户）</td></tr>
<tr><td colspan="2">付款开户行行号</td><td></td></tr>
<tr><td colspan="2">付款开户行名称</td><td></td></tr>
<tr><td colspan="2">付款账号</td><td></td></tr>
</table>

	付款人名称	
	提款路径选择	☐主动返还（变动保证金账户） ☐与付款路径共用
	提款开户行行号	
	提款开户行名称	
	提款账号	
	提款人名称	

以下信息由申请外汇保证金账户合并服务的机构填写：

人民币保证金结算路径（大额支付系统清算账户）	付款路径选择	☐主动扣收
	户名	
	行号	
	账号	

5. 非清算会员人员信息

姓名	部门职务	手机	传真	Email	备注

申请机构承诺事项：

1. 我单位保证提供的所有信息真实、完整、准确；

2. 我单位授权银行间市场清算所股份有限公司在集中清算业务中对我公司上述提供的账户进行自动的借记和贷记处理。

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；若申请表单涉及多页的，均需加盖骑缝章。

2. 非清算会员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. 非清算会员账号为非清算会员在上海清算所系统中的持有人账号。

C-1 V202612

上海清算所清算会员信息变更登记表

清算会员名称（全称）	
清算会员持有人账号（7 位码）	
清算会员编码	（仅大宗商品衍生品业务需填写）
清算会员 Swift BIC Code	（外汇业务账户路径变更须填此项）
参与业务名称	☐债券（☐现券 ☐质押式回购 ☐买断式回购 ☐通用回购） ☐人民币外汇（☐即期 ☐远期 ☐掉期 ☐期权 ☐T+1即期 ☐T+1掉期 ☐T+1期权☐长期限远期 ☐长期限掉期 ☐SGD/CNY即期 ☐NZD/CNY即期 ☐CNY/THB即期）☐外币对（☐澳元/美元 ☐欧元/美元 ☐英镑/美元 ☐美元/港币 ☐美元/日元 ☐美元/新加坡元 ☐新西兰元/美元） ☐外汇竞价（☐人民币外汇竞价 ☐外币对竞价） ☐利率互换 ☐标准债券远期 ☐信用违约互换 ☐大宗商品衍生品 ☐其他（_____）
业务类型	☐自营 ☐代理

<table>
<tr><td>变更项目</td><td colspan="5">基础信息类变更
☐申请机构人员信息（变更后信息需包括：姓名、用户名、联系电话、邮箱等）
☐客户终端管理员信息注销及新增（变更后信息需包括：用户姓名、用户 ID、联系电话、身份证件号）
☐客户终端管理员密码重置（变更后信息需包括：用户姓名、用户 ID；如需解锁密码并重置，请注明，重置后密码为初始密码）
☐账户信息（外汇账户信息变更要素包括：中间行行名（如有）、开户行 SWIFT BIC CODE、机构开在开户行的账号；如外币账户为开在境内外币支付系统的账户，调整时应当明确直参行行号、直参行行名、账号和户名；人民币账户信息变更要素包括：户名、行号、账号）
☐费用发票寄送信息（仅适用于变更发票寄送信息，非采集信息）
☐机构更名（变更后信息需包括：全称、简称、结算资金路径、提款路径）
☐其他（_____）</td></tr>
<tr><td></td><td colspan="5">CFCA证书信息变更：</td></tr>
<tr><td></td><td colspan="5">☐证书换发（☐新发UKEY ☐不需UKEY） 证书CN：_____</td></tr>
<tr><td></td><td colspan="5">☐证书补发（☐新发UKEY ☐不需UKEY） 证书CN：_____</td></tr>
<tr><td></td><td colspan="5">☐证书重发（不需UKEY） 证书CN：_____</td></tr>
<tr><td></td><td colspan="5">☐证书解锁（不需 UKEY） 证书 CN：_____
UKEY序列号：_____</td></tr>
<tr><td></td><td colspan="5">☐证书吊销 证书CN：_____</td></tr>
<tr><td></td><td colspan="5">☐其他：_____</td></tr>
<tr><td></td><td>证书经办人信息</td><td>经办人姓名</td><td></td><td>联系电话</td><td></td></tr>
<tr><td></td><td></td><td>电子邮箱</td><td colspan="3"></td></tr>
<tr><td></td><td>UKEY收件信息</td><td>收件人姓名</td><td></td><td>联系电话</td><td></td></tr>
<tr><td></td><td></td><td>收件地址</td><td></td><td>邮政编码</td><td></td></tr>
<tr><td></td><td colspan="5">管理员变更
☐新增 ☐注销 ☐密码重置
用户ID_____</td></tr>
</table>

	用户姓名_____ 证书CN_____
	风险管理参数相关变更 ☐清算限额 ☐保证金充足率（仅代理业务） ☐代理确认方式（变更后信息需明确业务类别为：外汇中央对手清算、利率互换、信用违约互换；确认方式为：默认确认、逐笔确认、超限确认或其他） ☐最低保证金已缴资产币种置换（变更前后信息需包括：币种、金额） ☐单产品持仓限额 ☐单产品次到期月持仓限额 ☐单产品到期月持仓限额 ☐日间容忍度 ☐其他（_____）
	资金路径相关变更(是否主动扣收) ☐人民币本金路径 ☐人民币保证金路径（☐最低保证金账户☐变动保证金账户） ☐清算费用路径 ☐清算基金路径 ☐标准债券远期实物交割资金结算路径 **资金路径相关变更(是否主动返还)** ☐人民币保证金路径（☐最低保证金账户☐变动保证金账户） ☐清算基金路径 ☐其他（_____）

<table>
<tr><td></td><td>外汇合并轧差和保证金（含清算基金）账户合并服务相关
☐合并轧差（默认通过原人民币外汇中央对手清算业务的结算路径完成结算。如有其他要求，请在变更后信息中明确。）
☐保证金（含清算基金）账户合并（默认将原人民币外汇业务的人民币变动保证金账户、美元最低保证金账户、清算基金账户设为合并后的人民币保证金账户、美元保证金账户、清算基金账户。如有其他要求，请在变更后信息中明确。）
☐主动扣收和返还设置 （☐人民币保证金主动扣收 ☐人民币保证金主动返还 ☐清算基金主动扣收 ☐清算基金主动返还）
申请保证金（含清算基金）账户合并服务，请填写下表账户信息。
<table>
<tr><td rowspan="3">1.人民币保证金结算路径
（大额支付系统清算账户）</td><td>户名</td><td></td></tr>
<tr><td>行号</td><td></td></tr>
<tr><td>账号</td><td></td></tr>
<tr><td rowspan="4">2.清算基金结算路径
（大额支付系统清算账户）</td><td colspan="2">☐与保证金相同（勾选则无须填写下述信息）</td></tr>
<tr><td>户名</td><td></td></tr>
<tr><td>行号</td><td></td></tr>
<tr><td>账号</td><td></td></tr>
<tr><td rowspan="4">3.美元保证金提款路径</td><td>会员 SWIFT CODE</td><td></td></tr>
<tr><td>开户行 SWIFT CODE</td><td></td></tr>
<tr><td>账号</td><td></td></tr>
<tr><td>中间行 SWIFT CODE</td><td></td></tr>
<tr><td>4.美元保证金缴款路径</td><td colspan="2">☐中国银行 ☐建设银行 ☐工商银行
（默认填写人民币外汇业务美元结算银行）</td></tr>
</table></td></tr>
<tr><td>变更前信息</td><td></td></tr>
<tr><td>变更后信息</td><td></td></tr>
</table>

变更生效时间	（选填，以实际收到原件为准）
变更情况说明	
以下仅在选择变更项目为“账户信息”、“标准债券远期实物交割资金结算路径”，且为“新开资金结算专户”时填写： 我单位申请在贵公司开立资金结算专户（　　业务专用），并作如下授权： 授权一：授权贵公司根据日终清算结果进行直接借记或贷记处理。 授权二：授权贵公司可直接通过我单位资金结算专户（　　业务专用）直接扣收我公司因　　业务产生的清算款项及相关税收、费用等，无须事先通知；承诺该“资金结算专户”为我公司　　业务结算资金转账存入账户及提取结算资金的收款账户。	
选择变更项目为“CFCA 证书换发”、“CFCA 证书补发”、“CFCA 证书重发”时，做出如下承诺： 我单位委托上海清算所代我单位向中国金融认证中心（CFCA）申请数字证书。我单位同意提交我单位的企业名称、企业编码等企业信息用于向 CFCA 申请数字证书，并承诺上述信息真实、有效。我单位知悉数字证书将绑定企业的身份信息，通过其作出的电子签名代表我单位的真实意思表示，经过电子签名的数据电文代表我单位知悉并认可其中所载内容。我单位已认真阅读 CFCA 官网（www.cfca.com.cn）发布的《CFCA 数字证书服务协议》《数字证书使用安全提示》《电子认证业务规则》等内容，接受并愿意遵守上述所有条款。	
选择变更项目为“证书补发”、“证书换发”“证书重发”“证书解锁”“证书吊销”时，做出如下承诺：兹声明：我单位委托上海清算所代我单位向中国金融认证中心（CFCA）申请数字证书。我单位同意提交我单位的企业名称、企业编码等企业信息用于向 CFCA 申请数字证书，并承诺上述信息真实、有效。我单位知悉数字证书将绑定企业的身份信息，通过其作出的电子签名代表我单位的真实意思表示，经过电子签名的数据电文代表我单位知悉并认可其中所载内容。我单位已认真阅读 CFCA 官网（www.cfca.com.cn）发布的《CFCA 数字证书服务协议》《数字证书使用安全提示》《电子认证业务规则》等内容，接受并愿意遵守上述所有条款。	
承诺事项	

<table>
<tr><td colspan="4">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：</td></tr>
<tr><td>经办人</td><td></td><td>联系电话</td><td></td></tr>
<tr><td></td><td></td><td>邮箱</td><td></td></tr>
</table>

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，若申请表单涉及多页的，均需加盖骑缝章：

（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；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 V202612

非清算会员信息变更登记表

综合清算会员全称_____ 综合清算会员代客业务印章

综合清算会员持有人账号__债券净额代理业务需填写债券净额综合清算会员账号，其他业务填写综合清算会员持有人账号_____

综合清算会员编码_____仅大宗商品衍生品业务需填写_____

变更报备信息	
非清算会员全称	若为单一项目批量调整的填写“见附表”
非清算会员简称	若为单一项目批量调整的填写“见附表”
非清算会员持有人账号	若为单一项目批量调整的填写“见附表”
清算参与者编码	仅大宗商品衍生品业务需填写；若为单一项目批量调整的填写“见附表”
参与业务名称	☐债券（☐现券 ☐质押式回购 ☐买断式回购 ☐通用回购） ☐人民币外汇（☐即期 ☐远期 ☐掉期 ☐期权 ☐T+1即期 ☐T+1掉期 ☐T+1期权☐长期限远期 ☐长期限掉期 ☐SGD/CNY即期 ☐NZD/CNY即期 ☐CNY/THB即期）☐外币对（☐澳元/美元 ☐欧元/美元 ☐英镑/美元 ☐美元/港币 ☐美元/日元 ☐美元/新加坡元 ☐新西兰元/美元） ☐利率互换 ☐标准债券远期 ☐信用违约互换 ☐大宗商品衍生品 ☐其他（_____）
变更项目（若为单一项目批量调整的，只能勾选一个变更项目）	☐申请机构基本信息（变更后信息需包括：姓名、用户名、联系电话、邮箱等） ☐清算限额 ☐代理关系 ☐代理确认方式

<table>
<tr><td></td><td colspan="5">☐账户信息（外汇账户信息变更要素包括：中间行行名、开户行SWIFT BIC CODE、机构开在开户行的账号；人民币账户信息变更要素包括：户名、行号、账号）
☐非清算会员人员信息
☐单产品持仓限额
☐单产品次到期月持仓限额
☐单产品到期月持仓限额
☐人民币本金路径(是否主动扣收)
☐人民币保证金路径(①是否主动扣收：☐最低保证金账户☐变动保证金账户；②是否主动返还：☐变动保证金账户)
☐清算费用路径(是否主动扣收)
☐标准债券远期实物交割资金结算路径
☐其他（_____）</td></tr>
<tr><td></td><td colspan="5">CFCA证书信息变更：</td></tr>
<tr><td></td><td colspan="5">☐证书换发（☐新发 UKEY ☐不需 UKEY） 证书 CN：_____</td></tr>
<tr><td></td><td colspan="5">☐证书补发（☐新发 UKEY ☐不需 UKEY） 证书 CN：_____</td></tr>
<tr><td></td><td colspan="5">☐证书重发（不需 UKEY） 证书 CN：_____</td></tr>
<tr><td></td><td colspan="5">☐证书解锁（不需UKEY） 证书CN：_____
UKEY 序列号：_____</td></tr>
<tr><td></td><td colspan="5">☐证书吊销 证书 CN：_____</td></tr>
<tr><td></td><td colspan="5">☐其他_____</td></tr>
<tr><td></td><td rowspan="2">证书经办人信息</td><td>经办人姓名</td><td></td><td>联系电话</td><td></td></tr>
<tr><td></td><td>电子邮箱</td><td></td><td></td><td></td></tr>
<tr><td></td><td rowspan="2">UKEY 收件信息</td><td>收件人姓名</td><td></td><td>联系电话</td><td></td></tr>
<tr><td></td><td>收件地址</td><td></td><td>邮政编码</td><td></td></tr>
</table>

	管理员变更 ☐新增 ☐注销 ☐密码重置 用户ID_____ 用户姓名_____ 证书CN_____
变更前信息	变更项目1：新增参与业务范围（变更前信息：变更前参与业务名称及范围） 变更项目2：资金路径相关变更（变更前信息：未开通人民币本金/人民币保证金/清算费用主动扣收） 变更项目3：标准债券远期实物交割资金结算路径（变更前信息：现券DVP结算的资金结算账户） 变更项目4：外汇保证金账户合并（变更前信息：为人民币外汇中央对手清算业务、外币对中央对手清算业务分别开立保证金账户） 若为单一项目批量调整的填写“见附表”
变更后信息	变更项目1：新增参与业务范围（变更后信息：变更后参与业务名称及范围） 变更项目2：资金路径相关变更（变更后信息：开通人民币本金/人民币保证金（最低保证金/变动保证金）/清算费用主动扣收），大额支付系统清算账户主动扣收路径信息：户名（**）、行号（**）、账号（**） 变更项目3：标准债券远期实物交割资金结算路径（变更后信息：开立用于标准债券远期实物交割业务的资金结算账户） 变更项目4：外汇保证金账户合并（变更后信息：申请人民币外汇中央对手清算业务、外币对中央对手清算业务保证金账户合并，大额支付系统清算账户结算信息：户名（**）、行号（**）、账号（**），并开通人民币保证金主动扣收（如需））。 若为单一项目批量调整的填写“见附表”
变更生效日期	
变更情况说明	

若为单一项目批量调整，应说明：“本次单一项目的批量调整，调整数量为X家。”
选择变更项目为“CFCA 证书换发”、“CFCA 证书补发”、“CFCA 证书重发”时，做出如下承诺： 我单位委托上海清算所代我单位向中国金融认证中心（CFCA）申请数字证书。我单位同意提交我单位的企业名称、企业编码等企业信息用于向CFCA申请数字证书，并承诺上述信息真实、有效。我单位知悉数字证书将绑定企业的身份信息，通过其作出的电子签名代表我单位的真实意思表示，经过电子签名的数据电文代表我单位知悉并认可其中所载内容。我单位已认真阅读CFCA官网（www.cfca.com.cn）发布的《CFCA数字证书服务协议》《数字证书使用安全提示》《电子认证业务规则》等内容，接受并愿意遵守上述所有条款。
注： 1．请在电子版上填写后打印、盖章；若申请表单涉及多页的，均需加盖骑缝章。 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．非清算会员账号为非清算会员在上海清算所系统中的持有人账号。 4. 综合清算会员进行单一变更项目批量报备调整的，应在相应提示栏位填写“见附表”并与填写完成的 C-2 附表一起提交； 5.本表单不适用申请外汇中央对手清算业务一对多代理关系的非清算会员选择默认综合清算会员的业务场景。 6. 本登记表单（包括或有的 C-2 附表在内）双面打印超过 2 页、单面打印超过 1 页的，应盖骑缝章。

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

C-2 附表（仅 C-2 为单一项目批量调整时需填写并提交）

编号	非清算会员全称	非清算会员简称	非清算会员持有人账号	清算参与者编码	变更前信息	变更后信息
1				仅大宗商品衍生品业务需填写；		
2				仅大宗商品衍生品业务需填写；		

注：1. 上表可自主增减行数，除表头部分以外的行数应对应本次批量调整数量，不可留空行。

2. 本附表单独提交无效，填写完毕后应与 C-2 同时提交。

上海清算所集中清算业务退出申请表

清算会员名称（全称）	
持有人账号	
已参与业务名称	☐债券（☐现券 ☐质押式回购 ☐买断式回购 ☐通用回购） ☐人民币外汇（☐即期 ☐远期 ☐掉期 ☐期权 ☐T+1即期 ☐T+1掉期 ☐T+1期权☐长期限远期 ☐长期限掉期 ☐SGD/CNY即期 ☐NZD/CNY即期 ☐CNY/THB即期）☐外币对（☐澳元/美元 ☐欧元/美元 ☐英镑/美元 ☐美元/港币 ☐美元/日元 ☐美元/新加坡元 ☐新西兰元/美元） ☐外汇竞价 ☐利率互换 ☐标准债券远期 ☐信用违约互换 ☐大宗商品衍生品 ☐其他（_____）
申请退出业务名称	☐债券（☐现券 ☐质押式回购 ☐买断式回购 ☐通用回购） ☐人民币外汇（☐即期 ☐远期 ☐掉期 ☐期权 ☐T+1即期 ☐T+1掉期 ☐T+1期权☐长期限远期 ☐长期限掉期 ☐SGD/CNY即期 ☐NZD/CNY即期 ☐CNY/THB即期）☐外币对（☐澳元/美元 ☐欧元/美元 ☐英镑/美元 ☐美元/港币 ☐美元/日元 ☐美元/新加坡元 ☐新西兰元/美元）） ☐外汇竞价 ☐利率互换 ☐标准债券远期 ☐信用违约互换 ☐大宗商品衍生品 ☐其他（_____）
业务类型	☐自营 ☐代理
是否同时申请终止清算会员资质	☐是 ☐否
是否同时注销CFCA证书信息	☐是 ☐否
说明	

<table>
<tr><td colspan="4"></td></tr>
<tr><td>承诺事项</td><td colspan="3"></td></tr>
<tr><td colspan="4">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：</td></tr>
<tr><td>经办人</td><td></td><td>联系电话</td><td></td></tr>
</table>

备注：勾选同时申请终止清算会员资质的，需提交《清算会员资质终止申请书》。