银行间市场清算所股份有限公司
合约类信用风险缓释工具双边清算业务操作指南

（修订征求意见稿）

1. 总则

为规范银行间市场参与者开展合约类信用风险缓释工具双边清算业务（以下简称本业务），银行间市场清算所股份有限公司（以下简称上海清算所）依据《关于开展信用风险缓释工具登记托管、清算结算业务有关事项的通知》（清算所发〔2017〕69号）《信用违约互换逐笔清算业务操作须知》，制定本操作指南。

本业务参与者原则上适用《银行间市场本币衍生品双边清算协议》，已入市参与者可沿用《结算成员服务协议》。本业务参与者应在规定时点前在相关账户中备付足额资金和债券，并授权上海清算所根据清算结果对本机构提供的账户进行自动的借记、贷记和担保处理。

2. 业务参与

2.1 参与者资质

具有中国银行间市场交易商协会的信用风险缓释工具核心交易商与一般交易商资质，且与上海清算所签署《银行间市场本

币衍生品双边清算协议》或《结算成员服务协议》的市场机构，可通过上海清算所办理本业务。

2.2 业务参与准备

2.2.1 信息登记

使用上海清算所信用违约互换清算系统（以下简称清算系统）开展本业务的参与者还应在业务开展前通过清算系统进行电子化的参与者信息登记。具有上海清算所综合业务系统账号的机构可使用其综合业务系统管理员账号直接登录清算系统，在业务申请界面录入并复核本机构基本信息。非法人产品管理人或托管人可为其管理或托管的非法人产品办理线上信息登记。上海清算所对机构提交的入市信息进行审核，如审核通过，上海清算所根据机构信息进行系统配置；如审核不通过，上海清算所向机构反馈原因，机构可修改信息后再次提交申请。

此外，本业务参与者也可通过应急方式提交《上海清算所合约类信用风险缓释工具双边清算业务信息登记表》（附件 1，以下简称《登记表》）进行信息登记。

2.2.2 指定或开立账户

参与者应具有上海清算所登记托管业务债券账户，并指定本业务的资金结算账户。其中，债券账户用于本业务信用事件的实物结算和双边履约保障品管理；资金结算账户用于各类应收应付金额的资金结算。应收应付金额包括但不限于前端费、期初返还金额、首期支付金额、信用保护费等。

2.2.3 印鉴卡

本业务印鉴卡沿用上海清算所登记托管业务印鉴卡，印鉴卡预留印鉴可用于本业务参与者信息变更、业务退出申请、发送应急指令等情形。

2.3 参与者信息变更

参与者变更资金结算账户、系统管理员等信息的，应向上海清算所提交《上海清算所合约类信用风险缓释工具双边清算业务信息变更登记表》（附件 2），完成变更手续。

上海清算所收到附件 2 后将于 3 个工作日内完成审核。材料未通过审核，上海清算所将向变更申请机构反馈结果及原因；材料通过审核，上海清算所将完成变更手续。

2.4 参与者退出本业务

参与者可自愿申请退出本业务。申请退出本业务的，需向上海清算所提交《上海清算所合约类信用风险缓释工具双边清算业务退出申请表》（附件 3），并确保退出时已无与本业务相关的债权债务关系并已结清费用。

上海清算所在确认该参与者已无与本业务相关的债权债务关系并结清费用后，办理退出手续，并注销客户终端相关权限。上海清算所将向本业务联系人反馈退出完成通知。

3. 业务流程

3.1 合约类信用风险缓释工具双边清算业务要素规定

表 1：单名信用违约互换、信用风险缓释合约双边清算业务的要素规定

一般要素			
信用保护买方	本业务参与者	**信用保护卖方**	本业务参与者
参考实体	约定	**交易名义本金**	约定，单位（万元人民币）
交易日	约定	**期限**	约定
起始日	约定	**约定到期日**	约定，不按营业日准则调整
参考比例	100%，可约定	**营业日准则**	经调整的下一营业日、下一营业日、上一营业日
支付频率	周、两周、月、季、半年、年、到期	**首期支付日**	起始日起按支付频率推算或约定，按营业日准则调整
前端费	约定，单位（元）	**期初返还金额**	约定，单位（元）
计息天数调整	不调整、实际天数	**计息基准**	A/360、A/365、A/A、A/365F
前端费支付日	约定	**费率**	约定，单位 bps
与信用事件有关要素			
信用事件	破产、支付违约、债务加速到期、债务潜在加速到期、债务重组、其他		
债务种类	付款义务、借贷款项、贷款、债务工具、贷款或债务工具、仅为参考债务、非金融企业债务融资工具、其他		
债务特征	一般债务、次级债务、交易流通、无扣减债务、可转让贷款、转让受限贷款、本币、外币、其他		
结算方式	现金结算、实物结算	**最终比例**	约定

表 2：信用违约互换指数双边清算业务的要素规定

指数名称		**指数管理人**	
一般要素			

币种	例：人民币	**期限**	例：季月 20 日标准到期日
起始日	例：交易日的下一个自然日	**支付频率**	例：季
计息基准	例：A/365	**费率（标准票息）**	例：25bp
贴现曲线	FR007 利率互换收盘曲线（即期）	**营业日准则**	例：经调整的下一营业日
计息天数调整	例：实际天数		
信用事件要素			
债务种类	例：债务工具	**债务特征**	例：一般债务；本币；交易流通；
信用事件	例：破产、支付违约（起点金额 100 万元人民币或其等值金额；宽限期 3 个营业日；适用宽限期顺延）		
结算要素			
结算方式	例：现金结算		
约定最终比例	例：0.25	**通过估值确定**	例：报价方法：买入价 报价时间：一个营业日的北京时间 16：00 估值方法：市场价格
可交付债务种类	例：债务工具	**可交付债务特征**	例：一般债务；本币；交易流通
其他约定要素			
要素名称	**要素枚举值**		
……	……		
……	……		
流通规则			
指数滚动	☐指数滚动后，新指数上市交易，原指数不再交易		
	☐指数滚动后，新指数上市交易，原指数继续交易		
	☐其他		
信用事件	☐信用事件发生后，发生信用事件的实体除名，原指数更名后继续交易		
	☐信用事件发生后，发生信用事件的实体除名，原指数继续交易，不更名		
	☐信用事件发生后，发生信用事件的实体除名，原指数补足新实体，更名后继续交易		
	☐其他		

上述规定要素的定义与《中国场外信用衍生产品交易基本术

语与适用规则（2022 年版）》一致。

3.2 日间清算处理

表 3：本业务清算系统运行时间表

日期	时间	事项
T 日	9:00	开市
	9:00-17:00	日间数据接收
	9:00-16:50	T+0 交易日间清算结算
	16:40	清算确认截止时点
	16:30	资金提款截止时点
	17:00	闭市
	17:30	日终清算处理 日终信用事件清算处理
T+1/T+N 日	13:00	非 T+0 交易应收应付资金结算启动时点 应收应付信用事件结算（或有）启动时点
	16:50	非 T+0 交易应收应付资金结算截止时点 应收应付信用事件结算（或有）截止时点

9:00-17:00，本业务清算系统实时接收通过中国人民银行认可机构的交易系统、电话、传真以及经纪撮合等方式达成的合约类信用风险缓释工具交易数据。其中，清算系统于 16:40 停止接收前端费支付日在交易日当天的交易数据（以下简称 T+0 交易）和外汇交易中心传输的交易数据；清算系统于 17:00 停止接收其他交易数据。

本业务清算系统实时对提交双边清算的合约类信用风险缓释工具交易进行要素合规性检查，检查通过后经交易双方清算确认，成功后实时生效。

3.2.1 接单处理

1）要素合规性检查

清算系统对于提交双边清算的成交数据实时进行要素检查：

一是交易双方是否均已完成本业务参与者信息登记；二是成交数据是否符合本业务要素规定。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，上海清算所不纳入双边清算处理。

2）清算确认

通过要素合规性检查的交易将进入清算确认环节：交易双方通过清算系统客户终端对交易要素进行清算确认后，交易实时纳入上海清算所双边清算处理。清算确认截止时点为 16:40，通过交易系统提交的成交数据将于日终清算前系统默认清算确认。对于未进行清算确认的合约类信用风险缓释工具交易，上海清算所不纳入双边清算处理，参与者可通过清算系统客户终端查询相关信息。

3）T+0 交易日间清算

9:00-16:50，对于已纳入双边清算的 T+0 交易，清算系统将实时进行清算处理。清算系统双边全额计算当日需结算的应收应付金额，包括前端费、期初返还金额（如适用），并生成资金结算清单。参与者可通过清算系统客户终端查看资金结算清单，并根据单据准备资金。

3.2.2 存续期交易处理

3.2.2.1 信用事件处理

对于单名信用违约互换、信用风险缓释合约交易，存续期内交易对应的参考实体或参考债务如发生约定的信用事件，需由信

用事件通知方向另一方发送确认该信用事件已发生的书面通知以及与所述信用事件有关的公开信息的书面通知。同时，交易双方对信用事件结算要素协商一致后，需于17:30前通过清算系统客户终端提交信用事件处理信息，交易双方确认后，上海清算所将组织交易双方完成信用事件清算结算。

对于信用违约互换指数交易，存续期内指数成分实体发生信用事件，应由指数管理人判定参考实体发生信用事件，并告知上海清算所信用事件结算要素、信用事件除名后的新指数实体列表以及更新后的信用违约互换指数名称（若有）等信息，上海清算所将组织交易双方完成信用事件清算结算。指数交易发生信用事件后，交易仍然存续，直到全部参考实体均发生信用事件或交易到期。

3.2.2.2 清算退出

市场参与者可对已纳入上海清算所双边清算的合约类信用风险缓释工具交易进行清算退出。交易双方需于16:30前通过清算系统客户终端提交清算退出申请并完成确认，该交易在清算系统中的状态变更为“清算退出”。上海清算所出具清算退出通知单，不再对清算退出的交易进行双边清算处理。清算系统亦接收外汇交易中心传输的清算退出数据，完成相关交易的清算退出处理。

3.2.2.3 提前终止

市场参与者可对已纳入上海清算所双边清算的合约类信用

风险缓释工具交易进行全部或部分提前终止。交易双方需于16:30前通过清算系统客户终端提交提前终止申请并完成确认，该交易在清算系统中的状态变更为“提前终止”或“部分提前终止”。提前终止申请要素包括提前终止结算金额、提前终止名义本金及付款机构。上海清算所出具提前终止通知单；根据提前终止申请要素组织交易双方完成提前终止结算金额的清算结算，并出具资金结算完成通知单。

3.3 日终清算处理

17:30，本业务清算系统对次一工作日需进行结算的交易进行日终清算处理，并生成资金应收应付通知单和信用事件应收应付通知单等。

清算系统双边全额地计算次一工作日需结算的应收应付金额，包括前端费（非T+0交易）、期初返还金额（如适用，非T+0交易）、信用保护费、提前终止结算金额（或有）、剩余应计保费（或有）、信用事件结算金额（或有）等。

如信用事件结算方式为实物结算，清算系统将于交割日前一工作日双边生成债券交付信息。

参与者于日终可通过清算系统客户终端查看资金应收应付通知单和信用事件应收应付通知单，并根据单据准备资金和债券。

3.4 结算处理

3.4.1 资金结算处理

9:00-16:50，清算系统对T+0交易进行实时清算结算，主动

划付资金，包括前端费、期初返还金额（如适用）、交付金额，并于日终生成资金结算完成通知单。

13:00-16:50，清算系统根据前一工作日日终清算结果对非T+0交易进行结算，主动划付资金，包括前端费（非T+0交易）、期初返还金额（如适用、非T+0交易）、信用保护费、剩余应计保费（或有）、提前终止金额（或有）等，并于日终生成资金结算完成通知单。

3.4.2 信用事件结算处理

清算系统根据指数管理人或交易双方提交的信用事件结算要素组织交易双方于结算日完成信用事件清算结算，并于结算日日终生成信用事件结算完成通知单。

现金结算交易，信用事件现金结算日13:00-16:50，清算系统根据指数管理人或交易双方提交的现金结算金额完成资金划付。

实物结算交易，信用事件资金结算日13:00-16:50，清算系统根据指数管理人或交易双方提交的实物结算金额完成资金划付；信用事件交割日13:00-16:50，清算系统根据交易双方提交的实物结算信息完成债券交割。

3.5 参考估值

上海清算所于每日日终为满足估值条件的合约类信用风险缓释工具双边清算交易提供参考估值服务。参考估值结果可通过清算系统客户终端进行查询。

3.6 双边履约保障品管理服务

参与者可基于双边清算的合约类信用风险缓释工具交易，以托管在上海清算所的债券作为双边履约保障品，管理交易对手信用风险。上海清算所为参与者提供双边履约保障品线上化一站式服务，包括履约保障品质押、解押、追加、替换等操作，并提供估值。参与者可通过清算系统客户终端查询双边履约保障品指令处理结果、参考估值等信息。

3.7 合约类信用风险缓释工具双边清算业务相关公式

上海清算所于清算日双边全额地计算需结算的应收应付金额，包括前端费、期初返还金额（如适用）、信用保护费、提前终止结算金额、剩余应计保费（或有）、信用事件结算金额（或有）。若本业务参与者为资金支付方，金额为负；若本业务参与者为资金接收方，金额为正。

3.7.1 前端费计算规则

前端费由参与者自行约定。

3.7.2 信用保护费计算规则

1）信用保护费支付日推算

首期支付日可根据起始日和支付频率按营业日准则推算得出，也可由交易双方约定。第 i 期保费支付日根据第 i-1 期保费支付日和支付频率按营业日准则推算得出。

如存续期内未发生信用事件，则最后一期保费支付日为按营业日准则调整的约定到期日；如发生信用事件，则剩余应计保费

的支付日为交易双方达成一致的信用事件结算日。

2）信用保护费金额计算

计算公式：$C_{t_i} = N \times C \times \Delta_i$

其中，C_{t_i}表示信用保护买方支付的第 i 期保费；N表示交易名义本金；C表示费率；Δ_i表示根据计息基准和计息天数调整确定的第 i 个计息期的年化时间，即Δ_i=计息天数/计息基准对应的年度天数，Δ_i的计算规则详见下表。

表 4：信用保护费计息期年化时间计算规则

计息基准	计息天数调整	Δ_i计算公式	
实际/360	实际天数	S_i 、S_{i-1} 均为工作日	Δ_i=（S_i - S_{i-1}）/360
		S_i 为工作日，S_{i-1} 为非工作日	Δ_i=（S_i - S_{i-1}’）/360
		S_i 为非工作日，S_{i-1} 为工作日	Δ_i=（S_i’ - S_{i-1}）/360
		S_i 、S_{i-1} 均为非工作日	Δ_i=（S_i’ - S_{i-1}’）/360
	不调整	S_i 、S_{i-1} 均为工作日	Δ_i=（S_i - S_{i-1}）/360
		S_i 为工作日，S_{i-1} 为非工作日	
		S_i 为非工作日，S_{i-1} 为工作日	
		S_i 、S_{i-1} 均为非工作日	
实际/365	实际天数	S_i 、S_{i-1} 均为工作日	Δ_i=（S_i - S_{i-1}）/365
		S_i 为工作日，S_{i-1} 为非工作日	Δ_i=（S_i - S_{i-1}’）/365
		S_i 为非工作日，S_{i-1} 为工作日	Δ_i=（S_i’ - S_{i-1}）/365
		S_i 、S_{i-1} 均为非工作日	Δ_i=（S_i’ - S_{i-1}’）/365
	不调整	S_i 、S_{i-1} 均为工作日	Δ_i=（S_i - S_{i-1}）/365
		S_i 为工作日，S_{i-1} 为非工作日	
		S_i 为非工作日，S_{i-1} 为工作日	
		S_i 、S_{i-1} 均为非工作日	

实际/实际	实际天数	S_i 、S_{i-1} 均为工作日	Δ_i=（S_i - S_{i-1}）/实际全年天数
		S_i 为工作日， S_{i-1} 为非工作日	Δ_i=（S_i - S_{i-1}’）/实际全年天数
		S_i 为非工作日， S_{i-1} 为工作日	Δ_i=（S_i’ - S_{i-1}）/实际全年天数
		S_i 、S_{i-1} 均为非工作日	Δ_i=（S_i’ - S_{i-1}’）/实际全年天数
	不调整	S_i 、S_{i-1} 均为工作日	Δ_i=（S_i - S_{i-1}）/实际全年天数
		S_i 为工作日， S_{i-1} 为非工作日	
		S_i 为非工作日， S_{i-1} 为工作日	
		S_i 、S_{i-1} 均为非工作日	
实际/365F	实际天数	S_i 、S_{i-1} 均为工作日	Δ_i=（ S_i - S_{i-1})/365 ，计息区间不包含 2 月 29 日； Δ_i=（ S_i - S_{i-1}-1)/365 ，计息区间包含 2 月 29 日；
		S_i 为工作日， S_{i-1} 为非工作日	Δ_i=（S_i - S_{i-1}’）/365，计息区间不包含 2 月 29 日； Δ_i=（S_i - S_{i-1}’-1）/365，计息区间包含 2 月 29 日；
		S_i 为非工作日， S_{i-1} 为工作日	Δ_i=（S_i’ - S_{i-1}）/365，计息区间不包含 2 月 29 日； Δ_i=（S_i’ - S_{i-1}-1）/365，计息区间包含 2 月 29 日；
		S_i 、S_{i-1} 均为非工作日	Δ_i=（S_i’ - S_{i-1}’）/365,计息区间不包含 2 月 29 日； Δ_i=（S_i’ - S_{i-1}’-1）/365,计息区间包含 2 月 29 日；
	不调整	S_i 、S_{i-1} 均为工作日	Δ_i=（S_i - S_{i-1}）/365，计息区间不包含 2 月 29 日； Δ_i=（S_i - S_{i-1}-1）/365，计息区间包含 2 月 29 日；
		S_i 为工作日， S_{i-1} 为非工作日	
		S_i 为非工作日， S_{i-1} 为工作日	
		S_i 、S_{i-1} 均为非工作日	

其中，S_i 表示未经营业日准则调整的第 i 期保费支付日；S_i’表示经营业日准则调整的第 i 期保费支付日；S_{i-1} 表示未经营

业日准则调整的第 i-1 期信用保费支付日；S_{i-1}’表示经营业日准则调整的第 i-1 期信用保费支付日。计息天数算头不算尾，最后一期算头又算尾。

如发生信用事件，则计算剩余应计保费时，Δ_i 根据计息基准和信用事件确定日[1]计算得出。Δ_i=（1+信用事件确定日 - S_{i-1} 或 S_{i-1}’）/计息基准对应的年度天数。对于信用违约互换指数交易，计算剩余应计保费时，名义本金为发生信用事件参考实体权重对应的名义本金。

3.7.3 信用事件现金结算金额计算规则

对于单名信用违约互换、信用风险缓释合约交易，信用事件现金结算金额由参与者自行约定。对于信用违约互换指数交易，信用事件现金结算金额由参与者或指数管理人确定。

4.业务应急操作

应急操作，是指本业务参与者因网络、系统或其他原因，无法及时通过清算系统客户终端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为。

4.1 适用范围

1）无法进行资金划拨操作；2）无法进行单据下载；3）无法进行查询操作；4）无法进行信用事件相关要素提交；5）其他无法在营业日终止或截止时间前完成的情形。

[1] 信用事件确定日：指信用事件通知与公开信息通知（若适用）均有效送达之日。 摘自《中国场外信用衍生产品交易基本术语与适用规则（2022 年版）》

4.2 办理流程

为保证本业务的正常进行，清算系统客户终端出现异常无法正常开展本业务时，在电话通知上海清算所后，按流程启动应急操作。

4.2.1 发送应急指令书

本业务参与者应及时填制应急指令书（附件 4），并加盖有效印鉴，以传真或邮箱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。

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

4.2.2 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等。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，本业务参与者可主动与上海清算所联系、查询。

4.2.3 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本业务参与者。本业务参与者也可向上海清算所查

询处理情况，或在客户终端恢复正常后查询。

4.3 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，于相应业务的截止时间前 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，本业务参与者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）本业务参与者可自行完成（建议在业务开展之初）应急账户开立并告知上海清算所，由上海清算所冻结应急账户。当应急情况发生时，上海清算所根据应急指令书解冻应急账户并通过该账户登录参与者客户终端，代为进行应急操作。未完成账户开立的，上海清算所仅可进行查询类应急操作。应急账户应具备对应的业务操作和审核权限，无需修改初始密码且不得绑定证书，一旦应急操作完成，上海清算所将自行冻结应急账户。具体账户设定如下：

表 5：账户设定

岗位名称	岗位代码	用户名称	角色
XX[2]应急业务操作岗	xx[3]yjywczg	shch01@AAAAAAA[4]	客户端业务员
XX 应急业务复核岗	xxyjywfhg	shch02@AAAAAAA	客户端业务员

3） 对于其他无法在营业日终止或截止时间前完成的情形，本业务参与者应在营业日及时致电上海清算所反映相关异常情

2. XX 此处为机构名称缩写
3. xx 此处为机构拼音缩写
4. AAAAAAA 为本业务参与者在上海清算所持有人账号

况，上海清算所视情况进行相应处理。

4.4 联系方式

接收传真电话：021-63326661

接收邮箱地址：account@shclearing.com.cn

应急操作电话：021-23198686/021-23198787

附件：

1.上海清算所合约类信用风险缓释工具双边清算业务信息登记表

2.上海清算所合约类信用风险缓释工具双边清算业务信息变更登记表

3.上海清算所合约类信用风险缓释工具双边清算业务退出申请表

4.上海清算所合约类信用风险缓释工具双边清算业务应急指令书

附件 1

上海清算所合约类信用风险缓释工具双边清算业务信息登记表

<table>
<tr><td colspan="4">1.机构基本信息</td></tr>
<tr><td>机构全称</td><td colspan="3"></td></tr>
<tr><td>持有人账号</td><td colspan="3"></td></tr>
<tr><td colspan="2">全国银行间同业拆借中心会员代码</td><td colspan="2"></td></tr>
<tr><td rowspan="8">资金结算账户（二选一）</td><td colspan="3">☐开在大额支付系统的清算账户</td></tr>
<tr><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 colspan="3">☐开在上海清算所的资金结算专户
（☐与_____业务共用　　☐新开专用账户）</td></tr>
<tr><td>资金往来账号</td><td colspan="2">（仅在勾选新开专用账户时填写）</td></tr>
<tr><td>资金往来账户户名</td><td colspan="2">（仅在勾选新开专用账户时填写）</td></tr>
<tr><td>资金往来账户开户行行号</td><td colspan="2">（仅在勾选新开专用账户时填写）</td></tr>
<tr><td>资金往来账户开户行行名</td><td colspan="2">（仅在勾选新开专用账户时填写）</td></tr>
<tr><td>联系人 1</td><td></td><td>部门及职务</td><td></td></tr>
<tr><td>座机</td><td></td><td>手机</td><td></td></tr>
<tr><td>电子邮件</td><td></td><td>传真</td><td></td></tr>
</table>

联系人 2		部门及职务	
座机		手机	
电子邮件		传真	

2.客户终端管理员信息
（已成为信用违约互换中央对手清算会员的机构无需填写下述信息）

姓名	登录名	身份证号	是否具有业务权限	手机	电子邮件	CFCA 证书串号

注:1.客户终端管理员必须是两人；
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 12 个字符以内；
3.“CFCA 证书串号”：请填写以“041”开头的证书串号，例如：041@712345678-X@shchcs@00000001；

相关事项：

依照本机构签署的《银行间市场本币衍生品双边清算协议》，本机构授权银行间市场清算所股份有限公司（以下简称上海清算所）获取本机构通过中国人民银行认可机构的交易系统、电话、传真以及经纪撮合等方式达成的合约类信用风险缓释工具交易数据，并自愿将本机构达成的合约类信用风险缓释工具双边交易提交上海清算所进行双边清算。同时，本机构承诺如下：

1.知晓并同意上海清算所网站发布的《关于开展信用风险缓释工具登记托管、清算结算业务有关事项的通知(清算所发〔2017〕69 号)》和《信用违约互换逐笔清算业务操作须知》及其他相关规则（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），按照上海清算所的要求参与业务，接受上海清算所的清算结算结果。

2.上述联系人和系统管理员已获得了本机构充分和必要的授权，该等人员电子确认结果对本机构具有法律约束力；如有调整，本机构将另行书面通知上海清算所。

3.在规定时点前在上述账户中备付足额资金和债券，并授权上海清算所根据清算结果对本机构提供的上述账户进行自动的借记、贷记和担保处理。

4.本业务印鉴卡沿用上海清算所登记托管业务印鉴卡。

机构公章：

日期：　　年　　月　　日

附件 2

上海清算所合约类信用风险缓释工具双边清算业务信息变更登记表

<table>
<tr><td>机构名称
（全称）</td><td colspan="4"></td></tr>
<tr><td>持有人账号</td><td colspan="4"></td></tr>
<tr><td>变更项目</td><td colspan="4">☐申请机构人员信息　　☐客户终端管理员信息
☐账户信息　　☐费用发票寄送信息
☐其他（_____）</td></tr>
<tr><td>变更前信息</td><td colspan="4"></td></tr>
<tr><td>变更后信息</td><td colspan="4"></td></tr>
<tr><td>变更生效时间</td><td colspan="4"></td></tr>
<tr><td colspan="5">资金结算专户申请信息
以下仅在选择变更项目为“账户信息”，且为“新开资金结算专户”时填写。</td></tr>
<tr><td>资金往来账号</td><td></td><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></td><td>资金往来账户开户行行名</td><td colspan="2"></td></tr>
<tr><td>联系人</td><td></td><td>联系地址</td><td colspan="2"></td></tr>
<tr><td>联系电话</td><td></td><td>邮编</td><td colspan="2"></td></tr>
<tr><td rowspan="2">☐法定代表人
☐单位负责人</td><td>姓名</td><td colspan="3"></td></tr>
<tr><td>证件种类</td><td></td><td>证件号码</td><td></td></tr>
<tr><td colspan="5">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。</td></tr>
<tr><td colspan="5">以下栏目由上海清算所审核后填写：</td></tr>
<tr><td>资金结算专户</td><td colspan="2"></td><td>开户日期</td><td>年　月　日</td></tr>
</table>

（_____业务专用）账号			

资金结算专户（_____业务专用）名称			
经办人		复核人	
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。 有效印鉴（预留印鉴或公章）： 日期：			
经办人		联系电话	

附件 3

上海清算所合约类信用风险缓释工具双边清算业务退出申请表

<table>
<tr><td>机构名称
（全称）</td><td colspan="3"></td></tr>
<tr><td colspan="4">说明</td></tr>
<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。
3. 我单位已无与本业务相关的债权债务关系并已结清费用。

有效印鉴（预留印鉴或公章）：
日期：</td></tr>
<tr><td>经办人</td><td></td><td>联系电话</td><td></td></tr>
</table>

附件 4

上海清算所合约类信用风险缓释工具双边清算业务应急指令书

传真指令编号：_____（请从 001 开始自行编制）

<table>
<tr><td>应急指令要求（必填）</td><td colspan="5">☐资金划拨　☐单据导出
☐信息查询（☐账户余额 其它信息：_____）
☐其它 _____</td></tr>
<tr><td rowspan="4">应急内容（必填）</td><td rowspan="3">选择资金划拨填写</td><td>转出账户账号</td><td></td><td>转入账户账号</td><td></td></tr>
<tr><td>转出账户名称</td><td></td><td>转入账户名称</td><td></td></tr>
<tr><td>划拨金额（大写）</td><td></td><td>划拨金额(小写)</td><td></td></tr>
<tr><td colspan="5">其它应急指令具体操作要求：</td></tr>
<tr><td colspan="6">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。</td></tr>
</table>

指令发送方保证：

1. 所发送的应急指令书内容真实、准确、完整、有效。

2. 授权上海清算所解冻应急账户并登录本机构客户终端，进行上述应急操作。

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：