

中央对手方清算协议

金融测试案例专用

签约双方：

甲方：银行间市场清算所股份有限公司

法定代表人：***

注册地址：上海市黄浦区北京东路2号

邮编：200000

乙方： 机构A

法定代表人： ***

注册地址：上海市浦东新区*路*号

邮编：200000

特 别 提 示

签署本协议即表明乙方已认真阅读了甲方发布的（包括但不限于甲方通过其官方网站 <http://www.shclearing.com> 发布的）关于各项中央对手方清算业务所有相关文件，并已充分理解相关信息。同时，签署本协议即视为乙方已完全接受并同意遵守甲方已发布的甲方相关规则及甲方今后对其不时进行的修改和补充。

双方同意，在认可本协议相关条款的基础上，如有需要，可另行签订补充协议。

金融测试案例专用

目 录

第一条 协议的适用	6
第二条 协议的构成与效力等级.....	6
第三条 声明和保证	7
第四条 （适用代理清算业务）甲方的承诺.....	10
第五条 （适用代理清算业务）乙方的承诺.....	10
第六条 特别授权	12
第七条 保证金和清算基金.....	12
第八条 甲方的权利与义务.....	13
第九条 乙方的权利与义务.....	14
第十条 特别约定	16
第十一条 清算会员资格和费用	17
第十二条 协议终止	18
第十三条 甲方的违约责任	20
第十四条 乙方的违约责任	20
第十五条 自动提前终止	21
第十六条 免责事由	23
第十七条 会员终端软件	24
第十八条 保密义务	25

第十九条 名称及标题	26
第二十条 通知方式与生效	26
第二十一条 法律及规范性文件的适用	27
第二十二条 条款可分割性	27
第二十三条 争议处理方式	27
第二十四条 其他	28

金融测试案例专用

为开展中央对手方清算自营和代理中央对手方清算业务，防范清算风险，提高清算效率，维护各方合法权益，保障金融市场稳定，根据国家法律法规、部门规章、规范性文件及甲方相关规则（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，简称甲方相关规则），经友好协商，双方在平等、自愿的基础上达成本协议。

第一条 协议的适用

（一）本协议适用于甲方提供、乙方自愿参与的各项中央对手方清算业务。上述各项中央对手方清算业务包括但不限于债券产品、汇率产品、利率产品、信用产品、航运及大宗商品等。

（二）乙方可以申请成为甲方普通清算会员，就自营交易参与甲方提供的中央对手方清算业务；也可以申请成为甲方综合清算会员，代理非清算会员参与甲方提供的中央对手方清算业务。乙方参与甲方的中央对手方清算业务或者代理非清算会员参与甲方的中央对手方清算业务的，以获得甲方的书面或电子通知为准。

（三）本协议中涉及代理清算业务的约定，仅在乙方获得甲方同意开展代理清算业务时适用。

第二条 协议的构成与效力等级

（一）本协议、本协议补充协议（若有）、本协议下有效单据（包括但不限于资格认定通知文件、清算通知单、资金结算单、保证金清

单、清算基金交纳通知单以及费用清单等等,简称本协议下有效单据)共同构成单一和完整的协议。

协议双方共同确认:除非另有约定,任何一方对本协议、本协议补充协议(若有)、本协议下有效单据任一构成部分和/或任一构成部分中任一义务的违反,均视为对本协议的违反,应承担相应的违约责任。

(二) 甲乙双方共同确定:

1、若本协议与本协议补充协议(若有)不一致,则以本协议补充协议(若有)为准;

2、若本协议或本协议补充协议(若有)与甲方相关规则不一致,则应以甲方发布并不时修改的甲方相关规则为准;

3、经制定、修改或补充后发布的甲方相关规则,以最新发布的甲方相关规则为准。甲方对甲方相关规则的修改以甲方官方网站(即<http://www.shclearing.com/>)进行公告后,自公告中指定的日期开始生效。

第三条 声明和保证

(一) 任何一方于本协议签署之日起声明并保证:

1、其按照设立所在地法律已合法设立,并有效存续。

2、其有权且可以:

(1) 签署本协议以及与本协议有关的任何其他文件;

(2) 交付本协议以及需交付、提供的任何其他文件;

(3) 履行其在本协议、本协议补充协议（若有）、本协议下有效单据（如无特别说明，以下所称本协议是指本协议、本协议补充协议（若有）及本协议下有效单据）及甲方相关规则下的各项义务。

3、签署、交付和履行本协议及与本协议相关的文件，并未、且不会与任何适用于其的法律法规、其组织章程等文件的任何规定以及任何适用于其或其任何资产的判决、裁决、指令或协议约定相违背或相冲突。

4、其对本协议及与本协议相关文件的签署、交付和履行已经获得所需的一切政府性质的或其他性质的（包括但不限于其内部决策程序要求）许可、同意、授权或批准，且该等许可、同意、授权或批准在本协议有效期间应保持持续有效。

5、乙方自愿参与或代理非清算会员参与甲方的中央对手方清算业务，双方承诺严格遵守以下适用于中央对手方清算业务的所有文件：

- (1) 本协议；
- (2) 本协议的补充协议（若有）；
- (3) 本协议下有效单据；
- (4) 甲方制定及不时修改或补充的甲方相关规则；
- (5) 其他对中央对手方清算业务有约束力的相关文件。

对上述任一文件的违反即可视为其对本协议的违反，并应承担相应的违约责任。双方在本协议及甲方相关规则下的义务构成其合法、有效及有约束力的义务，并应按照该等文件各自的条款予以执行。法律、法规或监管部门另有强制性规定的除外。

6、代表其从事业务的人员，均已获得充分和必要授权和资格。

7、任何一方不得转让本协议项下的任何权利或义务，除非经对方事先书面同意。

8、保证将来自于对方的与中央对手方清算业务相关的信息仅用于为履行本协议之目的。

(二) 甲方进一步声明并保证：

1、甲方是中国人民银行认定的合格中央对手方清算机构，为各类交易提供中央对手方清算及相关服务。

2、甲方制定或修改相关规则，应事先以甲方认为适当的方式听取市场参与者的意见。

3、甲方官方网站是转发业务主管部门相关文件和发布甲方相关规则等信息的平台，除非甲方认为必要，甲方在官方网站上发布的上述信息不再以纸质邮寄方式传递给乙方。

4、甲方不对乙方的任何交易或投资决策负责或承担任何责任。

5、甲方严格按照甲方相关规则对纳入中央对手方清算的合约进行净额清算处理，并严格按照净额清算结果履行结算义务。甲方承诺，在任何情况下，都不采取可能造成净额结果无效的措施或行为，以确保净额结果的有效，且不可撤销。

(三) 乙方进一步声明并保证：

1、乙方保证向甲方提供的资料真实准确、合法有效。如涉及与中央对手方清算业务有关的资料变更时，乙方应及时向甲方提供合法有效的书面变更申请及变更证明。若由于乙方所提供的资料有误

或发生变更时未及时通知甲方，由此发生的风险和损失由乙方承担。

2、乙方保证遵守甲方制订的、为与甲方业务系统连接和使用而确定的技术要求。若由于乙方自身原因造成其与甲方业务系统相关的技术要求无法匹配的，由此产生的任何后果由乙方承担。

甲方业务系统是指由甲方运行和维护的办理清算结算业务相关的计算机综合应用系统等。

3、乙方用于中央对手方清算业务的资金不存在法律、法规、部门规章或规范性文件、相关市场自律规则及甲方相关规则所禁止或限制从事中央对手方清算业务的情形。

第四条 （适用代理清算业务）甲方的承诺

（一）甲方对乙方所代理的中央对手方清算业务合约、合约组合风险敞口、结算资金和债券按各个非清算会员分业务分别登记、计算，以支持乙方代理清算业务的开展。

（二）甲方将自有资产与乙方代理清算业务保证金相隔离，确保保证金的安全性。

第五条 （适用代理清算业务）乙方的承诺

（一）乙方对其代理的非清算会员纳入中央对手方清算的合约，乙方提供履约担保。当非清算会员未及时履行参与中央对手方清算业务相关义务时，乙方保证及时替非清算会员履行相应义务。乙方若未能及时履行履约担保义务，则应当向甲方承担违约责任。

(二) 乙方根据本协议下有效单据, 按时、足额向甲方交纳所代理清算业务的保证金、清算基金, 并支付结算资金、清算费用等。

(三) 乙方对其代理的非清算会员确保皆已不可撤销地承诺:

1、遵守甲方相关规则, 履行相关权利和义务, 保证已获得参与中央对手方清算业务相关资格。

2、就纳入中央对手方清算的交易, 与原交易对手方不再有任何的债权债务关系, 仅适用本协议和甲方相关规则, 并履行相应的权利和义务。

3、按照本协议和甲方相关规则的要求, 制定相应的内部操作规程或实施细则。

4、配合甲方按照甲方相关规则进行的中央对手方清算业务处理。

5、根据甲方相关规则, 及时向乙方提供财务报表和其他信息、资料, 并对该等财务报表、信息和资料的合法性、准确性、真实性、完整性向乙方承担完全的法律 responsibility。

6、承认甲方按照甲方相关规则对各项中央对手方清算业务的净额计算结果合法有效, 并据此履行相应的清算义务。

7、承认甲方按净额计算结果组织完成的资金结算和债券等标的资产收付具有最终性, 且不可撤销。

8、承认甲方提供的电子单据是处理日常清算与结算业务的依据, 具有法律效力, 除特殊约定外, 甲方不必提供纸质单据。

第六条 特别授权

(一)为了确保中央对手方清算业务的顺利进行,在业务申请时,乙方可以对甲方就下列事项中一项或几项作出不可撤销地特别授权:

1、乙方授权甲方根据清算结果办理乙方指定人民币账户或外币账户的借记、贷记处理。

2、乙方授权甲方根据清算结果办理乙方指定账户(包括债券账户和甲方认可的其他资产账户)的借记、贷记和质押处理。

(二)甲方接受并基于乙方的委托,根据清算结果对指定账户进行借记、贷记和质押处理。

(三)乙方应在参与或代理非清算会员参与中央对手方清算业务前将指定账户信息以书面形式通知甲方。乙方更改指定账户信息的,应提前将相关内容以书面形式通知甲方。因乙方未能及时履行通知义务或通知有误而导致的相关责任由乙方承担。

第七条 保证金和清算基金

(一)乙方根据甲方相关规则按时足额向甲方交纳自营、代理中央对手方清算业务的保证金以及相应的清算基金。甲方有权按照甲方相关规则对乙方自营、代理中央对手方清算业务保证金和清算基金进行处理。

(二)乙方保证:在交付时及参与中央对手方清算业务期间内,保证金和清算基金不包含或存在为任何第三方设定的任何担保物权或其他可能对甲方按照约定处分上述保证金和清算基金造成影响或

限制的权利。

第八条 甲方的权利与义务

（一）甲方的权利

1、根据甲方相关规则收取乙方中央对手方清算自营、代理中央对手方清算业务的保证金、清算基金、结算资金和清算费用等。

2、根据甲方相关规则设定乙方自营、代理中央对手方清算业务相关参数(包括但不限于清算限额、持仓限额、保证金收取标准等),并有权根据甲方相关规则进行相应调整。

3、根据甲方相关规则的规定,当乙方发生违约时,有权采取甲方相关规则规定的违约处理措施(包括但不限于使用乙方的保证金和清算基金用于弥补违约处理的损失,收取违约金,暂停清算业务等)。

4、按照本协议下有效单据的内容,要求乙方按时、足额交付应付资金和债券等标的资产。

5、管理乙方交纳的保证金、清算基金。

6、对甲方业务系统中产生的信息与中央对手方清算业务相关的信息、公告、通知、文本等享有完整的知识产权。

7、按照本协议及甲方相关规则等规定,享有的其他权利。

（二）甲方的义务

1、向乙方提供客户端应用软件或提供接口软件及接口交互规范。

2、甲方应向乙方提供风险管理服务,并建立风险管理相关制度。

3、编制本协议下有效单据并及时提供给乙方,并据此在乙方已

缴纳所有应付资金和债券等标的资产的前提下向乙方足额交付其应收资金和债券等标的资产。

4、将乙方交纳的保证金、清算基金等资产与甲方自有资产相分离。

5、及时向乙方提供中央对手方清算业务相关信息。

6、管理和维护甲方业务系统。

7、在法律法规规定的期限内，妥善保管中央对手方清算业务相关记录。

8、按照本协议及甲方相关规则等规定，需承担的其他义务。

第九条 乙方的权利与义务

（一）乙方的权利

1、使用甲方提供的客户端应用软件或参照甲方接口交互规范自行开发客户端软件。

2、获得本协议下有效单据，并据此取得或代理非清算会员取得相关交易中央对手方清算后的应收资金和债券等标的资产。

3、及时获取甲方提供的中央对手方清算业务的相关信息，并有权使用涉及乙方的此类信息。

4、按照甲方相关规则获得或代理非清算会员获得所交纳保证金等资金的孳息。

5、按照甲方相关规则的要求可以办理退出一项或多项自营、代理中央对手方清算业务。

6、按照甲方相关规则，选派员工参加甲方培训。

7、（适用代理清算业务）按照乙方的业务模式、资金交收方案、风险管理政策，有权决定对代理的非清算会员的交易是否确认递交中央对手方清算。

8、（适用代理清算业务）对代理的非清算会员做出违约判定，并启动该非清算会员违约处置流程，必要时有权要求甲方予以协助。

9、按照本协议及甲方相关规则等规定，可享有的其他权利。

（二）乙方的义务

1、（适用代理清算业务）乙方代理每一非清算会员参与中央对手方清算之前，应当将其签订的《中央对手方清算业务代理清算协议》交甲方备案。

2、根据甲方相关规则和本协议下有效单据按时、足额向甲方交纳中央对手方清算自营、代理中央对手方清算业务保证金、清算基金，并支付结算资金、清算费用等。

3、根据甲方相关规则，及时向甲方提供自身或代理的非清算会员的财务报表和其他信息、资料，并对该等财务报表、信息和资料的合法性、准确性、真实性、完整性向甲方承担完全的法律責任。

4、乙方对其自身或代理的非清算会员发生的重大事项，应及时通知甲方，并提供相关书面证明材料，法律、法规另有规定的除外。该等重大事项包括但不限于自身或代理的非清算会员发生并购、重组、解散、清算、破产，被监管机构采取停业整顿、托管、接管、撤销、关闭等监管措施，因重大违法违规行为被监管机构调查或处罚，因经

营状况、财务状况恶化或司法强制执行等原因不能履行或可能导致其不能履行中央对手方清算相关义务等情形。

5、确保自身及代理的非清算会员配合甲方按照甲方相关规则进行违约处理，包括但不限于强制结算、使用清算基金等。

6、按照本协议及甲方相关规则等规定，需承担的其他义务。

第十条 特别约定

（一）甲方接收的由乙方发送的，或甲方接收的由甲方认可的交易平台发送的乙方或乙方代理的非清算会员与中央对手方清算业务相关的信息，甲方均视为是乙方自愿参与或代理非清算会员参与中央对手方清算业务且履行其权利与义务的依据，且真实、准确、合法、有效。

（二）双方承诺：就纳入中央对手方清算的交易，原交易对手方之间不再有任何的债权债务关系，仅适用本协议和甲方相关规则，并履行相应的权利和义务。

（三）乙方承诺：按照本协议和甲方相关规则的要求，制定相应的内部操作规程或实施细则。

（四）双方确认：甲方按照甲方相关规则净额计算各项中央对手方清算业务的结果合法有效，乙方据此履行相应的义务。甲方按净额计算结果组织完成的资金结算和债券等标的资产收付具有最终性，且不可撤销。

（五）乙方承诺：乙方配合甲方按照甲方相关规则进行的业务处

理。

(六) 乙方承诺：乙方根据本协议下有效单据，按时、足额向甲方交纳自营、代理中央对手方清算业务保证金、清算基金，并支付结算资金、清算费用等。乙方如有确切证据证明本协议下有效单据存在错误，应及时向甲方提出异议，否则视为接受本协议下有效单据的内容。在甲方接受并认可上述异议之前，乙方应根据相关单据进行结算。

(七) 甲方向乙方提供电子单据作为处理日常清算与结算业务的依据，具有法律效力，除特殊约定外，甲方不提供纸质单据。

(八) (适用代理清算业务) 代理清算业务特别约定

1、乙方应当按照甲方相关规则，及时向甲方履行代理清算业务义务。乙方不得以其代理的非清算会员未履行相应义务，而对甲方的履约要求提出抗辩。

2、若乙方代理的非清算会员对乙方违约，且乙方未对甲方违约的，甲方有义务协助乙方对非清算会员进行违约处理。乙方应当将非清算会员违约及处置情况通报甲方。

3、因乙方违约被取消代理清算业务资格的，乙方应配合甲方办理非清算会员移仓。

4、乙方代理的非清算会员可向乙方申请变更代理综合清算会员，乙方应予配合并按甲方相关规则办理非清算会员移仓。

第十一条 清算会员资格和费用

(一) 乙方自愿申请成为甲方的清算会员，具体清算会员资格类

型由资格认定通知文件确定。

(二) 乙方有权根据甲方相关规则的规定申请变更其清算会员资格的类型，经甲方确认后由甲方调整。

甲方有权依据甲方相关规则或监管部门要求，调整乙方的清算会员资格类型。

(三) 乙方作为甲方的清算会员，可参与甲方所提供的与乙方所属清算会员资格相关的服务，需向甲方交纳相关费用（包括但不限于清算会员注册费、会员年费、清算产品清算费、各种设施使用费等）。相关费用标准及支付方式依据甲方相关规则的收费规定实行，且甲方有权根据实际情况调整相关费用标准、收费项目及支付方式，并提前通知乙方。

(四) 若因乙方原因导致甲方不能在规定时间内足额收取相关费用的，视同乙方违约，甲方有权按照甲方相关规则进行处理。

第十二条 协议终止

(一) 双方协商终止

经甲、乙双方协商一致后，可以终止本协议。若双方协商一致终止本协议的，应以书面形式并由甲方指明具体终止日。

(二) 甲方终止协议的权利

出现下述任一情形时，甲方有权单方终止本协议，并根据甲方相关规则完成对业务的后续处理：

1、乙方在本协议项下作出的任何一项声明或保证被证实在作出

或被视为作出之日存在虚假陈述、误导性成分或重大遗漏；

2、乙方出现本协议约定或甲方相关规则规定的违约情形，且在甲方规定的期限内未纠正的；

3、由于适用法律的变动或不可抗力发生，导致乙方无法继续履行本协议的；

4、乙方存在甲方相关规则规定的甲方单方面终止协议的其他情形。

甲方单方终止本协议并不损害或影响甲方根据本协议已经采取或将要采取的任何违约处理行为或补救措施的权利。若甲方在根据相关规则的规定采取违约处置措施后仍有部分款项未得到足额清偿，甲方有权在本协议终止后根据本协议及相关业务规则继续向乙方追偿。

（三）乙方终止协议的权利

在乙方与甲方结清中央对手方清算业务有关的所有债权债务的前提下，乙方有权终止本协议。乙方应按照甲方相关规则以书面形式通知甲方，经甲方同意后本协议终止。乙方无权索回已缴纳的清算费用、清算会员注册费和会员年费。

（四）协议终止的法律后果

协议终止不影响双方已经完成的结算。

本协议终止，乙方应与甲方结清本协议下产生的所有债务。乙方未能结清其债务的，甲方有权处置乙方的保证金、清算基金和债券等标的资产冲抵其债务，或从其对乙方所负的任何其他付款义务或从乙方任何应收清算款项中抵扣，不足部分，甲方有权依法依约继续追偿。

乙方与甲方结清全部债权债务后，方可要求甲方将中央对手方清算业务保证金和清算基金余额中应归属乙方或乙方代理的非清算会员的金额（若有）划归乙方。

第十三条 甲方的违约责任

（一）甲方若未在结算日按甲方相关规则的规定向乙方支付其自营、代理中央对手方清算业务应收资金或债券等标的资产的，除必须履行资金和债券等标的资产交付义务外，还应按照本协议及甲方相关规则的规定承担相应的责任。

（二）乙方在甲方规定的可提取时间内，申请提取自营、代理中央对手方清算业务可用资金或债券等标的资产后，甲方未在规定的时间内将相应的资金或债券等标的资产划出，则应按照本协议及甲方相关规则的规定承担相应的责任。

（三）其他本协议及甲方相关规则规定的甲方所应承担的违约责任。

第十四条 乙方的违约责任

（一）乙方出现下列一项或多项事件的，构成中央对手方清算业务违约：

1、乙方未能在甲方相关规则规定的时点前交纳中央对手方清算业务保证金、清算基金，或支付结算资金、清算费用等，无论是基于自身原因或是乙方代理的非清算会员的原因，均要向甲方承担违约责任。

任。

2、乙方未能在甲方相关规则规定的时点前交付中央对手方清算业务相关债券等标的资产以完成其应履行的自营、代理清算义务，无论是基于自身原因或是乙方代理的非清算会员的原因，均要向甲方承担违约责任。

3、乙方发生经营状况、财务状况持续恶化，不能清偿到期债务或明显缺乏清偿能力。

(二) 乙方出现违约时，甲方有权根据甲方相关规则暂停为乙方提供一项或几项中央对手方清算业务、冻结其保证金账户和清算基金账户、处置保证金和清算基金、处置清算业务资金和债券等标的资产、计收违约金、取消一项或几项清算业务资格等甲方相关规则规定的处理程序。

(三) 甲方按照甲方相关规则的规定进行违约处置，乙方应自行承担因甲方处置其违约产生的相关费用和损失，且应承担甲方采取违约处理措施的一切不利后果。

(四) 其他甲方相关规则规定的乙方所应承担的违约责任。

第十五条 自动提前终止

(一) 自动提前终止事件

就任何一方发生的下述任一事件构成该方的自动提前终止事件，并且属于本协议下的违约事件：

1、解散（出于联合、合并或重组目的而发生的解散除外）；

2、监管部门启动停业整顿、托管、接管、机构重组、行政重组、撤销等风险处置措施；

3、自身或其债权人向人民法院提出重整、和解或破产清算申请；

4、通过停业、清算或申请破产的决议。

（二）自动提前终止

若一方发生自动提前终止事件，则无需另一方发送通知或确认，双方所有的中央对手方清算业务合约于自动提前终止事件发生之刻起自动终止，且应以该自动提前终止事件发生之日作为上述合约的提前终止日。如果一方发生第（一）款规定的多个自动提前终止事件，则自动提前终止日为第一个事件发生之日。在向人民法院提出重整、和解或者破产清算申请的情况下，自动提前终止事件发生的时点为向人民法院提交申请书之时。

无论就哪一方发生自动提前终止事件，都应由甲方根据相关规则的条款对清算业务合约按照违约事件进行处理。

（三）自动提前终止后仍被提交清算的合约

如果在自动提前终止事件发生后，乙方仍新提交合约进行中央对手方清算的：

1、甲方应立即终止该合约并将不予纳入中央对手方清算的决定通知乙方。但甲方已经对该合约执行了清算结算的，双方承认，该清算结算合法有效，且不可撤销。

2、该合约已经被纳入保证金计算范围并且双方就此收付了保证金的，仍由保证金接收方予以保留。

（四）自动提前终止后的调整

由于发生了本条第（一）款规定的违约事件而使得中央对手方清算业务合约自动提前终止的，从自动提前终止之刻起、截至甲方知道发生了自动提前终止事件时为止，如果中央对手方清算业务的基础资产在此期间的报价或市值发生变化并使得甲方承担了支出、成本、损失或责任的，乙方须对此全额补偿。

第十六条 免责事由

（一）不可抗力，是指不能预见、不能避免并不能克服的客观情况，包括但不限于战争、自然灾害、台风、水灾、海啸、雷击、地震、停工、罢工、暴动、恐怖分子袭击、法定传染性疾病、政府行为等。

一方因不可抗力不能履行或不能完全履行本协议的，应及时通知对方以减轻可能造成的损失，并应采取适当措施防止损失的扩大，并在合理期限内提供证明。

一方因不可抗力发生违约行为给对方造成损失的，根据不可抗力的影响程度，该方可部分或全部免除违约责任，但法律法规另有规定的除外。

（二）因以下原因造成清算数据或指令传送延迟、错误、丢失、全部或局部暂时中止清算系统服务及其它异常情况，甲乙双方均有及时排除障碍和采取补救措施的义务，可全部免除违约责任并不承担赔偿责任：

1、公共通讯网络故障或电力供应故障等；

2、中国人民银行大额支付系统或相关交易系统方面的失误或故障等；

3、电信部门技术管制、非因甲方原因所致的清算系统及网络设备设施故障。

（三）甲方因本条第（一）款与第（二）款所述情况而采取全部或局部暂时中止系统服务或更改运营时间或启动灾备系统时，乙方应予以配合。

（四）甲方在管理部门特殊要求或市场整体利益需要的情况下，可暂时或持续性更改运营时间，或暂时中止甲方业务系统，或停止提供部分服务，对中止期限甲方应依据实际情况作出必要及恰当的确定。

第十七条 会员终端软件

甲方保证，甲方提供的会员终端使用的软件知识产权完全属于甲方或有充分授权提供给乙方使用，乙方使用该软件不会侵犯任何第三人的知识产权或其他民事权利。如果甲方违反上述保证，或任何第三人就乙方使用该软件提出或指控乙方侵犯了其知识产权或其他民事权利，则甲方应负责消除全部法律障碍，并赔偿因此给乙方造成的损失。

乙方承认并同意，所有甲方提供的会员终端使用的软件相关的知识产权（不论注册与否）是且始终属于甲方。乙方不得对会员终端软件进行反向工程、反汇编、分解或进行其他试图取得此等软件或程序源代码的行为，或者将此等软件用于本协议以外的用途。乙方若使用

甲方提供的接口交互规范自行开发会员终端软件，应参照甲方系统软件升级的情况配合进行验收测试。

如果甲方与本协议相关的软件在运行过程中被人为攻击，或发生其他不可归责于甲方的原因致使该等软件在一定时间内无法使用、运行不畅或导致信息泄露，甲方不承担由此给乙方所造成的损失，但应尽快排除该等妨碍事由并在该等事由发生后及时告知乙方。

第十八条 保密义务

本协议任何一方及其工作人员应保守其在本协议订立和履行过程中知悉的对方的商业秘密以及其他未公开的信息，未经对方事先书面许可，不得用于本协议以外目的或向第三方透露、供其使用，但根据法律法规、有权机关、机构及法院或仲裁庭要求应当进行披露或为履行本协议需要而必须向其关联方、服务提供方以及聘请的外部专业顾问（中介机构）披露的情形除外（但无论如何，此时披露方应确保信息接收方对所披露的信息承担保密义务，并不得为本协议之外的目的使用该等信息）。

商业秘密是指不为公众所知悉、能为权利人带来经济利益、具有实用性并经权利人采取保密措施的经营信息和技术信息。

关联方就某一特定的个人、公司或单位而言，指(a)直接或间接地控制该个人、公司或单位的其它个人、公司或单位，或(b)受该等个人、公司或单位控制的其它个人、公司或单位，或(c)与该个人、公司或单位处于共同受控之下的任何其它个人、公司或单位。在本定义中，针

对某一特定的公司或单位使用的“控制”一词系指，通过股权、股份或其它证券所有权或表决权或以合同形式或其它方式，直接或间接地拥有指导该等公司或单位的管理和政策或促使其管理和政策受到指导的权力，且“控制”、“被控制”和“处于共同受控之下”等词语具有与前述相同的含义。任何一方或其工作人员或任何一方聘请的外部专业顾问违反上述保密条款，该方应对另一方由此遭受的损失作出赔偿。

双方一致同意，即使本协议终止，本条所约定的保密义务继续有效。

第十九条 名称及标题

本协议名称及本协议所列标题仅为便于参考之目的，并不影响本协议的结构且并不用来解释本协议的任何内容。

第二十条 通知方式与生效

- (一) 采用专人递送或快递服务的，于寄出日生效；
- (二) 采用挂号邮寄方式发送的，于寄出日生效；
- (三) 采用传真发送的，于发件方发出传真当日生效；
- (四) 采用电子信息系统发送的，于通知从发件方电子信息系统发出之日生效；
- (五) 采用电话录音方式的，即时生效；
- (六) 当收件方、收件方的代理人或对收件方行使破产管理人权

限的人士拒绝在送达回执上签收或无人签收的，发件方可以采用公证送达或公告送达，双方约定公告送达即指在甲方官方网站上以公告的形式向被送达方发送相关通知，经过7个工作日即视为已送达给被送达方；

（七）采用甲方官方网站公布的，于公布时间或公布的文件所指定的时间生效；

（八）采用其他方式的，于双方约定的时间生效。

第二十一条 法律及规范性文件的适用

本协议受中国法律管辖并依其进行解释。中国法律及规范性文件指中华人民共和国境内（就本协议而言，其范围不包括香港特别行政区、澳门特别行政区及台湾）现行有效的法律、法规、规章、条例，以及具有立法、司法或行政管理权限或职能的机构依法发布的且现行有效的具有普遍约束力的解释、决定、批复、命令、规则、制度、通知、公告和其他类似的规范性文件。

第二十二条 条款可分割性

若本协议的任何条款或任何条款中的部分内容在任何方面构成或造成非法、无效或不可执行，则本协议其余部分的合法性、有效性或可执行性不受任何影响或减损。

第二十三条 争议处理方式

就本协议解释、履行和其它相关事项产生的任何争议，双方首先

应友好协商解决。如协商不成，协议双方同意向甲方所在地有管辖权的人民法院起诉。

第二十四条 其他

（一）协议文本

本协议正本一式肆份，双方各执贰份，每份具有同等的法律效力。

（二）协议生效

本协议自双方法定代表人或授权代理人签章并加盖公章或合同专用章之日起生效。

（三）协议修改或变更

除另有约定外，本协议的任何修改或变更，必须以书面形式做出并经双方签署后生效。

（四）名词解释

本协议所用之词语，除本协议特别说明外，均依据甲方相关规则中所界定的含义。

（本页以下无正文）

签署页：

甲方：银行间市场清算所股份有限公司

法定代表人或授权代理人：

单位公章或合同专用章：



生效日期： 2021 年 10 月 15 日

乙方： 机构A

法定代表人或授权代理人： **

单位公章或合同专用章



生效日期： 2021 年 10 月 15 日

银行间市场清算所股份有限公司

2021 年便函第*号

关于上海清算所清算会员认定的通知

机构 A:

贵单位参与人民币外汇交易中央对手清算自营业务的申请材料收悉。经评估，同意贵单位开展人民币外汇交易中央对手清算自营业务。贵单位清算会员类型为上海清算所 C 类普通清算会员，参与的集中清算业务如下：

清算业务名称	自营清算
人民币外汇交易中央对手清算	√

双方议定清算会员年费为人民币*万元/年。

本通知是《中央对手方清算协议》项下有效单据之一，并将根据贵单位的清算会员类型变化情况和参与的集中清算业务变化情况进行更新。

贵单位人民币外汇交易中央对手清算自营业务上线相关安排，以后续通知为准。

联系人：***，021-2319****

特此通知。

银行间市场清算所股份有限公司

2021 年 10 月 29 日

银行间市场清算所股份有限公司

2021 年便函第 * 号

关于参与人民币外汇交易中央对手清算业务 有关事宜的通知

机构A:

经审核，自 2021 年 11 月 22 日起，同意贵单位参与人民币
外汇交易中央对手清算业务，清算品种为即期、远期、掉期、期
权。

特此通知。

银行间市场清算所股份有限公司

2021 年 11 月 11 日

抄送：中国外汇交易中心

FX Swap 掉期

清算品种	交易日期	近端起息日	远端起息日	近端清算日	远端清算日	近端交易期限	远端交易期限	货币对	基准货币	近端基准币种交易方向	近端基准币种名义本金	远端基准币种名义本金	近端交易价格(元)	远端交易价格(元)
FX Swap	2021/12/24	2021/12/28	2022/12/23	2021/12/27	2022/12/22	SPOT	1Y	USDCNY	USD	BUY	450,000,000.00	450,000,000.00	6.4606	6.745

FX Forward 远期

清算品种	交易日期	远期远端起息日	远期远端清算日	远端交易期限	货币对	基准货币	远期基准币种交易方向	远期基准币种名义本金	远端交易价格(元)
FX Forward	2022/1/28	2022/10/28	2022/10/27	9M	USDCNY	USD	SELL	100,000,000.00	6.8453
FX Forward	2022/1/14	2022/11/18	2022/11/17	BROKEN	USDCNY	USD	SELL	400,000,000.00	6.6548
FX Forward	2022/8/22	2023/6/22	2023/6/21	BROKEN	USDCNY	USD	BUY	150,000,000.00	6.593
FX Forward	2022/8/22	2023/8/24	2023/8/23	1Y	USDCNY	USD	SELL	280,000,000.00	6.497

清算会员永久性违约通知

机构 A:

2022 年 9 月 19 日, 贵机构人民币外汇交易中央对手清算业务应缴未缴超限保证金为 5,000,000 元人民币, 应缴未缴盯市保证金为 3,000,000 元人民币。

2022 年 9 月 20 日, 贵机构人民币外汇交易中央对手清算业务应缴未缴超限保证金为 7,000,000 元人民币, 应缴未缴盯市保证金为 4,000,000 元人民币。

截止至 2022 年 9 月 21 日 9 时 00 分贵机构仍未完成相应支付义务。

根据《中央对手方清算协议》第十四条、《银行间市场清算所股份有限公司集中清算业务规则》第四十七条和第四十八条、《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》第五条、《银行间市场清算所股份有限公司集中清算业务指南》3.3, 上海清算所认定机构 A 在人民币外汇交易中央对手清算业务永久性违约。

上海清算所有权根据《中央对手方清算协议》、《银行间市场清算所股份有限公司集中清算业务规则》、《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》采取违约处置措施。贵机构应予以配合, 并承担相应法律后果。

特此通知。

银行间市场清算所股份有限公司

2022年9月21日



金融测试案例专用

人民币外汇交易中央对手清算业务 违约处置结果通知

机构 A:

本次人民币外汇交易中央对手清算业务违约处置整体损失金额为 101,631,116.91 元人民币。

具体损失构成：风险对冲阶段损失 85,379,008.62 元人民币（其中原始交易损失 51,104,394.52 元人民币，对冲交易损失 34,274,614.10 元人民币）；拍卖阶段损失 9,252,108.29 元人民币；违约处置前两个工作日应缴未交盯市损失 7,000,000.00 元人民币。

拍卖报价说明：上海清算所共收到 35 家清算会员有效报价，中标价格为 175,000,000 元人民币。

机构 A 已缴纳保证金和清算基金情况：初始保证金为 122,685,899.76 元人民币，清算基金为 18,402,884.96 元人民币。

截止 2022 年 9 月 23 日，本次违约处置整体损失已从贵机构已缴纳的保证金中予以扣除。

特此通知。

银行间市场清算所股份有限公司

2022年 9 月23 日



金融测试案例专用



SPT USD/CNY ODM



2022-09 - 21 20:30:05

Bid

6.4350

▲ 133.00
▲ 0.18

Ask

6.4290

6.4400

Prev Close

Open

High

Low

16:30 Cl...

6.3800

6.3890

6.4700

6.3820

6.4300



Real-Time

History

● Bid ● Ask ● Latest



6.4800

6.4700

6.4600

6.4300

6.3800

Time 13:00

Latest --

Bid/Ask

6.4521/6.4561

Time 14:02

Latest --

Bid/Ask 6.4540/6.4546

Time 14:04

Latest --

Bid/Ask 6.4550/6.4560

09:30