银行间市场清算所股份有限公司

外币回购清算业务指南

（2019年12月 试行）

# **总则**

1. 为推动银行间市场外币回购清算业务发展，规范外币回购清算结算行为，银行间市场清算所股份有限公司（以下简称上海清算所）依据国家相关法律法规、管理部门规定以及《银行间市场清算所股份有限公司债券登记托管、清算结算业务规则》，制定了《外币回购清算业务指南》（以下简称本指南或《业务指南》）。
2. 本指南适用于上海清算所外币回购清算业务。
3. 本指南所指外币回购包含外币质押式回购、外币买断式回购。
4. 外币质押式回购是交易双方进行的以债券为权利质押的一种短期外币资金融通业务，正回购方在将债券出质给逆回购方融入外币资金的同时，双方约定在将来某一日期由正回购方按约定回购利率计算的资金额向逆回购方返还资金，逆回购方解除出质债券上质权的融资行为。
5. 外币买断式回购是正回购方将债券卖给逆回购方的同时，交易双方约定在未来某一日期，正回购方再以约定的价格从逆回购方买回相等数量同种债券，且首期资金结算额币种和到期资金结算额币种均为同一种非人民币币种的买断式回购的交易行为。
6. 外币回购业务中，正回购方为资金融入方，逆回购方为资金融出方。
7. 本指南所指外币回购清算是指上海清算所为外币回购交易提供的清算结算及其他相关服务。外币回购清算业务服务范围包括但不限于：外币回购清算确认、结算指令的生成和发送、结算指令处理、债券抵押品管理、数据查询等。

# **机构参与、变更与退出**

1. 外币回购清算业务的参与机构应当在上海清算所开立债券持有人账户（包括A类、B类、C类户）。开展业务前，参与机构应当已成为银行间市场外币拆借会员。
2. 参与机构申请变更法定代表人、授权人员及资金往来账户、联络信息等信息的，办理要求详见上海清算所《债券账户业务操作须知》。
3. 参与机构申请退出外币回购清算业务且需终止上海清算所持有人账户的，办理要求详见上海清算所《债券账户业务操作须知》。

# **业务开展**

1. 外币回购清算业务支持的回购币种包括：美元（USD）、欧元（EUR）、英镑（GBP）、日元（JPY）、港币（HKD）、澳元（AUD）、加拿大元（CAD）、新加坡元（SGD）、新西兰元（NZD）等。
2. 外币回购清算业务支持见券付款和见款付券两种结算方式。见券付款是指收券方以付券方应付债券足额为资金支付条件的结算方式。见款付券是指付券方以收到收券方支付的足额资金为债券过户条件的结算方式。
3. 外币质押式回购首期结算日支持见券付款，到期结算日支持见款付券；外币买断式回购首期结算日和到期结算日同时支持见券付款或见款付券。
4. 外币回购首期结算日和到期结算日应当符合外币回购交易相关起息日（还款日）规则。
5. 如遇节假日调整，上海清算所将根据银行间市场外币回购交易节假日相关规则对所涉交易的结算日进行相应调整，并生成新的结算指令。原结算指令同时作废。
6. 外币回购交易日为T日。
7. 外币回购交易首期结算日应当在T+3（含）日内。
8. 外币回购标的券为在上海清算所托管的可在银行间市场公开发行流通的债券。
9. 单笔外币买断式回购标的券种数量为1，单笔外币质押式回购标的券种数量为1到10。
10. 外币回购清算业务服务时间为北京时间09:00-17:00。
11. 参与机构可在外币回购交易达成后实时通过上海清算所客户端对已达成交易的相关要素进行清算确认。首期结算日北京时间17:00前未完成确认的，上海清算所不予进行后续处理。
12. **结算操作**

见券付款结算模式下，交易双方自行结算外币资金，付款方在结算日北京时间17:00前，通过上海清算所客户端提交付款确认指令，上海清算所实时进行债券抵押、解押或过户。付券方债券不足或付款方在结算日北京时间17:00仍未提交指令的，判定结算失败。

见款付券结算模式下，交易双方自行结算外币资金，收款方在结算日北京时间17:00前，通过上海清算所客户端提交收款确认指令，上海清算所实时进行债券抵押、解押或过户。收款方债券不足或在结算日北京时间17:00仍未提交指令的，判定结算失败。

参与者可通过双方认可的交互方式提高外币资金交收效率。

1. 外币回购清算业务中，若首期结算日结算失败，则到期结算日结算指令自动作废。
2. 外币回购清算业务存续期间，若标的债券发生派息，上海清算所将支付利息至派息时债券持有方账户。交易双方可根据相关协议自行进行债券利息支付。
3. 完成结算后，上海清算所实时更新债券结算状态，参与机构可通过上海清算所客户端进行查询。
4. 外币回购交易发生结算失败时，交易双方应当填写《外币回购交易结算失败备案表》（附件1），向上海清算所进行结算失败备案。
5. 参与机构可申请撤销当日成交的外币回购交易。若交易双方已在上海清算所客户端完成清算确认，则该笔交易不可撤销清算。
6. 外币质押式回购到期结算日结算失败的，可于次日北京时间09:00至17:00通过外币回购逾期返售指令办理解券。外币回购逾期返售指令由逆回购方发起并复核，正回购方确认后生效。

# **信息服务**

1. 参与机构可通过上海清算所客户端实时查询并下载自身账务数据，相关内容包括但不限于：交易明细及其状态、结算指令明细及其状态。
2. 参与机构可通过上海清算所客户端下载相关结算单据，包括但不限于：外币回购交割单、外币回购交割失败通知单、外币回购交割终止通知单、外币回购逾期返售交割单等。

# **收费**

1. 外币回购清算业务费用包括外币质押式回购结算过户费、外币买断式回购结算过户费和外币逾期返售结算过户费。
2. 上海清算所收取相关费用时，按结算笔数收取固定金额。
3. 外币回购清算业务费用按季度收取，上海清算所于每季度最后一个工作日汇总外币回购参与机构本季度各项应交费用，参与机构可通过上海清算所客户端下载缴费通知单。外币回购清算业务的费用扣收日为计费季度后首月的25日，若为节假日则顺延至下一工作日，参与机构应于费用扣收日前将费用一次全额汇至上海清算所指定的银行账户。逾期未缴付的，上海清算所有权直接在参与机构指定的资金结算账户主动扣收。
4. 外币质押式回购和外币买断式回购结算过户费的收费对象为结算双方，外币回购逾期返售结算过户费的收费对象为正回购方。

# **应急处理**

1. 外币回购清算业务应急情况包括参与机构因网络、系统或其他原因，无法及时通过上海清算所客户端提交外币回购清算确认、外币质押式回购逾期返售申请以及外币回购清算收付款确认，无法通过上海清算所客户端下载外币回购相关单据、查询相关数据等。
2. 参与机构应根据不同应急业务类别，按要求填制应急指令书，以传真方式发送至上海清算所，并与上海清算所工作人员进行电话沟通。
3. 外币回购清算确认的应急操作，需填制《外币回购清算确认应急指令书》（附件2）、并以交易成交单作为附件。
4. 外币质押式回购逾期返售的交易录入、复核或确认的应急操作，需填制《外币质押式回购逾期返售应急指令书》（附件3）。
5. 外币回购清算收付款确认的应急操作，需填制《外币回购清算收付款确认应急指令书》（附件4）。
6. 外币回购单据导出相关操作，需填制《外币回购单据下载应急指令书》（附件5）。
7. 应急指令书应于北京时间16：30前传真至上海清算所。对于16：30后收到的应急指令书，上海清算所有权不予受理。相应责任由应急方自行承担，上海清算所不承担相应责任。
8. 外币回购清算业务所涉应急处理的预留印鉴送存及更换操作参见上海清算所《债券账户业务操作须知》。
9. 接收应急指令书后，上海清算所将核对预留印鉴，并致电发送指令方进行指令书信息确认。确认信息包括：交易结算要素信息、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。
10. 应急处理完成后，上海清算所将结算成功或失败的结果以电话方式告知参与机构。参与机构也可向上海清算所查询处理情况，或在上海清算所客户端恢复正常后查询打印结算单据。

# **附则**

1. 上海清算所按照主管部门相关规定，对外币回购清算业务进行监测。
2. 本指南由上海清算所负责制定、解释、修改，并自发布之日起实行。

附件：1.外币回购交易结算失败备案表

2.外币回购清算确认应急指令书

3.外币质押式回购逾期返售应急指令书

4.外币回购清算收付款确认应急指令书

5.外币回购单据下载应急指令书

附件1

银行间市场清算所股份有限公司

外币回购交易结算失败备案表

填表日期: 年 月 日

|  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- |
| 卖方/正回购方账户名称 |  | 持有人账号 |  |
| 买方/逆回购方账户名称 |  | 持有人账号 |  |
| 外币回购交易指令编号 |  | 结算指令编号 |  |
| 外币回购交易结算失败理由说明： | | | |
| 外币回购交易结算失败后续处理方式说明： | | | |
| 结算双方联系人、联系电话： | | | |
| 结算双方业务公章： | | | |

注：1.本备案表一式四份，交上海清算所及交易中心各一份保存，其余由交易双方保存，盖章有效。

2.联系电话：021-23198787； 邮箱：fund@shclearing.com； 传真：021-63326661。

附件2

**外币回购清算确认应急指令书**

传真指令编号：

银行间市场清算所股份有限公司：

我单位因 原因，不能正常办理外币回购清算业务，故以传真方式发送应急结算指令。我单位保证：买卖双方已达成交易；所发送的应急结算指令书内容真实、准确、完整、有效。

|  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- |
| 应急总笔数 |  | 应急交易编号 |  |
| 发送日期 | 年 月 日 | 自营/代理 | □自营 □ 代理 |
| 持有人账号（可为持有人本身或操作代理账户） |  | 持有人账户简称（可为持有人本身或操作代理账户） |  |
| 联系人姓名 |  | 联系人电话 |  |

发送指令方有效印鉴：

说明：

1.持有人账户或操作代理账户为同一个时，可合并填写一份批量应急汇总指令书。

2.应急交易编号：应为外汇交易中心生成的交易编号。

3.传真指令编号：由指令发送方自行编制，当天不重复。

4.外汇交易中心成交单需每张加盖有效印鉴，作为本指令书附件，且与本指令书一并加盖骑缝章。

5.填写必须清晰，不得涂改。上海清算所应急传真号码：021-63326661。

附件3

**外币质押式回购逾期返售应急指令书**

传真指令编号：

银行间市场清算所股份有限公司：

我单位因 原因，不能正常办理结算业务，故以传真方式申请办理外币质押式回购逾期返售的应急操作。我单位保证：买卖双方已协商一致；所发送的应急指令书内容真实、准确、完整、有效。

持有人账号（持有人本身或操作代理账户）：\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_ 持有人账户简称（持有人本身或操作代理账户）：\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_ 发送日期：\_\_ \_\_\_年\_ \_\_\_月\_\_\_\_日 联系人姓名：\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_ 联系人电话：\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_ □自营 □代理

|  |  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- | --- |
| **序号** | **成交编号** | **结算金额** | **结算日期** | **结算方式** | **操作类型** |
|  |  |  |  |  |  |
|  |  |  |  |  |  |
|  |  |  |  |  |  |
|  |  |  |  |  |  |

（注：以上表行数不够的，可自行添加。）

发送指令方有效印鉴：

说明：1.持有人账户或操作代理账户为同一个时，可合并填写一份批量应急指令书。

2.传真指令编号：由指令发送方自行编制，当天不重复。成交单编号：应为外汇交易中心生成的成交编号。

3. 操作类型为(1)逆回购方录入、(2)逆回购方复核、(3)正回购方确认，请按实际情况填写。

4.超过1页,需加盖骑缝章; 填写必须清晰，不得涂改。上海清算所应急传真号码：021-63326661。

附件4

**外币回购清算收付款确认应急指令书**

传真指令编号：

我单位因 原因，不能正常办理外币回购清算业务收付款确认，故以传真方式申请办理外币回购收付款确认的应急操作。我单位保证：买卖双方已协商一致；所发送的应急指令书内容真实、准确、完整、有效。

持有人账号（持有人本身或操作代理账户）：\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_ 持有人账户简称（持有人本身或操作代理账户）：\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_ 发送日期：\_\_ \_\_\_年\_ \_\_\_月\_\_\_\_日 联系人姓名：\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_ 联系人电话：\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_\_ □自营 □代理

|  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- |
| **序号** | **成交编号** | **结算指令编号** | **对方持有人账号** | **操作类型** |
|  |  |  |  | □收款确认 □付款确认 |
|  |  |  |  | □收款确认 □付款确认 |
|  |  |  |  | □收款确认 □付款确认 |
|  |  |  |  | □收款确认 □付款确认 |

（注：以上表行数不够的，可自行添加。）

发送指令方有效印鉴：

说明：1.持有人账户或操作代理账户为同一个时，可合并填写一份批量应急指令书。

2.传真指令编号：由指令发送方自行编制，当天不重复。成交单编号：应为外汇交易中心生成的成交编号。

3.超过1页,需加盖骑缝章; 填写必须清晰，不得涂改。上海清算所应急传真号码：021-63326661。

附件5

**外币回购单据下载应急指令书**

|  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- |
| 传真指令编号： | | | | |
| **应急内容 （必填）** | 持有人账号 |  | 持有人账户简称 |  |
| **具体要求：** | | | |
| **填写说明：**  请注明单据名称、时间范围、接收电子邮箱地址；单据范围包括外币回购交割单、外币回购交割失败通知单、外币回购交割终止通知单、外币回购逾期返售交割单等。 | | | | |

指令发送方保证：所发送的应急指令书内容真实、准确、完整、有效。

指令发送方账号： 指令发送方简称：

发送指令方有效印鉴： 发送日期： 年 月 日

联系人电话：

联系人姓名：

发送指令方传真号码：

说明：1.传真指令编号由指令发送方按当日顺序自行编制，从001、002开始依次类推，当天不重复。

2.上海清算所将通过邮件形式将相关单据发送至相关机构联系人。

3.填写须清晰，不得涂改。上海清算所接收传真电话：021-63326661。