

附件

银行间市场清算所股份有限公司 集中清算业务清算会员管理办法

第一章 总则

第一条 为进一步完善银行间市场清算所股份有限公司（以下简称上海清算所）清算会员的服务管理，保障清算会员的合法权益，根据《银行间市场清算所股份有限公司集中清算业务规则》等相关制度，制定本办法。

第二条 本办法适用于集中清算业务参与者，包括上海清算所清算会员以及申请机构等。

第二章 清算会员

第三条 上海清算所集中清算业务实行清算会员制度，清算会员分为普通清算会员、综合清算会员和特殊清算会员。

第四条 普通清算会员可参与集中清算自营业务，分为A类、B类和C类普通清算会员。

A类普通清算会员可参与所有集中清算自营业务；B类普通清算会员可参与两项或两项以上集中清算自营业务；C类普通清算会员只能参与一项集中清算自营业务。

第五条 综合清算会员可参与集中清算自营和代理业务，分为上海清算所综合清算会员和产品类综合清算会员。

上海清算所综合清算会员可参与所有集中清算自营及代理

业务；产品类综合清算会员可参与所有集中清算自营业务及对应业务的集中清算代理业务。

非清算会员通过综合清算会员代理，可间接参与集中清算业务。

第六条 特殊清算会员参与集中清算业务的具体规定另行制定。

第三章 会员参与

第七条 申请机构或清算会员应持续满足资信、业务、风险管理、技术和人员等相关参与要求或标准。上海清算所根据参与条件审核机构申请，并对清算会员持续评估。

第八条 自愿申请成为普通清算会员的机构，原则上应持续满足以下参与条件：

- （一）依法登记注册的法人或其他机构；
- （二）具备相关业务经营资格；
- （三）已签署上海清算所中央对手方清算协议等；
- （四）最近三个会计年度期末净资产（证券公司等为净资本）均不低于 20 亿元人民币（或等值外币）；
- （五）银行类金融机构的初始资信评分不低于 55 分，非银行类金融机构的初始资信评分不低于 50 分；
- （六）业务经营满足相关集中清算自营业务综合发展要求，申请 A 类普通清算会员的机构应已积极参与集中清算自营业务；
- （七）具备开展集中清算自营业务所必需的业务管理制度、

风险管理制度、技术系统、集中清算业务政策落实及发展计划等；

（八）具备相关业务能力的集中清算自营业务在岗人员，并指定相关联络人；

（九）遵守监管机构的有关规定，在申请普通清算会员之前的三年内无重大违法、违规记录，未发生重大风险管理违规违约事件等；

（十）具有较好的持续经营能力，未被行政机关、司法机关或监管机构采取停业整顿、托管、接管、重整以及其他可能影响持续经营能力的措施或行政、司法程序；

（十一）上海清算所要求的其他条件。

第九条 自愿申请成为产品类综合清算会员的机构，原则上应持续满足以下参与条件：

（一）已成为 A 类普通清算会员，并已积极参与集中清算自营业务；

（二）最近三个会计年度期末净资产（证券公司等为净资本）均不低于 100 亿元人民币（或等值外币）；

（三）银行类金融机构的初始资信评分不低于 65 分，非银行类金融机构的初始资信评分不低于 60 分；

（四）业务经营满足相关集中清算代理业务综合发展要求，根据业务实际，已积极参与相关自营清算业务；

（五）具备开展集中清算代理业务所必需的业务管理制度、风险管理制度、技术系统、集中清算业务政策落实及发展计划等；

(六)具备独立的代理业务团队和相应业务能力的代理业务在岗人员，并指定相关联络人；

(七)上海清算所要求的其他条件。

第十条 自愿申请成为上海清算所综合清算会员的机构，原则上应持续满足以下参与条件：

(一)已成为产品类综合清算会员，并已积极参与集中清算自营和代理业务；

(二)最近三个会计年度期末净资产(证券公司等为净资本)均不低于100亿元人民币(或等值外币)；

(三)银行类金融机构的初始资信评分不低于70分，非银行类金融机构的初始资信评分不低于65分；

(四)上海清算所要求的其他条件。

第十一条 如不满足相关清算会员参与条件，但符合相关政策、市场发展需要等，或出具了符合条件的担保等，经审核通过后，视同符合相关要求。

第十二条 上海清算所审核通过清算会员申请后，书面告知申请机构，并向市场公告。

第四章 持续评估

第十三条 上海清算所对清算会员进行持续评估，包括业务评估、资信评估、年度评估等。

第十四条 业务评估是对清算会员集中清算自营和代理业务综合开展情况，以及落实政策制度和配合业务创新发展等

情况的评估。

上海清算所发布业务评估方案，定期跟踪、提示和评估，并通知清算会员业务评估结果。业务评估结果分为合格、基本合格、不合格，用于清算会员参与集中清算业务范围等的动态管理。

第十五条 资信评估是对清算会员或申请机构资信水平的综合评价，包括初始资信评估、年度资信评估和动态跟踪与评估等。

资信评估按照《银行间市场清算所股份有限公司清算会员资信评估办法》开展。资信评估结果用于清算会员资质评估、动态风险管理、资信因子和信用系数设置等。

第十六条 年度评估是对清算会员上一年度在合格中央对手方政策落实、风险管理、制度落实、系统安全、业务参与、反洗钱及反恐怖融资等方面综合情况的评估。

上海清算所发布年度评估方案，每年进行评估，并通知清算会员年度评估结果。年度评估结果分为合格、基本合格、不合格，用于清算会员资质等的动态管理。

第五章 资质变更与终止

第十七条 清算会员新增或退出相关集中清算业务后，上海清算所可相应变更其清算会员资质。

第十八条 清算会员可申请变更或终止清算会员资质，但不得向其他机构转让，因机构改制、重组、合并、分立、更名等情形承继清算会员资质的除外。

清算会员申请变更资质的，应符合拟变更的清算会员参与条件。清算会员申请终止资质的，上海清算所对清算会员结清债权债务、市场影响等方面进行评估，并通知清算会员结果。

第十九条 上海清算所有权根据清算会员业务评估、资信评估、年度评估结果等，以及清算会员违反本办法、相关规定或参与集中清算业务过程中存在违规违约情形等情况，对清算会员资质、业务范围等进行动态管理，视情形采取口头警告、书面警示、约见谈话、限期说明情况、责令改正、通报批评、收取违约金等措施。情节严重的，限制、暂停、终止清算会员参与相关集中清算业务，变更、终止其清算会员资质。

第二十条 清算会员出现以下情况的，经综合评估后，上海清算所限制、暂停清算会员参与相关集中清算业务或变更相关清算会员资质：

- （一）业务评估结果为基本合格；
- （二）年度资信评分较相关参与条件的降幅超过一定范围；
- （三）年度评估结果为基本合格；
- （四）上海清算所规定的其他情形。

第二十一条 清算会员出现以下情况的，上海清算所有权终止清算会员参与相关集中清算业务或终止相关清算会员资质：

（一）同一业务连续三年业务评估结果为基本合格或任意一年业务评估结果为不合格；

（二）连续三年年度资信评分较相关参与条件的降幅超过一

定范围或任意一年银行类清算会员年度资信评分低于 50 分、非银行类清算会员年度资信评分低于 45 分；

（三）连续三年年度评估结果为基本合格或任意一年年度评估结果为不合格；

（四）多次出现业务差错并造成恶劣影响；

（五）严重违法违规行为被监管机构处罚，对履行清算会员义务造成重大不利影响；

（六）被依法撤销、关闭或解散；

（七）启动接管、破产、重整、清算等行政或司法程序，或被监管机构采取停业整顿、托管、接管、撤销、关闭等措施；

（八）被吊销法人营业执照或业务经营相关的许可证；

（九）经营状况、财务状况恶化，不能清偿到期债务或明显缺乏清偿能力，不再具备持续经营能力，缺乏履行清算会员义务的能力；

（十）严重违反集中清算业务规则、集中清算业务指南、相关协议、风险管理或其他有关规定，造成重大不利影响，在规定时间内未完成整改或拒不整改；

（十一）在申请清算会员资质及参与集中清算业务过程中存在弄虚作假、恶意隐瞒、欺诈行为；

（十二）出现不满足上海清算所规定的清算会员参与条件且在上海清算所规定的期限内仍无法满足；

（十三）上海清算所规定的其他情形。

第二十二条 上海清算所审核通过清算会员资质变更或终止后，书面告知清算会员，完成相关手续后向市场公告。

第六章 附则

第二十三条 本办法由上海清算所负责解释。

第二十四条 本办法自发布之日起实施。