

附件 1:

**中国银行间市场**

**金融衍生产品交易主协议**

**(跨境文本-2022 年版)**

## 声明

《中国银行间市场金融衍生产品交易主协议（跨境文本-2022年版）》（简称《主协议》）的著作权属于中国银行间市场交易商协会。除非为本协议下有关交易或进行教学、研究的目的，未经著作权人事先书面同意，任何人不得复制、复印、翻译或分发《主协议》的纸质、电子或其他形式版本。

使用人为开展本协议下交易的目的，可在使用过程中根据《主协议》的有关约定并基于自身独立判断对《主协议》的相关条款进行补充或修改，签署相应补充协议，以确保最终的协议条款符合其风险管理需要。

## 目 录

第一条 协议的构成与效力等级 .....	4
第二条 主协议的适用 .....	4
第三条 声明与保证 .....	4
第四条 交易项下支付或交付义务的履行 .....	6
第五条 履约保障 .....	7
第六条 违约事件 .....	7
第七条 终止事件 .....	9
第八条 事件的等级 .....	10
第九条 违约事件的处理 .....	11
第十条 终止事件的处理 .....	13
第十一条 利息 .....	15
第十二条 税务条款 .....	16
第十三条 合同货币与终止货币 .....	18
第十四条 抵销与跨协议结算安排 .....	18
第十五条 转让 .....	19
第十六条 不放弃权利 .....	19
第十七条 电话录音 .....	19
第十八条 保密与信息披露 .....	19
第十九条 交易机构 .....	20
第二十条 争议的解决 .....	20
第二十一条 通知方式与生效 .....	20
第二十二条 费用 .....	21

第二十三条 标题 .....	21
第二十四条 累积补救 .....	21
第二十五条 协议的签署 .....	21
第二十六条 定义 .....	21

## 中国银行间市场金融衍生产品交易主协议

为促进金融衍生产品交易的顺利开展，明确交易双方的权利义务，维护交易双方的合法权益，根据适用的法律，交易双方在平等、自愿的基础上签署主协议。

### 第一条 协议的构成与效力等级

(一) 交易双方关于金融衍生产品交易的协议由以下部分构成：

1、《中国银行间市场金融衍生产品交易主协议（跨境文本-2022 年版）》（简称“主协议”）；

2、《中国银行间市场金融衍生产品交易主协议补充协议（跨境文本-2022 年版）》（简称“补充协议”，若有）；

3、交易有效约定。

上述三部分文件构成交易双方之间单一和完整的协议（简称“本协议”）。

(二) 补充协议与主协议不一致的，补充协议有优先效力；就一笔具体交易而言，在主协议、补充协议和交易有效约定出现不一致时，效力优先顺序如下：交易有效约定、补充协议、主协议。

### 第二条 主协议的适用

(一) 在中华人民共和国（仅为本协议之目的，不包括香港特别行政区、澳门特别行政区及台湾地区，下同）境外设立的交易一方与境内设立的另一方或境外设立的交易双方达成的金融衍生产品交易适用主协议。

(二) 交易双方在签署主协议之后达成的金融衍生产品交易适用主协议。

(三) 除非交易双方另有约定，交易双方在签署主协议之前达成的衍生产品交易不适用主协议。

### 第三条 声明与保证

交易一方在签署主协议及补充协议（若有）之时向另一方做出下列声明与保证，除本条第 1 项、第 11 项和第 12 项下的声明与保证视为在本协议签署后的每日重复作出外，其他各项声明与保证视为在每项交易达成之日重复作出：

- 1、其系根据成立地**法律**合法成立并有效存续；
- 2、其有权并已获充分和必要的授权签署**本协议**（及其为一方的与**本协议**有关的任何其他文件），并履行其在**本协议**（及其为一方的与**本协议**有关的任何其他文件）下的义务，上述行为不违反任何适用于其的**法律**、公司章程与协议；
- 3、其已经取得签署和履行**本协议**所需的政府机关、监管机构的同意（若适用）；
- 4、以其名义达成和签署**本协议**的人员已获得充分和必要的授权；以其名义或代表其从事**交易**的人员，均已获得充分和必要的授权，且通过了相关的业务培训并获得了相关机构颁发的资格证书，前提是前述业务培训和资格证书为从事相关**交易**所必需；
- 5、其在**本协议**及其作为一方的**履约保障文件**下的义务构成对其合法、有效且有约束力的义务；
- 6、其没有持续存在任何**违约事件**或**潜在违约事件**，且就其所知，没有任何针对其的**终止事件**已经产生和持续存在，也不会因其签署**本协议**或其为一方的**履约保障文件**或履行**本协议**或其为一方的**履约保障文件**下的义务而发生该等事件；
- 7、没有任何针对其、其**履约保障提供者**或其指定的**特定实体**的诉讼、仲裁或类似事件已发生或正在发生，且该等诉讼、仲裁或类似事件将实质性地负面影响**本协议**或其为一方的**履约保障文件**的合法性、有效性或可执行性，或将实质性地负面影响其在**本协议**或在**其为一方的履约保障文件**下履行义务的能力；
- 8、为本款之目的，其提供的且在**补充协议**或**交易有效约定**中列明适用本款的文件及信息在所有实质性方面均真实、准确、完整；
- 9、其具备独立评估**交易**风险的能力，能够对**交易**中所涉及的法律、财务、税务、会计和其他事项自行调查评估（不依赖另一方的意见），且充分认识并愿意承担**交易**风险，根据自身的利益和判断进行**交易**；
- 10、除非其另行披露，其系代表自身而非代理任何第三方签署**本协议**并进行**交易**；但若**交易**一方为**产品管理人**且其为管理**产品**之目的签订**本协议**，则本款不适用于该**交易**一方；若**交易**一方为**产品管理人**且其为管理**产品**之目的签订**本协议**，**产品管理人**保证其已经获得充分的授权代表其管理的**产品**签署**本协议**；在**本协议**项下达成的**交易**符合相关产品的投资范围；**产品**具备足够的资产履行**本协议**下相关**交易**的支付义务或交付义务；
- 11、其以付款方的身份在**补充协议**中所作的有关税务方面的陈述均真实、准确、完整；
- 12、其以收款方的身份在**补充协议**中所作的有关税务方面的陈述均真实、准确、完整；

13、交易双方在补充协议中约定的其他声明与保证事项。

#### 第四条 交易项下支付或交付义务的履行

(一) 受限于本协议其他条款的约束，若交易一方在交易项下负有向另一方付款的义务（即支付义务），付款方应根据交易双方约定的时间、地点、货币、金额、账户以及支付路径等条件向另一方进行支付；若交易一方负有向另一方交付实物的义务（即交付义务），除非交易双方另有约定，该交付义务应按行业惯例于约定的交付日履行。

##### (二) 账户变更

除非另有约定，交易一方需要变更其账户的，应不迟于相关付款日或交付日前的第 10 个营业日书面通知另一方。除非另一方在不迟于相关付款日或交付日前的第 2 个营业日就账户变更提出合理的反对意见，该账户变更生效。

(三) 交易一方按交易有效约定的内容履行支付或交付义务须以下述条件同时满足为前提：

- 1、另一方没有发生且持续存在**违约事件**或**潜在违约事件**；
- 2、就产生该支付或交付义务的交易而言，与该交易有关的**提前终止日**未发生或未被有效指定；
- 3、交易双方约定的其他履约前提条件。

##### (四) 同笔交易项下支付义务的履行

同笔交易项下的支付义务适用支付净额，即在交易双方之间达成的同笔交易项下，若在任何一日交易双方均须向对方支付相同币种的款项，交易双方的应支付款项将进行轧差计算。若交易一方本应支付的金额高于对方本应支付的金额，则该交易一方只须向另一方支付两个金额之间的差额部分。该交易一方支付该差额部分后，交易双方在该交易项下的上述支付义务视为于支付当日完成并解除。

##### (五) 多笔交易项下支付义务的履行

交易双方可在补充协议中选择是否对多笔交易适用支付净额。若选择适用，则在交易双方之间达成的两笔以上（含）的交易项下，在任何一日交易双方均须向对方支付相同币种的款项时，交易双方的应支付款项将进行轧差计算。若交易一方本应支付的金额高于对方本应支付的金额，则该交易一方只须向另一方支付两个金额之间的差额部分。该交易一方支付该差额部分后，交易双方在相关交易项下的上述支付义务被视为于支付当日完成并

解除。

## **第五条 履约保障**

交易双方可协商签署或安排如下**履约保障文件**：

- （一）《中国银行间市场金融衍生产品交易转让式履约保障文件》；
- （二）《中国银行间市场金融衍生产品交易质押式履约保障文件》；
- （三）其他保障安排。

## **第六条 违约事件**

下列事件构成**交易一方在本协议下的违约事件**：

（一）**交易一方未按本协议的约定履行支付义务，或未按主协议第四条第（一）款的约定履行交付义务，且在另一方发出的未履约通知生效后的第3个营业日届满时仍未纠正的。**

（二）**交易一方的履约保障提供者未按其签署或出具的履约保障文件的约定履行有关义务且在适用的宽限期届满时仍未纠正的；或对其签署或出具的履约保障文件下的全部或部分义务、履约保障文件的有效性予以否认或明示将拒绝履行；或未经另一方书面同意，交易一方的履约保障文件在其所保障的交易项下义务履行完毕前提前到期、终止或失效（该履约保障文件按照其条款正常到期、终止或失效的情况除外）。**

（三）**交易一方对本协议下的全部或部分义务、本协议的有效性予以否认或明示将拒绝履行。**

（四）**交易一方在本协议下（主协议第三条第11项或第12项下的声明与保证除外）或该交易一方的履约保障提供者在履约保障文件下作出的某项声明与保证被证实在作出或被视为作出之日存在实质性的不实陈述、误导或重大遗漏。**

（五）**在交易一方或该交易一方的履约保障提供者发生分立后仍然存续，或与另一实体联合、合并或重组，或把其实质性资产转移到另一实体的情况下，该最终存续、承继或受让的实体未能履行或明示将不履行前述交易一方或履约保障提供者在本协议或原履约保障文件下的义务，或未经另一方同意，该最终存续、承继或受让的实体履行本协议下的义务未获得原履约保障文件的保障。**

（六）**交叉违约。若交易一方、该交易一方的履约保障提供者或在补充协议中为本款**

目的而指定的针对该**交易一方**的**特定实体**在其他债务文件下出现违约且在适用的宽限期届满时仍未纠正，从而导致出现下列任一情形的，也构成该**交易一方**对**本协议**的违约，即交叉违约：

1、其他债务文件下的债务被宣告或可被宣告加速到期，且该等债务的累计本金数额超过交叉违约起点金额；

2、其他债务文件下的债务虽不存在被宣告或可被宣告加速到期的情形，但出现付款违约，且该等违约累计金额超过交叉违约起点金额。

除非**交易双方**在**补充协议**中另有约定，其他债务文件指借款合同、债券及其担保协议。交叉违约起点金额是指触发交叉违约的最低违约金额；**交易双方**可在**补充协议**中约定适用于**交易一方**的交叉违约起点金额，若无约定，则视为对该**交易一方**不适用交叉违约。

（七）**特定交易**下违约。若**交易双方**在**补充协议**中约定适用本款，则在已有效达成的**特定交易**下，**交易一方**、该**交易一方**的**履约保障提供者**或在**补充协议**中为本款目的而指定的针对该**交易一方**的**特定实体**发生下列任一情形的，构成该**交易一方**对**本协议**的违约：

1、对该**特定交易**予以否认或明示将拒绝履行；

2、未按约定履行支付义务，且该不履行行为导致该**特定交易**发生清算、被提前终止或义务被宣告加速到期的情形；

3、未按约定在该**特定交易**的最终支付日履行支付义务，或未支付与该**特定交易**的提前终止有关的任何款项，且在适用的宽限期届满时仍未纠正的；

4、未按约定履行任何交付义务，且在适用的宽限期届满时仍未纠正的，导致该**特定交易**所属协议下的全部交易发生清算、被提前终止或义务被宣告加速到期。

但若上述第2、3或4项的情形是由于一个相当于**主协议**第七条第（一）款或第（三）款所述事件导致的除外。

（八）**交易一方**、该**交易一方**的**履约保障提供者**或在**补充协议**中为本款目的而指定的针对该**交易一方**的**特定实体**发生下列任一情形的，构成该**交易一方**对**本协议**的违约：

1、解散（出于联合、合并或重组目的而发生的解散除外）；

2、不能清偿到期债务，并且资产不足以清偿全部债务或明显缺乏清偿能力的；

3、书面承认其无力偿还到期债务；

4、为其债权人利益就其全部或实质性资产达成转让协议或清偿安排，或就其全部或大部分债务的清偿事宜与债权人做出安排或达成和解协议；

5、自身或其监管部门启动针对其的接管、破产、清算等行政或司法程序；或其债权人启动针对其的接管、破产、清算等行政或司法程序，导致其被依法宣告破产、停业、清算或被接管，或上述程序在启动后 30 天内未被驳回、撤销、中止或禁止的；

6、通过其停业、清算或申请破产的决议；

7、就自身或自身的全部或大部分资产寻求任命临时清算人、托管人、受托人、接管人或其他类似人员或被任命了任何前述人员；

8、其债权人作为担保权人采取行动取得了其全部或大部分资产，或使其全部或实质部分资产被查封、扣押、冻结、或强制执行，且上述情形在 30 天内未被相关权力机关撤销或中止；

9、其他任何与本款第 1 项至第 8 项有类似效果的事件。

（九）**交易一方**未履行其在本协议下的其他义务，且在另一方发出的未履约通知生效后的第 30 天届满时仍未纠正的。但是，**交易一方**未按照**主协议**第四条第（二）款约定通知帐户变更事宜，或作为**受影响方**的**交易一方**未能在**主协议**第十条第（一）款或第（二）款约定的期限内履行通知、确认以及提供相关证明材料的义务，或对**受影响交易**的转让安排未完成或未达成处理方案，或未按照**主协议**第十二条第（二）款第 1 项至第 3 项约定履行提供有关税务的信息、文件或通知的义务，不构成一项**违约事件**或**潜在违约事件**。

## **第七条 终止事件**

**交易一方**发生下列任一事件时，即构成一项**终止事件**：

（一）在一项**交易**达成后，由于适用法律的变动导致该方（“**受影响方**”）：

1、履行该**交易**项下的支付或交付义务变得不合法，或收受关于该**交易**的款项或交付的实物变得不合法，或遵守关于该**交易**的**本协议**下的其他实质性条款变得不合法；或

2、履行、或其**履约保障提供者**履行与该**交易**有关的**履约保障文件**约定的任何实质性义务变得不合法。

（二）若**交易双方**在**补充协议**中约定本款适用于**交易一方**，而该**交易一方**、其**履约保障提供者**或在**补充协议**中为本款目的而指定的针对该**交易一方**的任何**特定实体**发生**补充协议**约定的合并事件，虽未构成**主协议**第六条第（五）款约定的**违约事件**，但最终存续、承继或受让的实体在该合并事件刚发生后的资信状况（在考虑了适用的**履约保障文件**的情况下）与上述**交易一方**、其**履约保障提供者**或**特定实体**（视情况而定）在该合并事件即将

发生时的资信状况相比严重降低（该交易一方或最终存续、承继或受让的实体为“受影响方”）。

（三）在一项交易达成后，由于不可抗力事件的发生导致该方（“受影响方”）履行该交易项下的支付或交付义务、或收受关于该交易的任何款项或任何交付的实物、或遵守关于该交易的本协议下的任何其他实质性条款变得不可能或不切实际，或履行、或其履约保障提供者履行与该交易相关的履约保障文件约定的任何实质性义务变得不可能或不切实际，且上述情形从发生之日起3个营业日后仍然持续。

（四）在一项交易达成后，若由于与税务有关的适用法律的变动、有关税务机关或其他有权机关的任何要求或行动导致或可能导致交易一方（“受影响方”）在该交易下将收到的付款被扣除或预提税款，且受影响方无权依据第十二条第（一）款第2项要求另一方支付税款补偿金额（除非另一方可依据第十二条第（一）款第3项拒绝支付该税款补偿金额），或须就其在该交易下将支付的付款向另一方支付税款补偿金额。

（五）在一项交易达成后，若交易一方（该交易一方为“受影响方”）与另一实体联合、合并或重组，或把其实质性资产转移到另一实体，虽未构成主协议第六条第（五）款约定的违约事件，但该事件导致或可能导致交易双方中的任一方（该方为“受损方”）在该交易下将收到的付款被扣除或预提税款，且受损方无权依据第十二条第（一）款第2项要求另一方支付税款补偿金额（除非另一方可依据第十二条第（一）款第3项拒绝支付税款补偿金额），或须就其在该交易下将支付的付款支付税款补偿金额。

（六）若交易双方约定了其他终止事件并指明相应的受影响方，则该事件的发生构成一项终止事件。

## 第八条 事件的等级

若任何事件或情形构成或产生主协议第七条第（一）款或第（三）款约定的一项终止事件，但该事件或情形与未支付、未交付或未遵守本协议下的任何其他主要条款有关并构成或产生了主协议第六条第（一）、（二）或（九）款项下的一项违约事件或潜在违约事件，则该事件或情形仍应视为构成了相应的终止事件。但是，主协议第七条第（三）款下由于不可抗力事件所导致的情形在发生之日起3个营业日内不构成一项潜在违约事件。

除上述情况外，若任何事件或情形在构成或产生主协议第七条第（一）款或第（三）款项下的一项终止事件的同时亦构成或产生主协议下的一项违约事件（或其他的终止事

件)，则该事件或情形应视为构成了相应的**违约事件**（或该其他的**终止事件**）。

## 第九条 违约事件的处理

### （一）确定提前终止日

1、当发生**主协议**第六条所述**违约事件**且该**违约事件**仍然持续，**守约方**有权书面通知（通知方式仅适用**主协议**第二十一条第（一）款约定的方式）**违约方**该**违约事件**的发生，并指定**提前终止日**。**提前终止日**应为该通知生效之日起 15 个营业日内的一个营业日，且一旦被指定后即不可撤销或更改。所有**被终止交易**将在**提前终止日**终止。

2、若**交易双方**在**补充协议**中约定“自动提前终止”适用于**交易一方**，则（A）若**交易一方**发生了**主协议**第六条第（八）款第 1、4、6、7 项所述**违约事件**或在与之类似的范围内发生了该款第 9 项约定的**违约事件**，所有**被终止交易**于该**违约事件**发生之日自动终止，**提前终止日**为该**违约事件**发生之日；或（B）若**交易一方**发生了**主协议**第六条第（八）款第 5 项所述**违约事件**或在与之类似的范围内发生了该款第 9 项约定的**违约事件**，**提前终止日**为相关请求提出或相关程序提起之日，所有**被终止交易**立即于相关请求提出或相关程序提起之前自动终止。

3、在**提前终止日**被有效指定或发生后，**交易双方**在本**协议**下的所有**被终止交易**适用终止净额，即**交易双方**均无须按照**主协议**第四条的约定进行**被终止交易**项下的支付或交付，而须按照本条第（二）款和第（三）款的约定在轧差计算**被终止交易**的公允价值的基础上计算并支付**提前终止应付额**。

### （二）违约事件项下提前终止应付额的计算

确定**提前终止日**后，**守约方**作为**终止净额计算方**须以**基准日**为基准，负责就**提前终止应付额**进行计算，具体原则与方法如下：

1、**终止净额计算方**对**提前终止应付额**的计算应本着诚实信用和商业合理原则进行，不得重复计算。

#### 2、计算公式

**提前终止应付额**的计算公式为：

**提前终止应付额** = 所有**被终止交易**的公允价值总和的终止货币等值额 + **守约方**收到的**未付款项**终止货币等值额 - **违约方**应收到的**未付款项**终止货币等值额

若该数额为正数，应由**违约方**向**守约方**支付；若该数额为负数，应由**守约方**向**违约方**

支付。

### 3、被终止交易的公允市场价值的计算

交易双方可在补充协议中选择以下一种方法计算被终止交易的公允市场价值（若没有选择，则适用替代交易法）：

#### （1）替代交易法

适用此方法时，一项或一组被终止交易的公允市场价值是其终止数额，由终止净额计算方依据以下信息确定：

（a）第三方就该被终止交易的替代交易提供的报价，该方在提供上述报价时可考虑终止净额计算方的信用状况；

（b）由第三方提供的与被终止交易相关的金融市场数据，包括利率、汇率、价格、收益率曲线、价差等；

（c）若终止净额计算方有合理的理由相信无法获得(a)或(b)所述的信息或数据，或适用该等信息或数据可能产生商业上不合理的结果，则可使用终止净额计算方内部在计算类似交易的价值时通常采用的上述信息。

#### （2）市场报价法

适用此方法时，一项或一组被终止交易的公允市场价值由终止净额计算方依据该被终止交易的市场报价（不论正数或负数）确定。若无法就该被终止交易确定市场报价或终止净额计算方基于诚实信用原则确信依据有关市场报价不会产生合理的商业结果，则应采用本项第（1）部分所述的替代交易法。

#### （三）计算报告

终止净额计算方须在提前终止日（若适用“自动提前终止”，则为其知晓或应知晓提前终止日发生之日）后的 20 天内向另一方提交计算报告（计算报告提交方式仅适用主协议第二十一条第（一）款约定的通知方式）。该计算报告须明确列示提前终止应付款方、提前终止应付额，说明计算的细节及依据。提前终止应付款方应在提前终止应付额付款日支付该计算报告提及的提前终止应付额及其利息。本款下的提前终止应付额付款日为该计算报告生效日。

#### （四）自动提前终止的调整

若一个提前终止日因为“自动提前终止”适用于交易一方而产生，则根据主协议第九条第（二）款第 2 项计算得出的提前终止应付额需进行相应调整，以反映在相关的提前终

止日起至第九条第（三）款所述的**提前终止应付额付款日止**的一段期间内交易一方在本协议下向另一方支付的且为另一方保留的任何款项或实物交付。

## **第十条 终止事件的处理**

### **（一）通知**

**受影响方**应在获悉**终止事件**后，立即通知另一方该**终止事件**的发生及所有**受影响交易**的明细，并在发出通知后的 15 个**营业日**内提供相关证明材料。

在**非受影响方**获悉**终止事件**，且未收到**受影响方**的**终止事件**通知时，**非受影响方**有权通知**受影响方**；**受影响方**应在通知生效后 2 个**营业日**内予以回应，并在通知生效后 15 个**营业日**内提供相关证明材料。

### **（二）协商与转让处理**

**交易双方**可在**终止事件**通知生效后进行协商，以避免**受影响交易**的提前终止。

若发生了第七条第（四）款项下的一项**终止事件**且只有一个**受影响方**，或发生了第七条第（五）款项下的一项**终止事件**且**受损方**为**受影响方**，**受影响方**应尽其合理努力在发出本条第（一）款所述通知后的 20 个**营业日**内，将其在本协议项下与**受影响交易**有关的全部权利和义务转让给其另一分支机构（或总部），以使该**终止事件**不再存续，前提是采取该等处理措施不会使其产生重大损失。若**受影响方**无法在该 20 个**营业日**的期限内完成上述转让，则应在该期限届满前通知另一方，另一方可在收到本条第（一）款所述通知后的 30 个**营业日**内采取类似的转让。上述转让均需获得对方的事先书面同意，但该方不得不合理地拒绝或拖延给予该同意。为避免疑问，当**受影响方**是**产品管理人**管理的**产品**时，**产品管理人**应尽其合理努力在发出本条第（一）款所述通知后的 20 个**营业日**内对相关**受影响交易**进行处理，以使该**终止事件**不再存续。

若发生了第七条第（四）款项下的一项**终止事件**且**交易双方**均为**受影响方**，**交易双方**应尽其合理努力在发出本条第（一）款所述通知后的 30 个**营业日**内达成处理方案，以使该**终止事件**不再存续。

### **（三）指定提前终止日**

1、若**交易双方**无法就**终止事件**的处理方式通过协商达成一致且届时该**终止事件**仍然持续，则根据以下约定确定的**交易一方**有权书面通知（通知方式仅适用**主协议**第二十一条第（一）款约定的方式）另一方，指定**受影响交易**的**提前终止日**：

(1) 在发生**主协议**第七条第（一）款、第（三）款约定的**终止事件**时，为**交易双方**中的任何一方；

(2) 在发生**主协议**第七条第（二）款约定的**终止事件**时，为**非受影响方**；

(3) 在发生**主协议**第七条第（四）款约定的**终止事件**时，为**受影响方**；

(4) 在发生**主协议**第七条第（五）款约定的**终止事件**时，为**受损方**；

(5) 在发生**主协议**第七条第（六）款约定的**终止事件**时，为**交易双方在补充协议中约定的非受影响方**。

2、**提前终止日**应为该通知生效之日起 15 个营业日内的一个营业日。全部**受影响交易**将在该**提前终止日**终止。若**交易双方**均有权发出书面通知，以先生效的通知中指定的**提前终止日**为准。

3、在**提前终止日**被有效指定后，**交易双方**在本协议下的所有**受影响交易**适用终止净额，即**交易双方**均无须按照**主协议**第四条的约定进行**被终止交易**项下的支付或交付，而须按照本条第（四）款第 1 项的约定在轧差计算**被终止交易**的公允市场价值的基础上计算并支付**提前终止应付额**。

#### （四）**终止事件**项下**提前终止应付额**的计算与支付

1、**终止净额计算方**按照**主协议**第九条第（二）款和第（三）款的约定计算**提前终止应付额**。若**非受影响方**为**终止净额计算方**，第九条第（二）款第 2 项所述的“**守约方**”为**非受影响方**、“**违约方**”为**受影响方**；若**交易双方**均为**终止净额计算方**，该项所述的“**守约方**”为进行计算的自身一方，“**违约方**”为另一方。

2、若**非受影响方**为**终止净额计算方**，适用于本款的**提前终止应付额付款日**为计算报告的生效日后第 3 个营业日；若**交易双方**均为**终止净额计算方**且对计算结果无异议，**提前终止应付额付款日**为后一份生效的计算报告的生效日后第 3 个营业日。

3、若**交易双方**均为**终止净额计算方**且对计算结果有异议，**交易双方**可协商确定**提前终止应付额**，或共同指定第三方作为计算代理人，依照**主协议**第九条第（二）款和第（三）款的约定，在**交易双方**同意的期限内计算**提前终止应付额**。若**交易双方**协商不成，或未能就计算代理人的指定或计算期限达成一致，或**交易一方**对计算代理人的计算结果有异议，任一方可依据**主协议**第二十条的约定申请仲裁或提起诉讼。

## 第十一条 利息

### （一）未发生或指定提前终止日

在未发生或指定提前终止日的情形下，按本款约定的方式就支付和交付义务计息：

#### 1、因另一方违反履约前提条件而暂停付款的计息

由于另一方违反了**主协议**第四条第（三）款约定的履约前提条件，**交易一方**因而暂停履行其根据**主协议**第四条第（一）款本应履行的支付义务，则应另一方的要求（且在该**交易一方**可藉以主张暂停履行支付义务的原因消除之后），该**交易一方**应就该款项以相同币种的货币向另一方支付利息。利息期间始于该**交易一方**原应履行支付义务之日（含），止于该**交易一方**在上述原因消除之后实际应履行支付义务之日（不含）。利息率为**银行间利率**。

#### 2、未按时付款的计息

**交易一方**未按时履行其在本协议下就任何款项进行付款的义务（本款第1项描述的情形除外），则应另一方的要求，该**交易一方**应就该款项以相同币种的货币向另一方支付利息。利息期间始于**交易一方**本应履行支付义务之日（含），止于该**交易一方**实际付款之日（不含），利息率为**违约利率**。但是，若**主协议**第七条第（一）款或第（三）款所述的一项情形导致该**交易一方**未履行上述支付义务，就始于该**交易一方**因为此项情形而未履行上述义务之日（含）、止于该情形停止存在之日（不含）的利息期间，利息率为**银行间利率**。

#### 3、与交付义务有关的计息

由于另一方违反了**主协议**第四条第（三）款约定的履约前提条件，**交易一方**因而暂停履行其根据**主协议**第四条第（一）款本应履行的交付义务，则其应本着诚实信用原则、根据本款第1项的约定，就交付物在原定交付日的公允价值，进行利息的计算与支付。

在其他情况下，若**交易一方**未按时履行其在本协议下任何交付义务，其应本着诚实信用原则、根据本款第2项的约定，就交付物在原定交付日的公允价值进行利息计算与支付。

### （二）发生或指定提前终止日

在发生或指定提前终止日的情形下，按本款约定的方式就支付和交付义务计息：

#### 1、未付款项的计息

根据**主协议**第九条第（二）款和第十条第（四）款计算的**未付款项**应按**未付款项**中各具体款项币种计算利息。利息期间始于**交易一方**本应履行支付或交付义务之日（含），止

于**提前终止日**（不含）。利息率确定如下：

- （1）对于原应由**违约方**支付的款项，为**违约利率**；
- （2）对于原应由**守约方**支付的款项，为**银行间利率**；
- （3）对于原应由**受影响方**或**非受影响方**支付的款项，为**银行间利率**。

## 2、提前终止应付额的计息

就**交易一方**根据**主协议**第九条第（二）款、第（三）款和第十条第（四）款约定应支付的**提前终止应付额**，应以终止货币按照以下原则计算利息：

（1）就始于**提前终止日**（含）、止于**提前终止应付额付款日**（不含）的利息期间，利息率确定如下：

- （a）由**违约方**支付的，为**违约利率**；
- （b）由**守约方**支付的，为**守约利率**；
- （c）由**受影响方**或**非受影响方**支付的，为**银行间利率**。

（2）就始于**提前终止应付额付款日**（含）、止于（不含）实际支付日的利息期间，利息率确定如下：

- （a）除下述第（b）段约定的部分，为**违约利率**；
- （b）若**提前终止应付额**的任何部分未被支付是由于**主协议**第七条第（一）款或第（三）款所述的一项情形或由于不可归咎于付款方的原因所导致的，就始于该部分金额因该情形而未被支付之日（含）、止于该情形停止存在之日（不含）的期间，为**银行间利率**。

（三）本条约定的利息按照复利逐日计算。

## 第十二条 税务条款

### （一）税款的扣除或预提

**本协议**项下的所有付款不应扣除或预提任何税款，除非根据适用于**交易一方**的**法律**或**税务机关**的要求，作为付款方的**交易一方**须在向另一方付款时扣除或预提有关税款。在此情况下：

1、**交易一方**应将该要求及时通知另一方，在**法律**或**税务机关**要求的期限内及时向有关机关缴纳所需扣除或预提的全部税款，并将缴款的正式收据（或其经认证的副本）或另一方可合理接受的其他文件及时交付给另一方。

2、**交易一方**在向另一方付款时，须相应增加支付金额（所增加的金额为“**税款补偿**”

金额”），以确保另一方收到的款项净额相当于在不需要任何扣除或预提税款时其本应收到的金额。但是，若**交易一方**本来没有扣除或预提任何税款的义务，仅由于另一方的原因而需要扣除或预提该税款（包括但不限于另一方成为**交易一方**所在国家或地区的税收居民，或在**交易一方**所在国家或地区进行营业，或在**交易一方**所在国家或地区设有或曾经设有常设机构，但不包括仅因另一方或其授权人士在该国家或地区境内签署、交付、履行或执行**本协议**或相关**履约保障文件**而产生的联系），则**交易一方**没有向另一方支付相关**税款补偿金额**的义务。

3、若另一方未遵守本条第（二）款项下义务，或在第三条第 12 项下的声明与保证存在错误、误导或重大遗漏（但由于适用法律的变动、有关税务机关针对任何人士采取的任何要求或行动所引起的除外），从而导致**交易一方**在付款时须扣除或预提任何税款，则**交易一方**无需按照上述第 2 项的要求支付**税款补偿金额**。**交易一方**由此向有关政府或税务机关承担任何税收或其他责任的，该等责任应由另一方承担，且另一方应及时向**交易一方**支付有关该责任的全部款项（包括应付给有关政府或税务机关的罚金、罚息或利息（若有））；若**交易一方**已向有关政府或税务机关支付了任何款项，则另一方还应按照第十一条第（一）款第 2 项的约定向**交易一方**支付应计利息。

#### （二）与税务有关的约定

在**交易一方**于**本协议**或其为一方当事人的**履约保障文件**下负有或可能负有任何付款义务时，**交易双方**就有关税务方面作出以下约定：

1、**交易一方**应向另一方提供**补充协议**或任何**交易有效约定**要求的有关税务的表格、文件或证明；

2、根据另一方以书面形式提出的合理要求，**交易一方**应向另一方或其**履约保障提供者**提供其所需的任何表格、文件或证明，以使另一方或其**履约保障提供者**在**本协议**或相关**履约保障文件**下向**交易一方**付款时无需扣除或预提任何税款，或可以降低扣除或预提任何税款的适用税率，前提是签署、交付或填写该等表格、文件或证明不会对**交易一方**的商业或法律地位造成严重损害；**交易一方**应如实填写、签署及交付该等表格、文件或证明，并附上任何合理要求的证明文件；

3、若**交易一方**知悉其在第三条第 11 项或 12 项下的声明与保证有不准确或不完整之处，应及时书面通知另一方；

4、**交易双方**及其分支机构应各自在其所在国家或地区缴纳适用于其签署、交付及履行**本协议**的印花税、文件税、登记税或类似税项；但是，若另一方仅因为签署、交付及履

行本协议而需要在交易一方或其分支机构所在国家或地区缴纳该等税款，则交易一方应依照另一方的书面要求及时补偿其已缴纳的该等税款。

### 第十三条 合同货币与终止货币

#### （一）合同货币

合同货币指在本协议正常履行的情况下，交易双方约定的支付本协议下各款项的货币。若以合同货币以外的货币支付，收款方有权拒绝接受。中国法律另有规定的，从其规定。

#### （二）终止货币

终止货币指在发生提前终止的情况下，计算提前终止应付额所使用的货币。终止净额计算方应本着诚实信用原则将被终止交易项下的款项换算或套算为终止货币等值额。

若被终止交易的合同货币含人民币，则以人民币作为“终止货币”。其他币种应按照提前终止日当日中国人民银行公布或授权公布的人民币汇率中间价（若无，则按照交易双方另行约定的方法）换算为人民币，计入提前终止应付额。中国法律对外币兑换或换算另有规定的，从其规定。但是因为中国法律尚未允许交易双方之间以人民币跨境支付和结算提前终止应付额的，终止货币可为交易双方在补充协议中约定的币种。

若被终止交易的合同货币不含人民币，终止货币应为交易双方在补充协议中约定的币种。在不违反中国法律的前提下，根据交易双方的约定在各币种之间进行换算。

### 第十四条 抵销与跨协议结算安排

#### （一）抵销

在有一个违约方的情况下，或在发生了使本协议下全部交易均成为被终止交易的终止事件并且只有一个受影响方的情况下，守约方或非受影响方有权选择将交易一方应向另一方支付的任何提前终止应付额与另一方应向该交易一方支付的任何其他金额进行抵销。守约方或非受影响方应根据本条约定进行的抵销及时通知违约方或受影响方，通知方式仅适用主协议第二十一条第（一）款约定的方式。

#### （二）跨协议结算安排

若交易双方在补充协议中约定适用本款，则在违约方发生了违约事件并导致本协议下的提前终止日发生或被指定时，并同时满足，（1）交易双方在补充协议中约定的交易双

方之间已签署的其他协议（包括但不限于其他有关衍生产品交易的主协议或类似合约）按其约定已经发生违约；（2）该等违约导致该等协议下届时存续的所有交易被提前终止、且根据该等协议的约定进行结算，结算后得出的**交易一方**在该等协议下应向另一方支付一笔金额，则此时该等金额须作为**本协议**下的一笔**未付款项**，纳入**主协议**第九条第（二）款第2项列明的**提前终止应付额**的计算公式。**交易双方**在此同意，将上述结算金额纳入**本协议**下**提前终止应付额**的计算，即取代了**交易双方**原本在该等协议下需要进行的结算。

### 第十五条 转让

未经另一方事先书面同意，**交易一方**不得转让**本协议**下任何权利或义务，但**交易一方**有权将**违约方**应向其支付的任何**提前终止应付额**的全部或部分权益，以及根据**主协议**第十一条就相应部分的**提前终止应付额**所享有的利息向第三人转让，无需取得**违约方**的同意。

### 第十六条 不放弃权利

未行使、迟延履行或部分行使**本协议**下的任何权利，不应被视为放弃该权利。

### 第十七条 电话录音

除非**交易双方**另有约定，**交易一方**可对**交易双方**之间就**本协议**下**交易**或任何潜在的**交易**的电话交谈进行录音，并可在不违反**中国法律**的前提下在争议解决过程中出具该等录音作为证据。

### 第十八条 保密与信息披露

#### （一）保密

未经另一方事前书面同意，**交易一方**不得将与**本协议**以及**本协议**下**交易**有关的涉及另一方的任何信息向任何人士披露，但根据本条第（二）款约定作出的披露除外。

#### （二）法定信息披露

本条不限制**交易一方**根据适用法律的要求，就与**本协议**以及**本协议**下**交易**有关的任何信息进行披露。

## **第十九条 交易机构**

### **（一）通过分支机构进行交易**

**交易一方**依照本条第（二）款的约定，既可以通过总行或总部机构达成交易，也可通过分支机构（包括但不限于其分行或办事处）达成**交易**，即使该分支机构所在国家或地区不同于其总行或总部机构所在国家或地区。

### **（二）总部或多个分支机构**

若**交易双方**在**补充协议**中约定**交易一方**适用本款，该**交易一方**可以通过**补充协议**中列明的总部或任一分支机构（包括但不限于其分行或办事处）与另一方达成**交易**、作出或接受该**交易**项下的支付或交付。

## **第二十条 争议的解决**

### **（一）适用法律**

**交易双方**可在相关**补充协议**中约定管辖相关**交易**的**本协议**的适用法律。若未约定，则适用法律为**中国法律**。

### **（二）争议的解决方式**

**交易双方**可通过协商方式解决双方之间在**本协议**下或与**本协议**相关的任何争议、索赔或纠纷。

若**交易双方**不进行协商或协商未果，除非**补充协议**另有约定，则**交易双方**同意应将争议、纠纷或索赔提交中国国际经济贸易仲裁委员会按照届时有有效的《中国国际经济贸易仲裁委员会仲裁规则》在北京以仲裁方式解决，仲裁庭由三名仲裁员组成，仲裁裁决是终局的，对**交易双方**具有约束力。

## **第二十一条 通知方式与生效**

（一）采用专人递送或速递服务的，于送达回执的签收日生效；但是收件方、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的，发件方可采用公证送达的方式，或可根据**交易双方在补充协议**中约定的公告送达或留置送达方式做出有效通知，且经公证送达、公告送达或留置送达而生效的通知应被视为在一切方面具有与根据原送达方式而生效的通知相同的效力。

（二）采用挂号邮寄方式发送的，于签收日生效。

(三) 采用传真发送的，于收件方确认收到字迹清楚的传真当日生效。

(四) 采用电子信息系统发送的，于通知进入收件方指定的接受电子信息的系统之日生效。

(五) 采用其他方式的，于**交易双方**另行约定的时间生效。

若以上日期并非**营业日**，或通知是在某个**营业日**的营业时间结束后送达、收到或进入相关系统的，则该通知应被视为在该日之后的下一个**营业日**生效。

## 第二十二条 费用

在不影响**履约保障文件**就实现债权的费用所做的约定，且也不造成任何重复计算的前提下，就**守约方**因保障和行使其在**本协议**或**履约保障文件**下的相关权利而产生的所有合理费用和其他开支，以及**守约方**因为任何**本协议**下**交易**被提前终止而产生的所有合理费用和其他开支，**违约方**应在**守约方**的要求下予以全部补偿。

## 第二十三条 标题

**本协议**名称以及**本协议**所列标题仅出于便于参考之目的，并不影响**本协议**的结构且不应被用来解释**本协议**的任何内容。

## 第二十四条 累积补救

除**本协议**另有约定外，**本协议**赋予并承认的权利及救济具有累积性质，且不排除适用法律所赋予并承认的任何权利和救济。

## 第二十五条 协议的签署

主协议在**交易双方**签字盖章后生效。**交易双方**之间可根据需要签署补充协议。

## 第二十六条 定义

在**本协议**下，下列名词含义为：

**被终止交易**：指就一个**提前终止日**而言，若其因为**违约事件**而产生，则为**本协议**下届时存续的全部**交易**；若其因为**终止事件**而产生，则为**本协议**下届时存续的全部**受影响交易**。

**不可抗力**：指不能预见、不能避免并不能克服的客观情况，包括但不限于如下事件：

自然灾害，交通、通讯瘫痪、突发公共卫生事件以及其他具有类似性质的事件。

**参考做市商：**指在主协议第九条第（二）款第 3 项约定的“市场报价法”下，**终止净额计算方**按诚实信用原则在相关市场中选择的交易商（若在中国银行间市场选择，该交易商应为具有该市场做市商业资格的金融机构）。**终止净额计算方**应尽可能从该市场中拥有最高信用状况等级的交易商中选择**参考做市商**，并且在可行的范围内，应从在同一城市设有办事机构的交易商中挑选**参考做市商**。

**产品：**指交易双方在补充协议中明确约定的非法人产品，或交易双方之间约定的能够适用本协议的其他金融产品。

**产品管理人：**指对产品承担资产管理职责或类似职责的机构（具体名称或形式由交易双方在补充协议中具体约定），其代表产品与交易一方签署本协议。

**成交单：**指交易双方之间通过中国外汇交易中心暨全国银行间同业拆借中心交易系统达成交易后生成的确认该交易成交条件的书面凭证。

**法律：**指宪法、条约、法律、法规、条例、规则、规章、规定，以及任何具有立法、司法或行政管理权限或职能的机构依法发布的具有普遍约束力的命令、解释、许可、通知、判决、裁决、禁止令等规范性文件。

**非受影响方：**在主协议第七条项下，若仅有一个**受影响方**的，指另一方。

**基准日：**指提前终止日。若**终止净额计算方**诚信地认为以提前终止日为基准进行本协议下所有**被终止交易**的计算不具有商业合理性，则为商业上可合理进行计算的**提前终止日**之后尽可能早的一个或多个日期。

**交易确认书：**指交易双方交换的用以确认或证明交易的文件或其他书面证据，包括但不限于**成交单**、电子邮件、电报、电传、传真、合同书和信件等。

**交易双方：**在具体交易项下，指受本协议约束的双方当事人。

**交易一方：**指交易双方中的任何一方。

**交易有效约定：**指就各项具体交易做出的具有法律约束力的约定（包括但不限于**交易确认书**）。

**金融衍生产品交易（简称“交易”）：**就本协议而言，指交易双方以一对一方式达成的、根据中国法律要求或交易双方约定应适用主协议的、按照交易双方的具体要求拟定交易条款的金融衍生合约，以及交易双方约定适用主协议的其他金融合约，包括但不限于符合上述条件的利率衍生产品交易、汇率衍生产品交易、债券衍生产品交易、信用衍生产品交易、

黄金衍生产品交易，以及前述衍生产品交易的组合。

**履约保障提供者：**指在**履约保障文件**下承担保障义务的主体（可为**交易一方**），包括但不限于担保人。

**履约保障文件：**指在**补充协议**中列明的就**交易**的履约保障作出具体安排的法律文件，包括但不限于：《中国银行间市场金融衍生产品交易转让式履约保障文件》、《中国银行间市场金融衍生产品交易质押式履约保障文件》及其他履约保障安排文件。

**潜在违约事件：**指任何经发送通知或随时间推移可构成**违约事件**的事件。

**市场报价：**对于一项或一组**被终止交易**和一个**终止净额计算方**而言，指按**参考做市商**的报价为基础而决定的款额。每一报价为该**终止净额计算方**（应考虑针对其义务的任何现有的**履约保障文件**）若与**参考做市商**达成交易（“**替换交易**”）应支付给该**终止净额计算方**（以负数表达）或该**终止净额计算方**应支付（以正数表达）给**参考做市商**的一个数额（若有）。此替换交易使该**终止净额计算方**享有的经济效果与**交易双方**根据**主协议**第四条原本应（若不是由于出现了相关的**提前终止日**）在**提前终止日**后就该项或该组**被终止交易**进行的任何付款或实物交付（不论基础义务是绝对义务还是或有义务，并假设已满足了所有适用的先决条件）所产生的经济效果相同，且受到该**终止净额计算方**及**参考做市商**按照诚实信用原则同意的文本的限制。为此目的，有关**被终止交易**的**未付款项**应被排除。但是，**市场报价**应包括（但不限于）原本应（若非出现了相关的**提前终止日**）在**提前终止日**后就该项或该组**被终止交易**获得的任何付款或实物交付（假设已满足了所有适用的先决条件）。**终止净额计算方**（或其代理人）须尽可能地寻求至少四名**参考做市商**于**基准日**提供其报价，并且在合理可行的范围内，要求各**参考做市商**均在同一日期和时间（不考虑时区）提供其报价。报价的日期和时间由该**终止净额计算方**按诚实信用原则选择。若提供的报价不少于三个，则应除去最高及最低报价，取剩余报价的算术平均值；若有一个以上的报价并列最高值或最低值，则应仅分别除去其中一个最高或最低的报价。若少于三个报价，应视作无法确定有关该**被终止交易**的**市场报价**。

**守约利率：**指**守约方**合理证明的其作为资金拆入方从相关银行间市场上的一家主要银行得到的就有关币种的隔夜拆放利率，该银行由**守约方**进行选择，但其报价应是能够合理反映**守约方**在相关市场上资金拆借成本的有代表性报价。若**守约利率**高于**银行间利率**，则**守约利率**取用**银行间利率**的数值。

**受损方：**指**主协议**第七条第（五）款指明的“受损方”。

**受影响方：**指主协议第七条项下指明为“受影响方”的交易一方。

**受影响交易：**当发生主协议第七条第（一）、第（三）、第（四）、第（五）款所述**终止事件**时，指本协议下届时存续的受该等**终止事件**影响的全部**交易**；当发生其他**终止事件**时，除非**交易双方**另有约定，指本协议下届时存续的全部**交易**。

**税款补偿金额：**指主协议第十二条第（一）款第 2 项指明的“税款补偿金额”。

**特定交易：**指交易一方（或其**履约保障提供者**，或其适用的**特定实体**）与另一方（或其**履约保障提供者**，或其适用的**特定实体**）之间当前存续的或将达成的债券回购交易、债券借贷交易、本协议管辖范围之外的衍生产品交易及**交易双方**约定的本协议管辖范围之外的其他交易。

**特定实体：**指在补充协议中指定为“特定实体”的任何公司、企业或实体。

**提前终止日：**指根据主协议第九条第（一）款或第十条第（三）款确定的**被终止交易**提前终止的日期。

**提前终止应付额：**指按照主协议第九条第（二）款第 2 项所列公式计算得出的金额。

**提前终止应付额付款日：**指主协议第九条第（三）款或第十条第（四）款第 2 项下约定的应支付**提前终止应付额**及其利息的日期。

**未付款项：**就一个**提前终止日**而言，**交易一方**应收到的**未付款项**包括以下款项：

1、截止该**提前终止日**另一方依照主协议第四条的约定在每一项**被终止交易**下应付而未付的款项，以及在每一项**被终止交易**下应交付而未交付的每一项实物在原定交付日的公允价值（该公允价值由**终止净额计算方**本着诚实信用原则按照商业上合理的方式确定；若**交易双方**均为**终止净额计算方**，则公允价值为**交易双方**各自计算确定的价值之平均数），且在不重复计算的前提下，上述任何一种情况下均包括依据主协议第十一条第（二）款第 1 项计算的应付利息数额；

2、若本协议下所有交易在该**提前终止日**成为**被终止交易**，在该**提前终止日**前应付未付的**提前终止应付额**，以及在不重复计算的前提下，依据主协议第十一条第（二）款第 2 项计算的该**提前终止应付额**的应付利息数额；

3、若**交易双方**在补充协议中选择适用“跨协议结算安排”，就补充协议中约定的其他协议进行结算后得出的另一方应向该**交易一方**支付的金额。

**违约方/守约方：**按照主协议第六条约定，发生某一项**违约事件**的**交易一方**为**违约方**；就该项**违约事件**，另一方为**守约方**。

**违约利率：**除非**交易双方**另有约定，指收取款项的一方合理证明的其为获得一笔与该款项数额相等的资金而可能产生的合理的融资成本，加百分之一年利率。

**违约事件：**指根据**主协议**第六条及**补充协议**，被确定为“违约事件”的任一事件。

**银行间利率：**除非**交易双方**另有约定，就每一个计息日而言，针对人民币是指中国人民银行授权全国银行间同业拆借中心发布的上海银行间同业拆放利率（Shibor）中的隔夜利率；针对美元是指美元有效联邦基金利率（Effective Federal Funds Rate）；针对欧元是指欧元隔夜平均指数（EONIA）；针对英镑是指英镑隔夜平均指数（SONIA）；针对其他币种的自由兑换货币是指主要银行之间就在相关的付款地以该币种货币进行隔夜存款而报出的同业拆放利率。

**营业日：**除非**交易双方**另有约定，指下列日期：对于任何付款而言，为相关账户所在地商业银行正常营业的日期（不含法定节假日）；对于任何交付而言，为交付行为发生地登记托管结算机构营业的日期（不含法定节假日）；对通知或通讯而言，为接收方提供的通知地址中指定城市的商业银行正常营业的日期（不含法定节假日）。

**中国法律：**在中华人民共和国（为**本协议**之目的，不包括香港特别行政区、澳门特别行政区及台湾地区）境内有效施行的法律、法规、规章，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具有普遍约束力的规范性文件。

**终止净额计算方：**在发生**违约事件**时，指**守约方**；在发生**终止事件**时，指**非受影响方**（若**交易双方**均为**受影响方**或**受损方**，则指任一方）。

**终止事件：**指根据**主协议**第七条及**补充协议**，被确定为“终止事件”的任一事件。

**终止数额：**对于一项或一组**被终止交易**以及一个**终止净额计算方**而言，是指该**终止净额计算方**在**基准日**本着诚实信用原则，以商业上合理方式确定的为了替代该**被终止交易**的主要条款（包括**交易双方**按照**主协议**第四条的约定原本应在**提前终止日**之后支付或交付（假定满足了**主协议**第四条第（三）款的全部履约前提条件）却由于**提前终止日**的产生未曾支付的任何款项或未曾交付的任何实物）或为了获得与该**被终止交易**的该等主要条款相同的经济效果而在当时环境下产生的或将会产生的损失及成本（以正数表示）或收益（以负数表示）。**终止数额**不包括一项或一组**被终止交易**的未付款项，也不包括**主协议**第二十二条所列的任何费用。在不重复计算的前提下，**终止净额计算方**可将其融资的成本，及其为终止、清算或重建与一项或一组**被终止交易**相关的任何对冲风险安排而合理产生的损失以及成本（或任何收益）包括在相关的**终止数额**的计算内。

签署栏

甲方：

乙方：

甲方有权签署人

乙方有权签署人

姓名：

姓名：

签字： \_\_\_\_\_

签字： \_\_\_\_\_

【单位公章：】\*

【单位公章：】\*

年 月 日

年 月 日

\* 请选择是否适用。

中国银行间市场金融衍生产品交易主协议（跨境文本-2022 年版）  
补充协议

本补充协议由：

\_\_\_\_\_（“甲方”）

和

\_\_\_\_\_（“乙方”）

于\_\_\_\_\_年\_\_\_\_\_月\_\_\_\_\_日签署并生效。

鉴于甲乙双方均已签署《中国银行间市场金融衍生产品交易主协议（跨境文本-2022 年版）》（简称“主协议”），为进一步明确双方的权利义务，双方在主协议基础上签署本补充协议，对下列事项做出补充或特别约定。

本补充协议中的一项定义的含义与主协议中的相同定义的含义相同，但本补充协议对该定义的含义另有约定的除外。

### 一、第二条“主协议的适用”

对于签署主协议之前达成的，且在签署本补充协议时尚未履行完毕的衍生产品交易，是否适用主协议：

**【适用】 / 【不适用】**

### 二、关于“声明与保证”

为第三条第 8 项之目的，就交易一方适用的文件及信息为：

甲方：

乙方：

为第三条第 10 项之目的，若交易一方或交易双方为产品管理人，交易双方声明如下：

（\* 请选择是否适用。）

[\* [甲方/乙方] 为产品管理人且其为管理产品之目的签订本协议，其在本协议项下的权利义务均以其管理的相应产品的财产为限承担责任，交易双方在补充协议中另有约定的

除外； ]

[\*主协议及本补充协议是由[甲方/乙方]作为**产品管理人**代表其管理的**产品**达成的。  
[甲方/乙方]承认并同意，为管理不同**产品**分别与交易另一方在**本协议**下开展衍生产品交易之目的，与交易另一方达成任意一笔**交易**时，应在**交易有效约定**中明确该**交易有效约定**适用的具体**产品**，该笔**交易**应被视为是在**产品管理人**代表该**产品**与交易另一方签订独立的**主协议及补充协议**下作出的。因此，与交易另一方开展的**交易**项下的权利义务根据相关**交易有效约定**的指定构成所指定的具体**产品**的债权债务，适用于不同**产品**的**交易**之间的权利义务互不影响且不可抵销，且独立于**产品管理人**为自营目的叙做的**交易**。]

**本协议**下，[甲方/乙方]作为**产品管理人**所代表的**产品**指（可以以附件方式列举，详见代签产品列表）

[列明产品信息]

为第三条第 11 项之目的，适用于付款方的有关税务方面的陈述如下：

甲方：

乙方：

为第三条第 12 项之目的，适用于收款方的有关税务方面的陈述如下：

甲方：

乙方：

**本协议**为第三条第 13 项之目的，其他声明与保证事项如下：

### 三、关于“特定实体”

甲方的**特定实体**是：

- 1、在**主协议**第三条第 7 项下：
- 2、在**主协议**第六条第（六）款下：
- 3、在**主协议**第六条第（七）款下：
- 4、在**主协议**第六条第（八）款下：
- 5、在**主协议**第七条第（二）款下：

乙方的**特定实体**是：

- 1、在**主协议**第三条第 7 项下：
- 2、在**主协议**第六条第（六）款下：
- 3、在**主协议**第六条第（七）款下：

4、在主协议第六条第（八）款下：

5、在主协议第七条第（二）款下：

#### 四、第四条第（五）款多笔交易支付净额

**【适用】 / 【不适用】**

若适用，支付净额的约定适用于下列交易或交易组：

#### 五、履约保障

适用于甲方的履约保障文件为：

适用于乙方的履约保障文件为：

其他保障安排为：

#### 六、第六条第（六）款“交叉违约”

**【适用】 / 【不适用】**

若适用，则交叉违约的起点金额为：

甲方：

乙方：

其他债务文件的定义为：**【按主协议约定】**

#### 七、第六条第（七）款“特定交易下违约”

**【适用】 / 【不适用】**

若适用，则特定交易定义中“交易双方约定的本协议管辖范围之外的其他交易”为：**【按主协议约定】**

#### 八、关于第六条“违约事件”

#### 九、第七条第（二）款“终止事件”

【适用】 / 【不适用】

若适用，为该款之目的，“合并事件”指：

#### 十、关于“其他终止事件”

为第七条第（六）款之目的，“其他终止事件”包括下述事件：

#### 十一、第九条第（一）款“确定提前终止日”

##### 1. 第2项“自动提前终止”

【适用】 / 【不适用】

2. [如交易一方或交易双方为产品管理人且其为管理产品之目的签订本协议，选择【适用】 / 【不适用】以下条款：

第九条第（一）款“确定提前终止日”下新增第4项“4、为避免疑问，若交易一方为产品管理人且其为管理产品之目的签订本协议，则被终止交易仅限于相应的产品，其他未发生违约事件的产品相关交易不得作为被终止交易。当管理人管理的多个产品发生违约事件时，各产品涉及的被终止交易应独立计算提前终止应付额，不同产品之间的被终止交易权利义务不得相互抵销。”]

#### 十二、对被终止交易公允市场价值的计算方法

为第九条第（二）款第3项及第十条第（四）款第1项之目的，适用：【替代交易法】 / 【市场报价法】

#### 十三、关于第十三条第（二）款“终止货币”

被终止交易的合同货币不含人民币时，或被终止交易的合同货币含人民币，但交易双方均在中华人民共和国境外设立，或虽交易一方在中华人民共和国境内设立，但适用法律尚未允许交易双方之间以人民币跨境支付和结算提前终止应付额的，终止货币为\_\_\_\_\_，且各币种之间的换算方法为：

#### 十四、关于第十四条第（二）款“跨协议结算安排”

**【适用】 / 【不适用】**

若适用，为该段目的：

交易双方之间已签署的其他协议包括：

#### **十五、关于第十八条“保密与信息披露”**

交易双方就保密与信息披露条款，作如下补充约定：

#### **十六、关于第十九条第（二）款“总部或多个分支机构”**

甲方：**【适用，甲方可以通过以下列明的任一机构与乙方达成一项交易：**

**列明适用的总部机构或分支机构】**

**【不适用】**

乙方：**【适用，乙方可以通过以下列明的任一机构与甲方达成一项交易：**

**列明适用的总部机构或分支机构】**

**【不适用】**

#### **十七、关于第二十条“争议的解决”：**

适用法律：**【中国法律(不包括冲突法规则)】**

仲裁机构：

#### **十八、通知方式**

甲方接收第二十一条第（一）、（二）、（三）、（四）款约定的通知的联系方式包括：

地址：

收件人：

邮政编码：

电话：

传真：

电子信息系统：

乙方接收第二十一条第（一）、（二）、（三）、（四）款约定的通知的联系方式包括：

地址：  
收件人：  
邮政编码：  
电话：  
传真：

电子信息系统：

双方同意采用公告送达、留置送达的有关约定：

双方约定的其他通知方式及通知生效时间：

## 十九、其他补充约定

### 签署栏

甲方： \_\_\_\_\_

乙方： \_\_\_\_\_

\_\_\_\_\_

\_\_\_\_\_

授权代表签字： \_\_\_\_\_

授权代表签字： \_\_\_\_\_

签字代表职衔： \_\_\_\_\_

签字代表职衔： \_\_\_\_\_

【单位公章：】\*

【单位公章：】\*

\* 请选择是否适用。

附件：

### 代签产品列表

(名称可以自行修改，正文仅作参考)

甲方：【】

乙方：【】(作为管理人代表其管理的代签产品列表中每一只产品)本《代签产品列表》系甲乙双方签署的【主协议名称】及其补充协议的附件。【产品管理人名称】作为所列金融产品的管理人，代表所列每一只产品与【交易另一方名称】签订本《代签产品列表》。为避免歧义，“乙方”和“产品”仅指代签产品列表中单只产品，而非其与代签产品列表中其他产品的合称。

本《代签产品列表》所列产品可根据实际情况随时修订，并由甲乙双方协商一致后以书面形式确认并盖章。

### 代签产品清单

序号	产品名称	托管机构(如有)	代签日期(入表日期)
1			
2			
3			

本《代签产品列表》与【主协议名称】及其补充协议具有同等法律效力。甲乙双方此前签署的相关内容如与本《代签产品列表》不一致的，以本《代签产品列表》为准。

甲方：【】

乙方：【】(作为管理人代表其管理的代签产品清单中每一只产品)

(单位公章\*):

(单位公章\*):

法定代表人(或授权代表):

法定代表人(或授权代表):

签署日期: 年 月 日

签署日期: 年 月 日

\* 请选择是否适用。