

中国银行间市场金融衍生产品交易

质押式履约保障文件

（2009 年版）

声明

《中国银行间市场金融衍生产品交易质押式履约保障文件（2009年版）》（简称“《本文件》”）的著作权属于中国银行间市场交易商协会。除非为开展与《本文件》有关的交易或为进行教学、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《本文件》的纸质、电子或其他形式版本。

使用人为开展与《本文件》有关的交易的目的，可在使用过程中根据《本文件》的有关约定并基于自身独立判断对《本文件》的相关条款进行补充或修改（但不得修改《本文件》第一条第二段、第十二条第（七）款和第（八）款），以确保最终的文件符合其风险管理需要。

目 录

标准条款.....	3
第一条 释义与效力等级	3
第二条 担保的范围	4
第三条 交付金额与返还金额	4
第四条 无须履行义务的情况	6
第五条 计算与估值	6
第六条 质权设立与解除的方式	7
第七条 替换	8
第八条 计算与估值的争议处理	8
第九条 利息金额	10
第十条 违约事件和不构成违约的情况.....	10
第十一条 出质方和质权方享有的救济权利.....	11
第十二条 其他	13
第十三条 定义条款	15
补充条款.....	20

中国银行间市场金融衍生产品交易

质押式履约保障文件

标准条款

本质押式履约保障文件（简称“本文件”）是双方为履行《中国银行间市场金融衍生产品交易主协议（2009 年版）》（简称“主协议”）下双方各自的义务而签订的一份履约保障文件。本文件由标准条款和补充条款两部分构成。

第一条 释义与效力等级

本文件的一项定义与主协议相同定义的含义相同，本文件特有的定义应具有标准条款第十三条相同定义所述的含义。

双方可在补充条款中对本文件的定义等内容进行修改和补充，但不得修改或排除中国法律的定义、标准条款第十二条第（七）款、第（八）款以及本句的内容。在此前提下：

- 1、标准条款与补充条款的约定不一致的，补充条款有优先效力；
- 2、主协议或补充协议与本文件的约定不一致的，就本文件而言，本文件的相关约定有优先效力；
- 3、就一笔具体的交易而言，其交易有效约定与本文件的约定不一致的，该交易有效约定有优先效力。

第二条 担保的范围

出质方应按照本文件的约定在合格履约保障品上为质权方设置质权。质权所担保的范围是出质方应履行的所有义务。

第三条 交付金额与返还金额

（一）交付金额

若在一个估值日，交付金额等于或超过了出质方的最低转让金额，则质权方可向出质方发出通知，要求出质方依据交付金额向质权方质押合格履约保障品。出质方应确保出质的合格履约保障品在质权设立当日的价值不少于适用的交付金额（按补充条款的约定取整）。

除非双方另有约定，就任何一个估值日，出质方所适用的交付金额按如下公式计算：

$$\text{交付金额} = \text{质权方经调整的风险敞口} - \text{出质方的已质押履约保障品在该估值日的价值}$$

（二）返还金额

若在一个估值日，返还金额等于或超过了质权方的最低转让金额，则出质方可向质权方发出通知，要求质权方依据返还金额解除出质方在已质押履约保障品上为质权方设立的质权。质权方应确保被解除质权的已质押履约保障品在质权解除当日的价值接近适用的返还金额（按补充条款的约定取整），但前述已质押履约保障品在质权解除当日的价值可不大于适用的返还金额。

除非双方另有约定，就任何一个估值日，质权方所适用的返还金额按如下公式计算：

$$\text{返还金额} = \frac{\text{出质方的已质押的履约保障品在该估值日的价值}}{\text{质权方经调整的风险敞口}}$$

（三）相关释义

在计算上述交付金额或返还金额时：

$$\begin{array}{ccccccc} \text{质权方} & & \text{质权方在} & & \text{对出质} & & \text{对质权} & & \text{对出质} \\ \text{经调整} & & \text{上述估值} & & \text{方适用} & & \text{方适用} & & \text{方适用} \\ \text{的风险} & = & \text{日的风险} & + & \text{的独立} & - & \text{的独立} & - & \text{的起点} \\ \text{敞口} & & \text{敞口} & & \text{金额} & & \text{金额} & & \text{金额} \end{array}$$

若计算出的质权方经调整的风险敞口为负数，则视为零。

在计算已质押履约保障品在一个估值日的价值时，在该估值日或之前已办理出质手续但相关质权尚未正式设立的任何先前的交付金额（或在对交付金额产生争议的情况下，与该交付金额有关的已办理出质手续但相关质权尚未正式设立的任何未产生争议的金额）应计入已质押履约保障品的价值之内；但在该估值日或之前已办理解除质押手续但相关质权尚未正式解除的任何先前的返还金额（或在对返还金额产生争议的情况下，与该返还金额有关的已办理解除质押手续但相关质权尚未正式解

除的任何未产生争议的金额)应排除在已质押履约保障品的价值之外。

第四条 无须履行义务的情况

(一) 出质方无须履行义务的情况

若质权方发生了一项违约事件、潜在违约事件或特定情况,从而导致提前终止日已然产生或被指定(但就该提前终止日已经没有任何尚未清偿的付款义务存在的情况除外),或虽未导致提前终止日的产生或被指定,但该违约事件、潜在违约事件或特定情况持续存在,则出质方无须履行其在标准条款第三条、第六条和第八条下原本应履行的任何设立质权的义务。

(二) 质权方无须履行义务的情况

若出质方发生了一项违约事件、潜在违约事件或特定情况,从而导致提前终止日已然产生或被指定(但就该提前终止日已经没有任何尚未清偿的付款义务存在的情况除外),或虽未导致提前终止日的产生或被指定,但该违约事件、潜在违约事件或特定情况持续存在,则质权方无须履行其在标准条款第三条、第六条、第七条、第八条和第九条下原本应履行的任何解除质权或转让的义务。

第五条 计算与估值

估值方应依据基于相关的估值时间所获得的信息计算价值和风险敞口。估值方应最迟在相应的估值日(在标准条款第八条的情况下,在异议通知生效后的第6个营业日)北京时间17时前(含该时点)将计算结果通知双方。

第六条 质权设立与解除的方式

在一方按照**标准条款**第三条的约定向另一方发出的通知生效后，另一方应按如下方式设立或解除相关的质权：

（一）质权设立的方式

除非双方另有约定，对于现金形式的**合格履约保障品**，出质方应于相关的**完成日**北京时间 17 时前（含该时点），将该种形式的**合格履约保障品**通过转帐方式划入**质权方**指定的专用账户；对于记账式债券形式的**合格履约保障品**，出质方和**质权方**应及时根据有关登记托管结算机构的规定办理相关的质押手续。双方每次就**合格履约保障品**的出质所形成的确认文件（若有）构成质押合同的一部分。

若按照本文件的约定出质方应在相关的**合格履约保障品**上为**质权方**设立质权，则出质方有义务确保在相关的**完成日**北京时间 17 时前（含该时点）在该**合格履约保障品**上为**质权方**设立质权。

（二）质权解除的方式

除非双方另有约定，对于现金形式的已质押**履约保障品**，**质权方**应于相关的**完成日**北京时间 17 时前（含该时点），将该种形式的已质押**履约保障品**通过转账方式划入**出质方**指定的账户；对于记账式债券形式的已质押**履约保障品**，**质权方**和**出质方**应及时根据有关登记托管结算机构的规定办理相关的解除质押手续。双方每次就已质押**履约保障品**的**质权**解除所形成的确认文件（若有）构成解除相关已质押**履约保障品**质权的合同。

若按照本文件的约定**质权方**应将相关的已质押**履约保障品**上为其设

立的质权予以解除，则质权方有义务确保在相关的完成日北京时间 17 时前（含该时点）解除出质方在该已质押履约保障品上为其设立的质权。

第七条 替换

出质方可向质权方发出通知，提议以通知中指定的合格履约保障品（简称“新履约保障品”）替换通知中指定的已质押履约保障品（简称“原履约保障品”）。

若质权方通知（可为电话通知）出质方其同意替换，则：

1、出质方应在相应的完成日北京时间 17 时前（含该时点），为质权方在新履约保障品上设立质权；

2、在出质方未出现标准条款第四条第（二）款所列的任何情况的前提下，质权方在确认新履约保障品上的质权设立后，应在相应的完成日北京时间 17 时前（含该时点）解除原履约保障品上的质权。

质权方应确保被解除质权的原履约保障品在质权解除当日的价值接近新履约保障品在该日的价值，但可不大于新履约保障品在该日的价值。

第八条 计算与估值的争议处理

若一方（“争议方”）对（A）估值方计算的交付金额或返还金额有异议，或对（B）任何出质的合格履约保障品或任何解除质权的已质押履约保障品的价值有异议，按如下方式处理：

1、在（A）的情况下，争议方应于收到另一方根据标准条款第三条发出的通知后的第一个营业日北京时间 17 时前（含该时点）向另一方及估值方发出异议通知；在（B）的情况下，争议方应于相关的完成日后的

第一个营业日北京时间 17 时前（含该时点）向另一方及估值方发出异议通知。

2、在（A）的情况下，有义务出质合格履约保障品（或解除已质押履约保障品上设立的质权）的一方应在相关的完成日北京时间 17 时前（含该时点）就无争议部分金额向另一方质押相应的合格履约保障品（或解除相应的已质押履约保障品上存在的质权）。

3、对（A）或（B）情况下任何争议的部分，双方应在异议通知生效后的 5 个营业日内协商解决争议。

4、若双方在上述时限内不能解决争议，则：

（1）在争议涉及交付金额或返还金额的情况下，估值方应按如下方法计算重新计算日的风险敞口和价值：

（a）采用本协议下没有争议的交易所对应的那部分风险敞口所采用的任何计算；

（b）在双方于本协议中约定采用替代交易法的情况下，估值方应向第三方（若双方在本协议中约定了替代交易法情况下第三方的特定含义，则向具有该特定含义的第三方）征询四个实际的市场中间报价，取其算数平均数，计算本协议下有争议的交易所对应的风险敞口；

（c）在双方于本协议中约定采用市场报价法的情况下，估值方应向参考做市商征询四个实际的市场中间报价，取其算数平均数，计算本协议下有争议的交易所对应的风险敞口；

（d）若一项交易无法取得四个报价，则可使用少于四个的报价；若一项交易无法获得报价，则估值方原先做出的计算将用于该项交易；

（e）在届时存续的已质押履约保障的价值产生争议的情况下，采用

补充条款约定的方式，重新计算该价值。

(2)在争议涉及任何出质的合格履约保障品或任何解除质权的已质押履约保障品的价值的情况下，估值方应按照补充条款的约定，重新计算该合格履约保障品或已质押履约保障品于相应完成日的价值。

5、估值方应在异议通知生效后的第6个营业日的北京时间17时前（含该时点）将按上述方法重新计算或估值的结果通知双方（或在估值方由一方担任的情况下，通知另一方）。相关的一方应在收到另一方后续发出的通知后，依据本文件的有关约定进行相应的设立质权或解除质权的操作。

第九条 利息金额

除非双方另有约定，受标准条款第四条的约束，就质权方占有（或按照市场惯例认为被其占有）的现金形式的已质押履约保障品，质权方有权保留且无须向出质方转让该现金形式的已质押履约保障品所产生的任何孳息，但质权方应在相关利息期间结束后的第一个利息转让日的北京时间17时前（含该时点）向出质方转让利息金额。质权方转让利息金额的义务以不会因此产生或增加一个交付金额（由估值方负责计算；为此目的，计算日被视为是一个估值日）为限。

第十条 违约事件和不构成违约的情况

（一）违约事件

一方发生下列任一情形的，构成主协议第六条第（二）款所述的一项违约事件，该方是违约方：

1、针对任何**合格履约保障品**、**已质押履约保障品**或**利息金额**，该方未按照本文件的约定，按时履行其应履行的任何转让义务、或任何设立质权、解除质权的义务，并且在另一方发出的未履约通知生效后的第 3 个**营业日**届满时该未履约状态仍然持续。

2、该方未按照本文件的约定，遵守或履行其应遵守或履行的本文件下的任何协议或义务（但不包括本款第 1 项所列的任何义务），并且在另一方发出的未履约通知生效后的第 30 天届满时该未履约状态仍然持续。

（二）不构成违约的情况

除非双方另有约定，若一方尚在按照**标准条款**第八条所列的争议解决程序履行自己的义务，则该方虽未对**标准条款**第八条所述的属于争议部分的任何金额进行相应的设立质权或解除质权的操作，不构成该方在主协议第六条第（二）款下的一项**违约事件**或**潜在违约事件**。

第十一条 出质方和质权方享有的救济权利

（一）质权方享有的救济权利

若出质方发生了一项**违约事件**或**特定情况**并且届时该**违约事件**或**特定情况**仍然处于持续的状态，或者因为出质方发生了一项**违约事件**或**特定情况**从而导致一个**提前终止日**产生或被指定（除非出质方已经付清其届时到期的所有义务），质权方有权行使下列一项或多项救济权利：

1、将质权方占有的现金形式的**已质押履约保障品**，与出质方就任何义务应支付的任何款项进行相互冲抵；

2、无须征得出质方另行同意，将**已质押履约保障品**进行拍卖、变卖或折价，用以清偿出质方就任何义务应支付的任何款项；

3、质权方在适用的法律下可获得的有关已质押履约保障品的其他救济权利。

（二）出质方享有的救济和权利

若因质权方发生了一项违约事件或特定情况从而导致一个提前终止日产生或被指定（但该提前终止日仅针对本协议下的部分交易且质权方已经付清其在本协议第九条和第十条下的届时到期的所有义务的情况除外），则：

1、质权方应立即解除出质方在已质押履约保障品上为其设立的质权并将利息金额立即转让给出质方；

2、若质权方未按本款第 1 项的约定解除相应的质权或未将利息金额转让给出质方，则出质方可：

（1）中止支付出质方就任何义务本应支付的任何剩余款项（以不超过剩余的已质押履约保障品的价值为限），直到质权方解除在该已质押履约保障品上出质方为质权方设立的质权；和

（2）将质权方占有的现金形式的已质押履约保障品，与出质方就任何义务应支付的任何款项进行相互冲抵；

3、出质方可行使其在适用的法律下可获得的有关已质押履约保障品的其他救济权利。

（三）不足和盈余的处置

在本条第（一）款和第（二）款下的任何救济措施或权利被采取后仍然有剩余的已质押履约保障品的前提下，若出质方就任何义务没有任何应支付的款项，则质权方应尽快解除在前述剩余的已质押履约保障品上为其设立的质权。若在本条第（一）款和第（二）款下的任何救济措

施或权利被采取后出质方仍存在有尚未支付的款项，则在任何情况下出质方均有义务予以支付。

（四）最终返还

若出质方现在和今后就任何义务均没有任何应支付的款项，则质权方应尽快解除在所有的已质押履约保障品上为质权方设立的质权，并将其占有（或按照市场惯例认为被其占有）的现金形式的已质押履约保障品所产生的且尚未转让给出质方的利息金额（若有）转让给出质方。

第十二条 其他

（一）声明

一方向另一方声明如下（该方在其签署本文件之日和在其履行本文件下任何义务之日做出本款第 1 项所述的声明，并在其每次作为出质方质押合格履约保障品之日做出本款第 2 项所述的声明）：

- 1、该方有权签署本文件，履行其在本文件下的任何义务，并已经采取了所有必要的行动授权该签署和履行；
- 2、该方对其所质押的任何合格履约保障品拥有完整的所有权，并且该等合格履约保障品并未设定第三方权益。

（二）费用

因履行本文件的义务产生的费用，由各方自行承担。

但是，就出质方或质权方因为行使标准条款第十一条下的任何救济权利而产生的所有合理的费用和成本，违约方应在守约方要求下，按照主协议第二十条的约定全部予以补偿。

（三）违约金

若质权方未根据本文件的约定于相关的完成日北京时间 17 时前（含该时点）解除已质押履约保障品上为其设立的质权（但标准条款第十条第（二）款所列情况除外），或未于相关的利息转让日的北京时间 17 时前（含该时点）将其占有的现金形式的相关已质押履约保障品所产生的相关利息金额转让给出质方，则其应根据上述相关资产在相关估值日、利息转让日、或（在质权方未按照标准条款第七条第 2 项的约定按时解除原履约保障品上的质权情况下）在新履约保障品上相关质权设立之日的价值，按照违约利率向出质方支付相应的利息。估值方（或当估值方是质权方时，为出质方）负责确定上述相关资产在该日期的价值。其应依据其在该日期的上一个营业日北京时间 17 时所获得的信息确定价值。利息期间从该到期日（含）起到相关质权实际解除（或相关利息金额实际转让）日（不含）止。利息按照实际的利息天数采用每日复利的方式计算。

（四）资产分离

在不影响质权方依据本文件所享有的救济和权利的前提下，质权方应采取所有必要的措施以确保将任何已质押履约保障品与质权方或其托管人的自有资产相分离。

（五）诚实信用和商业合理原则

双方应基于诚实信用和商业合理的原则履行本文件下的任何义务。

（六）通知

除非双方另有约定，一方根据本文件发出的通知及生效（质权方依据标准条款第七条的约定发出的电话通知除外），适用主协议第十九条的约定。

（七）适用法律

本文件适用中国法律，并根据中国法律解释。

（八）争议解决

双方之间发生的本文件下或与本文件有关的任何争议、纠纷或索赔，应按照双方在本协议中约定的争议解决方式处理，但是双方在补充条款中另有约定的除外。

双方可在补充条款中另行约定本文件所适用的争议解决方式。若双方约定采用诉讼方式解决争议，则任何一方只能向人民法院提起诉讼。若双方约定采用仲裁的方式解决争议，则双方选定的仲裁机构应是中华人民共和国（就本文件而言，不包括香港特别行政区、澳门特别行政区和台湾地区）境内合法成立且有效存续的仲裁机构，仲裁地点应位于中华人民共和国（就本文件而言，不包括香港特别行政区、澳门特别行政区和台湾地区）境内。

第十三条 定义条款

在本文件中，下列名词含义如下：

重新计算日：指产生标准条款第八条下争议的估值日。若在争议解决前，在标准条款第三条下出现了后续的估值日，则重新计算日指在标准条款第三条下出现的最新的估值日。

出质方：指出质合格履约保障品的一方。出质方可为双方中的任何一方。

独立金额：就一方而言，指在补充条款中约定的适用于该方并以此定义冠名的任何金额（以人民币表示）。除非双方另有约定，适用于任何

一方的独立金额为零。

返还金额：指标准条款第三条第（二）款所约定的并以此定义冠名的任何金额。

风险敞口：对任何估值日或在该日计算风险敞口的其他日期而言，并且在发生争议的情况下受限于标准条款第八条，假设双方在本协议下的所有交易在相关的估值时间终止，根据主协议第十条第（四）款第 1 项的约定（假设质权方不是受影响方）应由另一方向质权方支付的（以正数表示）或应由质权方向另一方支付的（以负数表示）数额（以人民币作为终止货币）。若在本协议中选择采用替代交易法，则由估值方代表质权方来确定终止数额；估值方将用其基于市场中间价所估算的用以支付与该等交易的主要条款具有相同经济效果的交易所需的金额来确定终止数额。若在本协议中选择采用市场报价法，则由估值方代表质权方来确定市场报价；估值方将用其基于市场中间价所估算的用以支付替换交易（如市场报价定义中所述）所需的金额来确定上述交易的市场报价。

估值比例：就某一类别的合格履约保障品而言，指在补充条款中约定的适用于该类别合格履约保障品的百分比。若补充条款未约定该类别合格履约保障品所适用的百分比的，则为 100%。

估值方：指在补充条款中约定的并以此定义冠名的实体。估值方可由一方或双方担任，也可由双方共同指定的第三方担任。

估值日：指在补充条款中约定的并以此定义冠名的任何日期。

估值时间：指在补充条款中约定的并以此定义冠名的任何时间。双方未约定估值时间的，估值时间为估值日的上一个营业日北京时间 17 时。

合格履约保障品：指双方在补充条款中约定为合格履约保障品的（A）任何现金和（B）在中华人民共和国（为本文件之目的，不包括香港特别行政区、澳门特别行政区及台湾地区）境内发行和买卖的任何记账式债券。

价值：就任何估值日或任何计算价值的其他日期而言，是指（标准条款第八条另有约定的，从其约定）：

1、对于合格履约保障品或已质押履约保障品的币种为人民币的现金数额而言，该金额；

2、对于合格履约保障品或已质押履约保障品的币种为其他货币的现金数额而言，该数额在乘以适用的估值比例后的人民币等值额；

3、对于合格履约保障品或已质押履约保障品的任何记账式债券而言，估值方获得的买入价，在乘以适用的估值比例后所得金额的人民币等值额。

交付金额：指标准条款第三条第（一）款所约定的并以此定义冠名的任何金额。

利率：就某一币种的货币而言，指在补充条款中为该币种货币所约定的利率。

利息金额：就一个利息期间而言，指已质押履约保障品的每一币种现金的本金在该利息期间的利息总额的人民币等值额的总和。每一币种现金的本金在该利息期间内每一日的利息，由估值方按照如下方式确定：

1、该种货币在该日的现金额；乘以

2、该日有效的相关利率；除以

3、365（在该种货币是英镑或港币的情况下）或 360（在该种货币是英镑和港币之外的货币的情况下）。

利息期间：指从上一个利息转让日（或者在没有利息金额被转让的情况下，从现金形式的已质押履约保障品被出质给质权方的营业日）（含）起直至当前利息转让日（不含）止的期间。

利息转让日：指为转让利息金额的目的，双方在补充条款中约定的并以此定义冠名的日期。双方未约定的，利息转让日是每一个公历月的最后一个营业日。

起点金额：就一方而言，指在补充条款中约定的适用于该方的并以此定义冠名的任何金额（以人民币表示）。除非双方另有约定，适用于任何一方的起点金额为零。

人民币等值额：就一个估值日的任何金额而言，若该金额的货币单位是人民币，则指该金额；若该金额的货币单位是人民币之外的其他某一种货币，则指估值方在不违反中国法律的前提下，本着诚实信用和商业合理的原则确定的用于于该估值日购买同等金额的该其他货币所需的人民币的金额。

特定情况：就一方而言，指在补充条款中约定的适用于该方并以此定义冠名的任何事件。

完成日：除非双方另有约定，就标准条款第七条第 1 项而言，指出质方收到质权方发出的同意替换的通知之日后的第一个营业日；就标准条款第七条第 2 项而言，指新履约保障品上相关质权设立之日后的第一个营业日；就本文件其他条款而言，指出质方或质权方收到要求其质押合格履约保障品或要求其解除已质押履约保障品上的质权的通知生效之

日后的第一个营业日。在确定相关的完成日时，若通知收到当日并非是一个营业日，或者通知是在一个营业日的北京时间 17 时后收到的，则该日后的第一个营业日应被视为是该通知的收到之日。

义务：指一方在本协议和在本文件下的任何现在或将来的义务。

已质押履约保障品：指出质方已经为质权方设立了质权并且该质权尚未被解除的任何合格履约保障品（或在该合格履约保障品是记账式债券并且在质权存续期间内该债券到期或被其发行人提前赎回的情况下，该合格履约保障品因此而产生的且尚未被出质方获得的任何本金）的总和，以及在质权存续期间内该等合格履约保障品中现金形式的合格履约保障品产生的且尚未被出质方获得的所有利息金额。

质权方：指要求（或有权接受）合格履约保障品出质的一方。质权方可为双方中的任何一方。

最低转让金额：就一方而言，指在补充条款中约定的适用于该方的并以此定义冠名的任何金额（以人民币表示）。除非双方另有约定，适用于任何一方的最低转让金额均为人民币壹拾万元整。

中国银行间市场金融衍生产品交易 质押式履约保障文件

补充条款

本文件由：

_____（“甲方”）

和

_____（“乙方”）

于_____年____月____日签署并生效。

双方约定，对本文件的标准条款的下列部分进行变更、修改和补充：

（一）交付金额、返还金额及质权方经调整的风险敞口

1、交付金额具有标准条款第三条第（一）款中所约定的含义，除非此处另有约定：

2、返还金额具有标准条款第三条第（二）款中所约定的含义，除非此处另有约定：

3、质权方经调整的风险敞口具有标准条款第三条第（三）款中所约定的含义，除非此处另有约定：

（二）合格履约保障品及其估值比例

一方所适用的合格履约保障品及其估值比例如下：

	合格履约保障品	甲方	乙方	估值比例
(1)	人民币现金	✓	✓	100%
(2)	人民币以外的现金形式的合格履约保障品			
	[币种 1]	[]	[]	[]%
	[币种 2]	[]	[]	[]%
		[]	[]	[]%
(3)	剩余到期期限不超过一年的可依法转让的记账式国债	[]	[]	[]%
(4)	剩余到期期限超过一年但不超过五年的可依法转让的记账式国债	[]	[]	[]%

(5)	剩余到期期限超过五年但不超过十年的可依法转让的记账式国债	[]	[]	[]%
(6)	剩余到期期限超过十年的可依法转让的记账式国债	[]	[]	[]%
(7)	其他	[]	[]	[]%

(三) 独立金额、起点金额和最低转让金额

1、就甲方而言，独立金额为：

2、就乙方而言，独立金额为：

3、就甲方而言，起点金额为：

4、就乙方而言，起点金额为：

5、就甲方而言，最低转让金额为：

6、就乙方而言，最低转让金额为：

(四) 取整

交付金额和返还金额将[按照_____的整数倍数向下取整] /
[按照_____的整数倍数以四舍五入的方式取整]。

(五) 估值

1、估值方：

在**标准条款**第三条和第八条中，**估值方**是指按照**标准条款**第三条的约定发出通知的一方；在**标准条款**第九条中，**估值方**是指**质权方**；但此处另有约定除外：

2、估值日：

3、估值时间：

估值时间为**估值日**的上一个**营业日**北京时间 17 时，除非此处另有约定：

（六）完成日

完成日具有**标准条款**第十三条中所约定的含义，除非此处另有约定：

（七）特定情况

下列**终止事件**是一方适用的**特定情况**（若该方产生了该事件，则该方是**受影响方**）：

就**甲方**而言，**特定情况**是指：

就乙方而言，特定情况是指：

（八）关于第六条的补充约定

双方在此对**标准条款**第六条做出如下补充或另行约定：

（九）计算或估值的争议处理

在**标准条款**第八条第 4 项中，合格履约保障品或已质押履约保障品的价值将按照如下方式计算：

（十）利息转让日

就甲方而言，利息转让日是指：

就乙方而言，利息转让日是指：

（十一）利息金额

双方同意按照**标准条款**第九条的约定转让利息金额并处理质权方占有（或按照市场惯例认为被其占有）的现金形式的已质押履约保障品所产生的孳息，除非此处另有约定：

利息金额采用单利的方式计算，除非此处另有约定：

（十二）利率

以下所列的每种现金所适用的利率为：

币种	利率
人民币	

（十三）通知

甲方的通知方式是：

地址：_____

收件人：_____

邮政编码：_____ 电话：_____

传真：_____ 电子信息系统：_____

乙方的通知方式是：

地址：_____

收件人: _____

邮政编码: _____ 电话: _____

传真: _____ 电子信息系统: _____

(十四) 争议解决

双方之间发生的本文件下或与本文件有关的任何争议、纠纷或索赔，应按照双方在本协议中约定的争议解决方式处理，除非此处另有约定：

(十五) 其他

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：