

# 上海金融法院 金融市场案例测试机制

## 证据与资料目录

上海金融法院：

贵院正在审理的申请人违约机构 A 与被申请人银行间市场清算所股份有限公司（下称“上海清算所”）关于中央对手清算业务违约处置的测试案例（案号：（2022）沪 74 测试 1 号），申请人违约机构 A 依据《上海金融法院关于金融市场案例测试机制的规定》（试行）第十五条之规定，特此提出以下证据与资料，供贵院在审理过程中予以参考，并授权贵院在互联网平台公布。

代理律师：王正，上海虹桥正瀚律师事务所律师。

代理律师：钱前，上海虹桥正瀚（临港新片区）律师事务所。

序号	证据/资料名称	证明内容
1	《中央对手方清算协议》	2021 年 10 月 15 日，申请机构 A 与被申请人上海清算所签订《中央对手方清算协议》。
2	《关于上海清算会员认定的通知》	2021 年 10 月 29 日，上海清算所同意机构 A 开展人民币外汇交易中央对手清算自营业务，会

		员类型为 C 类普通清算会员。
3	《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》	2021 年 11 月 12 日，上海清算所同意机构 A 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。
4	机构 A 清算合约要素	机构 A 在上海清算所人民币外汇交易中央对手清算业务中，共持有五份合约，包括一笔掉期交易（FX Swap）及四笔远期交易（FX Forward）。
5	《清算会员永久性违约通知》	2022 年 9 月 21 日，机构 A 收到上海清算所出具的《清算会员永久性违约通知》，被告知机构 A 在人民币外汇交易中央对手清算业务中永久性违约。上海清算所将根据《清算协议》《清算业务规则》《违约处置指引》《清算业务指南》采取违约处置措施。
6	《上海清算所人民币外汇交易中央对手清算业务违约处	2022 年 9 月 23 日，上海清算所通知机构 A，告知违约处置整体

	置损失结果通知》	亏损金额为 101,631,116.91 元人民币，其中对冲交易损失 34,274,614.10 元，拍卖阶段亏损 9,252,108.29 元。
7	最优市场价截图	上海清算所进行风险对冲当日（2022 年 9 月 21 日）14:02 分美元对人民币市场最优报价为 6.4546，14:04 分美元对人民币市场最优报价为 6.4560。即，上海清算所风险对冲阶段的两笔成交价偏离该时段市场最优价报价 60pips 和 66pips。

此致

上海金融法院

提供人：机构 A

代理人：上海虹桥正瀚律师事务所 王正  
上海虹桥正瀚（临港新片区）律师事务所 钱前



日期：2022 年 10 月 18 日