附件3

3个月同业存单标准利率互换合约要素

|  |  |
| --- | --- |
| **合约名称**  | 3个月同业存单利率互换 |
| **合约标的** | 3个月全国性银行同业存单发行利率（PrimeNCD 3M） |
| **合约代码** | PrimeNCD3M \_2306 |
| **合约面值** | 1000万（1手） |
| **合约月份** | 4个季月合约和不在季月循环里的最近2个日历月合约 |
| **报价收益率** | 为最后交易日PrimeNCD3M的预期值（年化利率）单位：%，精确到0.0001% |
| **最小报价单位** | 0.0001%（0.01bp） |
| **合约计息期首日** | 到期结算日的下一个营业日 |
| **合约计息期尾日** | 计息期首日往后3M对应的日历月。如遇节假日，调整为下一个营业日。 |
| **计息方式/基准** | 单利，A/A-bond |
| **结算方式** | 现金结算 |
| **到期结算日** | 到期月份的第三个周三，D日 |
| **最后交易日** | 到期结算日前一个工作日，D-1日 |
| **新合约上市日** | 前一个合约最后交易日的下一个营业日，D日 |
| **到期结算利率** | 货币网公布的最后交易日的PrimeNCD3M的数值（年化利率） |
| **累计到期结算金额** | （合约到期结算利率-合约成交价）\*合约面值\*A/A-Bond |
| **挂牌基准利率** | 合约上市前一营业日同业拆借中心同业存单（AAA）收盘收益率曲线推算出的对应计息期的远期利率 |
| **每日结算利率** | （1）取当日最后1小时成交的加权价格，该时段因系统故障等原因导致交易中断的，扣除中断时间后向前取满相应时段；（2）若最后1小时成交笔数少于5笔，则取当日最后5笔交易的加权价格；（3）若全天该合约成交笔数少于5笔，取最后一小时的（bid的平均+ ofr平均）×0.5；（4）若无报价或出现其他难以确定结算利率的情况，则可取前一日结算利率（如为合约上市首日，则取挂牌基准利率）或同业拆借中心计算的其他利率。 |
| **涨跌幅** | 50BP |
| **头寸报告标准** | 1.当全市场总持仓达到2万手时，单个参与者总持仓占市场总持仓量超过5%的，应当向交易中心履行报告义务。2.达到以下标准之一的，交易中心可以要求相关参与者履行报告义务：（1）参与者总持仓占市场总持仓量超过20%的。（2）其他交易中心要求报告的情形。 |