附表

LPR1Y利率互换合约要素表

|  |  |
| --- | --- |
| 互换条款 | |
| 品种 | 参考利率为LPR1Y的利率互换 |
| 互换类型 | 支付固定利率（买方）；收取固定利率（卖方） |
| 互换期限 | 6M/9M/1Y/2Y/3Y/4Y/5Y/7Y/10Y |
| 代码 | 采取参考利率+期限的形式。例如：LPR1Y\_5Y合约表示标的为LPR1Y、期限为5年的利率互换 |
| 互换价格 | 利率，单位% |
| 单位变动点 | 0.25BP（即0.0025%） |
| 交易时间 | 周一至周五：北京时间9:00-12:00,13:30-17:30，节假日除外 |
| 交易日 | T日 |
| 起息日 | 默认D=T+1 |
| 到期日 | 默认起息日+互换期限 |
| 首次利率确定日 | 默认为起息日上一日，除另有约定，利率确定日适用上一营业日准则 |
| 支付日调整 | 默认为经调整的下一营业日 |
| 支付周期 | 默认为按季支付 |
| 支付日 | 支付日按照起息日与支付周期依次推算；支付日为按照该支付周期推算的相应月份中与起息日相同的一日 |
| 重置频率 | 季 |
| 浮动利率 | LPR1Y，指全国银行间同业拆借中心在每月20日（节假日顺延）发布的LPR1Y。如利率确定日落在两次发布日之间，利率取已发布的参考利率值。 |
| 固定利率 | 指约定的计算固定利率支付方应支付的固定金额所依据的利率水平 |
| 计息方法 | 单利 |

LPR5Y利率互换合约要素表

|  |  |
| --- | --- |
| 互换条款 | |
| 品种 | 参考利率为LPR5Y的利率互换 |
| 互换类型 | 支付固定利率（买方）；收取固定利率（卖方） |
| 互换期限 | 6M/9M/1Y/2Y/3Y/4Y/5Y/7Y/10Y |
| 代码 | 采取参考利率+期限的形式。例如：LPR5Y\_5Y合约表示标的为LPR5Y、期限为5年的利率互换 |
| 互换价格 | 利率，单位% |
| 单位变动点 | 0.25BP（即0.0025%） |
| 交易时间 | 周一至周五：北京时间9:00-12:00,13:30-17:30，节假日除外 |
| 交易日 | T日 |
| 起息日 | 默认D=T+1 |
| 到期日 | 默认起息日+互换期限 |
| 首次利率确定日 | 默认为起息日上一日，除另有约定，利率确定日适用上一营业日准则 |
| 支付日调整 | 默认为经调整的下一营业日 |
| 支付周期 | 默认为按季支付 |
| 支付日 | 支付日按照起息日与支付周期依次推算；支付日为按照该支付周期推算的相应月份中与起息日相同的一日 |
| 重置频率 | 季 |
| 浮动利率 | LPR5Y，指全国银行间同业拆借中心在每月20日（节假日顺延）发布的LPR5Y。如利率确定日落在两次发布日之间，利率取已发布的参考利率值。 |
| 固定利率 | 指约定的计算固定利率支付方应支付的固定金额所依据的利率水平 |
| 计息方法 | 单利 |