



开发三部 职能概要



中國外匯交易中心 | 全國銀行間同業拆借中心
中匯信息技術(上海)有限公司
CFETS Information Technology (Shanghai) Co., Ltd.

2020年10月



目录

CONTENTS

01

部门职责

系统建设、产品研发、运营服务

02

业务系统介绍

业务概览、业务范围、技术架构

03

产品体系与规划

产品规划、产品体系、现有服务

04

技术改进及其他

交易后等系统改造



01

部门职责



基本职责

负责**清算部主管**系统筹建、项目交付、产品研发、技术改进、运维保障、运营服务等。

系统筹建

项目交付

产品研发

技术改进

运维保障

运营服务

01

客户部门主要为中心清算部，组织其主管的清算及央行类新系统筹建、在线运行系统项目实施与交付。

02

跟踪清算相关的业务动态和需求创新，进行可复用领域构件、平台产品的规划和研发，组织交流与合作，进行产品策划推广。

03

承接清算相关前瞻性技术研究和创新工作，组织实施相关技术的引进、消化、吸收，负责关键核心技术、架构持续优化。



02

业务系统介绍

2

交易后服务

交易后处理系统
外汇账务系统

1

信息服务

中间价系统

2

支付接入服务

SWIFT交易中心接入系统
大额支付系统CNAPS交
易中心接入系统

22

总行托管服务

央行外汇交易系统 (5)
央行公开市场操作市
内部管理系统 (9)
央行清算账务系统 (4)
其他 (4)

10

办公支持服务

呼叫中心系统
远程培训系统
等..



交易后处理系统



参与方

金融市场部

资金清算后台

境内会员

金交所

CNAPS2

境内基础设施

金融市场部

境外会员

明讯银行

境外基础设施

Comstar

金融科技公司

风险管理部

货币经纪公司

清算所

资金清算后台

SWIFT

市场服务

确认服务

集中交易确认

swift报文匹配

债券代理核对

利息确认

组合对账

合约核对

估值核对

现金流计算

计算服务

交易冲销

双边冲销

多边冲销

风险缓释

重置服务

结算服务

同步交收

交割管理

指令代发

交易报告

购售报送

风险准备金计算

其他

违约信息管理

支撑

结算账户管理

业务参数设置

基础服务

用户/权限管理

运行监控

机构管理

场务服务

场务应急

公告管理

典型业务-交易确认



市场类型	业务类型	清算方式	产品类型	确认方式	确认场景
外汇市场	外汇询价	双边清算	即期	点击确认\文件上传\API确认	交易达成后（含到期未确认及交易撤销）
			远期	点击确认\文件上传\API确认	交易达成后（含到期未确认及交易撤销）、NDF现金流生成
			掉期	点击确认\文件上传\API确认	交易达成后（含到期未确认及交易撤销）
		净额清算	即期	点击确认\文件上传\API确认	交易达成后（含到期未确认及交易撤销）
			远期	点击确认\文件上传\API确认	交易达成后（含到期未确认及交易撤销）
			掉期	点击确认\文件上传\API确认	交易达成后（含到期未确认及交易撤销）
	外汇期权（含行权）	双边清算	/	点击确认\文件上传	交易达成后（含到期未确认及交易撤销）、全额行权、差额行权时）
	外汇期权（含行权）	净额清算	/	点击确认\文件上传	交易达成后（含到期未确认及交易撤销）、全额行权、差额行权时
	货币掉期（含利息）	双边清算	/	点击确认\文件上传\API确认	交易达成后（含到期未确认及交易撤销）、利息生成后
	外币拆借	双边清算	/	点击确认\文件上传\API确认	交易达成后（含到期未确认及交易撤销）
	外币利率互换	双边清算	/	点击确认\文件上传	交易达成后（含到期未确认及交易撤销）
	外币回购	双边清算	/	点击确认\文件上传\API确认	交易达成后（含到期未确认及交易撤销）
黄金市场	黄金询价交易	钱货两讫	即期	点击确认\文件上传\API确认	交易达成后（含到期未确认及交易撤销）
		钱货两讫	远期	点击确认\文件上传\API确认	交易达成后（含到期未确认及交易撤销）
		钱货两讫	掉期	点击确认\文件上传\API确认	交易达成后（含到期未确认及交易撤销）
本币市场	利率互换	/	/	点击确认\文件上传\API确认	交易达成后（含到期未确认及交易撤销）、提前终止
	标准利率互换			点击确认	交易达成后
	利率上下限期权	/	/	点击确认	交易达成后
	利率互换期权			点击确认\文件上传	交易达成后
	同业存款			点击确认\文件上传	存入、存出、提前支取
	信用违约互换			点击确认\文件上传	交易达成后



确认要素差异

涵盖3大市场不同交易品种，各品种的确认要素不同，需要根据不同交易品种定制化设计



确认场景差异

不同交易品种涉及的确认场景不同，涉及行权、利息、差额交割、提前终止等个性化场景



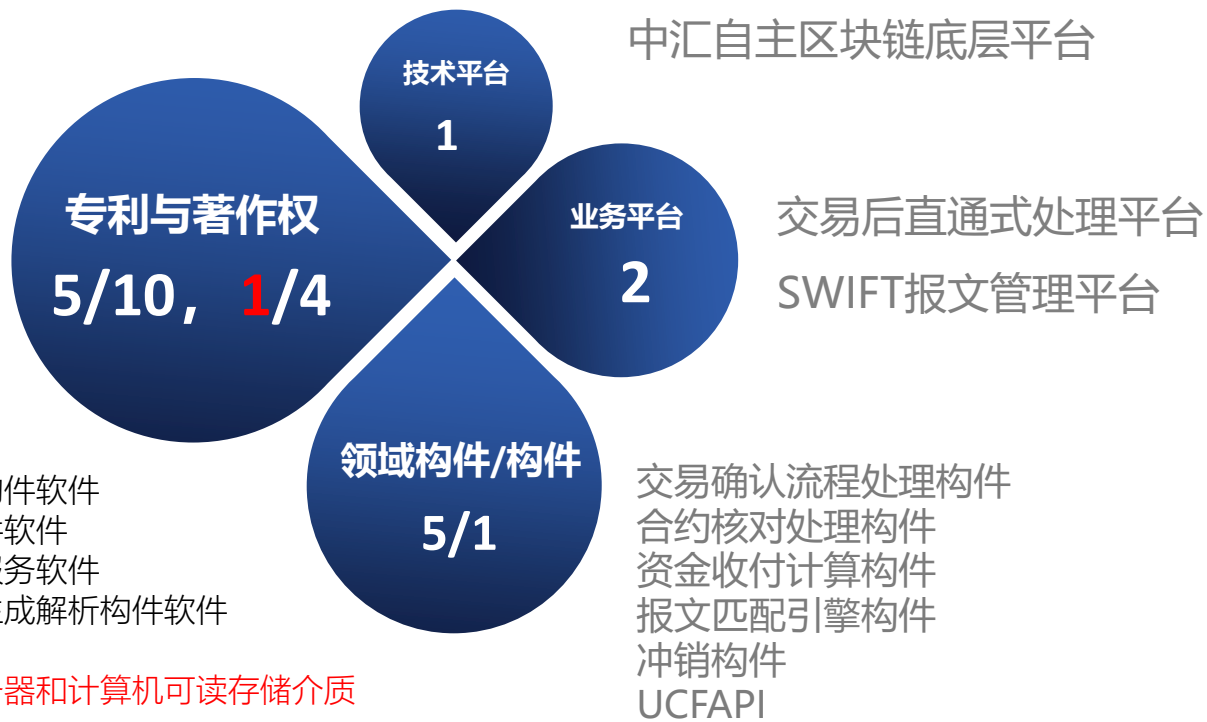
确认方式差异

不同交易品种根据市场成员习惯不同，提供的确认方式不同。



03

产品研发



中汇通用消息格式转换构件软件
中汇交易后冲销服务构件软件
中汇交易确认匹配引擎服务软件
中汇大额支付系统报文生成解析构件软件

一种消息匹配方法、服务器和计算机可读存储介质



04

技术改进及其他

交易后处理系统改良翻新

确认服务

丰富确认模式，适用场内外多种确认场景，确保数据完整一致

组合对账

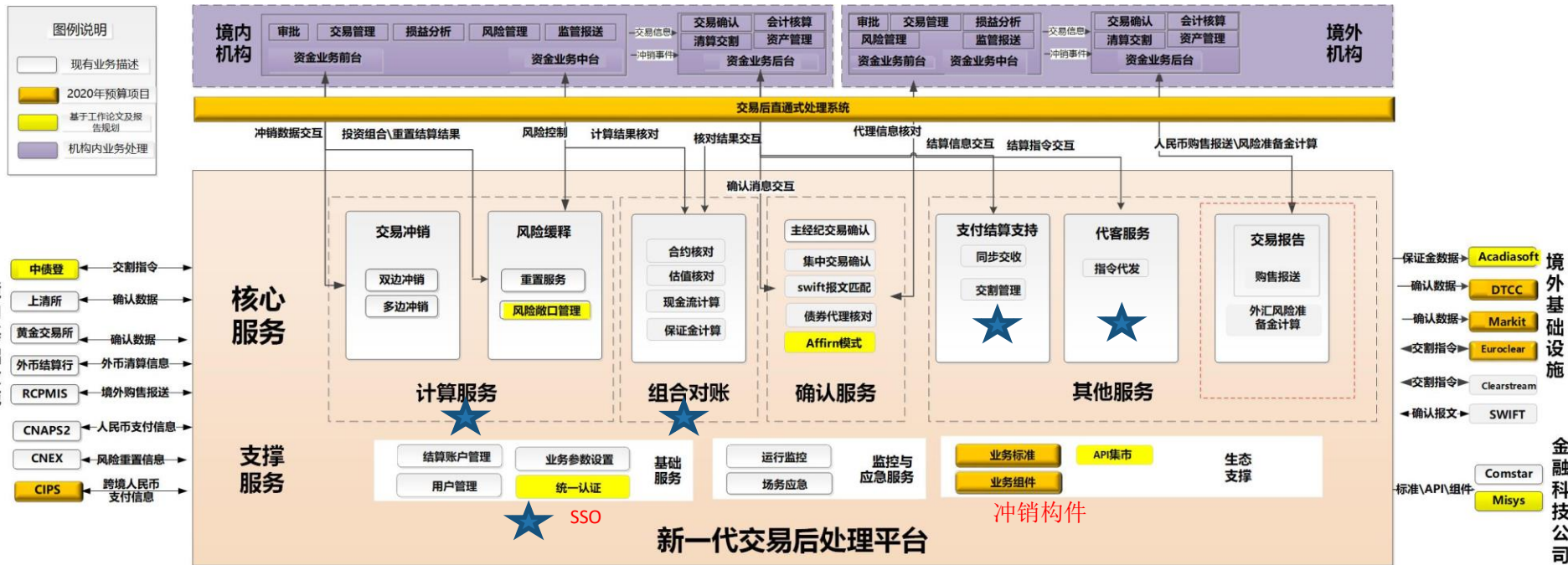
存续期内，对合约要素、估值、保证金等核对以提升运营效率

计算服务

扩展服务范围，支持汇率衍生品、信用衍生品风险敞口管理

其他服务

提供支付结算支持等服务，以开放的API集市促进金融科技生态



THANKS

谢 谢 聆 听