

中国人民银行关于在银行间外汇市场开办人民币外汇货币掉期业务有关问题的通知 PDF转换可能丢失图片或格式，建议阅读原文

https://www.100test.com/kao_ti2020/301/2021_2022__E4_B8_AD_E5_9B_BD_E4_BA_BA_E6_c80_301590.htm 中国人民银行关于在银行间外汇市场开办人民币外汇货币掉期业务有关问题的通知银发〔2007〕287号 中国人民银行上海总部，各分行、营业管理部，各省会（首府）城市中心支行、副省级城市中心支行；国家外汇管理局各省、自治区、直辖市分局，外汇管理部，深圳、大连、青岛、宁波、厦门市分局；各政策性银行、国有商业银行、股份制商业银行、中国外汇交易中心：现就境内机构在银行间外汇市场开办人民币外汇货币掉期业务的有关事宜通知如下：一、本通知所称人民币外汇货币掉期，是指在约定期限内交换约定数量人民币与外币本金，同时定期交换两种货币利息的交易协议。本金交换的形式包括：（一）在协议生效日双方按约定汇率交换人民币与外币的本金，在协议到期日双方再以相同的汇率、相同金额进行一次本金的反向交换；（二）中国人民银行和国家外汇管理局规定的其他形式。利息交换指双方定期向对方支付以换入货币计算的利息金额，可以固定利率计算利息，也可以浮动利率计算利息。二、现阶段在银行间外汇市场开办人民币兑美元、欧元、日元、港币、英镑五个货币对的货币掉期交易。三、具备银行间远期外汇市场会员资格的境内机构可以在银行间外汇市场开展人民币外汇货币掉期业务。四、国家外汇管理局对人民币外汇货币掉期业务实行备案制治理。具备本通知第三条规定资格的境内机构，在开展人民币外汇货币掉期业

务之前，应通过中国外汇交易中心向国家外汇管理局备案。备案材料包括：开办人民币外汇货币掉期业务的申请；申请机构开展人民币外汇货币掉期业务的风险内控制度。备案材料交中国外汇交易中心初审后，报国家外汇管理局。国家外汇管理局自收到中国外汇交易中心递交的备案材料之日起20个工作日内，根据本通知规定的条件向申请人下达备案通知书，同时抄报中国人民银行、抄送中国外汇交易中心。

五、开展人民币外汇货币掉期业务应遵循以下规定：（一）货币掉期中人民币的参考利率，应为经中国人民银行授权全国银行间同业拆借中心发布的具有基准性质的货币市场利率，或中国人民银行公布的存贷款基准利率；货币掉期中外币参考利率由交易双方协商约定。（二）境内机构开展人民币外汇货币掉期业务应遵守国家外汇管理局的结售汇综合头寸治理规定及有关外汇治理规定。（三）在银行间外汇市场办理人民币外汇货币掉期业务应通过中国外汇交易中心的交易系统进行。（四）为明确交易双方的权利和义务，办理人民币外汇货币掉期业务交易双方须签订主协议。主协议和成交记录（包括中国外汇交易中心的交易系统打印的交易单等）共同构成书面交易合同。交易双方认为必要时，可签订补充协议，对双方的权利义务、违约情形及违约责任等做出明确约定，补充协议是交易合同的组成部分。（五）货币掉期交易合同达成后，交易双方应严格履行合同义务，并按交易协定内容进行清算。（六）货币掉期交易发生违约，对违约事实或违约责任存在争议的，交易双方可以根据交易合同申请仲裁或者向人民法院提起诉讼，并于接到仲裁或诉讼最终结果的次一工作日12 00之前，将最终结果送达中国外汇交易中心

，中国外汇交易中心应在接到最终结果的当日公告。六、中国外汇交易中心负责提供人民币外汇货币掉期交易系统，并依据本通知制定人民币外汇货币掉期交易规则，报中国人民银行及国家外汇管理局备案后实施。七、中国外汇交易中心对交易进行日常统计和监控，应将统计信息和有关情况于次月的前10个工作日内以书面形式报送中国人民银行和国家外汇管理局，并及时向市场披露有关信息，但不得泄漏非公开信息或误导市场参与者，发现异常情况应及时向中国人民银行和国家外汇管理局报告。八、中国人民银行和国家外汇管理局对银行间外汇市场人民币外汇货币掉期业务实施监督 and 治理。中国人民银行和国家外汇管理局将依据《中华人民共和国中国人民银行法》和《中华人民共和国外汇管理条例》等有关法律、法规和其他相关治理规定，对违反本通知规定开展人民币外汇货币掉期业务、扰乱市场秩序的机构，进行相应处罚。九、请人民银行各分支机构将本通知转发至辖区内城市商业银行、农村商业银行、农村合作银行和外资银行。十、本通知自印发之日起实施。中国人民银行二〇一七年八月十七日 100Test 下载频道开通，各类考试题目直接下载。详细请访问 www.100test.com