

特 急

中国人民银行文件

银发〔2005〕202号

中国人民银行关于加快发展 外汇市场有关问题的通知

中国人民银行各分行、营业管理部，省会（首府）城市中心支行，大连、青岛、宁波、厦门、深圳市中心支行；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、厦门、宁波市分局；各中资外汇指定银行；中国外汇交易中心：

为进一步完善社会主义市场经济体制，提高汇率形成的市场化程度，充分发挥市场在资源配置中的基础作用，中国人民银行决定加快银行间外汇市场的发展，为银行和企业提供更多的风险管理工具。根据《中华人民共和国外汇管理条例》和《银行间外汇市场管理暂行规定》等有关法规，现就有关问题通知如下：

一、扩大即期外汇市场交易主体

（一）非金融企业符合以下条件的，可以向中国外汇交易中心

(以下简称交易中心)申请会员资格,进入银行间即期外汇市场进行自营性交易:

1.上年度经常项目跨境外汇收支**25**亿美元或者货物贸易进出口总额**20**亿美元以上;

2.具有**2**名以上从事外汇交易的专业人员;

3.具备与银行间外汇市场联网的电子交易系统;

4.自申请日起前两年内没有重大违反外汇管理法规行为;

5.国家外汇管理局规定的其他条件。

(二)非银行金融机构符合以下条件的,可以向交易中心申请会员资格,进入银行间即期外汇市场交易:

1.具有主管部门批准的外汇业务经营资格;

2.具有经国家外汇管理局批准的结售汇业务经营资格;

3.保险公司注册资本金不低于**10**亿元人民币或等值外汇,证券公司、信托公司、财务公司等注册资本金不低于**5**亿元人民币或等值外汇,基金管理公司注册资本金不低于**1.5**亿元人民币或等值外汇;

4.具有**2**名以上从事外汇交易的专业人员;

5.具备与银行间外汇市场联网的电子交易系统;

6.自申请日起前两年内没有重大违反外汇管理法规行为;

7.国家外汇管理局规定的其他条件。

(三)非金融企业和非银行金融机构进入银行间即期外汇市场交易申请程序:

1.符合条件的非金融企业和非银行金融机构应当持以下材料,向交易中心提出申请,交易中心初审后报国家外汇管理局备案。

(1)申请报告(说明申请的主要目的、人员配备等);

(2)非金融企业应出具上年度经常项目跨境外汇收支或者货物贸易进出口总额等有关情况的报告;

(3)非银行金融机构应出具外汇业务经营资格和结售汇业务经营资格的证明文件,上年度经会计师事务所审计的外汇财务报告;

(4)技术支持系统的配置和功能说明;

(5)参与银行间即期外汇市场交易的内部管理制度,包括基本操作规程、风险管理规定、业务权限管理规定等;

(6)交易中心要求提供的其他材料。

2.国家外汇管理局自收到交易中心递交的备案报告起,15个工作日内出具备案通知书,同时抄送交易中心;对不符合规定而不予备案的申请者,国家外汇管理局以书面形式予以通知。不予备案的非金融企业和非银行金融机构,不能取得交易中心会员资格,不得进入即期外汇市场进行交易。

3.在特定情况下,非金融企业和非银行金融机构可直接向国家外汇管理局提出申请,经批准可取得交易中心会员资格,进入银行间即期外汇市场进行交易。

(四)非金融企业和非银行金融机构交易管理

1.非金融企业在银行间外汇市场的即期交易以实需为原则,除现行外汇管理法规规定须经国家外汇管理局及其分支局(以下简称外汇局)批准的交易外,均可入市交易。

2.非银行金融机构在银行间外汇市场的即期交易,除按现行外汇管理法规规定须经外汇局批准并出具结汇或者售汇批准文件方可交易外,其他交易可在市场内进行。

3. 非银行金融机构须遵守各自行业主管部门规定的风险管理规定,或者参照执行《商业银行市场风险管理指引》(中国银行业监督管理委员会令 2004 年第 10 号)中有关市场风险管理的规定。

二、增加外汇市场询价交易方式

(一)在银行间外汇市场引入询价交易系统,交易中心会员可自主决定采取询价交易或竞价交易方式。

(二)采取询价交易方式的会员应当在双边授信基础上,通过交易中心询价交易系统进行交易,交易的币种、汇率、金额等由交易双方协商议定。

(三)询价交易实行双边清算,风险自担,并遵守交易中心询价交易管理制度的各项规定。

三、开办银行间远期外汇交易

(一)银行间远期外汇交易是指交易双方以约定的外汇币种、金额、汇率,在约定的未来某一日期交割的人民币对外汇的交易。

(二)银行间远期外汇市场参与主体须为交易中心的会员。

(三)政策性银行、商业银行、信托投资公司、金融租赁公司、财务公司和汽车金融公司会员参与银行间远期外汇交易,须获得中国银行业监督管理委员会颁发的金融衍生产品交易业务资格;其他非银行金融机构会员须获得其监管部门的批准;非金融企业会员须经国家外汇管理局批准。

(四)国家外汇管理局对银行间远期外汇市场参与主体实行法人备案管理。符合条件的交易中心会员持本条第(三)项规定的文件,向交易中心提出申请,交易中心初审后报国家外汇管理局备案。国家外汇管理局按照本通知第一条第(三)项第 2 点规定的程序对该机构进行备案审核。

(五)国家外汇管理局根据结售汇业务量、资本金或营运资金规模、外汇资产状况等指标,核定非金融企业和非银行金融机构的本外币转换头寸。

(六)银行间远期外汇交易应遵守以下规定:

1. 交易双方通过交易中心询价交易系统进行交易,交易的外币币种、金额、期限、汇率、交割安排等由交易双方协商议定。

2. 远期交易可采取到期日本金全额交割的方式,也可采取在到期日根据约定的远期交易价格与到期日即期交易价格轧差交割的方式。两种交割方式及币种在成交单中应予以明确。

3. 为明确交易双方的权利与义务,远期外汇市场会员应签订银行间远期外汇交易主协议。

4. 为防范违约风险,保证远期外汇交易合同的履行,远期外汇市场会员可按交易对手的信用状况协商设定保证金。保证金可由交易中心代为集中保管。

5. 远期外汇市场会员应建立、健全内部管理制度和风险防范机制,并采取切实有效的措施对远期风险进行监控和管理。

6. 交易中心负责提供交易系统并进行日常统计与监控工作,及时向市场披露有关信息,但不得泄露非公开信息或误导市场参与者。

7. 远期外汇市场会员除遵守本通知规定外,还应遵守银行间外汇市场其他有关规定。

(七) 远期外汇市场会员自获得远期交易备案资格起6个月后,可按即期交易与远期交易相关管理规定,在银行间市场开展即期与远期、远期与远期相结合的人民币对外币掉期交易。

四、加强外汇市场监管

中国人民银行授权国家外汇管理局对银行间即期外汇市场和远期外汇市场进行监督管理。

国家外汇管理局应依据《中华人民共和国外汇管理条例》和相关外汇管理规定,加强对外汇市场的监督和检查,对违反本通知规定、扰乱外汇市场交易秩序的参与主体,依法严肃查处。

本通知自发布之日起施行。

二〇〇五年八月八日

主题词：金融 外汇市场 通知

抄 送：外汇局。

内部发送：办公厅，货政司，市场司。

联系人：王允贵

联系电话：68402099

(共印 68 份)

中国人民银行办公厅

2005 年 8 月 9 日印发
