

国家外貨管理局による人民元外貨デリバティブ商品業務の 管理の調整に関する通知

(中国語名称：国家外匯管理局關於調整人民幣外匯衍生產品業務管理的通知)
法令番号：---

国家外匯管理局关于调整人民币外汇衍生产品业务管理的通知

国家外匯管理局各省、自治区、直辖市分局、外匯管理部，深圳、大连、青岛、厦门、宁波市分局，各政策性银行、国有商业银行、股份制商业银行，中国外匯交易中心：

为促进外匯市场发展，根据《外匯指定银行办理结匯、售匯业务管理暂行办法》等有关法规规定，现就调整人民币外匯衍生产品业务管理有关事宜通知如下：

一、简化外匯掉期和货币掉期业务准入管理

按照《中国人民银行关于扩大外匯指定银行对客户远期结售匯业务和开办人民币与外币掉期业务有关问题的通知》（银发[2005]201号）取得（含本通知实施前已取得）对客户远期结售匯业务资格的银行及其分支机构，可自动取得外匯掉期、货币掉期业务资格，无需再次申请备案。

银行及其分支机构新开办对客户外匯掉期、货币掉期业务前，应与国家外匯管理局或其分支局确认结售匯统计等管理事宜。

二、增加货币掉期业务本金交换形式

银行可以为客户符合外匯管理规定的境内外外币债务还本付息，办理合约生效日不实际交换本金、到期日实际交换或不实际交换本金的货币掉期业务，银行间外匯市场货币掉期业务增加相应本金交换形式。上述货币掉期业务形成的外匯敞口，银行可以纳入结售匯综合头寸统一管理。

三、支持银行完善期权业务定价和风险管理

银行按照《国家外汇管理局关于推出人民币对外汇期权交易有关问题的通知》（汇发[2011]8号）对客户或在银行间外汇市场开展的差额交割期权业务，参考价可由交易双方按照商业原则协商确定，但应是境内真实、有效的市场汇率。银行可以自主选择合理、适当的方法和参数计量期权 Delta 头寸，并纳入结售汇综合头寸统一管理。

四、银行对客户办理人民币外汇衍生产品业务，应按照“了解你的客户”、“了解你的业务”和“尽职审查”原则，向适当的客户销售适当的产品，加强对客户风险揭示和自身风险管理，审慎、合规开展业务。

五、中国外汇交易中心应根据本通知规定，相应调整银行间外汇市场有关交易规则及系统，做好技术支持。

六、本通知自 2014 年 1 月 1 日起实施。

国家外汇管理局各分局、外汇管理部接到本通知后，应即转发辖内银行和货币经纪公司。

特此通知。

国家外汇管理局

2013 年 12 月 16 日