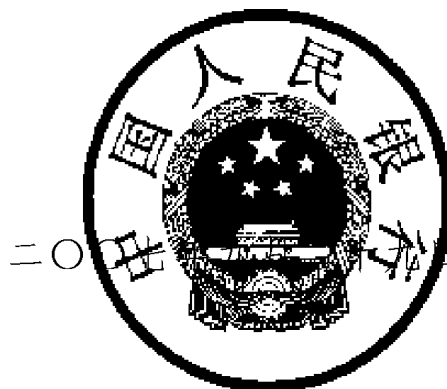


中国人民银行公告

〔2007〕第 20 号

为规范远期利率协议业务，完善市场避险功能，促进利率市场化进程，中国人民银行制定了《远期利率协议业务管理规定》，现予公布。



远期利率协议业务管理规定

第一条 为规范远期利率协议业务，根据《中华人民共和国中国人民银行法》等有关法律、行政法规，制定本规定。

第二条 本规定所称远期利率协议是指交易双方约定在未来某一日，交换协议期间内一定名义本金基础上分别以合同利率和参考利率计算的利息的金融合约。其中，远期利率协议的买方支付以合同利率计算的利息，卖方支付以参考利率计算的利息。

第三条 远期利率协议的参考利率应为经中国人民银行授权的全国银行间同业拆借中心（简称交易中心）等机构发布的银行间市场具有基准性质的市场利率或中国人民银行公布的基准利率，具体由交易双方共同约定。

第四条 全国银行间债券市场参与者（简称市场参与者）中，具有做市商或结算代理业务资格的金融机构可与其他所有市场参与者进行远期利率协议交易，其他金融机构可以与所有金融机构进行远期利率协议交易，非金融机构只能与具有做市商或结算代理业务资格的金融机构进行以套期保值为目的的远期利率协议交易。

第五条 市场参与者进行远期利率协议交易应遵循公平、诚信、风险自担的原则，建立健全相应的内部操作规程和风险管理

预览已结束，完整报告链接和二维码如下：

https://www.yunbaogao.cn/report/index/report?reportId=11_679

