

中国人民银行文件

银发〔2007〕287号

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

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管理。

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其他代指基准利率。货币掉期中外币利率

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_684

