

中国人民银行公告

[2006]第 1 号

为完善以市场供求为基础、参考一篮子货币进行调节、有管理的浮动汇率制度,促进外汇市场发展,丰富外汇交易方式,提高金融机构自主定价能力,中国人民银行决定进一步完善银行间即期外汇市场,改进人民币汇率中间价形成方式。现就有关事宜公告如下:

一、自 2006 年 1 月 4 日起,在银行间即期外汇市场上引入询价交易方式(以下简称 OTC 方式),同时保留撮合方式。银行间外汇市场交易主体既可选择以集中授信、集中竞价的方式交易,也可选择以双边授信、双边清算的方式进行询价交易。同时在银行间外汇市场引入做市商制度,为市场提供流动性。

二、自 2006 年 1 月 4 日起,中国人民银行授权中国外汇交易中心于每个工作日上午 9 时 15 分对外公布当日人民币对美元、欧元、日元和港币汇率中间价,作为当日银行间即期外汇市场(含

OTC 方式和撮合方式)以及银行柜台交易汇率的中间价。

三、引入 OTC 方式后,人民币兑美元汇率中间价的形成方式将由此前根据银行间外汇市场以撮合方式产生的收盘价确定的方式改进为:中国外汇交易中心于每日银行间外汇市场开盘前向所有银行间外汇市场做市商询价,并将全部做市商报价作为人民币兑美元汇率中间价的计算样本,去掉最高和最低报价后,将剩余做市商报价加权平均,得到当日人民币兑美元汇率中间价,权重由中国外汇交易中心根据报价方在银行间外汇市场的交易量及报价情况等指标综合确定。

四、人民币兑欧元、日元和港币汇率中间价由中国外汇交易中心分别根据当日人民币兑美元汇率中间价与上午 9 时国际外汇市场欧元、日元和港币兑美元汇率套算确定。

五、本公告公布后,银行间即期外汇市场人民币对美元等货币交易价的浮动幅度和银行对客户美元挂牌汇价价差幅度仍按现行规定执行。即每日银行间即期外汇市场美元对人民币交易价在中国外汇交易中心公布的美元交易中间价上下千分之三的幅度内浮动,欧元、日元、港币等非美元货币对人民币交易价在中国外汇交

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_747

