

会员换汇业务指引

(2020年12月)

为规范上海国际能源交易中心（以下简称上期能源）境内特定品种期货交易结汇和购汇业务的开展，根据国家外汇管理局有关规定，以及《上海国际能源交易中心结算细则》等相关业务规则，制定本业务指引。

《国家外汇管理局关于境外交易者和境外经纪机构从事境内特定品种期货交易外汇管理有关问题的通知》（汇发[2015]35号）第七条规定：“外汇在境内兑换及期货交易人民币结算业务，应当符合《通知》附件《境外交易者和境外经纪机构从事境内特定品种期货交易人民币结算业务与境内特定品种期货交易人民币结算业务》”

1. **可换汇额度**：根据委托会员结算的境外客户、境外中介机构、境外特殊参与者（以下简称境外结算交割委托人）从事境内特定品种期货交易的实际结果，由会员端系统自动生成，以结算货币显示。

2. **当日特定品种净盈亏** = 当日特定品种盈亏 - 当日特定品种手续费 + 特定品种当日利息收入

3. **当日特定品种累计净盈亏** = 上一交易日特定品种累计净盈亏 + 当日特定品种净盈亏 - 当日特定品种其他费用支出 - 当日已购汇金额

上一交易日发生以下情形之一的，“上一交易日特定品种累计净盈亏”和“当日已购汇金额”取值均为零：

- 1) 上一交易日为换汇截止日；
- 2) 特定品种累计净盈亏小于零；
- 3) 结算后变更盈利货币。

4. **人民币结存：**~~指境外结算交割委托人的人民币货币资金结存。~~

当日人民币结存 = 上一交易日人民币结存 + 当日特定品种净盈亏 - 当日出金 + 当日入金

5. **换汇截止日：**~~每月第四个周一(遇国家法定节假日顺延)为换汇截止日。~~如当日为换汇截止日，则会员应按照境外结算交割委托人的当日可换汇额度，于下一交易日收市前完成全部换汇业务的办理。

(一) **结算货币：**为人民币。外汇保证金结汇后方可用于结算。

(二) ~~盈利货币~~境外结算交割委托人可以自主选择人民币或者美元作为盈利货币，并与其委托结算的会员书面约定。盈利货币允许变更，经协商一致不得超过6个月。

(三) **业务类型：**包括代理换汇，交割货款换汇，和代理强制结汇三种类型。

(四) **可换汇额度：**每日结算时，会员端系统根据每一境外结算交割委托人当日可换汇额度，并据此计算当日可换汇金额。不同境外结算交割委托人当日可换汇额度不得轧差。

当日可换汇额度一旦生成不得更改。

(五) 业务办理：会员应于规定的时限之前完成换汇业务的办理

换汇业务必须通过具有境外客户保证金存管业务资格的指定存管银行，
并通过会员的人民币保证金专用账户和外汇保证金专用账户办理。

(一) 业务场景

会员是否需要为境外结算交割委托人办理

景条件判断：

T	T		T	T+1 11:30	T+1 15:00
			—	—	
0	0			—	
	<0	—			

下一交易日 11:30 之前选择美元作为盈利货币的境外结算交割委托人可以向会员提交购汇申请，购汇申请的金额不得超过当日可换汇额度。会员收取境外结算交割委托人提交的有效购汇申请的，应于 15:00 前通过指定存管银行完成购汇业务的办理。

2. 当日为非换汇截止日，且可换汇额度小于零

该场景下可换汇额度即为人民币结存，说明出现结算货币资金缺口。会员可要求境外结算交割委托人自行入金人民币，于 15:00 前为其办理结汇以补足。

(四) 银期换汇

会员可以通过指定存管银行银期换汇电子渠道查询实时汇率报价，根据保证金占用比例及实际可用资金金额等情况，选择办理换汇业务的指定存管银行，并发送银期换汇申请。

银期换汇申请根据实际换汇业务方向分为结汇申请、购汇申请。每个申请可以包含一个或多个境外结算交割委托人。境外个人客户和境外机构客户的换汇申请应当

会员应当配合指定存管银行按时提供结购汇业务凭证（附件 1），以满足银行对业务真实性、合规性的审核以及结售汇申报要求。

(五) 数据报送

中国期货市场监控中心在法定节假日结束次日交易前 17:00。按指定存管银行实际完成换汇业务办理的时间划分，17:00 之前完成办理的数据应在当日进行报送；17:00 之后完成办理的数据应在下一交易日报送。

参见《结算细则》第四十二条（略）。

会员应妥善保存换汇业务记录及相关数据，以备交易所及相关监管

境外结算交割委托人、会员、指定存管银行应当根据境外结算交割
委托人从境外指定日期起按实际汇率，办理相关外汇结汇和购
汇手续。同时应当加强换汇业务的合规管理，不得通过构造交易等方式
违规办理换汇业务。

（本指引英文文本仅供参考，如与中文文本不一致，以中文文本为
准。）

附件 1
