

上海黄金交易所现货大宗交易管理办法

目 录

- 第一章 总 则
- 第二章 市场准入
- 第三章 申报与成交
- 第四章 违规处理
- 第五章 附 则

第一章 总 则

第一条 为规范上海黄金交易所（以下简称交易所）现货大宗交易业务，保护参与机构的合法权益，根据《上海黄金交易所交易规则》、《上海黄金交易所竞价交易细则》等有关规定，制定本办法。

第二条 本办法所称现货大宗交易业务（以下简称大宗交易）是指由买卖双方会员通过交易所会员服务系统申报，经双方协商确定成交价格、且成交数量较大的现货实盘交易业务。

第三条 交易所、会员、客户、其他相关参与者及相关单位的工作人员，开展现货大宗交易及相关业务应当遵守本规则。

第二章 市场准入

第四条 具备交易所竞价市场交易权限的会员可以从事大宗交易业务。

第五条 法人客户可通过会员代理参与大宗交易，个人客户暂不允许参与大宗交易。进行大宗交易的买方客户与卖方客户中，至少有一方是交易所金融类会员的自营交易账户。

第六条 大宗交易的单笔交易金额一般不低于人民币 200 万元。特殊情况需与交易所联系并说明具体原因，否则交易所可不予受理。

第七条 交易所用于交易合约的发行、风险处置、错单处理等特

殊用途的大宗交易，不受市场准入规定的限制。

第三章 申报与成交

第八条 大宗交易品种

允许进行现货大宗交易的合约为交易所的现货实盘合约。

第九条 申报时间

大宗交易的申报时间为每个交易日的夜市 20:00 至次日 15:45。

第十条 申报方式

大宗交易买卖双方分别通过交易所会员服务系统进行大宗交易申报，客户由会员代理申报。大宗交易申报由系统自动匹配，在交易所复核通过后成交。

第十一条 申报要素

大宗交易的申报要素包括交易品种、交易价格、交易手数，买卖双方各自的客户代码、席位代码、会员代码等。

大宗交易的价格应在当日合理价格范围内，交易对手须在大宗交易申报单备注栏对不在当日合理范围内的申报价格进行情况说明。交易所有权利不复核价格偏离合理范围且未做正当情况说明的大宗交易申报单。

第十二条 申报流程

（一）申报单提交。具有大宗交易权限的会员用户登录会员服务系统，根据交易双方达成的交易协议录入大宗交易信息，完成提

交后申报单显示“已提交”状态。提交大宗交易申报时，会员须准备相应的资金和实物库存。

（二）申报单匹配。大宗交易双方完成申报单提交后，系统自动进行匹配，交易要素匹配一致的，该笔申报单显示“已配对”状态。

（三）申报单复核。“已配对”的大宗交易申报单由交易所审核，复核通过后交易完成，会员服务系统中该笔大宗交易申报单更新为“已成交”状态。

第十三条 交易所在每交易日的上午11:00-11:30和下午15:00-15:45，分两次对已提交的大宗交易申报单进行审核，审核通过后执行复核操作。

会员因特殊原因，在会员服务系统提交大宗交易申报单后需要立即成交的，可向交易部工作人员说明情况，申请即时复核。

第十四条 交易所对复核通过的大宗交易成交单，实行交易账户的可用资金与客户实物库存实时过户。大宗交易申报单审核未通过或成交复核未通过的，该笔申报失效，会员可在大宗交易申报时段内，补充要求的申报材料或补足资金、库存后重新申报。

第十五条 大宗交易达成后会员可在会员服务系统查询大宗交易成交单。大宗交易成交信息不在竞价实时行情中显示。

第十六条 大宗交易成交与该合约的现货实盘竞价成交为同一合约的不同成交方式，交易所按现货实盘合约、现货即期合约、延期交收合约、定价交易合约、报价交易合约、询价交易合约的顺序进行资

金清算和实物交收结算。大宗交易成交与该现货实盘合约的竞价成交具有相同的法律效力。

第十七条 交易所大宗交易手续费的收取标准，遵照交易所现货实盘合约交易手续费收费标准。

第四章 违规处理

第十八条 会员通过交易所会员服务系统进行大宗交易业务，应遵守交易所发布的相关规范性文件。

第十九条 大宗交易参与会员应建立、健全内部管理制度和风险防范机制，采取切实有效的措施对洗钱、利益输送等违法违规行为进行监控和管理，遵守国家法律法规，遵守交易所及行业监管机构的有关规定。

第二十条 大宗交易参与会员应保守其在参与大宗交易过程中所知悉的对手方的交易信息以及其他未公开的信息，未经对方事先书面许可，不得用于大宗交易以外目的或向第三方透露、供其使用，根据法律法规或有权机关要求应当进行披露的情形除外。

第二十一条 大宗交易参与会员违反本办法及其相关规则规定，或存在交易所认定的其他异常交易行为，交易所可参照《上海黄金交易所违规处理办法》等有关规定对其采取相应处理措施。

第五章 附 则

第二十二条 因不可抗力及计算机系统软硬件故障等不可归责于交易所的原因导致大宗交易申报、复核、资金清算或实物交割业务延误或无法正常进行，交易所不承担相关责任。

第二十三条 本办法以中文书写，任何其他语种和版本之间产生歧义的，以最近的中文文本为准。

第二十四条 本办法未尽事项按照交易所相关制度执行。

第二十五条 本办法解释权属于交易所。

第二十六条 本办法自发布之日起实施。