上海国际黄金交易中心业务管理办法

(修订稿)

目 录

- 第一章 总 则
- 第二章 会员与客户管理
- 第三章 交易接入
- 第四章 结算业务
- 第五章 交割业务
- 第六章 风险控制
- 第七章 附 则

第一章 总则

第一条 为规范国际投资者的交易行为，保护国际投资者的合法权益，根据《上海黄金交易所章程》、《上海黄金交易所交易规则》、《上海黄金交易所交割细则》、《上海黄金交易所结算细则》、《上海黄金交易所风险控制管理办法》和《上海国际黄金交易中心有限公司章程》等规章制度制定本办法。

第二条 上海国际黄金交易中心有限公司（以下简称国际中心）作为上海黄金交易所（以下简称交易所）的全资子公司，在交易所授权下，对交易所国际会员（以下简称国际会员）进行集中管理，并为国际会员和国际客户提供服务。

第三条 国际会员、国际客户从事交易所业务活动，应当遵守中华人民共和国有关法律、法规、规章以及交易所和国际中心的章程、规则、办法等各项规定。

第二章 会员与客户管理

第四条 国际会员是指在中华人民共和国境外、港澳台地区及中国（上海）自由贸易试验区等交易所认可的其他地区登记注册的，依照中华人民共和国有关法律、法规及交易所章程的有关规定，经交易所审核批准，在交易所从事贵金属业务的法人机构或其它营业机构。

第五条 申请成为交易所国际会员，须符合交易所规定的条件，并按交易所要求向交易所提供申请材料，由交易所审批。

第六条 国际客户是指通过具备代理业务资格的国际会员代理进入交易所交易的投资者。国际会员应按中国人民银行反洗钱规定履行反洗钱、反恐怖融资义务。

第七条 国际客户须在具备代理业务资格的国际会员处办理开

户登记。国际会员应按照“了解你的客户”、“了解你的业务”和“尽职审查”的三原则，严格履行反洗钱、反恐怖融资和反逃税的责任及义务，对其代理的客户进行必要的适当性审核，并将其开户材料报交易所备案。客户开户材料须符合交易所的相关规定。

第八条 国际会员在受理客户开户申请时，应向客户充分揭示交易风险，并签署委托代理合同。国际会员应当加强对代理客户履行反洗钱、反恐怖融资和反逃税责任及义务的管理与指导，以确保相关责任及义务落到实处。

第三章 交易接入

第九条 国际会员在交易所进行自营交易或代理客户参与交易，除经国际中心书面审批同意外，其交易须通过国际中心系统接入交易所系统，国际中心为国际会员提供必要的系统接口。

国际中心对国际会员、国际客户参与交易所各合约交易设置不同权限，具体的权限根据交易所及国际中心公告执行。国际会员可为自身或其代理的客户向国际中心申请调整相关合约的交易权限，国际中心审批后执行。

第十条 国际中心有权在交易所公布的各合约保证金率的基础上，依据国际会员不同的信用资质加收不同的保证金。

第十一条 国际中心对国际会员发送的交易指令审核验证的内容包括但不限于国际会员资金、库存、持仓以及指令其他内容是否符合交易所及国际中心的有关规定等。

第十二条 国际中心按照时间优先的原则及时、准确地处理国际会员的有效指令，并及时将委托回报和成交结果反馈给国际会员。

第十三条 国际会员的最终成交结果以国际中心的结算结果

为准。国际会员必须履行其成交结果对应的义务,并承担相应的责任。

第十四条 国际会员对委托回报和成交结果有异议的,应当在下一交易日开市前及时以电子邮件、传真等书面方式向国际中心提出。

第十五条 国际中心对国际会员及其客户的资金、成交、持仓、库存等信息负有保密义务,相关法律、法规或司法机关、行政主管部门要求公开的除外。

第四章 结算业务

第十六条 依据交易所的授权,国际中心对国际会员及其客户的资金进行专项管理,严格限定资金的使用范围。国际会员及其客户的资金仅用于交易所的交易和结算,由国际中心遵照中华人民共和国有关法律法规的相关规定,依据相关业务结算结果办理资金结算。

第十七条 国际中心实行集中、净额、分级的原则进行清算和结算。

“集中”是指交易所为会员提供集中清算和履约担保服务,国际中心对国际会员集中办理结算业务;

“净额”是指国际中心对国际会员在交易所的成交额进行轧差处理;

“分级”是指国际中心负责对国际会员实行清算,国际会员负责对其代理客户实行清算。

第十八条 国际中心对国际会员按席位进行清算和结算。

第十九条 国际中心根据交易结果对国际会员的货款、保证金、盈亏、手续费等应收或应付资金及国际会员或国际客户的应收或应付实物进行清算:

(一) 对当日进行实物交割的合约计算应收或应付货款和实物;

(二)对当日成交的现货即期合约以成交价与结算价的差额计算当日盈亏,并按合约净买卖量以当日结算价计算保证金;

(三)对延期交收合约和履约担保型询价交易合约按逐日盯市制度以当日结算价或交易所指定的基准价计算交易保证金、当日盈亏、延期补偿费等有关款项;

(四)对当日成交的定价交易合约以当日午盘的集中定价价格作为合约的当日结算价计算当日盈亏,并按合约净买卖量以当日结算价计算保证金;

(五)以相应合约结算价格计算应收或应付实物溢短差重量、金额;

(六)按规定的标准计算手续费、仓储费、运保费等费用;

(七)对其他合约的清算按国际中心相关规定执行。

第二十条 国际中心和国际会员间的资金必须经国际中心指定的保证金存管银行结算专用账户往来。

第二十一条 国际会员须在保证金存管银行根据开展业务的性质分别开立自营席位结算专用账户、代理席位结算专用账户、自有资金结算专用账户进行资金结算。

第二十二条 国际中心对国际会员存入国际中心结算专用账户的资金实行分账户管理,为每一国际会员的每一席位设立明细账户,明细账户根据业务性质分为自营保证金账户、代理保证金账户和自有资金账户,分别与国际会员指定的自营席位结算专用账户、代理席位结算专用账户和自有资金结算专用账户建立绑定对应关系,按日序时登记核算每一席位资金转入和转出、盈亏、交易保证金、手续费等。

第二十三条 清算完成后,国际中心根据清算结果组织结算,从相关国际会员或国际客户账户扣划其应付资金或实物,向相关国际会

员或国际客户账户划付其应收资金或实物。国际会员或国际客户应当确保其资金账户或实物账户在结算前备足结算所需的资金或实物。结算一旦完成不可撤销。

第二十四条 所有国际会员及其客户在交易所系统中成交的合约交易必须通过国际中心统一结算。国际中心对国际会员的自营和代理交易分别结算。

第二十五条 日终结算完成后，国际会员可以从国际交易系统及时取得国际中心提供的结算数据和结算单据。国际会员应当做好核对工作，并妥善保存相关数据，保存时间5年以上；但对有关交易有争议的，应当保存至该争议消除时为止；涉及监管机构或交易所调查的，应当保存至调查工作结束。

国际中心将结算数据和结算单据等在国际交易系统内成功发送视为已送达国际会员。

第二十六条 国际会员如对结算数据和结算单据有异议，应在下一交易日开市前三十分钟以书面形式通知国际中心。如在规定时间内未对结算数据和结算单据提出异议，则视作国际会员已认可结算数据和结算单据的正确性。

第二十七条 国际中心根据上述结算业务规则制定《上海国际黄金交易中心结算管理办法》。

第五章 交割业务

第二十八条 交易所设立国际板指定仓库，为国际会员、国际客户提供实物仓储、出入库交接等服务。国际板指定仓库接受中华人民共和国海关监管。

第二十九条 竞价交易合约、定价交易合约、询价交易合约与交

割品种对应关系参见《上海黄金交易所合约及交割品种对应表》，用于主板合约交割的交割品种为主板交割品种，用于国际板合约交割的交割品种为国际板交割品种。

第三十条 国际会员及国际客户入库资格需经交易所批准。经交易所批准的国际会员及其客户可在国际板指定仓库存入国际板交割品种；经批准的国际会员及其客户可在给定的额度内在国际板指定仓库存入主板交割品种。国际会员及其客户不可在主板指定仓库存入实物。

国际会员及其客户可在国际板指定仓库提取国际板交割品种，不可在主板指定仓库提取实物。

第三十一条 国际会员及其客户不可参与铂金及白银实物交割。

第六章 风险控制

第三十二条 国际中心按照《上海黄金交易所风险控制管理办法》及本业务管理办法，协助交易所对国际会员及其客户进行风险管理。

第三十三条 国际中心执行交易所风险管理措施时，各项措施的实施规则和标准与交易所保持一致。

第三十四条 当日结算完成后，国际会员的货币结算准备金余额低于规定的最低标准时，该结算结果即视为国际中心向国际会员发出的追加保证金通知，追加保证金的数额为国际会员的货币结算准备金余额与规定的最低标准之差额。

第三十五条 国际会员出现第三十四条情况，应当在下一交易日开市前补足货币资金至结算准备金最低标准。未能补足的，若货币结算准备金余额不小于零，国际中心有权对国际会员采取限制延期交收合约开仓和限制现货实盘合约买入等限制性措施；若货币结算准备金

余额小于零，国际中心有权按照《上海黄金交易所风险控制管理办法》的相关规定对国际会员采取强行平仓措施。在采取强行平仓措施前，国际中心应履行通知义务。

第三十六条 国际中心按规定对国际会员采取强行平仓措施时，强行平仓发生的费用及损失由国际会员承担，因市场原因无法强行平仓造成的损失扩大部分也由国际会员承担，国际会员不得以强行平仓的时机未能选择最佳价位和数量为由要求国际中心承担责任。

第三十七条 国际中心在实施强行平仓后，应当及时将有关情况告知国际会员。强行平仓结果随国际会员结算数据一起发送。

第三十八条 当市场出现较大风险，交易所按规定对会员采取限制出金措施时，国际中心有权根据交易所的要求限制国际会员出金。

第三十九条 国际会员及其客户达到交易所规定的大户报告标准时，应当通过国际中心向交易所提交相关报告。

第四十条 国际中心按照交易所的要求对国际会员及其客户执行风险警示制度。

第四十一条 除交易所规定的异常交易行为外，国际会员或其客户的交易出现以下情形之一的，国际中心认定为异常交易行为：

（一） 通过与关联的会员或客户进行大量关联交易，可能影响交易价格或误导其他客户进行交易的行为；

（二） 以资金或实物优势，垄断市场资源，操纵市场价格或扰乱市场秩序的交易行为；

（三） 以参与贵金属交易为借口，违反国家进出口管理、人民币跨境业务管理或外汇管理制度，进行实物或资金非法跨境转移的行为；

(四) 利用交易所的交易平台,进行洗钱、恐怖融资、逃税等非法活动的行为;

(五) 交易所和国际中心认定的其他情形。

第四十二条 国际会员及其客户进行交易应当遵守中华人民共和国法律、法规、规章和交易所、国际中心业务规则,自觉规范交易行为。国际中心对国际会员及其客户的交易行为进行监控,发现异常交易情形的,有权对相关国际会员或客户采取相应的监管措施。

第四十三条 国际会员应当切实履行对其客户交易行为的管理职责,密切关注客户的交易行为,不得纵容、诱导、怂恿、支持客户进行异常交易。国际会员发现客户在交易过程中出现异常交易行为的,应当予以提醒、劝阻和制止,并及时向国际中心或交易所报告;经劝阻、制止无效的,国际会员可以采取提高交易保证金、限制开仓、强行平仓、限制交易额度、限制出入金、拒绝客户委托或者终止代理关系等措施。

第四十四条 国际会员或客户出现异常交易行为的,交易所和国际中心可以采取电话提醒、要求报告情况、要求提交书面承诺、列入监管关注名单、约见谈话、限制开仓、限期平仓、强行平仓等措施;情节严重的,交易所和国际中心可以根据《上海黄金交易所风险控制管理办法》、《上海黄金交易所违规处理办法》等规定采取公开谴责、暂停交易、取消会员资格等监管措施;涉嫌违反中华人民共和国法律、法规、规章,构成犯罪的,移送司法机关立案调查。

第七章 附则

第四十五条 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。

第四十六条 本办法涉及的相关各方开展交易所业务的相关事务均适用中华人民共和国法律。

第四十七条 本办法解释权属于交易所。

第四十八条 本办法自发布之日起实施。