

上海黄金交易所现货交易规则

目 录

第一章	总则
第二章	上市品种与合约
第三章	代理与自营
第四章	报价与成交
第五章	现货实盘交易与现货即期交易
第六章	现货延期交收交易
第七章	风险管理
第八章	清算业务
第九章	交割业务
第十章	发票管理
第十一章	异常交易处理
第十二章	异常情况处理
第十三章	信息管理
第十四章	监督管理
第十五章	争议与调解
第十六章	附 则
附表 1	上海黄金交易所交易时间明细表
附表 2	上海黄金交易所合约参数表
附表 3	上海黄金交易所交易权限表

第一章 总 则

第一条 为规范市场交易行为，保护交易当事人的合法权益和社会公众利益，根据中国人民银行《上海黄金交易所业务监督管理规则》和《上海黄金交易所章程》制定本规则。

第二条 上海黄金交易所（以下简称“交易所”）按照公开、公平、公正和诚实信用的原则，组织经中国人民银行批准的黄金及其他贵金属的集中交易、清算和实物统一配送。

第三条 交易所按照价格优先、时间优先的交易原则，采取自由报价、撮合成交的方式组织上市品种的竞价交易，交易所为竞价交易提供集中履约担保。

交易所按照信用交易等原则组织询价交易（询价交易规则另行制定）。

第四条 本规则适用交易所内的一切交易活动，交易所、会员、客户、指定仓库、指定结算银行及其工作人员必须遵守本规则。

第五条 交易所授权上海国际黄金交易中心有限公司（以下简称“国际中心”）对国际会员进行集中管理，并为国际会员及其客户提供服务。

国际中心、国际会员及其客户、国际中心指定结算银行等其他相关参与者除须遵守本规则外，还须遵守国际中心的相关业务规则。

第二章 上市品种与合约

第六条 交易所上市的品种有黄金（Au）、白银（Ag）、铂金（Pt），以及其他经中国人民银行批准的品种。

第七条 交易日为每周一至周五（国家法定节假日及交易所公告的休市日除外），每一交易日的交易时间安排，详见《上海黄金交易

所交易时间明细表》(附表1)。

交易时间的调整根据交易所的公告执行。

第八条 根据交易方式不同,交易所挂盘合约分为现货实盘合约、现货即期合约、现货延期交收合约及其他经中国人民银行批准的合约。

现货实盘合约包括: Au50g、Au100g、Au99.99、Au99.95、Au99.5、Pt99.95、iAu100g、iAu99.99、iAu99.5;

现货即期合约包括: Ag99.9 和 Ag99.99;

现货延期交收合约包括: Au (T+D)、Au (T+N1)、Au (T+N2)、mAu (T+D)、Ag (T+D)。

第九条 根据交割地点的不同,交易所挂盘合约分为主板合约和国际板合约。主板合约包括 Au50g、Au100g、Au99.99、Au99.95、Au99.5、Pt99.95、Ag99.9、Ag99.99、Au (T+D)、Au (T+N1)、Au (T+N2)、mAu (T+D) 和 Ag (T+D); 国际板合约包括 iAu100g、iAu99.99 和 iAu99.5。

新增合约的挂盘根据交易所的公告执行。

第十条 合约的主要参数包括: 交易品种、合约代码、交易方式、交易单位、报价单位、最小变动价位、每日价格最大波动限制、最大单笔报价量、最小单笔报价量、交易时间、最低交易保证金、清算方式、交割品种、交割方式、交割时间、交割地点、交易手续费、交割费等。

具体合约参数参见《上海黄金交易所合约参数表》(附表2)。

调整合约参数根据交易所的公告执行。

第三章 代理与自营

第十一条 交易所实行会员制组织形式。会员直接参与交易所交

易，客户必须通过会员的代理参与交易。

第十二条 客户参与交易所的交易，必须事先在具备相应代理业务资格的会员处办理开户登记。

第十三条 按照代理会员的不同，客户分为国内客户和国际客户。国内会员代理的客户称为国内客户，国际会员代理的客户称为国际客户。按照其主体类型的不同，客户又可分为法人客户和自然人客户。

第十四条 交易所对国内客户、国际客户参与各合约交易设置不同权限，具体参见《上海黄金交易所交易权限表》（附表3）。

上述权限的变更根据交易所公告执行。

第十五条 会员在受理客户开户申请时，应当向客户充分揭示交易风险，并认真评估客户风险承受能力。

第十六条 会员在接受客户开户申请时，双方须签署委托代理协议。

第十七条 交易所实行客户交易编码管理制度，会员必须为客户申请交易编码。会员和客户必须遵守一户一码的制度，不得混码交易。

第十八条 会员不得以任何形式向客户作获利保证、分担风险或分享盈利。

第十九条 会员可参照交易所对会员收取的交易保证金比例，根据自身风险管理要求，确定代理业务的交易保证金比例。会员收取客户的交易保证金必须高于交易所对会员收取的交易保证金比例。

第二十条 会员的自营业务、代理业务都必须通过交易所的交易系统完成，不得私下对冲。

第二十一条 会员自营业务与代理业务的会计账目必须严格分开。

客户保证金属于客户所有，严禁会员以任何形式挪用客户资金。

第二十二条 每日交易结束，会员可通过交易所获取成交记录。会员应及时核对，如有异议应在下一交易日开市前以书面形式向交易所提出。在规定时间内，若会员未对成交结果提出异议，即视为其已确认交易结果正确。

第二十三条 客户对交易结果有异议的应向代理会员提出，由代理会员在委托代理协议约定的时间内予以核实确认。

第二十四条 会员在每日交易收市后应当为客户准备交易结算报告。客户有权按照委托代理协议约定的时间和方式知悉交易结算报告的内容。

第二十五条 会员应按照客户的委托进行交易，并为客户保守交易秘密。

第二十六条 会员对其自营交易及代理交易先行承担全部责任，会员在交易中违约的，应当承担违约责任。交易所先以违约会员的保证金、自有资金及该会员在交易所的其他资产承担该会员的违约责任；上述资金仍不足的，交易所应当以交易所风险基金和交易所自有资金代为承担；交易所以交易所风险基金和交易所自有资金代为承担责任后，由此取得对违约会员的相应追偿权。对于守约方，交易所应当向守约方支付补偿金的形式代为履约。

客户对自己委托的交易负全部责任，客户有向交易所反映委托交易业务中存在问题的权利。

第二十七条 会员负责客户的交易风险控制。对交易保证金不足的客户，会员有权对客户持仓实施强行平仓。会员执行强行平仓应当符合双方协议规定的标准和条件，并以约定的方式通知客户。强行平仓造成的损失，由客户承担。

第二十八条 国内会员进行自营交易必须在交易所指定的结算银行单独开立自营专用账户，国际会员进行自营交易必须在国际中心指定的结算银行单独开立自营专用账户，存入足够的资金。会员自营交易通过自营交易编码进行。

第四章 报价与成交

第二十九条 交易所各类合约交易价格，是指其交割品种在指定仓库交货的含增值税价格。

第三十条 黄金、铂金的报价单位为人民币元/克，最小变动价位为 0.01 元；白银的报价单位为人民币元/千克，最小变动价位为 1 元。

第三十一条 交易所的交易单位为“手”，报价必须以“一手”的整数倍进行，不同交易合约每手代表的商品数量，详见《上海黄金交易所合约参数表》（附表 2）。

第三十二条 报价必须要素齐全，包括席位号、客户交易编码、合约代码、买卖方向、开/平仓、手数、价格等。

第三十三条 交易所实行价格涨跌停板制度。当某一合约在某一交易日收盘前 5 分钟内出现只有停板价位的买入（卖出）申报、没有停板价位的卖出（买入）申报，或者一有卖出（买入）申报就成交、但未打开停板价位的情况时，交易所确定该合约在该交易日收市时出现涨（跌）停板，并按《上海黄金交易所风险控制管理办法》的有关规定处理。

第三十四条 交易所实行保证金制度。该制度所提及的保证金是指会员按规定标准交纳的资金，用于清算和保证履约。

第三十五条 保证金分为清算准备金和交易保证金。

清算准备金是指会员为了交易清算在交易所或国际中心保证金

账户中预先存入的资金，是未被合约占用的资金。清算准备金的最低金额根据交易所或国际中心的相关规则确定。

交易保证金是指会员在交易所或国际中心保证金账户中存入的确保合约履行的资金，是已被合约占用的资金。交易所可根据市场情况相应调整交易保证金比例。

第三十六条 现货实盘合约以当日第一笔成交的价格作为开盘价。现货即期合约和现货延期交收合约的开盘价通过集合竞价的方式产生，开盘集合竞价没有产生开盘价的，以当日第一笔成交的价格作为开盘价。

第三十七条 集合竞价采用最大成交量、最小剩余量原则，高于集合竞价产生价格的买入申报全部成交；低于集合竞价产生价格的卖出申报全部成交；等于集合竞价产生的价格的买入或卖出申报，根据买入申报量和卖出申报量的多少，按少的一方的申报量成交。

第三十八条 开盘集合竞价中的未成交申报单自动参与开盘后的竞价交易。

第三十九条 报价在一个交易日内有效，报价尚未成交前可以在集合竞价申报阶段或连续交易时段进行撤单。撤单指令只对原报价未成交部分有效，若该笔报价已全部成交，则该指令无效。在交易暂停期间，交易所计算机系统不接受任何报价或撤销报价指令。

第四十条 交易系统对报价指令按照价格优先、时间优先的原则撮合成交。当买入价大于、等于卖出价则自动撮合成交。撮合成交价等于买入价（bp）、卖出价（sp）和前一成交价（cp）三者中居中的一个价格。即：

当 $bp \geq sp \geq cp$ ，则：最新成交价 = sp

$bp \geq cp \geq sp$ ， 最新成交价 = cp

$cp \geq bp \geq sp$, 最新成交价 = bp

开盘价的 cp 为上日收盘价，新挂盘合约的 cp 为挂盘基准价。

第四十一条 新上市合约的挂盘基准价由交易所确定并提前公布。挂盘基准价是确定新上市合约第一天交易涨跌停板幅度的依据。

第四十二条 收盘价是某合约当日最后五笔成交的加权平均价。

收盘价是现货实盘合约计算下一交易日涨跌停板幅度的基准。

第四十三条 结算价是某合约整个交易日成交价格按成交量的加权平均价。当日无成交价格的，以上一交易日的结算价作为当日结算价。

结算价是现货即期合约和延期交收合约计算下一交易日涨跌停板幅度的基准，是延期交收合约进行当日未平仓合约盈亏清算的依据。

第四十四条 交易行情中的成交量是指某一合约在当日交易期间成交的双边数量；持仓量是指客户所持有的未平仓延期交收合约的双边数量；交收量是指某一延期交收合约实物交收配对成功的双边数量。

第四十五条 交易所按成交金额的一定比例收取交易手续费，各合约的手续费率根据交易所公告执行。交易所可以根据市场状况调整不同合约的交易手续费率。

第五章 现货实盘交易与现货即期交易

第四十六条 现货实盘合约交易，买方报价时必须有全额资金（其中，铂金现货实盘合约买入报价时需另加 2%的实物溢短差清算准备金），卖方报价时交易账户中必须有相应的实物。报价后，对应的资金或实物即被冻结。

报价成交后，买入的黄金实物可用于当日或以后交易日的卖出，

也可以申请提货；买入的铂金实物不能卖出，只能申请提货；卖出实物所得货款的 90%可用于本交易日内的交易，余款在交易所日终清算时结算。

第四十七条 现货即期交易：

（一）客户进行买报价或卖报价时，必须有 20%的保证金。

（二）以成交当日为 T+0 日，日终清算时对买入量和卖出量进行轧差，轧差后的净头寸按当日结算价冻结 20%的保证金，同时对成交价与结算价的差额进行清算。在 T+2 交易日日终清算时，按 T+0 日的结算价，对 T+0 日的净头寸执行实物交割。

（三）交易所对 T+2 日不能履行实物交割的一方按即期合约交割违约处理，根据违约金比例向违约方收取违约部分的违约金，根据违约金比例向守约方支付被违约部分的补偿金，同时实物交割终止。违约金比例为 20%。

（四）实物交割后卖方的保证金转换为交付增值税专用发票的担保金。

第六章 现货延期交收交易

第四十八条 现货延期交收交易是指以支付保证金的形式在交易所集中买卖某种延期交收合约的交易活动，客户可以选择合约成交当日交割，也可以延期交割，同时引入延期补偿费机制来调节实物供求矛盾。

第四十九条 延期交收交易按买卖方向和交易性质分为：买入开仓报价、卖出平仓报价、卖出开仓报价、买入平仓报价。

买入开仓报价是指买入一定数量的延期交收合约以增加多头持仓的报价；卖出平仓报价是指对多头持仓进行反向的卖出交易以了结多头合约的报价。

卖出开仓报价是指卖出一定数量的延期交收合约以增加空头持仓的报价；买入平仓报价是指对空头持仓进行反向的买入交易以了结空头合约的报价。

第五十条 延期交收合约的平仓顺序，按照先开先平的原则处理。

第五十一条 交易所分别限定会员和客户可持有某延期交收合约的最大单边持仓数量。当会员某一方向的持仓达到限仓上限时，其名下的所有客户只能进行平仓报价，不能进行开仓报价。

当客户某一方向的持仓达到限仓上限时，该客户只能进行平仓报价，不能进行开仓报价。

第五十二条 延期交收合约的实物交割采用交收申报制度，交收申报时间参见《上海黄金交易所交易时间明细表》（附表1）。在每日的交收申报时段，多头持仓可进行收货申报、空头持仓可进行交货申报。交收申报结束前，客户可以撤销申报。

第五十三条 客户交收申报时，应按相应合约最小交收申报量的整数倍进行申报，最小交收申报量参见《上海黄金交易所合约参数表》（附件2）。申报交收需准备好相应的实物或资金，交收申报配对成功，在当日清算时完成资金的收付和实物所有权的转移。

第五十四条 延期补偿费是客户延期交收时，为了融通资金或实物所发生的成本，延期补偿费的支付方向根据交货申报和收货申报的数量对比确定。

当某延期交收合约空头申报的交货量小于多头申报的收货量时，当日延期补偿费支付方向为“空付多”，清算时该合约的全部空头持仓，按一一对应的方式向全部的多头持仓支付延期补偿费。

当某延期交收合约空头申报的交货量大于多头申报的收货量时，当日延期补偿费支付方向为“多付空”，清算时该合约的全部多

头持仓，按一一对应的方式向全部的空头持仓支付延期补偿费。

当交货申报量等于收货申报量时，不发生延期补偿费支付。

第五十五条 延期补偿费有按日收付和定期收付两种收付方式。

按日收付是指合约的延期补偿费在每个交易日收付，收付数量为从本交易日到下一交易日前的自然日天数（含节假日）。

定期收付是指合约的延期补偿费在指定的延期补偿费收付日收付，其他交易日不收付，收付数量为 1。

延期补偿费=持仓量×当日结算价×延期补偿费率×收付数量

各延期交收合约的延期补偿费收付方式、延期补偿费率参见《上海黄金交易所合约参数表》（附表 2）。

延期补偿费收付方式、延期补偿费率等发生变更的按照交易所公告执行。

第五十六条 当交货申报量与收货申报量不相等时，市场通过中立仓申报调节实物交收的矛盾。

第五十七条 中立仓是指为了获取延期补偿费而参与实物交收时生成的持仓。当交收申报的收货量大于交货量时，客户以交实物的形式进行中立仓申报，交货成功后，按当日结算价生成相应的多头持仓；当交收申报的交货量大于收货量时，客户以收实物的形式进行中立仓申报，收货成功后，按当日结算价生成空头持仓。中立仓免收手续费。

第五十八条 客户在中立仓申报时间段内，按照当日交收申报结果确定的中立仓方向进行中立仓申报，申报时交易所按合约当日结算价冻结生成相应反向持仓所需的保证金。中立仓申报时间段参见《上海黄金交易所合约参数表》（附件 2）。

中立仓申报量应为最小交收申报量的整数倍。中立仓申报结束

前，客户可以撤销申报。

第五十九条 交收申报和中立仓申报按时间优先的原则进行集中撮合配对，配对成功的申报在当日清算时按合约当日结算价完成实物交割。交收配对成功但清算时没有相应的可提资金或可用库存，按交割违约处理。

第六十条 交易所按合约当日结算价和交易所公布的违约金比例计算违约金，违约部分不足1手按1手计。

如果出现交收申报违约，交易所向违约方收取违约金，向守约方支付补偿金，同时合约终止。如果中立仓申报违约，交易所向违约方收取违约金，向守约方支付补偿金，守约方的合约终止；违约方在交收配对时生成的中立仓依然为有效持仓。

第六十一条 延期交收合约允许连续持有，直至平仓或完成交收。

交易所可以对连续持有时间超过规定期限的超期持仓征收超期费。超期费的收取按照交易所相关细则执行。

第七章 风险管理

第六十二条 交易所风险管理实行保证金制度、涨跌停板制度、延期补偿费制度、超期费制度、限仓制度、大户报告制度、强行平仓制度和风险警示制度等措施。

第六十三条 交易所实行涨跌停板制度。涨跌停板幅度由交易所设定。交易所可以根据市场情况调整不同合约的涨跌停板幅度。

第六十四条 交易所实行限仓制度。限仓是指交易所规定会员或客户对某一延期交收合约单边持仓的最大数量。交易所对会员及客户分别设定限仓。

第六十五条 交易所实行大户报告制度。当会员或客户的某一延期交收合约持仓达到交易所规定的持仓报告标准或者交易所指定必

须报告时，会员或客户应向交易所或国际中心报告其资金、头寸、交收意向等情况。

交易所可以根据市场风险状况，制定并调整持仓报告标准。

第六十六条 交易所实行强行平仓制度。对会员或客户存在未按照规定及时追加保证金、持仓超过交易所限仓标准未及时自行减仓等违规行为，以及交易所规定的其他情形的，交易所或国际中心有权采取强行平仓措施。

强行平仓盈利部分按照有关规定处理，发生的费用、损失及因市场原因无法强行平仓造成的损失扩大部分由相关会员或者客户承担。

第六十七条 当延期交收合约价格出现同方向连续涨跌停板或市场风险明显增大时，交易所可以采取调整涨跌停板幅度、提高交易保证金及按规定原则减仓等措施释放交易风险。采取风险控制措施后仍然无法释放风险时，交易所应宣布进入异常情况，由交易所理事会决定采取进一步的风险控制措施。

第六十八条 会员无法履约时，交易所或国际中心有权采取下列保障措施：

- （一） 暂停开仓业务；
- （二） 按规定强行平仓，并用平仓后释放的保证金履约赔偿；
- （三） 依法处置质押物；
- （四） 用该会员的会员资格费或会员资格转让所得款项或其他资金履约赔偿；
- （五） 交易所或国际中心代其履约后，依法向会员追偿。

第六十九条 有根据认为会员或者客户违反交易所业务规则并且对市场正在产生或者将产生重大影响的，为防止违规行为后果进一

步扩大，交易所或国际中心可以对该会员或者客户采取下列临时处置措施：

- （一） 限制入金；
- （二） 限制出金；
- （三） 限制开仓；
- （四） 提高保证金标准；
- （五） 限期平仓；
- （六） 强行平仓。

第七十条 上述有关风险管理制度的具体规定，见《上海黄金交易所风险控制管理办法》。

第八章 清算业务

第七十一条 本章适用于在交易所内进行的资金清算活动。交易所授权国际中心为国际会员提供清算服务，具体清算规则由国际中心另行制定。

第七十二条 交易所实行“集中、净额、分级”的资金清算原则。

“集中”是指交易所对会员统一办理资金清算和划付；

“净额”是指会员就其在交易所买卖的成交差额与交易所进行清算；

“分级”是指交易所负责对会员实行清算，会员负责对其代理客户实行清算。

第七十三条 交易所对现货实盘交易和现货即期交易采取钱货两讫制度进行清算。对现货延期交收交易实行当日无负债清算制度和交易保证金制度。

第七十四条 交易所和会员间资金必须由交易所指定的结算银行，且通过专用账户往来。

第七十五条 交易所实行 T+0 资金清算，T+1 资金结算，即交易所在交割或清算时，扣减买方会员的清算准备金，增加卖方会员的清算准备金，完成资金清算；在 T+1 日的 9:00 至 15:30，交易所根据会员申请将资金划入会员在结算银行的专用账户。

第七十六条 所有在交易所交易系统中成交的合约必须通过交易所进行统一清算。交易所对会员的自营和代理交易分别清算。

第七十七条 当日盈亏为平仓盈亏与持仓盈亏之和。

第七十八条 会员清算准备金余额低于交易所规定的最低余额，应该追加资金，追加的资金必须在下一个交易日开市前补足。若清算准备金未按时补足，交易所按《上海黄金交易所风险控制管理办法》的相关规定处理。

第七十九条 交易所和开展代理业务的会员要分别对会员和代理客户的资金进行详细的会计记录，按日序时登记核算会员和客户资金转入、资金转出、盈亏、交易保证金、手续费等。

第八十条 当日交易结束后，交易所对每一会员的盈亏、交易手续费、交易保证金等款项进行清算。清算完成后，会员可通过会员服务系统获得相关的清算数据。

第八十一条 会员对清算数据有异议，应在下一交易日开市前向交易所提出。如在规定时间内会员没有对清算数据提出异议，则视作会员已认可清算数据的正确性。

第八十二条 会员每天应及时取得交易所提供的清算数据和清算有关的会计凭证，做好核对工作，并将之妥善保存，保存时间不少于 5 年；对超过上述时限仍有争议的，应当保存至该争议消除时为止。

第八十三条 交易所根据上述清算业务规则制订《上海黄金交易

所现货交易资金清算实施细则》。

第九章 交割业务

第八十四条 交易所提供实物登记托管、交割清算、质量认证、物流配送、质押过户和租借过户等业务服务。

第八十五条 实物交割是指为履行交易合约，交易所进行的相应实物所有权的转移行为。

第八十六条 交易所实物交割实行一户一码制，实物交割处理到每个会员及客户的实物账户。

第八十七条 会员及客户的现货实盘交易、现货即期交易、现货延期交收交易的实物实行同一账户管理。

第八十八条 交易所实物交割品种分为主板交割品种和国际板交割品种。主板交割品种用于主板合约的交割，国际板交割品种用于国际板合约的交割。

第八十九条 交易所主板交割品种有：标准重量 1 千克、成色不低于 99.99%的金锭；标准重量 3 千克、成色不低于 99.95%的金锭；标准重量 12.5 千克、成色不低于 99.5%的金锭；标准重量 0.05 千克、成色不低于 99.99%的金条；标准重量 0.1 千克、成色不低于 99.99%的金条；标准重量分别为 0.5 千克、1 千克、2 千克、3 千克、4 千克、5 千克、6 千克，成色不低于 99.95%的铂锭；标准重量 15 千克、成色不低于 99.9%的银锭；标准重量 15 千克、成色不低于 99.99%的银锭等。

交易所国际板交割品种有：标准重量 1 千克、成色不低于 99.99%的金锭；标准重量 12.5 千克、成色不低于 99.5%的金锭；标准重量 0.1 千克、成色不低于 99.99%的金条。

新增交割品种按照交易所的公告执行。

第九十条 交易所交割的金锭、金条、铂锭及银锭为交易所认定的及交易所认可的国际相关市场认定的合格供货商生产的标准实物。

第九十一条 会员及客户参与实物交割，若出现交割违约，交易所根据违约金比例向违约方收取违约部分的违约金，同时交割终止。违约金比例根据交易所公告执行。

第九十二条 会员及客户应按规定足额交纳仓储费、运保费、交割费、质押登记费、租借登记费、出入库费等费用。

第九十三条 会员及客户存入或提取的实物以实际重量清算，实际重量与标准重量的差额用资金进行二次清算。二次清算价格，按该合约出库日或交割日的结算价计算。

第九十四条 会员及客户对所提取的实物如有质量异议，应在规定的时间内由会员向交易所提出。

第九十五条 交易所设立主板指定仓库和国际板指定仓库。交易所指定仓库负责为会员及客户办理实物存储、出入库手续，并收取仓储费及出入库费。

第九十六条 交易所根据上述交割业务规则制订《上海黄金交易所现货交易交割细则》。

第十章 发票管理

第九十七条 国内会员和国内客户参与主板合约交易，根据财政部和国家税务总局有关黄金、铂金税收政策，黄金、铂金交易和实物交割涉及结算发票和增值税专用发票的，其发票开具管理按如下规定执行。

（一）结算发票的名称为：上海黄金交易所发票。结算发票由交易所设制，由国家税务机关监印。

(二) 增值税专用发票名称为：上海增值税专用发票。增值税专用发票由交易所向税务主管机关申领，发票使用量由税务主管机关根据实际需要审核确定。

(三) 法人客户通过交易所进行黄金、铂金交易，由交易所按实际成交价格分别向买卖各方（自然人客户除外）开具结算发票。卖方须按实际成交价格向交易所开具普通发票，并据此换取结算发票（结算联）；发生实物交割（指实物已由买方提取出库）的，由交易所的税务主管机关向具有增值税一般纳税人资格的买方按实际成交价格代开增值税专用发票（发票联、记账联由黄金交易所留存，买方收取抵扣联）。增值税专用发票中的单价、金额和税额的计算公式分别为：

单价=实际成交单价÷（1+增值税税率）

金额=数量×单价

税额=金额×税率

实际成交价格为所提取黄金的买方、卖方按规定报价方式所成交的价格，按后进先出法原则确定，不包括交易手续费、仓储费等费用。

(四) 买方会员和法人客户应将交易所开具的结算发票（发票联）作为会计记账凭证进行财务核算；买方会员和法人客户（提货方）取得税务机关代开的增值税专用发票（抵扣联），仅作为核算进项税额的凭证。

(五) 对交易交割环节中产生的手续费、仓储费、运保费等费用，会员和法人客户可以交易系统生成的费用清算单为会计核算凭证，交易所不单独开具收费凭证。

(六) 增值税专用发票的开具时限、交付方式等其他规定，以

及违规处理，按《上海黄金交易所会员发票管理办法》执行。

第九十八条 白银交易不开具结算发票，国内会员或国内客户的开仓和平仓交易，以系统提供的交易结算单为会计核算凭证，发生实物交割的，增值税专用发票的管理按《上海黄金交易所会员发票管理办法》执行。

第九十九条 国内会员及其客户参与国际板合约交易的，交易所仅开具结算发票。发生实物交割，交割后转入关内并存入主板指定仓库的，由交易所向具有进口资格的国内会员或客户开具《上海黄金交易所成交单》，作为海关申报凭证。

第一百条 禁止一切利用黄金、铂金等合约交易套取增值税专用发票、虚开发票等违反国家税收政策与《上海黄金交易所会员发票管理办法》规定的行为，违者一经查实，即取消其会员资格。

第一百零一条 国际会员及其客户参与交易，交易所不开具结算发票，也不开具增值税专用发票，以交易系统生成的成交记录作为会计核算凭证。

第十一章 异常交易处理

第一百零二条 交易所对市场交易进行监控，发现交易出现异常情形的，有权对相关会员或者客户采取相应监管措施。

第一百零三条 客户参与交易应当遵守法律、法规和交易所业务规则，接受交易所监管及会员对其交易行为的合法合规性管理，自觉规范交易行为。

第一百零四条 会员应当切实履行客户交易行为管理职责，及时发现、及时报告、及时制止客户的异常交易行为；积极防范客户在交易中可能出现的异常交易行为，不得纵容、诱导、怂恿、支持客户进行异常交易。

第一百零五条 交易出现以下情形之一的，交易所认定为异常交易行为：

（一） 以自己为交易对象，大量或者多次进行自买自卖；

（二） 实际控制关系账户之间大量或多次进行互为对手方的交易；

（三） 日内出现频繁申报并撤销申报，可能影响交易价格或误导其他客户进行交易的行为；

（四） 日内出现大量或多次大额申报并撤销申报，可能影响交易价格或者误导其他客户进行交易的行为；

（五） 实际控制关系账户合并持仓超过交易所持仓限额规定；

（六） 特定交易对手之间大量或者多次进行高买低卖交易；

（七） 通过计算机程序自动批量下单、快速下单影响交易所系统安全或者正常交易秩序；

（八） 交易所认定的其他情形。

第一百零六条 会员应当密切关注客户的交易行为，发现客户在交易过程中出现第一百零五条所列异常交易行为之一的，应当予以提醒、劝阻和制止，并及时向交易所报告；经劝阻、制止无效的，会员可以采取提高交易保证金、限制开仓、拒绝客户委托或者终止代理关系等措施。

第一百零七条 会员或客户出现第一百零五条所列异常交易行为之一的，交易所可以采取电话提醒、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，交易所可以根据本规则及《上海黄金交易所风险控制管理办法》、《上海黄金交易所违规违约处理办法》

的规定采取相应监管措施或者纪律处分措施；涉嫌违反法律、法规、规章的，交易所提请相关部门进行立案调查。

第一百零八条 交易所对存在异常交易行为的客户采取有关监管措施或者做出相关书面决定的，通过客户所在会员向客户发出，会员应当及时与相关客户取得联系，告知交易所或国际中心的相关监管信息和书面决定，保留有关证据，并采取有效措施，规范客户交易行为。

第一百零九条 对异常交易以及违规违约的其他处理措施，按照《上海黄金交易所违规违约处理办法》的规定执行。

第十二章 异常情况处理

第一百一十条 在交易过程中，如果出现以下情形，交易所可以宣布进入异常情况，采取紧急措施化解风险：

（一）地震、水灾、火灾、战争、罢工等不可抗力或技术故障等不可归责于交易所的原因导致交易无法正常进行；

（二）会员无法完成结算或交割，对市场正在产生或者将产生重大影响；

（三）出现连续单边市的情况并采取相应措施后仍未化解风险；

（四）交易所规定的其他情况。

第一百一十一条 出现第一百一十条第（一）项异常情况时，交易所可以采取调整开市收市时间、暂停交易的紧急措施；出现第一百一十条第（二）、（三）、（四）项异常情况时，理事会可以决定采取调整保证金、调整涨跌停板幅度、限期平仓、强行平仓、限制出金、调整开市收市时间、暂停交易等紧急措施。

第一百一十二条 因异常情况交易所采取相应措施造成的损失，交易所不承担责任。

第一百一十三条 交易所宣布进入异常情况并决定采取紧急措施，必须及时报告中国人民银行，并予以公告。

第一百一十四条 交易所宣布进入异常情况并决定暂停交易时，暂停交易的期限不得超过 3 个交易日，但经中国人民银行批准延长的除外。

第十三章 信息管理

第一百一十五条 交易所对当日市场行情以及必要的统计资料等其他有关信息予以发布。

第一百一十六条 交易所发布的信息包括：

交易合约的开盘价、最高价、最低价、最新价、收盘价、结算价、涨跌、成交量、成交金额、持仓量、交收量以及其他需要公布的信息。

第一百一十七条 会员可以通过交易所或国际中心对自身的各种信息进行查询。

第一百一十八条 交易所的市场交易信息归交易所所有。未经许可，任何机构和个人不得用于商业用途。

第一百一十九条 交易所、国际中心、会员、指定交割仓库、指定结算银行不得发布虚假的或带有误导性质的信息。

第一百二十条 交易所、国际中心、会员、指定交割仓库、指定结算银行不得泄露业务中获取的商业秘密。

交易所可以向有关监管部门或其他相关单位提供相关信息，并执行相应的保密规定。

第十四章 监督管理

第一百二十一条 交易所依据本规则及有关规定，对涉及交易的

业务活动进行监督管理。国际中心被授权代表交易所对国际会员及其客户的业务活动进行监管。

第一百二十二条 交易所和国际中心监督管理的主要内容是：

（一）监督、检查市场政策、法规和交易规则的落实情况，控制市场风险；

（二）监督、检查各会员交易行为；

（三）了解和掌握各会员的财务、资信状况；

（四）监督、检查各指定仓库和指定结算银行与交易有关的业务活动；

（五）调解、处理交易纠纷，调查处理各种违规案件；

（六）协助司法机关、行政执法机关依法执行公务；

（七）对其他违背“公开、公平、公正”原则、制造市场风险的行为进行监控。

第一百二十三条 交易所和国际中心可以每年对会员遵守交易所业务规则的情况进行抽查，必要时将抽查结果上报中国人民银行。

第一百二十四条 交易所和国际中心发现有涉嫌违规行为的，应立案调查。

第一百二十五条 交易所和国际中心履行监督管理职责时可按有关规定行使调查、取证等权利，会员应当配合。

第一百二十六条 会员、客户、指定仓库和指定结算银行应当接受交易所和国际中心对其相关业务的监督管理。对于不如实提供资料、隐瞒事实真相、故意回避等不协助或妨碍交易所和国际中心工作人员行使职权的，交易所和国际中心可按有关规定采取必要的限制性措施或处罚。

第一百二十七条 会员、客户、指定仓库和指定结算银行在从事

相关业务时涉嫌重大违规，交易所和国际中心立案调查的，为防止违规行为后果进一步扩大，交易所和国际中心可采取相应措施。

第一百二十八条 对交易过程中发生的重大问题，经理事会决定，可由会员代表、交易所或国际中心工作人员及有关人士组成特别调查委员会。特别调查委员会存续期间，按本规则行使监督管理权。特别调查委员会应实行回避制度。

第一百二十九条 交易所和国际中心工作人员不能正确履行监督管理职责的，会员、客户、指定仓库和指定结算银行有权向交易所投诉、举报。经查证属实的，应严肃处理。

第一百三十条 交易所依据《上海黄金交易所违规违约处理办法》对违规违约行为进行处理。

第十五章 争议与调解

第一百三十一条 会员、客户、指定仓库和指定结算银行之间因交易而发生纠纷时，可以自行协商解决，也可向交易所申请调解。

第一百三十二条 提请交易所调解的当事人，应提出书面调解申请。交易所的调解意见，经当事人确认，在调解意见书上签章后生效。

第一百三十三条 当事人也可以依法向仲裁机构申请仲裁或向人民法院提起诉讼。

第十六章 附 则

第一百三十四条 交易所可根据本规则制定相关细则。

第一百三十五条 本规则以中文书写，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。

第一百三十六条 本规则解释权属于上海黄金交易所理事会。

第一百三十七条 本规则的制定和修改须经会员大会通过，按有关规定向中国人民银行报告。

第一百三十八条 本规则自发布之日起实施。

附表 1：上海黄金交易所交易时间明细表^(注)

A. 普通交易日的交易时间明细表

周一	周一开市	上周五 19:45
	开盘集合竞价	上周五 19:50-19:59
	夜市连续交易时段	上周五 20:00-上周六 2:30
	交易暂停	上周六 2:30-周一 9:00
	上午时段连续交易	9:00-11:30
	交易暂停	11:30-13:30
	下午时段连续交易	13:30-15:30
	交收申报	15:00-15:30
	收盘	15:30
	中立仓申报	15:31-15:40
	交收申报撮合配对	15:40
	收市	15:45
周二	周二开市	周一 19:45
	开盘集合竞价	周一 19:50-19:59
	夜市连续交易时段	周一 20:00-周二 2:30
	交易暂停	2:30-9:00
	上午时段连续交易	9:00-11:30
	交易暂停	11:30-13:30
	下午时段连续交易	13:30-15:30
	交收申报	15:00-15:30
	收盘	15:30
	中立仓申报	15:31-15:40
	交收申报撮合配对	15:40
	收市	15:45
周三	周三开市	周二 19:45
	开盘集合竞价	周二 19:50-19:59
	夜市连续交易时段	周二 20:00-周三 2:30
	交易暂停	2:30-9:00
	上午时段连续交易	9:00-11:30

	交易暂停	11:30-13:30
	下午时段连续交易	13:30-15:30
	交收申报	15:00-15:30
	收盘	15:30
	中立仓申报	15:31-15:40
	交收申报撮合配对	15:40
	收市	15:45
周四	周四开市	周三 19:45
	开盘集合竞价	周三 19:50-19:59
	夜市连续交易时段	周三 20:00-周四 2:30
	交易暂停	2:30-9:00
	上午时段连续交易	9:00-11:30
	交易暂停	11:30-13:30
	下午时段连续交易	13:30-15:30
	交收申报	15:00-15:30
	收盘	15:30
	中立仓申报	15:31-15:40
	交收申报撮合配对	15:40
	收市	15:45
周五	周五开市	周四 19:45
	开盘集合竞价	周四 19:50-19:59
	夜市连续交易时段	周四 20:00-周五 2:30
	交易暂停	2:30-9:00
	上午时段连续交易	9:00-11:30
	交易暂停	11:30-13:30
	下午时段连续交易	13:30-15:30
	交收申报	15:00-15:30
	收盘	15:30
	中立仓申报	15:31-15:40
	交收申报撮合配对	15:40
	收市	15:45

B. 节假日（除周六、周日）后第一个交易日的交易时间明细表

节 假 日 后 第 一 个 交 易 日	开市	8:45
	开盘集合竞价	8:50-8:59
	上午时段连续交易	9:00-11:30
	交易暂停	11:30-13:30
	下午时段连续交易	13:30-15:30
	交收申报	15:00-15:30
	收盘	15:30
	中立仓申报	15:31-15:40
	交收申报撮合配对	15:40
	收市	15:45

注：

1、普通交易日的交易时间安排按表 A 执行，节假日（除周六、周日）后第一个交易日交易时间安排按表 B 执行。

2、若周末交易所系统需要重大维护，交易所可以决定周五夜市临时休市，并提前五个工作日发布公告。

附表 2：上海黄金交易所合约参数表

Au99.95 合约参数表

交易品种	黄金
合约代码	Au99.95
交易方式	现货实盘交易
交易单位	1000 克/手
报价单位	元（人民币）/克
最小变动价位	0.01 元/克
每日价格最大波动限制	上一交易日收盘价±30%
最小单笔报价量	1 手
最大单笔报价量	1000 手
交易时间	上午：9:00 至 11:30，下午：13:30 至 15:30，夜间：20:00 至次日 02:30
清算方式	钱货两讫
交割品种	标准重量 3 千克、成色不低于 99.95% 的金锭
交割方式	实物交割
交割时间	T+0
质量标准	经交易所认定的可提供标准金锭企业生产的符合交易所金锭 SGE B1-2002 质量标准的实物，及伦敦金银市场协会（LBMA）认定的合格供货商生产的标准实物。
交割地点	交易所指定仓库
交易手续费	成交金额的万分之三点五
交割费	0
上市日期	2002 年 10 月 30 日

Au99.99 合约参数表

交易品种	黄金
合约代码	Au99.99
交易方式	现货实盘交易
交易单位	10 克/手
报价单位	元（人民币）/克
最小变动价位	0.01 元/克
每日价格最大波动限制	上一交易日收盘价±30%
最小单笔报价量	1 手
最大单笔报价量	10000 手
交易时间	上午：9:00 至 11:30，下午：13:30 至 15:30，夜间：20:00 至次日 02:30
清算方式	钱货两讫
交割品种	标准重量 1 千克、成色不低于 99.99% 的金锭
交割方式	实物交割
交割时间	T+0
质量标准	经交易所认定的可提供标准金锭企业生产的符合交易所金锭 SGEB1-2002 质量标准的实物，及伦敦金银市场协会（LBMA）认定的合格供货商生产的标准实物。
交割地点	交易所指定仓库
交易手续费	成交金额的万分之三点五
交割费	0
上市日期	2002 年 10 月 30 日

Au99.5 合约参数表

交易品种	黄金
合约代码	Au99.5
交易方式	现货实盘交易
交易单位	12.5 千克/手
报价单位	元（人民币）/克
最小变动价位	0.01 元/克
每日价格最大波动限制	上一交易日收盘价±30%
最小单笔报价量	1 手
最大单笔报价量	200 手
交易时间	上午：9:00 至 11:30，下午：13:30 至 15:30，夜间：20:00 至次日 02:30
清算方式	钱货两讫
交割品种	标准重量 12.5 千克、成色不低于 99.50% 的金锭
交割方式	实物交割
交割时间	T+0
质量标准	经交易所认定的可提供标准金锭企业生产的符合交易所金锭 SGEB1-2002 质量标准的实物，及伦敦金银市场协会（LBMA）认定的合格供货商生产的标准实物。
交割地点	交易所指定仓库
交易手续费	成交金额的万分之三点五
交割费	0
上市日期	2013 年 6 月 6 日

Au100g 合约参数表

交易品种	黄金
合约代码	Au100g
交易方式	现货实盘交易
交易单位	100 克/手
报价单位	元（人民币）/克
最小变动价位	0.01 元/克
每日价格最大波动限制	上一交易日收盘价±30%
最小单笔报价量	1 手
最大单笔报价量	1000 手
交易时间	上午：9:00 至 11:30，下午：13:30 至 15:30，夜间：20:00 至次日 02:30
清算方式	钱货两讫
交割品种	标准重量 0.1 千克、成色不低于 99.99% 的金条
交割方式	实物交割
交割时间	T+0
质量标准	经交易所认定的可提供标准金条企业生产的符合交易所金条 SGEB2-2004 质量标准的实物，及伦敦金银市场协会（LBMA）认定的合格供货商生产的标准实物。
交割地点	交易所指定仓库
交易手续费	成交金额的万分之三点五
交割费	0
上市日期	2006 年 12 月 25 日

Au50g 合约参数表

交易品种	黄金
合约代码	Au50g
交易方式	现货实盘交易
交易单位	50 克/手
报价单位	元（人民币）/克
最小变动价位	0.01 元/克
每日价格最大波动限制	上一交易日收盘价±30%
最小单笔报价量	1 手
最大单笔报价量	1000 手
交易时间	上午：9:00 至 11:30，下午：13:30 至 15:30，夜间：20:00 至次日 02:30
清算方式	钱货两讫
交割品种	标准重量 0.05 千克、成色不低于 99.99% 的金条
交割方式	实物交割
交割时间	T+0
质量标准	经交易所认定的可提供标准金条企业生产的符合交易所金条 SGB2-2004 质量标准的实物，及伦敦金银市场协会（LBMA）认定的合格供货商生产的标准实物。
交割地点	交易所指定仓库
交易手续费	成交金额的万分之三点五
交割费	0
上市日期	2004 年 6 月 28 日

Pt99.95 合约参数表

交易品种	铂金
合约代码	Pt99.95
交易方式	现货实盘交易
交易单位	1000 克/手
报价单位	元（人民币）/克
最小变动价位	0.01 元/克
每日价格最大波动限制	上一交易日收盘价±30%
最小单笔报价量	1 手
最大单笔报价量	1000 手
交易时间	上午：9:00 至 11:30，下午：13:30 至 15:30，夜间：20:00 至次日 02:30
清算方式	钱货两讫
交割品种	标准重量分别为 0.5 千克、1 千克、2 千克、3 千克、4 千克、5 千克、6 千克、成色不低于 99.95% 的铂锭
交割方式	T+0 实物交割
交割时间	T+0
质量标准	伦敦铂钯市场协会（LPPM）、东京工业品交易所（TOCOM）、纽约商品交易所（NYMEX）认可的或经交易所认定的合格铂锭供货商生产的标准实物。
交割地点	交易所指定仓库
交易手续费	成交金额的万分之四
交割费	0
上市日期	2003 年 7 月 30 日

Ag99.9 合约参数表

交易品种	白银
合约代码	Ag99.9
交易方式	现货即期交易
交易单位	15 千克/手
报价单位	元（人民币）/千克
最小变动价位	1 元/千克
每日价格最大波动限制	上一交易日结算价±10%
最小单笔报价量	1 手
最大单笔报价量	1000 手
保证金比例	20%
交易时间	上午：9:00 至 11:30，下午：13:30 至 15:30，夜间：19:50 至次日 02:30
清算方式	钱货两讫
交割品种	标准重量 15 千克、成色不低于 99.9% 的银锭
交割方式	实物交割
交割时间	T+2
质量标准	经交易所认定的可提供标准银锭企业生产的符合国家银锭 GB/T4135-2002 标准的实物，及伦敦金银市场协会（LBMA）认定的合格供货商生产的标准实物。
交割地点	交易所指定仓库
交易手续费	成交金额的万分之二
交割费	1 元/千克
开票方式	卖方给买方开具增值税票
违约金比例	20%
上市日期	2006 年 10 月 30 日

Ag99.99 合约参数表

交易品种	白银
合约代码	Ag99.99
交易方式	现货即期交易
交易单位	15 千克/手
报价单位	元（人民币）/千克
最小变动价位	1 元/千克
每日价格最大波动限制	上一交易日结算价±10%
最小单笔报价量	1 手
最大单笔报价量	1000 手
保证金比例	20%
交易时间	上午：9:00 至 11:30，下午：13:30 至 15:30，夜间：19:50 至次日 02:30
清算方式	钱货两讫
交割品种	标准重量 15 千克、成色不低于 99.99% 的银锭
交割方式	实物交割
交割时间	T+2
质量标准	经交易所认定的可提供标准银锭企业生产的符合国家银锭 GB/T4135-2002 标准的实物，及伦敦金银市场协会（LBMA）认定的合格供货商生产的标准实物。
交割地点	交易所指定仓库
交易手续费	成交金额的万分之二
交割费	1 元/千克
开票方式	卖方给买方开具增值税票
违约金比例	20%
上市日期	2010 年 4 月 26 日

Ag (T+D) 合约参数表

交易品种	白银
合约代码	Ag (T+D)
交易方式	现货延期交收交易
交易单位	1 千克/手
报价单位	元 (人民币) / 千克
最小变动价位	1 元/千克
每日价格最大波动限制	上一交易日结算价±7%
最小单笔报价量	1 手
最大单笔报价量	2000 手
合约期限	连续交易
最低交易保证金	9%
交易时间	上午：9:00 至 11:30，下午：13:30 至 15:30，夜间：19:50 至次日 02:30
延期补偿费收付日	按自然日逐日收付
延期补偿费率	合约市值的万分之二/日
最小交收申报量	1 手
交收申报时间	15:00—15:30
中立仓申报时间	15:31—15:40
超期持仓期限	按交易所公告执行
超期费率	按交易所公告执行
交易手续费	成交金额的万分之二
违约金比例	合约价值的 8%
清算方式	当日无负债清算制度
实物交收方式	交收申报制
交割方式	实物交割
交割品种	标准重量 15 千克、成色不低于 99.99% 的银锭
交割时间	交收申报配对成功的当日
交割地点	交易所指定仓库
交割费	1 元/千克
上市日期	2006 年 10 月 30 日

Au (T+D) 合约参数表

交易品种	黄金
合约代码	Au (T+D)
交易方式	现货延期交收交易
交易单位	1000 克/手
报价单位	元 (人民币) / 克
最小变动价位	0.01 元/克
每日价格最大波动限制	上一交易日结算价±5%
最小单笔报价量	1 手
最大单笔报价量	1000 手
合约期限	连续交易
最低交易保证金	6%
交易时间	上午：9:00 至 11:30，下午：13:30 至 15:30，夜间：19:50 至次日 02:30
延期补偿费收付日	按自然日逐日收付
延期补偿费率	合约市值的万分之二/日
最小交收申报量	1 手
交收申报时间	15:00—15:30
中立仓申报时间	15:31—15:40
超期持仓期限	按交易所公告执行
超期费率	按交易所公告执行
交易手续费	成交金额的万分之二
违约金比例	合约价值的 8%
清算方式	当日无负债清算制度
实物交收方式	交收申报制
交割方式	实物交割
交割品种	基准交割品种为标准重量 3 千克、成色不低于 99.95% 的金锭。标准重量 1 千克、成色不低于 99.99% 的金锭可替代交割。
交割时间	交收申报配对成功的当日
交割地点	交易所指定仓库
交割费	0
上市日期	2004 年 8 月 16 日

Au (T+N1)、Au (T+N2) 合约参数表

交易品种	黄金
合约代码	Au (T+N1)、Au (T+N2)
交易方式	现货延期交收交易
交易单位	100 克/手
报价单位	元 (人民币) / 克
最小变动价位	0.05 元/克
每日价格最大波动限制	上一交易日结算价±6%
最小单笔报价量	1 手
最大单笔报价量	10000 手
合约期限	连续交易
交易保证金	7%
交易时间	上午：9:00 至 11:30，下午：13:30 至 15:30，夜间：19:50 至次日 02:30
延期补偿费收付日	Au (T+N1)：6 月 15 日；Au (T+N2)：12 月 15 日，遇节假日提前到前一交易日。
延期补偿费率	合约市值的百分之六
最小交收申报量	1 手
交收申报时间	15:00—15:30
中立仓申报时间	15:31—15:40
超期持仓期限	按交易所公告执行
超期费率	按交易所公告执行
交易手续费	成交金额的万分之二
违约金比例	合约价值的 8%
清算方式	当日无负债清算制度
实物交收方式	交收申报制
交割方式	实物交割
交割品种	交割品种为标准重量 1 千克、成色不低于 99.99% 的金锭。
交割时间	交收申报配对成功的当日
交割地点	交易所指定仓库
交割费	0
上市日期	2007 年 11 月 5 日

mAu(T+D) 合约参数表

交易品种	黄金
合约代码	mAu(T+D)
交易方式	现货延期交收交易
交易单位	100 克/手
报价单位	元(人民币)/克
最小变动价位	0.01 元/克
每日价格最大波动限制	上一交易日结算价±5%
最小单笔报价量	1 手
最大单笔报价量	2000 手
合约期限	连续交易
最低交易保证金	6%
交易时间	上午：9:00 至 11:30，下午：13:30 至 15:30，夜间： 19:50 至次日 02:30
延期补偿费收付日	按自然日逐日收付
延期补偿费率	合约市值的万分之二/日
最小交收申报量	1 手
交收申报时间	15:00 - 15:30
中立仓申报时间	15:31 - 15:40
超期持仓期限	按交易所公告执行
超期费率	按交易所公告执行
交易手续费	成交金额的万分之二
违约金比例	合约价值的 8%
清算方式	当日无负债清算制度
实物交收方式	交收申报制
交割方式	实物交割
交割品种	标准重量 1 千克、成色不低于 99.99% 的标准金锭。
交割时间	交收申报配对成功的当日
交割地点	交易所指定仓库
交割费	0
上市日期	2014 年 1 月 2 日

iAu99.5 合约参数表

交易品种	黄金
合约代码	iAu99.5
交易方式	现货实盘交易
交易单位	12.5 千克/手
报价单位	元（人民币）/克
最小变动价位	0.01 元/克
每日价格最大波动限制	上一交易日收盘价±30%
最小单笔报价量	1 手
最大单笔报价量	200 手
交易时间	上午：9:00 至 11:30，下午：13:30 至 15:30，夜间： 20:00 至次日 02:30
清算方式	钱货两讫
交割品种	标准重量 12.5 千克、成色不低于 99.5% 的金锭
交割方式	实物交割
交割时间	T+0
质量标准	经交易所认定的可提供标准金锭企业生产的符合交易所金锭 SGE B1-2002 质量标准的实物，及伦敦金银市场协会（LBMA）认定的合格供货商生产的标准实物。
交割地点	交易所国际板指定仓库
交易手续费	成交金额的万分之三点五
交割费	0
上市日期	2014 年 9 月 19 日

iAu99.99 合约参数表

交易品种	黄金
合约代码	iAu99.99
交易方式	现货实盘交易
交易单位	10 克/手
报价单位	元（人民币）/克
最小变动价位	0.01 元/克
每日价格最大波动限制	上一交易日收盘价±30%
最小单笔报价量	1 手
最大单笔报价量	10000 手
交易时间	上午：9:00 至 11:30，下午：13:30 至 15:30，夜间：20:00 至次日 02:30
清算方式	钱货两讫
交割品种	标准重量 1 千克、成色不低于 99.99% 的金锭
交割方式	实物交割
交割时间	T+0
质量标准	经交易所认定的可提供标准金锭企业生产的符合交易所金锭 SGEB1-2002 质量标准的实物，及伦敦金银市场协会（LBMA）认定的合格供货商生产的标准实物。
交割地点	交易所国际板指定仓库
交易手续费	成交金额的万分之三点五
交割费	0
上市日期	2014 年 9 月 19 日

iAu100g 合约参数表

交易品种	黄金
合约代码	iAu100g
交易方式	现货实盘交易
交易单位	100 克/手
报价单位	元（人民币）/克
最小变动价位	0.01 元/克
每日价格最大波动限制	上一交易日收盘价±30%
最小单笔报价量	1 手
最大单笔报价量	1000 手
交易时间	上午：9:00 至 11:30，下午：13:30 至 15:30，夜间：20:00 至次日 02:30
清算方式	钱货两讫
交割品种	标准重量 0.1 千克、成色不低于 99.99% 的金条
交割方式	实物交割
交割时间	T+0
质量标准	经交易所认定的可提供标准金条企业生产的符合交易所金条 SGEB2-2004 质量标准的实物，及伦敦金银市场协会（LBMA）认定的合格供货商生产的标准实物。
交割地点	交易所国际板指定仓库
交易手续费	成交金额的万分之三点五
交割费	0
上市日期	2014 年 9 月 19 日

附表 3:

上海黄金交易所交易权限表^(注)

板块	品种	合约代码	指定交割 仓库	国内会员 国内客户	国际会员 国际客户
主板	黄金	Au99.95	主板指定 仓库	1、允许交易、交割； 2、允许出入库。	1、允许交易、交割； 2、不允许出入库。
		Au99.99			
		Au100g			
		Au99.5			
		Au(T+D)			
		Au(T+N1)			
		Au(T+N2)			
		mAu(T+D)			
	Au50g	1、不允许交易、交割； 2、不允许出入库。			
	白银				Ag99.9
					Ag99.99
Ag(T+D)		1、允许交易，不允许交割； 2、不允许出入库。			
铂金	Pt99.95	1、不允许交易、交割； 2、不允许出入库。			
国际板	黄金	iAu99.99	国际板指 定仓库	1、允许交易、交割； 2、不允许出入库。	1、允许交易、交割； 2、允许出入库。
		iAu99.5			
		iAu100g			

注：经批准的客户的特殊出入库权限另见交割细则。