

# 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：“结汇和购汇只涉及期货交易盈亏结算、缴纳手续费、交割货款或追缴结算货币资金缺口等与境内特定品种期货交易相关的款项”。

## 一、名词解释

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<sup>①</sup> - 当日特定品种手续费<sup>②</sup> + 特定品种当日权利金收支

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<sup>③</sup> - 当日已购汇金额<sup>④</sup>

---

注<sup>①</sup>：包括当日平仓盈亏、当日持仓盈亏等；

注<sup>②</sup>：包括交易手续费、交割手续费、期转现手续费、仓单转让手续费、有价证券保管费、行权/履约手续费等；

注<sup>③</sup>：包括入库押金等；

注<sup>④</sup>：为上一交易日结算后至当日收市前，境外结算交割委托人合计购汇金额。

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<sup>⑤</sup> + 当日入金

---

注<sup>⑤</sup>：含当日特定品种其他费用支出。

**5. 换汇截止日：**每月第四个周一(遇国定节假日顺延至下一交易日)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。

## 二、基本原则

**(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，但变更间隔不得少于6个月。

**(三) 业务类型：**包括日常结算换汇，交割货款换汇，和上期能源强制结汇三种类型。

**(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从事境内特定品种期货交易的实际结果自动计算，逐一生成当日可换汇额度。不同境外结算交割委托人的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。

### 三、日常结算换汇

#### (一) 业务场景

会员是否需要为境外结算交割委托人办理结汇或者购汇，按以下场景条件判断：

T日人民币结存	T日特定品种累计净盈亏	盈利货币	T日是否换汇截止日	T+1日 11:30 前，境外结算交割委托人是否提交有效购汇申请	T+1日 15:00 前，会员应否办理换汇
≥0	≥0	人民币	—	—	无需办理
		美元	是	—	应购汇
			否	提交	应购汇
				未提交	无需办理
	<0	—	—	—	无需办理
<0	—	—	—	—	应结汇，或入金人民币补足缺口

#### (二) 换汇截止日

如当日为换汇截止日，会员应于下一交易日 15:00 之前，按照当日可换汇额度，通过指定存管银行完成全部换汇业务的办理。

换汇截止日的下一交易日起，累计净盈亏从零开始逐日累计。

#### (三) 非换汇截止日

1. 当日为非换汇截止日，且可换汇额度大于零

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，或于下一交易日 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，根据保证金专用账户实际可用资金余额等情况，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的换汇明细数据。境外个人客户和境外机构客户的换汇申请应当分开发送。

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换汇业务数据报送的截止时间为每个交易日 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。

## **四、交割货款换汇**

上期能源境内特定品种期货实物交割业务包括标准交割、期转现和标准仓单转让。

### **(一) 买方货款结汇**

境外机构作为买方时，可以向会员支付美元作为交割货款。会员向指定存管银行办理结汇后，向上期能源支付人民币交割货款。

境外机构可以根据实际需要决定办理买方货款结汇的金额，但不得超出其实际应付货款金额。

买方会员应当在货款结算日 14:00 之前，完成买方交割货款结汇并向上期能源支付人民币交割货款。

### **(二) 卖方货款购汇**

境外机构作为卖方时，可选择以人民币或者美元形式收取交割货款。如选择美元，由会员向指定存管银行办理购汇后，支付给境外机构。

境外机构可以根据实际需要决定办理卖方货款购汇的金额，但不得超出其实际应收货款金额。

卖方会员应当在货款结算日下一交易日收市之前，完成卖方货款购汇。

### **(三) 交割货款换汇业务凭证**

交割货款换汇的业务凭证是上期能源标准仓单管理系统生成的交割结算单或者标准仓单转让结算单。会员应按照指定存管银行的要求，及时提供相关业务凭证，以满足银行对业务真实性、合规性的审核以及结售汇申报的要求。

## **五、 上期能源强制结汇**

参见上期能源《结算细则》第四十二条（略）。

## **六、 监督管理**

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部门核查，发现异常情况应及时报告交易所。

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事境内特定品种期货交易的实际结果，办理相关资金结汇和购汇手续。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

## 结购汇业务凭证

注 1		注 2		注 3	注 4		注 5							注 6						
结算日期	会员代码	会员名称	客户统一编码	客户类型	盈利币种	换汇方向	上一交易日特定品种累计净盈亏	当日特定品种盈亏	当日特定品种手续费	当日特定品种权利金收支	当日特定品种其他费用支出	当日已换汇金额合计	当日特定品种累计净盈亏	当日可换汇额度	美元结存	人民币结存	生成日期	生成时间	备注	

注1. “会员代码”：指会员在中国期货市场监控中心的统一编码；

注2. “客户类型”：0 - 自然人，1 - 机构；

注3. “盈利货币”：CNY - 人民币，USD - 美元；

注4. “换汇方向”：指当日可换汇额度的方向，0 - 结汇，1 - 购汇；

注5. “当日已换汇金额合计”：指上一交易日结算后至当日 15:00 之前，境外结算交割委托人合计换汇金额。购汇为正值，结汇为负值；

注6. “备注”：如当日为换汇截止日，或境外结算交割委托人当日累计净盈亏小于零，备注栏会相应体现。