

上海黄金交易所黄金租借基准费率业务规程（试行）

第一章 总 则

第一条 为促进黄金市场平稳发展，规范上海黄金交易所（下称“上金所”）黄金租借基准费率的形成机制、信息发布机制和监督管理机制，依据中国人民银行《黄金租借业务管理暂行办法（征求意见稿）》、《上海黄金交易所交易规则》、《上海黄金交易所交割细则》等，制定本规程。

第二条 本规程所指黄金租借基准费率是指由上金所按照一定规则对商业银行向其他金融机构借出黄金的自主报价进行计算确定的费率，该费率是单利、无担保费率。

第三条 上金所依据本规程确定和调整报价银行团成员（下称“报价行”），监督和管理租借费率运行，规范报价行行为。各

报价行应根据本规程开展黄金租借基准费率报价、信息发布等事项。

第二章 报价行构成

第四条 报价行由符合条件的商业银行组成。上金所可根据监管、市场变化及其他影响报价的因素确定报价行数量。

第五条 报价行应具备以下条件：

- （一）已参与上金所黄金租借业务两年以上；
- （二）具有稳定的黄金实物来源，且年租借量排名不低于前 20 名；
- （三）已建立合理公允的内部转移定价相关机制；
- （四）已获得上海银行间同业拆放利率基准报价行、两年内获得年度最佳租借参与机构等资质或奖励的商业银行优先考虑；
- （五）严格遵守国家及监管部门有关规定，租借业务运行合规稳健，能够积极参与黄金市场业务创新；
- （六）有利于开展报价工作的其它条件。

第六条 符合上述条件、并愿意成为报价行的商业银行可向上金所提交《上海黄金交易所黄金租借基准费率报价行申请表》（详见附件 1）及相关书面证明材料，经评估合格后可成为报价行。

第三章 报价行职责

第七条 报价行应基于市场实际情况开展当日基准费率报价，不得相互参照报价，保证报价独立性。

第八条 报价行应于每个交易日（以下简称每日）上午十点四十五分前完成报价，保证报价时效性。

第九条 报价行应每日按时对全部期限进行报价，保证报价完整性。

第十条 报价行应以年费率（%， $\text{Act}/360$ ， $T+0$ ）对各期限报价，报价保留 4 位小数，保证报价有效性。

第十一条 报价行应加强内控，建立流程清晰、权责明确的定价机制和报价程序，建立报价记录留存制度，做到专人专岗，保证报价规范性。

第十二条 报价行应建立应急机制，有效应对突发情况，确保每日按时报出各期限费率。

第四章 上金所职责

第十三条 上金所负责维护黄金租借基准费率系统，提供报价界面，确保黄金租借基准费率相关业务正常运行。

第十四条 上金所负责制定黄金租借基准费率相关规则并确定基准费率计算方案。上金所将接收到的每一期限费率数据，剔除最高、最低各 2 家报价，对其余报价进行算术平均计算，得出每一期限的费率。

第十五条 上金所负责按时对外发布黄金租借基准费率，同时公布各报价行的借出报价。

第十六条 上金所负责建立黄金租借基准费率形成和发布应急机制。如有报价行未报价，上金所根据已报的数据进行计算确定最终费率；如当日报价行数量少于 6 家，则使用上一交易日相应期限费率作为当日该期限基准费率。

第五章 监督管理

第十七条 报价行应恪尽职守，认真履行报价行职责。对于连续 12 个月内累计出现三次以上迟报、漏报、误报等情况的报价行，上金所有权撤销其报价行资格。

第十八条 上金所对报价行报价质量进行监督。如果报价行报价出现违反本规程第三章有关规定的情况，上金所将及时发出警告，要求其整改。对于整改不及时或累计出现三次警告的报价行，上金所有权撤销其报价行资格。

第十九条 报价行资格被撤销的商业银行三年内不能重新申请报价行资格。

第六章 附则

第二十条 上金所保留对黄金租借基准费率的所有权利。转发黄金租借基准费率信息，或使用黄金租借基准费率开发相关产品，须经上金所许可，并签订相关使用许可协议。

第二十一条 上金所努力维护黄金租借基准费率及其相关数据的及时性、准确性和完整性，但不承担因任何原因导致的黄金租借基准费率及其相关数据中断、遗漏或者错误而给使用相关数据的机构或个人造成的损失。

第二十二条 本规程最终解释权归上金所所有。

第二十三条 本规程自发布之日起实施。

附件 1:

上海黄金交易所黄金租借基准费率报价行资格申请表

申请日期:

申请单位名称			
申请单位客户代码			
申请单位地址			
申请单位邮编			
法定代表人		职务	
报价联系人		职务	
固定电话		传真	
手机		邮箱	
申请单位声明	本单位自愿申请上海黄金交易所黄金租借基准费率报价行资格, 坚决遵守国家法规、监管部门有关规定, 严苛自律、创新务实, 加强系统建设, 完善内部制度章程, 充足人员配置, 确保报价科学、严谨、稳定。		
申请单位法人代表签章:	申请单位签章:		
(以下内容由交易所填写)			
报价行资格生效日期:	相关部门 签章确认:		

注: 1. 此申请表有效期为三个月; 2. 请另附书面证明相关材料。