

银行衍生产品业务准入业务指南

序号	项目	内容
1	事项名称	银行衍生产品业务准入
2	设定依据	1. 《中华人民共和国外汇管理条例》（国务院 2008 第 532 号令）；2. 《银行办理结售汇业务管理办法》（中国人民银行令〔2014〕第 2 号）；3. 国家外汇管理局关于印发《银行办理结售汇业务管理办法实施细则》的通知（汇发〔2014〕53 号）。
3	申请条件	1. 取得即期结售汇业务资格；2. 有健全的衍生产品交易风险管理制度和内控制度及适当的风险识别、计量、管理和交易系统，配备开展衍生产品业务所需专业人员；3. 符合银行业监督管理部门有关金融衍生产品交易业务资格的规定。
4	办理对象及范围	银行
5	办理材料	<p>一、总行申请衍生品业务应提交以下材料：</p> <p>1. 申请报告、可行性报告及业务计划书；2. 衍生产品业务内部管理规章制度，至少包括以下内容：业务操作规程，包括交易受理、客户评估、单证审核等业务流程和操作标准；产品定价模型。包括定价方法和各项参数得选取标准及来源；风险管理制度，包括风险管理架构、风险模型指标及量化管理指标、风险缓释措施、头寸平盘机制；会计核算制度，包括科目设置和会计核算方法；统计报告制度，包括数据采集渠道和操作程序；3. 主管人员和主要交易人员名单、履历；4. 符合银行业监督管理部门有关金融衍生产品交易业务资格规定的证明文件。</p> <p>二、银行分支机构开办衍生产品业务，应提交以下材料：</p> <p>1. 申请报告；2. 上级有权机构授权文件；3. 本级机构业务筹办情况说明（包括但不限于人员配备、业务培训、内部管理）。银行可以一次申请开办全部衍生产品业务，或者分次申请远期和期权业务资格。取得远期业务资格后，银行可自行开办外汇掉期和货币掉期业务。</p>
6	办理时限	自受理申请之日起二十个工作日
7	办理程序	<p>一、银行总行（除政策性银行和全国性商业银行外的其他银行）申请办理衍生产品业务：</p> <p>1. 持规定材料向所在地国家外汇管理局分局申请；（如处于市（地、州、区）、县，应向所在地国家外汇管理局中心支局或支局申请，并逐级上报至外汇分局审批）；</p> <p>2. 外汇局对申请材料进行审核；</p> <p>3. 外汇局受理结果通过备案通知书方式下达。</p> <p>二、银行分支机构开办衍生产品业务：</p> <p>1. 申请银行持规定材料于开办业务前至少 20 个工作日向所在地外汇局书面报告；</p> <p>2. 外汇局核实并确认收到后即可开办业务。</p> <p>三、外国银行分行视同总行管理。</p> <p>外国银行拟在境内两家以上分行开办衍生产品业务的，可由其境内管理行统一向该行所在地外汇分局提交申请材料。</p>
8	费用情况	不收费
9	办理部门名称	国际收支处
10	办理地点及邮编	中国人民银行合肥中心支行大楼1307房间（洞庭湖路3366号）
11	办公时间	正常营业时间（周一至周五、节假日除外）
12	联系电话	0551-63691039
13	传真电话	0551-63642428
14	监督电话	0551-63691131
15	备注	