

上海黄金交易所询价期权业务管理办法（试行）

第一章 总 则

第一条 为规范询价市场交易行为，保护市场参与者的合法权益，根据《关于促进黄金市场发展的若干意见》（银发[2010]211号）、《上海黄金交易所业务监督管理规则》（银发[2011]93号）、《上海黄金交易所章程》、《上海黄金交易所询价业务交易规则》等有关规定，制定本管理办法（以下简称“本办法”）。

第二条 本办法所称上海黄金交易所询价期权业务（以下简称“询价期权业务”）是指符合上海黄金交易所（以下简称“交易所”）规定的机构，通过交易所询价系统进行登记和行权的期权业务。

第三条 本办法涉及期权的术语释义，参照《中国场外黄金衍生产品交易基本术语》的有关解释执行。

第二章 交易品种

第四条 询价期权业务的交易品种包括“OAU9999”和“OAU9995”等，行权方式为欧式期权，其行权合约分别为“询价 Au9999”和“询价 Au9995”即期或远期合约等。

第五条 “OAU9999”期权和“OAU9995”期权的到期结算方式包括“实物交割”和“现金结算”。现金结算期权的参考价格类型必须为交易所市场产生的价格。参考价格日期不得晚于行

权日；若参考价格产生时点晚于行权截止时间，则参考价格日期应早于行权日。

第六条 期权的交易单位（即每手重量）与其行权合约的交易单位一致。

第七条 新增或调整交易品种及其相关参数，按照交易所的公告执行。

第三章 市场准入

第八条 具有行权合约交易权限的市场参与者均可参与相应品种的询价期权业务。

第九条 客户由其会员代理参与询价期权业务。会员对其代理客户实行询价期权业务准入管理。

第十条 代理会员应建立健全代理业务内部管理规章制度，落实风险管控措施。

第十一条 会员的自营、代理上海黄金交易所询价期权业务应通过交易所完成登记和行权，不得私下对冲。

第十二条 会员对其自营期权交易承担履约责任，客户对其委托的期权交易承担履约责任。交易所不承继交易双方期权交易项下的权利和义务。

第四章 期权登记与行权

第十三条 期权成交后，由交易双方的会员向交易所提交加盖公章的《上海黄金交易所询价期权交易登记申请单》(附件 1)，交易所审核无误后进行登记。

第十四条 期权成交后，期权费由交易双方自行清算。

第十五条 交易所已登记期权的行权日当天行权截止时间之前，买方有权选择行权。如买方选择行权，则应于行权截止时间之前向交易所提交加盖公章的《上海黄金交易所询价期权交易行权申报单》(附件 2)，并于行权截止时间之前通知期权卖方。双方约定的行权截止时间不得晚于北京时间 15: 00。

第十六条 若买方行权日当天行权截止时间之前未行权，之后与卖方协商一致进行行权，买卖双方需不晚于实际结算日 15: 00 向交易所提交加盖公章的《上海黄金交易所询价期权交易行权申报单》。

第十七条 若实物交割期权行权，则交易所审核《上海黄金交易所询价期权交易行权申报单》无误后在交易所询价系统生成一笔该期权行权合约的实物交割即期或远期交易，买方为看涨期权的买方或看跌期权的卖方，卖方为看涨期权的卖方或看跌期权的买方，价格为期权行权价，数量为期权交易重量除以行权合约交易单位，到期日为期权结算日。

第十八条 若现金结算期权行权，则交易所审核《上海黄金交易所询价期权交易行权申报单》无误后在交易所询价系统生成一笔该期权行权合约的交易所清算的现金交割即期或远期交易，

买方为看涨期权的买方或看跌期权的卖方，卖方为看涨期权的卖方或看跌期权的买方，价格为期权行权价，数量为期权交易重量除以行权合约交易单位，到期日为期权结算日，参考价格类型为手工输入，参考价格为现金结算期权参考价格。

第十九条 期权行权生成的行权合约交易，纳入该合约交易统一清算交割。

第二十条 交易双方协商一致后撤销已登记的期权交易，应分别向交易所提交书面申请，注明撤销原因、需撤销的期权登记编号、本方会员号等信息。由交易所按相关程序操作。

第二十一条 交易双方协商一致后修改已登记的期权交易要素，应分别向交易所提交书面申请，注明修改原因、需修改的期权登记编号、本方会员号、修改前与修改后要素等信息。由交易所按相关程序操作。

第二十二条 交易所暂免收取会员期权登记手续费；交易所就期权行权生成的行权合约交易按该合约手续费率向会员收取手续费。会员可根据与客户之间代理委托协议的约定，向客户收取代理交易费用。

第二十三条 询价期权交易的结算日、行权日或现金结算期权参考价格日期遇交易所休市日，则实际结算日、行权日、现金结算期权参考价格日期顺延至原日期的下一交易日。

第五章 信息披露

第二十四条 交易所负责询价期权业务的日常统计和相关信息披露。

第二十五条 未经交易双方事先书面许可，市场参与者不得泄漏其在参与询价期权交易过程中所知悉的交易信息以及其他未公开的信息（根据法律法规或有权机关要求应当进行披露的情形除外）。

会员应为其代理的客户保守客户的交易秘密。

第六章 业务监测

第二十六条 交易所负责询价期权业务的日常监测，向中国人民银行报告询价期权业务的相关情况。

第二十七条 交易所认为询价期权业务中发生异常交易的，相关会员应根据交易所的要求及时提供相应说明。

第二十八条 市场参与者在进行询价期权交易时认为有违规行为的，可向交易所举报。交易所根据需要可向相关当事方了解、核实有关情况。对确实存在违规的要求改正，并予以通报批评，情节严重的，取消询价交易资格。

第二十九条 市场参与者存在扰乱市场秩序、牟取不正当利益等异常行为，交易所将参照《上海黄金交易所违规违约处理办法》的有关规定采取处理措施。

第七章 附 则

第三十条 本办法未尽事项按照交易所相关制度执行。

第三十一条 本办法以中文书就，若不同中文文本或中文与任何翻译文本有任何歧异，概以最新的中文文本为准。

第三十二条 本办法解释权属于交易所。

第三十三条 本办法自询价期权业务开展之日起施行。

附件 1

上海黄金交易所询价期权交易登记申请单

交易日期		登记日期	
期权买方信息		期权卖方信息	
会员编号		会员编号	
会员名称		会员名称	
客户编号		客户编号	
客户名称		客户名称	
交易明细			
期权品种	<input type="checkbox"/> 0Au99.99 <input type="checkbox"/> 0Au99.95 <input type="checkbox"/> 其它 _____		
行权方式	欧式期权	期权交易类型	<input type="checkbox"/> 看涨期权 <input type="checkbox"/> 看跌期权
重量	_____ 千克	到期结算方式	<input type="checkbox"/> 实物交割 <input type="checkbox"/> 现金结算
数量（手）	_____ 手	行权价格	_____ 元/克
行权日		行权截止时间	北京时间 _____
结算日			
现金结算期权参考价格类型			
现金结算期权参考价格日期			
期权费金额		期权费支付日	
会员信息			
买方会员联系人		卖方会员联系人	
买方会员联系电话		卖方会员联系电话	
公章		公章	

上海黄金交易所询价期权交易登记确认单

上海黄金交易所已登记此期权交易，登记编号为_____。

公章：

日期：

附件 2

上海黄金交易所询价期权交易行权申报单

交易日期		登记编号	
期权买方信息		期权卖方信息	
会员编号		会员编号	
会员名称		会员名称	
客户编号		客户编号	
客户名称		客户名称	
交易明细			
期权品种	<input type="checkbox"/> 0Au99.99 <input type="checkbox"/> 0Au99.95 <input type="checkbox"/> 其它 _____		
行权方式	欧式期权	期权交易类型	<input type="checkbox"/> 看涨期权 <input type="checkbox"/> 看跌期权
重量	_____ 千克	到期结算方式	<input type="checkbox"/> 实物交割 <input type="checkbox"/> 现金结算
数量(手)	_____ 手	行权价格	_____ 元/克
行权日		行权截止时间	北京时间 _____
结算日			
现金结算期权参考价格类型			
现金结算期权参考价格日期			
期权费金额		期权费支付日	
行权交易信息			
行权交割交易 买方会员编号		行权交割交易 卖方会员编号	
行权交割交易 买方客户编号		行权交割交易 卖方客户编号	
行权合约	<input type="checkbox"/> 询价 Au9999 <input type="checkbox"/> 询价 Au9995 <input type="checkbox"/> 其它 _____		
数量(手)	_____ 手	价格	_____ 元/克
到期日		交割方式	<input type="checkbox"/> 实物交割 <input type="checkbox"/> 现金交割
现金结算行权交易参考价格	_____ 元/克		
备注			
会员信息			
买方会员联系人		卖方会员联系人	
买方会员联系电话		卖方会员联系电话	
公章		公章	