

附件2

《国家外汇管理局关于支持市场主体外汇风险管理有关措施的通知（征求意见稿）》起草说明

为进一步促进外汇市场发展，更好服务实体经济管理外汇风险，国家外汇管理局（以下简称“外汇局”）起草了《国家外汇管理局关于支持市场主体外汇风险管理有关措施的通知（征求意见稿）》（以下简称《通知》），推出若干支持市场主体外汇风险管理措施。

一、《通知》起草背景

（一）支持银行加强实体经济服务能力建设

银行是外汇市场服务实体经济的重要主体，在引导企业树立风险中性观念、为企业提供外汇风险管理服务等方面发挥着不可替代的作用。外汇局将继续支持银行强化外汇风险管理相关服务能力，为企业提供优质服务。

（二）进一步提高外汇市场服务实体经济水平

我国外汇市场发展始终坚持将服务实体经济放在首要位置，充分考虑微观经济主体的风险识别和防范能力，遵循由简单到复杂、由基础到衍生的路径，逐步丰富外汇风险管理工具。经过多年发展，境内外汇市场主体已对远期、合作远期、外汇掉期、货币掉期、普通欧式期权及其组合有了较深的认识 and 实践经验，运用外汇衍生品工具进行套期保值的观念不断深化，市场的成熟度

和适应性不断提高。在此基础上，外汇局进一步丰富产品类型、拓宽交易范围、健全基础设施，有助于夯实外汇市场服务实体经济的基础，满足企业汇率风险管理的需求。

（三）支持银行自身外汇风险管理

随着我国金融市场双向开放程度不断加深，银行自身外汇风险管理日益重要，在守住风险底线的同时，外汇局不断优化管理理念和方式，简化银行自身结售汇行政许可手续，适当放开银行自身外汇衍生品业务，支持银行高效管理自身外汇风险。

二、《通知》主要内容

一是支持银行持续加强服务实体经济外汇风险管理的能力建设。强调引导客户树立风险中性意识，支持银行对客户外汇业务灵活展业。

二是丰富银行对客户外汇市场产品。银行对客户外汇市场产品新增人民币对外汇普通美式期权、亚式期权及其组合产品。

三是支持中国外汇交易中心提升外汇市场服务水平。银行间市场配套推出人民币对外汇普通美式期权、亚式期权及其组合产品；中国外汇交易中心可根据市场需求扩大银行间人民币对外汇衍生品的币种覆盖范围；支持中国外汇交易中心完善银企服务平台，提高外汇交易电子化水平。

四是扩大合作办理人民币对外汇衍生品业务范围。业务范围包括合作远期结售汇、合作外汇掉期、合作货币掉期业务。

五是支持银行自身外汇风险管理。简化银行资本金本外币转

换行政许可，除政策性注资外，其他资本金本外币转换可在符合法规要求的前提下由银行自行办理。允许银行自行按照实需原则办理自身项下外汇衍生品业务。取消银行贵金属汇率敞口平盘备案，由银行纳入自身结售汇直接办理。