

上海黄金交易所询价业务交易细则

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）、《上海黄金交易所现货交易规则》、《上海黄金交易所询价业务交易规则》等有关规定，制定本交易细则（以下简称“本细则”）。

第二条 银行间询价业务按照《上海黄金交易所银行间黄金询价业务交易规则》执行。

第二章 市场参与者

第三条 具有上海黄金交易所（以下简称“交易所”）交易席位的机构，可向交易所提交开展询价业务（不含银行间询价业务）的书面备案报告，格式见附表1《上海黄金交易所询价业务权限备案表》。备案机构经交易所核准，方可开展询价自营业务与代理业务。交易所暂不开放国际会员代理业务权限。

第四条 会员开展询价代理业务，应坚持符合国家相关产业政策、风险可控和审慎等原则，服务实体经济。

第五条 机构客户参与交易所询价业务，应委托其代理会员进行询价交易。客户与会员应签署询价业务委托代理协议，明确双方的权利与义务，协议应至少包括客户授权会员代理交易、授权会员代理资金

清算、授权会员申报交易违约等内容。

个人客户不能参与询价业务。

第三章 交易

第六条 交易所询价业务的交易日为每周一至周五（国家法定节假日及交易所公告的休市日除外）。各交易品种交易时间及其它参数详见附表2《上海黄金交易所询价品种参数表》。

第七条 交易所询价业务的交易品种包括“询价 Au9999”、“询价 Au9995”、“询价 iAu9999”、“询价 iAu995”、“询价 iAu100g”、LAu9999、LAu9995、iLAu9999、iLAu995、iLAu100g。

第八条 “询价 Au9999”、“询价 Au9995”、“询价 iAu9999”、“询价 iAu995”和“询价 iAu100g”品种的交易类型分为即期、远期和掉期交易。

即期交易是交易双方约定在交易当日进行交割的交易。

远期交易是交易双方约定在未来某一到期日进行交割的交易。

掉期交易是交易双方约定在未来两个不同的到期日（近端到期日含交易当日）进行方向相反和数量相同的两次交割的交易。

第九条 即期、远期和掉期交易的交割方式分为实物交割和现金差额交割。

实物交割交易是指交易双方在到期日按照约定要素根据钱货两讫原则进行资金清算与实物交割的交易。

现金差额交割交易是指交易双方在到期日根据约定的交易价格与参考价格轧差后对现金差额进行资金清算的交易。

第十条 现金差额交割交易的参考价格是交易双方指定日期的收盘价、开盘价、加权平均价、基准价等交易所公开的市场价格或交易双方约定的其他价格。

第十一条 现金差额=（交易价格-参考价格）×交易重量。差额为正值，则买方应向卖方支付相应金额；差额为负值，则卖方应向买方支付相应金额；差额为零，交易双方无需进行资金收付。

第十二条 LAu9999、LAu9995、iLAu9999、iLAu995、iLAu100g 的交易类型为拆借交易，按照《上海黄金交易所黄金拆借业务交易规则》与《上海黄金交易所拆借业务交易细则》执行。

第十三条 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。

第四章 资金清算与实物交割

第十四条 会员应委托交易所进行实物交割询价交易的资金清算与实物交割。交易所根据委托提供资金清算与实物交割服务，但不承继交易双方交易项下的权利和义务。

第十五条 交易双方达成现金差额交割询价交易时需选择“交易所清算”或“非交易所清算”模式。

(一) “交易所清算”模式下，交易双方委托交易所进行资金清算，交易所根据委托提供现金差额计算、资金划付等清算服务，但不承继交易双方交易项下的权利义务。

(二) “非交易所清算”模式下，现金差额清算由交易双方自行完成，交易所不进行差额计算、资金划付等清算处理。

第十六条 询价交易于每交易日 16:00 参与交易所资金清算与实物交割。该时点之后不可达成当日到期的交易。

第十七条 交易所于每一交易日 16:00 后按照现货实盘交易、现货即期交易、现货延期交易、询价交易（含银行间询价交易）的清算交割顺序进行日终清算，即资金实物首先满足现货实盘、现货即期、现货延期交易的履约，再满足询价交易的履约。清算交割顺序在前的交易所得资金和实物可用于顺序在后交易的资金清算与实物交割。

第十八条 交易双方需在清算交割前将足额资金和实物存入指定清算账户和实物账户，如某一笔或多笔询价交易出现一方资金或实物不足（除国际会员资金不足外）造成违约的，交易所将不予处理，并将违约信息反馈至交易双方（若其具有交易所交易席位）或交易双方的代理会员处（若其为交易所客户），由交易双方自行协商处理。若国际会员资金不足，由上海国际黄金交易中心（以下简称“国际中心”）在清算时先行垫付询价交易履约所需资金，相应询价交易仍可正常进行清算交割。国际会员须在下一个交易日开市前补足由国际中心垫付的资金。若下一交易日开市前国际会员未补足资金，按《上海黄金交

易所风险控制管理办法》、《上海国际黄金交易中心业务管理办法》等有关规定执行。

第十九条 客户在与会员（除国际会员外）约定的时点前已将足额资金和实物存入指定清算账户和实物账户，但其代理会员的代理账户资金不足，交易所系统判定该笔或多笔交易违约，代理会员应根据与客户已签署的询价业务委托代理协议承担相应赔偿责任。

第二十条 客户在与会员（除国际会员外）约定的时点前未将足额资金和实物存入指定清算账户，该代理会员可于每个交易日 16:00 前向交易所提交加盖公章的《上海黄金交易所询价业务买方违约申报单》（附表 3），交易所根据代理会员申请对其代理客户因资金不足而导致违约的相应实物交割交易进行买方违约申报。

第二十一条 跨年度的询价交易的到期日、现金交割交易的参考价格日期遇交易所休市日，则实际到期日、参考价格日期由交易所进入下一年度前进行一次性调整，将到期日、参考价格日期顺延至原日期的下一交易日。

第二十二条 涉及询价交易资金清算、实物交割及实物出入库的其他未尽事项参照《上海黄金交易所现货交易资金清算实施细则》、《上海黄金交易所现货交易交割细则》、《上海国际黄金交易中心业务管理办法》、《上海国际黄金交易中心资金清算管理办法》、《上海国际黄金交易中心客户资金封闭运行业务实施细则》、《上海黄金交易所国际版交割业务操作指引》、《上海黄金交易所保管库管理办法》

等有关规定执行。

第五章 应急与异常情况处理

第二十三条 应急交易相关事项参照《上海黄金交易所应急交易管理办法》的有关规定执行。

第二十四条 对于被交易所系统判为单方违约的询价交易，守约方会员可向交易所书面提出再次清算申请；对于被交易所系统判为双方违约的询价交易，交易双方会员应协商一致后分别向交易所书面提出再次清算申请。

第二十五条 申请再次清算的会员应在再次清算日 15:30 前向交易所提交加盖公章的《上海黄金交易所询价业务再次清算申请单》（附表 4）。

第二十六条 交易所受理《上海黄金交易所询价业务再次清算申请单》后，在再次清算日按原交易要素（到期日要素除外）重新进行清算。

第二十七条 交易双方会员协商一致后申请删除未清算或清算失败的询价交易，应分别向交易所提交书面申请，注明删除原因、需删除的交易单号、本方会员号等信息。由交易所按相关程序操作。

第二十八条 双方会员协商一致后申请更改询价交易的到期日或参考价格日期，应分别向交易所提交书面申请，注明更改原因、所涉及的交易单号、原到期日、新到期日、原参考价格日期、新参考价格日

期、本方会员号等信息。由交易所按相关程序操作。

第六章 附 则

第二十九条 对异常交易以及违规违约的其它处理措施，参照《上海黄金交易所违规违约处理办法》的规定执行。

第三十条 现金差额清算类型的询价交易，交易所不对交易双方之间的收付款项进行开票处理。其它发票相关事项参照《上海黄金交易所会员发票管理办法》的有关规定执行。

第三十一条 异常情况处理、监督管理、争议与调解相关事项参照《上海黄金交易所现货交易规则》的有关规定执行。

第三十二条 本细则未尽事项按照交易所相关制度执行。

第三十三条 本细则解释权属于交易所。

第三十四条 本细则自 2015 年 1 月 1 日起实施。

附表 1

上海黄金交易所询价业务权限备案表

机构名称				
备案日期				
上海黄金交易所会员号				
拟开通权限的交易员代码				
联系人信息	姓名		岗位	
	电话		手机	
	Email		邮编	
	地址			
	姓名		岗位	
	电话		手机	
	Email		邮编	
	地址			
备案事项情况说明				
备案机构声明	<p>本机构经上海黄金交易所核准后开展上海黄金交易所询价业务（不含银行间询价业务），受已与上海黄金交易所签署的协议及上海黄金交易所发布的规范性文件约束。</p> <p>本机构承诺根据服务实体经济、符合国家相关产业政策、风险可控和审慎等原则对代理客户实行询价业务准入管理，并与代理客户签署询价业务委托代理协议，明确双方的权利与义务，协议应至少包括客户授权会员代理交易、授权会员代理资金清算、授权会员申报交易违约等内容。</p> <p>本机构理解上海黄金交易所根据委托提供资金清算与实物交割服务时不承继交易双方交易项下的权利和义务。</p>			
公章				

附表 2

上海黄金交易所询价品种参数表^[注]

询价Au9999品种参数表（实物交割）

交易品种	询价Au9999
交易代码	PAu99.99
交易方式	询价交易
交易单位	100克/手
交易类型	即期、远期和掉期
报价单位	元（人民币）/克
最小变动价位	0.01元/克
最小单笔成交量	1手
最大单笔成交量	50,000手
交易时间	每交易日9:00-17:00
清算方式	到期日钱货两讫
交割品种	标准重量1千克、成色不低于99.99%的金锭
交割方式	实物交割
质量标准	经交易所认定的可提供标准金锭企业生产的符合交易所金锭SGEB1-2002质量标准的实物，及伦敦金银市场协会（LBMA）认定的合格供货商生产的标准实物。
交割地点	交易所指定仓库
交易手续费	即期：成交金额的万分之三点五 远期：成交金额的万分之三点五 掉期：成交金额的万分之四

询价Au9999品种参数表（现金交割）

交易品种	询价Au9999
交易代码	PAu99.99
交易方式	询价交易
交易单位	100克/手
交易类型	即期、远期和掉期
报价单位	元（人民币）/克
最小变动价位	0.01元/克
最小单笔成交量	1手
最大单笔成交量	50,000手
交易时间	每交易日9:00-17:00
清算方式	到期日现金差额清算
参考价格	交易双方指定日期的收盘价、开盘价、加权平均价、基准价等交易所公开的市场价格或交易双方约定的其他价格。
交割方式	现金交割
交易手续费	暂免

询价Au9995品种参数表（实物交割）

交易品种	询价Au9995
交易代码	PAu99.95
交易方式	询价交易
交易单位	1000克/手
交易类型	即期、远期和掉期
报价单位	元（人民币）/克
最小变动价位	0.01元/克
最小单笔成交量	1手
最大单笔成交量	5,000手
交易时间	每交易日9:00-17:00
清算方式	到期日钱货两讫
交割品种	标准重量3千克、成色不低于99.95%的金锭
交割方式	实物交割
质量标准	经交易所认定的可提供标准金锭企业生产的符合交易所金锭SGEB1-2002质量标准的实物，及伦敦金银市场协会（LBMA）认定的合格供货商生产的标准实物。
交割地点	交易所指定仓库
交易手续费	即期：成交金额的万分之三点五 远期：成交金额的万分之三点五 掉期：成交金额的万分之四

询价Au9995品种参数表（现金交割）

交易品种	询价Au9995
交易代码	PAu99.95
交易方式	询价交易
交易单位	1000克/手
交易类型	即期、远期和掉期
报价单位	元（人民币）/克
最小变动价位	0.01元/克
最小单笔成交量	1手
最大单笔成交量	5,000手
交易时间	每交易日9:00-17:00
清算方式	到期日现金差额清算
参考价格	交易双方指定日期的收盘价、开盘价、加权平均价、基准价等交易所公开的市场价格或交易双方约定的其他价格。
交割方式	现金交割
交易手续费	暂免

询价iAu9999品种参数表（实物交割）

交易品种	询价iAu9999
交易代码	iPAu9999
交易方式	询价交易
交易单位	10克/手
交易类型	即期、远期和掉期
报价单位	元（人民币）/克
最小变动价位	0.01元/克
最小单笔成交量	1手
最大单笔成交量	500,000手
交易时间	每交易日9：00-17：00
清算方式	到期日钱货两讫
交割品种	标准重量1千克、成色不低于99.99%的金锭
交割方式	实物交割
质量标准	经交易所认定的可提供标准金锭企业生产的符合交易所金锭SGEB1-2002质量标准的实物，及伦敦金银市场协会（LBMA）认定的合格供货商生产的标准实物。
交割地点	交易所国际版指定仓库
交易手续费	暂免

询价iAu9999参数表（现金交割）

交易品种	询价iAu9999
交易代码	iPAu9999
交易方式	询价交易
交易单位	10克/手
交易类型	即期、远期和掉期
报价单位	元（人民币）/克
最小变动价位	0.01元/克
最小单笔成交量	1手
最大单笔成交量	500,000手
交易时间	每交易日9:00-17:00
清算方式	到期日现金差额清算
参考价格	交易双方指定日期的收盘价、开盘价、加权平均价、基准价等交易所公开的市场价格或交易双方约定的其他价格。
交割方式	现金交割
交易手续费	暂免

询价iAu995品种参数表（实物交割）

交易品种	询价iAu995
交易代码	iPAu99.5
交易方式	询价交易
交易单位	12.5千克/手
交易类型	即期、远期和掉期
报价单位	元（人民币）/克
最小变动价位	0.01元/克
最小单笔成交量	1手
最大单笔成交量	500手
交易时间	每交易日9：00-17：00
清算方式	到期日钱货两讫
交割品种	标准重量12.5千克、成色不低于99.50%的金锭
交割方式	实物交割
质量标准	经交易所认定的可提供标准金锭企业生产的符合交易所金锭SGEB1-2002质量标准的实物，及伦敦金银市场协会（LBMA）认定的合格供货商生产的标准实物。
交割地点	交易所国际版指定仓库
交易手续费	暂免

询价iAu995品种参数表（现金交割）

交易品种	询价iAu995
交易代码	iPAu99.5
交易方式	询价交易
交易单位	12.5千克/手
交易类型	即期、远期和掉期
报价单位	元（人民币）/克
最小变动价位	0.01元/克
最小单笔成交量	1手
最大单笔成交量	500手
交易时间	每交易日9：00-17：00
清算方式	到期日现金差额清算
参考价格	交易双方指定日期的收盘价、开盘价、加权平均价、基准价等交易所公开的市场价格或交易双方约定的其他价格。
交割方式	现金交割
交易手续费	暂免

询价iAu100g品种参数表（实物交割）

交易品种	询价iAu100g
交易代码	iPAu100g
交易方式	询价交易
交易单位	100克/手
交易类型	即期、远期和掉期
报价单位	元（人民币）/克
最小变动价位	0.01元/克
最小单笔成交量	1手
最大单笔成交量	50,000手
交易时间	每交易日9：00-17：00
清算方式	到期日钱货两讫
交割品种	标准重量0.1千克、成色不低于99.99%的金条
交割方式	实物交割
质量标准	经交易所认定的可提供标准金条企业生产的符合交易所金条SGEB2-2004质量标准的实物，及伦敦金银市场协会（LBMA）认定的合格供货商生产的标准实物。
交割地点	交易所国际版指定仓库
交易手续费	暂免

询价iAu100g品种参数表（现金交割）

交易品种	询价iAu100g
交易代码	iPAu100g
交易方式	询价交易
交易单位	100克/手
交易类型	即期、远期和掉期
报价单位	元（人民币）/克
最小变动价位	0.01元/克
最小单笔成交量	1手
最大单笔成交量	50,000手
交易时间	每交易日9：00-17：00
清算方式	到期日现金差额清算
参考价格	交易双方指定日期的收盘价、开盘价、加权平均价、基准价等交易所公开的市场价格或交易双方约定的其他价格。
交割方式	现金交割
交易手续费	暂免

注：品种及其参数如有调整，按交易所的有关公告执行。

附表 3

上海黄金交易所询价业务买方违约申报单

会员名称		会员号	
客户名称		客户编码	
会员联系人		联系电话	
序号	询价成交单编号		
1			
2			
3			
4			
5			
会员公章			
负责人签字		日期	
交易所填写			
审批:			
录入:		复核:	

附表 4

上海黄金交易所询价业务再次清算申请单

买入方：			
会员名称		会员号	
客户名称		客户编码	
会员联系人		联系电话	
卖出方：			
会员名称		会员号	
客户名称		客户编码	
会员联系人		联系电话	
序号	询价成交单编号		
1			
2			
3			
4			
5			
买方会员公章		卖方会员公章	
买方负责人签字		卖方负责人签字	
日期		日期	
交易所填写			
审批：			
录入：		复核：	