

(银发[2005]140号)

全国银行间同业拆借中心、中央国债登记结算有限责任公司:

为加强银行间债券市场行业自律行为,明确债券远期交易双方的权利和义务,中国人民银行组织银行间债券市场参与者拟订了《全国银行间债券市场债券远期交易主协议》,现印发你们。请全国银行间同业拆借中心会同中央国债登记结算有限责任公司向银行间债券市场参与者公布并组织签署,并将签署信息通过中国货币网和中国债券信息网向市场参与者公告。

特此通知。

二

00五年六月三日

全国银行间债券市场债券远期交易主协议

第一条 为维护全国银行间债券市场债券远期交易参与者(以下简称参与者)的合法权益,明确债券远期交易双方的权利与义务,根据《中华人民共和国中国人民银行法》、《中华人民共和国合同法》、《全国银行间债券市场债券远期交易管理规定》等法律、行政法规和部门规章,参与者在平等、自愿的基础上,签订本协议。

第二条 债券远期交易可能蕴含一定风险,交易双方须了解相应法律、行政法规和部门规章,并审慎评估自身的财务状况、内控制度等,以确定是否从事债券远期交易。

第三条 名词释义

(一) 债券远期交易(以下简称远期交易):与《全国银行间债券市场债券远期交易管理规定》中远期交易的含义相同。

(二) 标的债券:远期交易的标的资产。在成交合同中以债券代码和债券简称标识。

(三) 标的债券数量:标的债券的面值总额,单位为万元。

(四) 买方:交易双方中买入标的债券的一方。

(五) 卖方:交易双方中卖出标的债券的一方。

(六) 成交日:交易双方订立成交合同的日期。

(七) 结算日:交易双方约定的进行债券交割和资金支付的日期。

(八) 远期交易期限:成交日至结算日的实际天数,含成交日,不含结算日。

(九) 远期交易净价:交易双方在成交日约定、在结算日进行交割的标的债券的净价,单位为元/百元面值。

(十) 结算日应计利息:上次付息日(或起息日)至结算日为止(不含结算日)累计的按百元面值计算的债券发行人应支付债券所有人的利息,单位为元/百元面值。

(十一) 结算金额: 远期交易结算时, 买方向卖方支付的资金额。结算金额 = (远期交易净价 + 结算日应计利息) × 标的债券数量 / 100, 单位为元。

(十二) 结算方式: 交易双方约定采用的债券交割和资金支付方式, 包括券款对付、见券付款和见款付券三种。

(十三) 债券账户: 交易双方在中央国债登记结算有限责任公司(以下简称中央结算公司)开立的用于远期交易债券交割的账户。

(十四) 资金账户: 交易双方约定的用于远期交易资金支付的账户, 其基本要素包括开户行名称、账户名称和账号。

第四条 交易双方进行远期交易, 应通过全国银行间同业拆借中心(以下简称同业中心)交易系统进行。交易双方在通过同业中心交易系统逐笔订立书面形式的成交合同(同业中心交易系统生成的成交单)时, 可视需要签订补充合同, 但补充合同不得与本协议相冲突。

本协议与书面形式的成交合同及补充合同一起构成完整的远期交易合同。

远期交易合同在成交合同订立后立即生效。

第五条 为保证远期交易合同的履行, 交易双方可按照交易对手的信用状况协商设定保证金或保证券。

(一) 交易双方约定设定保证金(券)时, 须明确保证金(券)的金额、数量、种类、提交日期、提交方式及保管方式。

(二) 保证金可由双方自行保管, 也可集中保管。集中的保证金由同业中心或中央结算公司代为保管, 同业中心或中央结算公司应在中国人民银行当地分行开立专门的资金账户用于存放保证金, 并与远期交易双方另行签订协议确定在保证金的集中保管及其处理过程中各自的权利与义务。保证金及其孳息归保证金的提供方所有, 同业中心或中央结算公司不得挪用。

保证券由中央结算公司在提供方的债券账户中办理质押登记。

(三) 交易双方应按约定提交或追加保证金(券)至约定账户。

(四) 交易双方应在完成资金和债券结算后的次一工作日, 将保证金及其孳息足额返还至约定资金账户, 或将保证券予以解押。

第六条 交易双方应在成交日或次一工作日向中央结算公司及时发送内容完整且相匹配的远期交易结算指令, 并在结算日将足额资金(或足额债券)支付(或交割)至交易对手方指定资金(或债券)账户。

第七条 交易双方中的任何一方发生但不限于如下情形时, 即构成违约:

(一) 买方或卖方未按合同约定日期发送远期交易结算指令。

(二) 约定提供保证金(券)的, 买方或卖方未按约定将足额保证金(券)提供(质押)到约定账户。

(三) 约定结算方式为券款对付的:

在结算日卖方没有足额债券用于交割, 或虽有足额债券但未交割至买方指定债券账户, 卖方违约;

卖方有足额债券用于交割, 但买方没有足额资金用于支付, 或虽有足额资金但未支付至卖方指定资金账户, 买方违约。

(四) 双方约定结算方式为见券付款的:

在结算日卖方没有足额债券用于交割, 卖方违约;

卖方有足额债券用于交割, 但买方没有按约定足额划付资金, 或已足额划付资金, 但未发送付款确认指令, 买方违约;

买方已按约定足额划付资金, 并已发送付款确认指令, 但卖方未按约定将足额债券交割至买方指定债券账户, 卖方违约。

(五) 双方约定结算方式为见款付券的:

在结算日买方未按约定将足额资金划付至卖方指定资金账户, 买方违约;

买方已按约定将足额资金划付至卖方指定资金账户, 卖方未按约定将足额债券交割至买方指定债券账户, 卖方违约。

(六) 买方或卖方在完成资金和债券结算后, 未按约定返还保证金及其孳息至约定资金账户, 或未将保证券予以解押。

第八条 远期交易发生违约, 交易双方应首先协商解决。若交易双方在违约事实和责任明确后的两个工作日内对违约处理不能达成协议, 应执行以下相应的违约处理条款。

(一) 交易一方发生第七条第(一)项、第(二)项违约行为的, 非违约方有权要求违约方继续履行合同, 并有权要求违约方就延迟履行合同导致的实际损失进行赔偿。

非违约方也有权书面通知违约方终止合同, 并有权要求违约方就违约所导致的损失进行赔偿, 就违约期间发生的有关合理费用进行补偿。

(二) 交易一方发生第七条第(三)项、第(四)项或第(五)项违约行为的, 非违约方有权要求违约方继续履行合同义务, 并有权要求违约方就延迟履行合同导致的损失进行赔偿。

非违约方也有权书面通知违约方终止合同, 并有权要求违约方就违约所导致的损失进行赔偿, 就违约期间发生的有关合理费用进行补偿; 若非违约方已将资金(或债券)支付(或交割)到违约方指定的资金(或债券)账户, 则有权要求违约方不迟于接到非违约方书面通知后的次一工作日全额返还支付资金及其孳息或将债券予以返还, 并有权要求违约方给予相应的赔偿。

(三) 交易一方发生第七条第(六)项违约行为的, 非违约方有权要求违约方在一定期限内将保证金及其孳息返还至约定账户或将保证券予以解押, 并有权要求违约方就延迟返还保证金及其孳息或延迟解押保证券所导致的损失进行赔偿。

(四) 本条第(一)项中, 违约所导致的损失为合同终