

全国银行间同业拆借中心2月24日起试运行利率期权交易

2020-01-02 16:57:04 来源：上海证券报·中国证券网 作者：张骄

上证报中国证券网讯（记者 张骄）1月2日，外汇交易中心发布公告称，为更好发挥银行间利率衍生品市场对实体经济支持作用，满足市场成员利率风险管理需求，完善利率风险定价机制，经人民银行批复同意，全国银行间同业拆借中心（下称交易中心）将于2020年2月24日起试运行利率期权交易及相关服务。

具体来看，公告称，交易时间为每周一至周五（国家法定节假日调整除外）北京时间9:00-12:00，13:30-17:00。交易品种挂钩LPR1Y/LPR5Y的利率互换期权、利率上/下限期权。期权类型为欧式期权。

已开通利率互换交易权限的市场成员需于2020年2月7日前提交《利率期权市场交易成员申请表》，申请开展利率期权交易。其他市场成员除提交申请表外，还需提交内部操作规程、风险管理制度等。交易中心提供对话报价和点击成交两种交易方式，各市场机构应根据自身需求开展利率期权交易。

从报价机构来看，交易中心组织报价机构通过交易系统以点击成交报价等方式向市场提供利率期权双边报价，并进行日终波动率曲线报价。利率互换曲线报价机构可于2020年2月7日前向交易中心申请成为利率期权报价机构。

上海证券报

7X24小时推送，聚焦资本市场

专业 · 深度 · 权威

更多精彩内容敬请关注



上海证券报微信公众号



上海证券报APP

已有 0 位网友发表评论

输入内容，请文明发言