

2020年3月23日

汇丰中国首批参与银行间市场利率期权交易***** 完成首笔挂钩 LPR 的人民币利率期权交易 *****

汇丰银行（中国）有限公司今日宣布，在中国银行间市场利率期权交易启动首日，完成了其首笔挂钩贷款市场报价利率（LPR）的银行间市场人民币利率期权交易，成为首批参与此类交易的银行。利率期权的推出有助于金融机构和企业对利率风险进行精细化管理，促进利率衍生品市场对实体经济的支持作用。

汇丰中国今日与一家中资银行在银行间市场达成了此笔交易，该交易为挂钩一年期 LPR 的利率下限期权。

汇丰中国副行长兼环球资本市场联席总监张劲秋表示：“在新的 LPR 形成机制下，利率期权作为非线性衍生品工具，能够完善利率风险定价机制，有助于金融机构和实体经济平抑利率波动风险，同时对提升利率互换市场的活跃度也有着积极作用。我们预计，未来银行间市场利率期权的交易量将逐步上升，这也能为企业管理利率风险提供更好的定价参考。长远来看，利率类衍生品市场的扩容，将进一步加速推动中国利率市场化的进程。”

中国外汇交易中心于今年初发布《关于试点利率期权业务有关准备事项的通知》，明确了全国银行间同业拆借中心试运行利率期权交易及相关服务，交易品种为挂钩 LPR1Y/LPR5Y 的利率互换期权、利率上/下期权。

此外，随着人民币利率期权业务的开放，汇丰中国近期还协助一家大型国有企业完成了首笔挂钩 LPR 的对客人民币利率期权交易。该交易为挂钩一年期 LPR 的利率下限期权，将企业固定利率的敞口转化为浮动利率，令企业可以享受利率下行带来的潜在财务成本节省，同时也限制了风险上限，从而帮助企业优化了人民币负债结构，有效降低了企业的融资成本。

作为领先的国际性银行，汇丰一直积极参与中国金融衍生品市场的发展，是上海清算所利率互换集中清算的首批会员、首批人民币外汇交易做市商银行、首批获准开展人民币外汇远期交易、人民币外汇期权业务的银行。

媒体查询:

张宁 (021) 38882419

harryzhang@hsbc.com.cn

杨斯媛 (021) 38886226

stella.s.y.yang@hsbc.com.cn

附注:

汇丰银行（中国）有限公司

汇丰银行（中国）有限公司作为首批本地注册的外资法人银行于 2007 年 4 月 2 日正式开业，由设于香港特别行政区的母行——香港上海汇丰银行有限公司全资拥有，其前身是香港上海汇丰银行有限公司的原中国内地分支机构。汇丰中国现有约 170 个网点，其总行设于上海浦东。

全文完