附件2

**大连商品交易所**

**基差交易业务交易商管理办法**

**（试行）**

* 1. 总则

1. 为规范大连商品交易所（以下简称交易所）基差交易业务交易商（以下简称交易商）行为，保障交易商合法权益，维护交易秩序，根据《大连商品交易所基差交易业务管理办法》及其他相关业务规则，特制定本办法。
2. 交易商及其工作人员从事基差交易业务，应当遵守法律法规、平台业务规则、相关协议等规定，遵循公平和诚实信用的原则，审慎经营，规范运作，接受平台的监督。
   1. 交易商分类
3. 交易商分为AA类、A类和B类三种类型。
4. 交易商的权利包括：
   * 1. 使用平台相关设施和资源，根据相关业务规则和协议，享有平台或第三方机构提供的交易、结算、融资和信息等服务；
     2. 成为交易商委员会委员，行使相关权利；
     3. AA类、A类、B类交易商具有在平台开展基差交易的权利，其中AA类、A类交易商均具有签发基差贸易合同的权利，B类交易商不具有该权利；
     4. 相关协议规定的其他权利。
5. 交易商的义务包括：
   * 1. 履行协议规定义务；
     2. 履行交易商委员会委员、纠纷调解及违规处理委员会委员的相关义务；
     3. 配合交易所监督管理，向交易所提供符合本办法或相关协议规定要求的证明文件；
     4. AA类交易商除上述三项义务外，还应当按照本办法或相关协议要求履行做市义务，做市义务分为回应询价和主动报价两类。
6. 交易商应当根据不同品种（系列）分别申请，经审核批准后，仅能进行相应品种（系列）的基差交易。除另有规定外，每个品种（系列）内的所有交易商之间均为当然的、合格的交易对手。
7. 平台对交易商数量进行限额管理，每个品种（系列）交易商数量上限为30家，上限可按本办法第六章规定程序进行调整。
   1. 交易商资格的取得
8. 申请成为B类交易商，应当符合以下条件：
   * 1. 注册资本及净资产均不低于人民币1亿元，或提供平台认可的担保函；
     2. 经营及财务状况良好；
     3. 商业信誉良好，且最近三年无重大违法违规记录；
     4. 公司治理健全，内部控制和风险管理制度完善；
     5. 具有完备的管理制度，能够对基差交易业务活动实施有效管理和风险隔离；
     6. 期货公司风险管理公司申请时，所属期货公司最近一期分类评级不低于B类BBB级；
     7. 与交易所具有良好业务合作关系，承诺遵守平台规则；
     8. 平台要求的其他条件。
9. 申请成为A类交易商，除应满足B类交易商所需条件外，还应当符合以下条件：
   * 1. 能组织稳定的货源，具备较强的货物交付能力；
     2. 具有较强的基差交易能力；
     3. 期货公司风险管理公司申请的，所属期货公司最近一期分类评级不低于A类；
     4. 平台要求的其他条件。
10. 申请成为AA类交易商，除应满足A类交易商所需条件外，还应当符合以下条件：

（一）具有较强的基差报价能力；

（二）具有较强的基差做市意愿；

（三）平台要求的其他条件。

1. 申请成为B类交易商，应当向交易所提交以下材料：
   * 1. 交易商资格申请表；
     2. 营业执照复印件；
     3. 法定代表人的身份证复印件；
     4. 最近两个年度财务审计报告；
     5. 担保函（如需要）；
     6. 中国人民银行征信中心出具的企业信用报告；
     7. 银行授信评级情况说明；
     8. 国内外评级机构出具的信用评级报告（如有）；
     9. 最近三年无重大违法违规记录承诺书；
     10. 最近两个年度涉诉情况说明，如有判决书也需一并提供；
     11. 内部控制制度和风险管理制度、部门及人员设置的说明材料；
     12. 申请单位为期货公司风险管理公司的，还应提供基差交易业务在中国期货业协会备案和所属期货公司最近一期分类评级的证明材料；
     13. 平台要求的其他材料。
2. 申请成为A类交易商，除应提交B类交易商所需的材料外，还应当向交易所提交以下材料：
   * 1. 货源、仓储和配送等现货能力的证明材料；
     2. 基差交易能力的证明材料；
     3. 平台要求的其他材料。
3. 申请成为AA类交易商，除应提交A类交易商所需的材料外，还应当向交易所提交以下材料：

（一）基差报价能力的证明材料；

（二）平台要求的其他材料。

1. 经交易所批准后，申请单位应当与交易所及相关各方签订协议，在观察期内参与平台交易。
2. 观察期考核合格后，经交易商委员会批准，申请单位可正式取得交易商资格。经考核不满足所申请类型交易商资格条件、但满足其他类型交易商资格条件的，经交易商委员会批准，可取得其他类型的交易商资格。
3. 考核不合格的，申请单位不能取得交易商资格。申请单位若未取得交易商资格，自交易所通知之日起不能在平台新增基差贸易合同，且应对未完成的基差贸易合同继续承担责任。
4. 申请成为交易商，应当缴纳风险保障金，具体金额在协议中约定，用于弥补基差交易业务的风险损失和相关违约违规处理事项；交易所有权根据交易商的授权或有权机关的法律文书等书面文件划付交易商的风险保障金。如风险保障金因使用而减少，或因平台规定金额提高的，交易商应当于5个交易日内补足；未补足的，交易商不能在平台新增基差贸易合同。

风险保障金利息按不低于中国人民银行公布的同期银行活期存款利率计算，交易所对具体执行利率进行公示并在每年的3 月、6月、9月和12月下旬将利息支付给交易商，具体执行利率由交易所确定、调整并公布。

交易商转让或被终止资格时,在其处理完平台业务且与平台各方没有纠纷后,交易所清退剩余的风险保障金。

* 1. 交易商资格的变更

1. 经批准，交易商可以进行资格转让或类型转换。禁止未经批准私下转让资格。
2. 资格转让时，转让方应当向平台提交转让申请，受让方应当按本办法第三章规定提交相关材料。
3. 资格类型转换时，交易商应当向平台提交转换申请，并应当按本办法第三章规定提交相关材料。
4. 交易商存在以下情况之一的,平台不予受理资格转让申请：
   * 1. 正式取得交易商资格未满一年的；
     2. 平台上的基差交易业务尚未了结的；
     3. 因涉嫌违法犯罪被国家有关部门立案调查的；
     4. 因涉嫌违规，被交易所立案调查的；
     5. 自交易所处罚期满之日起不足三个月的；
     6. 与平台或其他交易商发生纠纷尚未了结的。
5. 转让事项审核通过后，交易所应当通知转让方及受让方。转让方自交易所通知之日起，应当在30个交易日内办理完毕转让事项，包括但不限于与受让方签订转让协议、与交易所签订终止业务协议等。逾期未办理完毕的，资格转让事项应当重新提交申请。
6. 转让方办理完毕转让事项后，交易所应当通知受让方办理相关事项。受让方自交易所通知之日起，应当于30个交易日内办理完毕交易商资格事项，包括但不限于与交易所及相关各方签订协议，开立交易及资金账户等。逾期未办理完毕的，视为放弃受让交易商资格。
7. 资格类型转换事项审核通过后，交易商应当与交易所签订协议。
8. 资格变更后的交易商应通过观察期考核，相关要求及程序参照本办法第十五条、第十六条进行。
   1. 交易商资格的终止
9. 交易商出现以下情形之一的，平台有权终止该交易商的资格：
   * 1. 主动申请终止交易商资格的；
     2. 不再符合所属类型条件的；
     3. 无正当理由未按规定履行交易商义务的；
     4. 出现重大违法、违规、违约等行为的；
     5. 被交易商委员会批准的其他情形。
10. 主动申请终止交易商资格的，自申请之日起不能新增基差贸易合同，并应尽快了结未完成的基差交易业务；交易商资格终止后，应对未完成的基差贸易合同继续承担责任。
11. 平台终止交易商资格的，应当书面通知交易商。自通知之日起，交易商资格终止，平台一年内不再受理其交易商资格申请。
    1. 交易商委员会
12. 平台根据不同品种（系列）分别设立交易商委员会。每个品种（系列）的交易商超过10家后成立交易商委员会，交易商委员会成立前由交易所代为行使相关职能。交易商委员会下设纠纷调解及违规处理委员会等相关委员会，具体职能在《大连商品交易所基差交易业务纠纷调解及违规处理办法》等中规定。
13. 交易商委员会是平台的自律管理机构，由每个品种（系列）的全体交易商和三名非交易商委员组成，非交易商委员由交易所在交易所工作人员和外部专家中指定。交易商委员会设主任委员一名、副主任委员两名，由交易所提名、交易商委员会审议通过。
14. 交易商委员会行使下列职权：
    * 1. 提高交易商数量上限；
      2. 决定交易商资格的取得、变更与终止；
      3. 决定对违规交易商的处理措施；
      4. 批准纠纷调解及违规处理委员会名单；
      5. 批准交易商委员会主任委员和副主任委员名单；
      6. 批准交易所认为应当提交交易商委员会审议的其他事项。
15. 交易商委员会会议（以下简称会议）由交易所召集，不定期召开。会议审议事项由交易所或二分之一以上（含）交易商联名提出，交易所可以提出处理建议，并于会议召开3个自然日前将审议事项和处理建议书面或邮件通知委员。
16. 会议可以以现场会议方式召开，也可以通过网络或者其他通讯方式召开。会议由主任委员主持。主任委员因特殊原因不能履行职权时，由副主任委员主持。
17. 会议应当由全体委员的三分之二以上（含）出席方为有效。每一委员享有一票表决权。

会议对终止交易商资格形成决议，应当经全体委员三分之二以上（含）表决通过；其他决议应当由超过二分之一的全体委员表决通过。

对于平台发展具有重要影响的表决事项，须经交易所同意方可通过。

1. 会议应当对表决事项制作会议纪要，由出席会议的主任委员、副主任委员和记录员签名。
2. 交易商参加会议，应当由其法定代表人出席。法定代表人因故不能出席会议的，交易商可以委托代理人出席会议，代理人应当向交易所提交交易商授权委托书，并在授权范围内行使表决权。
3. 会议实行回避制度，审议事项涉及相关交易商的，该交易商委派的人员不能出席和表决。
   1. 监督管理
4. 交易所履行平台日常管理职责，按照本办法及相关规则、协议等对交易商进行监督管理。
5. 交易所可根据需要制定信息披露规范，交易商应根据规范的要求披露相关信息。
6. 交易商注册地、实际经营场所、法定代表人、业务负责人及其联系方式等变更的，以及经营、财务、资产、实际控制人等状况发生重大变化的，应当及时报告平台。
7. 交易所可以根据需要定期或不定期对交易商进行检查，包括但不限于交易行为、内部控制及风险管理措施、经营、财务、资信等方面，交易商应当配合。
8. 交易所进行监督检查时，可以采取以下方式：
9. 查阅、复制相关交易信息、文件和资料；
10. 要求交易商提供可证明自身经营情况的材料；
11. 要求交易商解释说明相关情况；
12. 对交易商进行调查、取证；
13. 其他方式。
14. 交易商应当配合交易所的监督检查，及时提供相关材料。
    1. 附则
15. 本办法的解释权属于交易所。
16. 本办法自发布之日起实施。