

《大连商品交易所场外衍生品交易商管理办法（试行）》

第一章 总则

第一条 为促进大连商品交易所（以下简称交易所）场外衍生品业务的平稳运行，规范场外衍生品交易商（以下简称交易商）管理，制定本办法。

第二条 交易商是指经交易所批准，为场外衍生品业务提供报价等服务，并作为客户的交易对手方的法人。

场外衍生品业务包括但不限于在交易所综合服务平台开展的商品互换、场外期权等。

第三条 交易商在交易所综合服务平台开展场外衍生品业务应当严格遵守国家有关法规、行政法规和规章，满足相关监管要求和条件，履行反洗钱相关义务。

第四条 本办法适用于交易商在交易所综合服务平台开展场外衍生品业务及相关活动，交易所、交易商应当遵守本办法。

第二章 资格管理

第五条 银行、证券公司、期货公司风险管理子公司或产业企业等符合条件的机构可以申请成为交易商。

第六条 申请成为交易商，应当获得交易所场外会员资格或符合以下条件：

(一) 注册资本及净资产均不低于 5000 万元;

(二) 银行应当为国有大型商业银行、股份制商业银行或境内设立的外资商业银行; 证券公司最近一年分类评级在 A 类 A 级及以上; 风险管理子公司所在期货公司最近一年分类评级在 B 类 B 级及以上;

(三) 具有健全的内部控制、风险管理和场外衍生品业务实施方案;

(四) 最近一年无重大违法违规记录;

(五) 交易所要求的其他条件。

第七条 申请成为交易商应当提交以下书面材料, 并确保提交材料真实、准确、完整:

(一) 营业执照复印件;

(二) 最近一年的企业年度报告和审计报告;

(三) 场外衍生品业务相关实施方案和管理流程;

(四) 最近一年无重大违法违规记录承诺书;

(五) 综合服务平台用户开户申请表;

(六) 企业法定代表人的身份证明文件;

(七) 法人的授权书及经办人员的身份证明文件;

(八) 交易所要求的其他材料。

交易所场外会员、期货保证金指定存管银行申请成为交易商的, 免于提交上述第(一)、(二)、(四)、(六)、(七)项规定的材料。以上材料均须加盖申请主体公章。

第八条 交易商提交的书面材料经审核通过后，应当与交易所签署《大连商品交易所场外衍生品交易商协议》及《风险揭示书》，明确双方的权利和义务，并缴存协议约定的结算准备金。交易商应当按照交易所业务规则以及协议，履行相关义务。

获得交易所场外会员资格的产业企业成为交易商后，只得开展其所属品种板块内相关品种的场外衍生品业务。

第九条 交易商存在下列情形之一的，交易所有权取消其交易商资格并向市场公告：

（一）两个自然年度内未在交易所综合服务平台开展场外衍生品业务；

（二）不再满足本办法第六条规定的交易商条件；

（三）存在重大违法违规行为；

（四）依法被收购、兼并、撤销、解散或者宣告破产；

（五）向交易所提交虚假材料；

（六）本办法规定、交易所认定或协议约定的其他情形。

第十条 交易商放弃交易商资格，应当提前一个月向交易所申请并经交易所同意。

第十一条 交易商放弃或被取消资格的，自交易所通知失去资格之日起，一年内交易所不再受理其交易商资格申请。

第三章 交易与报价服务

第十二条 交易商和客户开展场外衍生品业务前，应当与客

户签署相关场外衍生品交易主协议及补充协议，并按照相关监管要求对客户进行适当性审查、资信审查及反洗钱审查等必要工作，确保客户真实、合规。

第十三条 交易商应在交易所综合服务平台申请交易编码开展场外衍生品业务，不得使用该交易编码或身份在平台以外开展业务，或从事与场外衍生品业务无关的其他交易。

第十四条 交易商应当在场外衍生品业务中向客户提供报价服务，报价服务包括以下类型：

（一）回应报价。在交易时间内，交易商可以根据客户需求，与客户协商确定合约条款，并为客户提供回应报价服务；

（二）主动报价。在交易时间内，交易商可以向交易所申请开展主动报价服务。经交易所审批后，交易商可以向客户发布场外衍生品合约信息及交易价格信息。

第十五条 交易商可以向交易所提交《场外衍生品交易商信用额度申请确认书》，为其客户申请信用额度，该信用额度仅用于交易商与该客户之间的场外衍生品交易，交易商需为此承担相应信用风险。

第十六条 交易商应当审慎控制持仓规模，确保风险可控。

第四章 产业服务项目主体交易商资格管理

第十七条 产业服务项目，指“大商所农保计划”、“大商所企风计划”及交易所认可的其他项目。产业服务项目主体（以下

简称项目主体), 指获得产业服务项目立项或备案资格的主体。

第十八条 项目主体通过场外衍生品业务运行项目, 应当申请获得交易商或客户资格, 与交易所签订协议并开户。

第十九条 不符合交易商条件的项目主体, 可向交易所申请豁免部分条件, 交易所同意后, 获得交易商资格。

第二十条 豁免部分条件后获得交易商资格的项目主体, 仅限于开展产业服务项目范围内的场外衍生品业务。

第二十一条 对于豁免部分条件后获得交易商资格的项目主体, 发生如下情形的, 交易所所有权取消其交易商资格:

(一) 未经交易所允许, 开展产业服务项目范围外场外衍生品业务的;

(二) 产业服务项目运行结束的。

第二十二条 项目主体交易商资格管理其他未涉及事项, 按照本办法的相关规定执行。

第五章 监督管理

第二十三条 交易所按照本办法及交易所相关业务规则对交易商进行监督, 交易商及其相关机构应当积极配合交易所监督。

第二十四条 对于提供回应报价和主动报价服务的交易商应当依据市场情况合理报价, 为市场提供真实、有效的报价服务, 不得利用交易商资格进行虚假交易、内幕交易、市场操纵、

欺诈、洗钱和其他违法违规行为，或者牟取其他不正当利益。

第二十五条 交易所对交易商开展场外衍生品业务情况进行评价和评级管理，并可以将相关情况向市场进行公布。

第二十六条 交易商的控股股东（合伙人）、经营场所、法定代表人、业务负责人及其联系方式等发生变化，以及财务状况和技术系统等发生重大变化时，应当自发生之日起 3 个期货交易日内向交易所书面报告。

第二十七条 交易商应当按照交易所要求报告业务开展情况，妥善保存相关交易及风控记录，以备核查。

第二十八条 交易所可以对交易商的风险管理、交易行为、授信管理、系统运行以及经营、资信等情况进行监督和检查，交易商应当予以协助和配合。

第六章 附则

第二十九条 违反本办法规定的，交易所可以根据《大连商品交易所商品互换业务管理办法（试行）》、《大连商品交易所场外期权业务管理办法（试行）》及相关协议的有关规定处理。

第三十条 本办法解释权属于交易所。

第三十一条 本办法自公布之日起实施。