附件1

**《大连商品交易所基差交易业务管理办法》**

**修正案**

第二条 本办法所称基差交易，是指买卖双方在综合服务平台（以下简称平台）签订基差贸易合同并以实物交收方式进行履约的业务活动。合同成交后可通过转让、回购方式了结基差交易包括交易商之间的基差交易、交易商与客户之间的基差交易两种。

第四条 合同内容包括品种、交易数量、基准期货合约、基差、品级、交货地、最后点价日、最后交收日、点价方、追保方、交易保证金率等基本信息，以及专用、通用合同条款。合同模板由交易所制定。

第五条 参与基差交易的交易商等、客户（以下统称交易参与者）以及与基差业务相关的其他各类主体应当遵守本办法。

第六条 基差交易采用交易商制度，交易商实行分类管理。

第二章 交易商参与者管理

第七条 交易商的权利包括：

（二）AA类、A类、B类交易商具有按照本办法的规定在平台开展相关基差交易的权利；在交易商之间的基差交易中，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；在交易商与客户之间的基差交易中，各类交易商与客户均有权签发基差贸易合同。

第九条 交易商按品种板块管理，品种板块设置与场外会员相同。经交易所审核批准后，交易商仅能进行相应品种板块的基差交易。除另有规定外，每个品种板块内的所有交易商之间均为当然的、合格的交易对手。

第十三条 申请成为B类交易商，应当向交易所提交以下材料：

……

（三）申请单位人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；

……

第十六条 交易所可以根据申请人的财务状况、 风险管理能力、 运营稳健程度以及申请人提交的书面承诺等材料，豁免上述一项或者多项条件。经交易所批准后，申请单位人应当与交易所及相关各方签订协议，参与基差交易。

第四节 客户管理

第二十三条 申请成为客户应当具备以下条件：

1. 经工商行政管理部门注册登记，具有所参与交易品种合法经营资格的法人；
2. 承认并遵守相关政府监管部门的法律法规、本办法以及交易所公布的规则与规定；
3. 最近12个月未受到刑事处罚或者责令停产停业、吊销许可证或执照的行政处罚；
4. 与交易商建立互相同意对方为交易对手的认可关系；
5. 交易所认定的其他条件。

交易所可以根据申请人的财务状况、 风险管理能力、 运营稳健程度以及申请人提交的书面承诺等材料，豁免上述一项或者多项条件。

第二十四条 申请成为客户应当提交以下书面材料：

1. 营业执照复印件；
2. 综合服务平台用户开户申请表；
3. 申请人的授权书及经办人员的身份证明文件；
4. 无重大违法违规记录承诺函；
5. 申请人和交易商互相认可对方为交易对手的证明材料；
6. 交易所要求的其他材料。

上述资料均须加盖申请人公章，交易商出具的第（五）项证明材料须加盖交易商公章。申请人提交的材料应当真实、准确、完整。

第二十五条 客户开展基差交易业务前，应当与交易所签订相关协议，明确双方的权利和义务。

第二十六条 建立认可关系的客户与交易商之间只能开展该交易商获批的品种板块基差交易。

第二十七条 客户存在下列情形之一的，交易所有权取消其资格：

1. 两个自然年度内未在平台开展基差交易业务；
2. 受到刑事处罚或者责令停产停业、吊销许可证或执照的行政处罚；
3. 依法被收购、兼并、撤销、解散或者宣告破产；
4. 向交易所提交虚假材料；
5. 本办法规定、交易所认定或协议约定的其他情形。

第二十九条 交易商参与者开展基差交易前，应在平台开立交易账户和清算账户，。在交易商之间的基差交易以及交易商与客户间的基差交易两项业务相互独立，交易参与者应根据其拟开展的业务类型分别申请。交易参与者应在综合业务指定存管银行开立或指定资金账户。，开户后生成相关基差业务类型的交易编码。交易账户及密码是平台识别交易商或客户身份的依据。以交易账户登录信息、交易编码进行的操作、发出的指令即视为该交易商参与者做出。

第三十条 除另有规定外，每个品种板块内的所有交易商之间均可开展基差交易。交易商与客户之间只有在建立认可关系之后才能成为交易对手。

第三十一条 ……

挂牌交易，是指交易商参与者在平台上对合同进行公开报价，由其他有权与其交易商的交易参与者响应达成的交易。

协商交易，是指交易商参与者在平台上对合同进行定向报价，由指定的交易商参与者响应达成的交易。

第三十四条 交易商应当之间达成交易后生成的合同，由交易双方自行约定合同是否可转让。，合同转让期为合同首次成交时起至最后交收日闭市前。交易商与客户达成交易后生成的合同，不可转让。

第三十六条 交易商之间达成交易生成的合同，经双方协商一致，合同签发人可以对已签发的可转让合同进行回购。交易商与客户达成交易后生成的合同，不可回购。

第三十七条 交易商双方应当选择自行结算或委托平台结算。

自行结算的，合同不能在平台进行转让、回购，交易商之间双方自行约定结算方式等合同条款。

……

第三十九条 ……

交易保证金由平台按照交易商合同设定的交易保证金率计算收取，交易保证金首先以交易商双方之间互认的信用额度充抵，信用额度不足的部分，以货币资金支付。

追加保证金由交易商双方在合同中约定，平台按照追保方发出的追加保证金指令收取，追加保证金仅以货币资金支付。

第四十条 信用额度由交易商之间双方协商确定并自行承担风险，平台根据信用额度授予方的通知登记信用额度。

第四十二条 交易商参与者响应转让或回购交易的报价指令时，平台以首次基差成交价与转让或回购成交价之差计算、划转资金，公式为：

转让方或被回购方价差=（转让或回购成交价-首次基差成交价）×交易数量

受让方或回购方价差=（首次基差成交价-转让或回购成交价）×交易数量

第四十七条 ……清算账户货币资金不足的，平台在结算后发出追保通知，交易商参与者应当在下一交易日开市前补足。

第四十八条 ……清算账户货币资金不足的，平台在结算后发出追保通知，交易商参与者应当在下一交易日开市前补足。……

第五十条 最后点价日闭市前，交易商参与者未进行首次点价确认的，平台不接受其追加保证金指令及交收申请。……清算账户货币资金不足的，平台在结算后发出追保通知，交易商参与者应当在下一交易日开市前补足。

第五十一条 ……

清算账户货币资金不足的，平台在最后交收日结算后发出追加货款通知，交易商参与者应当在下一交易日开市前补足。

第五十四条 平台在每日闭市清算完成后办理出金业务。可出资金即清算账户货币资金中未被交易保证金占用的部分，当交易商参与者发生纠纷或涉嫌违规时，平台有权采取限制出金等处置措施。

第五十五条 交易商参与者清算账户中未被占用的货币资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，平台在每年的3月、6月、9月和12月下旬将利息支付给交易商参与者。具体执行利率由平台确定、调整并通知。

第六十二条 交易商参与者应当履行基差交易业务相关的各项义务，并承担相关风险及责任。

第六十三条 交易商参与者应当遵循国家法律法规和金融管理的相关规定，不得虚构交易，从事洗钱、避税等违法违规活动。

第六十四条 交易所有权对交易商参与者在平台上发生的所有交易行为进行监督管理。

第六十五条 交易所有权根据交易商参与者的授权及有权机关的法律文书等书面文件，对资金进行划转。

第六十六条 交易所仅以收取的资金为限按照基差交易业务相关规则对资金进行划转，不对各参与主体的信用风险承担任何责任，不承担与货物质量、数量等有关的任何责任。交易商之间基差交易业务以外的纠纷与平台及交易所无关。

第六十八条 交易商参与者涉嫌违规的，由交易所进行调查，交易商参与者有义务予以配合。

第六十九条 交易商参与者有以下行为之一的，交易所有权认定其违规：

……

第七十条 交易商参与者被认定违规的，应当及时改正或补救。交易所可视情节轻重，采取以下一项或多项措施：

……

（三） 限制交易商参与者业务范围；

（四） 暂停或终止交易商相关资格；

……

第七十一条 交易所认定交易商参与者违规的，应当制作违规处理决定书。

违规处理决定书应列明以下内容：

1. 交易商名称、住所地；

……

第七十二条 违规处理决定书将以邮寄或电子邮件的形式告知交易商参与者。……以电子邮件方式告知的，电子邮件发送至交易商参与者电子邮箱时即视为告知。交易商参与者地址及电子邮箱以交易所留存信息为准。

第七十三条 交易商参与者申请复议，应于告知之日起30个自然日内书面向交易所提出。复议期间，不停止违规处理决定的执行。

第七十四条 交易商参与者发生纠纷或涉嫌违规的……

第七十五条 交易所可以为交易商与客户之间的交易提供个性化服务，具体规定另行制定。

注：阴影部分为新增内容，双划线部分为删除内容；出现条款增删的，其他条款顺序依次顺延。