附件1

相关业务规则

一、大连商品交易所标准仓单交易管理办法（试行）

第一章 总则

第一条 为了提高大连商品交易所（以下简称交易所）服务实体经济的能力，保障大连商品交易所综合服务平台（以下简称平台）标准仓单交易及相关业务的有序开展，根据国家有关法律、法规、《大连商品交易所章程》《大连商品交易所标准仓单管理办法》及相关业务规则，制定本办法。

第二条 标准仓单交易的开户、交易、结算、交收、风险控制、违规违约处理以及在平台开展标准仓单质押（以下简称标准仓单平台质押）等适用本办法。交易所、仓单交易客户、期货公司会员、综合业务指定存管银行、贷款机构等主体在平台开展标准仓单交易相关业务应当遵守本办法。

第二章 客户管理

第三条 申请成为仓单交易客户应当具备以下条件：

（一）经市场监督管理部门登记注册，并具有所参与交易品种合法经营资格的法人；

（二）能够开具所参与交易品种的增值税专用发票；

（三）能够合规持有标准仓单；

（四）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；

（五）具有健全的风险管理、财务会计和内部控制制度；

（六）最近3年未因重大违法违规行为受到行政处罚或者刑事处罚；

（七）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。

除交易所非期货公司会员外，申请成为仓单交易客户还应当指定一家期货公司会员作为其标准仓单交易业务期间的仓单管理会员。

第四条 申请成为仓单交易客户，应当按要求向交易所提交相关证明材料，并对提交材料的真实性、准确性和合法性承担法律责任，证明材料的具体要求另行公布。

第五条 审核通过后，仓单交易客户应当与交易所签署协议，并按要求办理相关开户手续。

第六条 仓单交易客户应当申请开立仓单交易账户，每个仓单交易客户只拥有一个仓单交易账户。

第七条 仓单交易客户应当妥善保管其仓单交易账户的用户名和密码，对账户发出的交易要约和产生的交易结果承担法律责任，不得将其转让或转借他人使用。

第八条 交易所对仓单交易客户实施日常管理，发生下列事项之一的，仓单交易客户应当于事项发生之日起5个工作日内书面通知交易所：

（一）法人营业执照事项变更的；

（二）发生合并、分立、解散、申请破产、进入破产程序或者其他涉及主体变更情形的；

（三）涉及与经营管理有关的重大诉讼案件或者经济纠纷的；

（四）不具备履约能力的；

（五）其他可能影响履约能力的情形。

仓单交易客户未及时向交易所履行通知义务造成损失的，应当承担法律责任。

第九条 仓单交易客户在履约完毕并结清其资金及其他费用后，可以向交易所申请注销参与标准仓单交易的资格。交易所在审核通过后5个工作日内为其办理仓单交易账户注销及相关手续。

对于被交易所撤销参与标准仓单交易业务资格的仓单交易客户，应当在履约完毕并结清资金及其他费用后，配合交易所办理仓单交易账户注销及相关手续。

第十条 仓单交易客户未按照规定办理仓单交易账户注销及相关手续的，应当对其仓单交易账户发生的行为承担法律责任。

第三章 交易业务

第十一条 标准仓单交易的交易标的为交易所标准仓单，具体品种由交易所另行公布。

第十二条 标准仓单交易的交易日历与交易所期货交易一致。每一交易日的具体交易时间由交易所另行公布。

第十三条 仓单交易客户通过平台将标准仓单进行交易登记后，方可用于标准仓单交易及相关业务。完成交易登记的标准仓单需要解除交易登记后，方可用于除标准仓单交易及相关业务外的其他业务。进行交易登记的标准仓单需满足以下条件：

（一）标准仓单能够正常用于交易业务；

（二）标准仓单处于交易所规定的交易周期内，每个标准仓单交易品种交易周期由交易所另行公布；

（三）交易所认定的其他条件。

第十四条 标准仓单交易的单位为“手”，不同品种每手对应的标的物数量按照相应品种期货合约标准进行设置。

标准仓单交易应当以“一手”的整数倍进行，对于有交割单位的品种，标准仓单交易应当以该品种交割单位对应手数的整数倍进行。

第十五条 标准仓单交易采用挂牌交易方式，挂牌交易外的其他交易方式由交易所另行公布。

第十六条 标准仓单挂牌交易分为卖方挂牌交易、协商挂牌交易和买方挂牌交易三种方式，具体品种适用的挂牌交易方式由交易所另行公布。

卖方挂牌交易是指卖方仓单交易客户在规定的交易时间内，以挂牌方式发出标准仓单卖出信息，买方仓单交易客户摘牌后，于当日完成结算交收的交易方式。

协商挂牌交易是指卖方仓单交易客户在规定的交易时间内，以挂牌方式向特定买方仓单交易客户发出标准仓单卖出信息，买方仓单交易客户摘牌后，于当日完成结算交收的交易方式。

买方挂牌交易是指买方仓单交易客户在规定的交易时间内，发出买入标准仓单需求信息，卖方仓单交易客户以挂牌方式响应，买方仓单交易客户在已响应买入需求的卖方挂牌中选择进行摘牌后，于当日完成结算交收的交易方式。

第十七条 标准仓单挂牌交易可以设置全部或部分摘牌。

（一）卖方仓单交易客户单次挂牌出售标准仓单时设置为全部摘牌的，买方仓单交易客户摘牌时须一次性购买该单次挂牌的所有标准仓单。

（二）卖方仓单交易客户单次挂牌出售标准仓单时设置为部分摘牌并填写最小摘牌数量的，买方仓单交易客户摘牌时可以购买该次挂牌内的部分或者全部标准仓单，购买仓单数量应当大于或者等于最小摘牌数量。

最小摘牌数量是指采用分批挂牌的情况下，允许买方仓单交易客户摘牌购买的最小仓单数量。

第十八条 标准仓单交易的报价方式为全价报价和基差报价。

（一）全价报价是指仓单交易客户在交易时按照报价单位和报价的最小变动价位填写标准仓单交易价格的报价方式。报价单位和报价的最小变动价位按照相应品种期货合约的标准进行设置。

（二）基差报价是指卖方仓单交易客户在挂牌时选定挂牌标准仓单对应品种的某一月份期货合约并填写基差的报价方式。基差报价的标准仓单交易的成交价格为成交时刻对应期货合约价格加上相应基差后的价格，基差的报价单位参照相应品种期货合约报价单位进行设置。

第十九条 卖方挂牌交易的业务流程如下：

（一）卖方挂牌。卖方仓单交易客户以挂牌形式发布挂牌交易信息。挂牌信息包括品种、指定交割仓库、挂牌数量、挂牌价格、最小摘牌数量。最小摘牌数量是指卖方仓单交易客户挂牌时设定的允许买方仓单交易客户摘牌购买的最小仓单手数。

（二）买方摘牌。买方仓单交易客户根据挂牌信息进行摘牌。买方仓单交易客户摘牌数量应大于等于最小摘牌数量。买方仓单交易客户摘牌后挂牌信息不再显示。

第二十条 协商挂牌交易的业务流程如下：

（一）卖方挂牌。卖方仓单交易客户以挂牌形式向特定买方仓单交易客户发出标准仓单卖出信息。挂牌信息包括品种、指定交割仓库、挂牌数量、挂牌价格。

（二）买方摘牌。买方仓单交易客户根据挂牌信息进行摘牌。

第二十一条 买方挂牌交易的业务流程如下：

（一）买方信息发布。买方仓单交易客户在规定的交易时间，发布拟购入标准仓单需求信息。需求信息包括品种、指定交割仓库、意向价格、拟购入数量；

（二）卖方挂牌响应。卖方仓单交易客户以挂牌方式响应买方需求，卖方挂牌标准仓单的品种、指定交割仓库应当符合买方需求。；

（三）买方确认交易。买方仓单交易客户可以在已响应买入需求的卖方挂牌中选择进行摘牌。卖方仓单交易客户可以在买方仓单交易客户确认交易前撤销挂牌响应。

第二十二条 标准仓单交易采用全款交易方式。全款交易方式是指买方仓单交易客户在摘牌时付清所摘牌标准仓单全部货款及相关费用的交易方式。

第二十三条 卖方仓单交易客户在挂牌前应确保持有足额标准仓单。平台需校验卖方仓单交易客户存在相应标准仓单并将相应标准仓单予以冻结。

第二十四条 买方仓单交易客户在摘牌前应确保账户资金余额充足。平台需校验买方仓单交易客户账户资金余额充足并将相应货款及费用予以冻结。

第二十五条 仓单交易客户可以通过平台查询其参与标准仓单交易的相关信息。

第四章 结算业务

第二十六条 结算是指交易所根据仓单交易客户的交易结果和交易所的相关规定，对标准仓单交易的货款、手续费及其他款项进行计算、收付的行为。

第二十七条 交易所对标准仓单交易的买卖双方仓单交易客户进行当日结算。

第二十八条 仓单交易客户应当在综合业务指定存管银行开设或指定银行账户，用于办理与仓单交易账户的资金往来业务。综合业务指定存管银行应当按照《大连商品交易所综合业务指定存管银行管理办法（试行）》的规定予以办理。

第二十九条 交易所对标准仓单交易采取实时收付的方式。实时收付是指在交易时间段内，买方仓单交易客户付清标准仓单全部货款及相关费用，经交易所确认后，完成货款划转和标准仓单过户。

第三十条 交易所向卖方仓单交易客户支付货款时，将按照摘牌标准仓单全部货款金额的一定比例预扣发票保证金，卖方仓单交易客户迟交或者不交增值税专用发票的，交易所有权按照本办法第三十一条、第三十二条、第三十三条的规定，从该发票保证金中扣划发票违约金。每个标准仓单交易品种对应的发票保证金比例按照相应品种增值税税率设置，品种有另行规定的适用其规定。

第三十一条 对于采用卖方挂牌和买方挂牌交易方式的交易：

（一）买卖双方仓单交易客户完成标准仓单过户后，交易所向买方仓单交易客户开具增值税专用发票，卖方仓单交易客户向交易所开具增值税专用发票；

（二）交易所设定每月23日为当月开具增值税专用发票截止日，凡是在每月23日（含当日）之前成交的交易，交易所在当月向买方仓单交易客户开具增值税专用发票；凡是在当月23日之后成交的交易，交易所在次月增值税专用发票开票截止日之前向买方仓单交易客户开具增值税专用发票。交易所可以根据市场情况调整每月增值税专用发票开票截止日。

（三）卖方仓单交易客户应当在成交后5个交易日内向交易所开具增值税专用发票并送达交易所。卖方仓单交易客户是银行、证券等金融机构的，应当在成交后7个交易日内开具增值税专用发票并送达交易所。

（四）卖方仓单交易客户未在规定时间内送达增值税专用发票的，自应交而未交增值税专用发票次日起，交易所按照每天未交增值税专用发票对应货款金额0.5‰的比例扣收发票违约金；超过30天未交增值税专用发票的，视作不交增值税专用发票，交易所按照未交增值税专用发票对应货款金额20%的比例扣收发票违约金。

（五）交易所在收到增值税专用发票的2个交易日内对其进行验证，验证合格后清退发票保证金。对于验证不合格的，仓单交易客户应当在交易所发出书面通知的10个交易日内重新提交增值税专用发票。规定时间未能提交或者虽在规定时间内提交但经交易所验证仍不合格的，视作不交增值税专用发票，交易所按照未交增值税专用发票对应货款金额20%的比例扣收发票违约金。

第三十二条 对于采用协商挂牌交易方式的交易：

（一）买卖双方仓单交易客户完成标准仓单过户后，买方仓单交易客户应将增值税专用发票开票信息通知卖方仓单交易客户。

（二）卖方仓单交易客户向买方仓单交易客户开具增值税专用发票，并由双方线下交付并提交平台确认。交易所根据双方确认结果清退卖方发票保证金；

（三）标准仓单过户后，超过 30 个自然日卖方仓单交易客户仍未向买方仓单交易客户开具发票的，视作不交发票。交易所将卖方仓单交易客户的发票保证金作为赔偿金划转给买方仓单交易客户。买卖双方另有约定的，遵其约定。

第三十三条 因仓单交易客户违反本办法规定而产生的所有税收损失及相关费用由仓单交易客户自行承担。因仓单交易客户违反国家税务有关法律法规导致交易所产生税收损失及相关费用的，交易所有权向仓单交易客户追偿。

第三十四条 仓单交易客户当日结算资金余额计算方式如下：

当日结算资金余额=上一日结算资金余额+当日应收全额货款-当日应付全额货款+入金-出金+当日清退发票保证金-当日暂扣发票保证金-当日交易手续费-其他费用

第三十五条 仓单交易客户可以在交易所规定时间申请办理出入金。具体出入金办理时间由交易所另行公布。

第三十六条 仓单交易客户可出金额计算方式如下：

可出金额=出金时资金余额-其他应付费用

第三十七条 仓单交易客户出现下列情形之一的，交易所可以限制其出金：

（一）涉嫌重大违规，经交易所立案调查的；

（二）因违法或犯罪接受国家有关部门立案调查处理期间的；

（三）交易所认定的其他情形。

第三十八条 每个交易日闭市后，交易所向仓单交易客户提供当日结算报表。仓单交易客户对结算数据有异议的，应当在下一交易日开市前以书面形式通知交易所。在规定时间内仓单交易客户未对结算数据提出异议，视为仓单交易客户已认可结算数据的正确性。

第三十九条 仓单交易客户开展标准仓单交易应当按规定缴纳交易手续费，具体标准由交易所另行公布。交易所在每月初向仓单交易客户开具上月手续费发票。

第四十条 仓单交易客户仓单交易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，交易所在每年的 3 月、6 月、9 月和 12 月下旬向仓单交易客户支付利息，具体执行利率标准由交易所确定、调整并公布。

第五章 交收业务

第四十一条 标准仓单交易实行当日交收制度。买卖双方仓单交易客户采取仓单过户的方式实现交易标的标准仓单所有权的转移。标准仓单在成交当日完成标准仓单过户。

第四十二条 标准仓单交易后，若买方仓单交易客户对标准仓单注销后的商品质量、数量有异议的，按照《大连商品交易所标准仓单管理办法》及相关品种细则中的有关规定处理。

第六章 质押业务

第四十三条 贷款机构开展标准仓单平台质押业务，应当具备以下条件，并按规定向交易所提交申请：

1. 具备开展相关贷款业务的资质；
2. 技术系统满足标准仓单平台质押业务需求；
3. 在综合业务指定存管银行开设或者指定银行账户用于办理与质押业务相关的资金往来业务；
4. 交易所认定的其他条件。

交易所审核通过后，为贷款机构开立质押业务专用账户并开通标准仓单平台质押业务权限。

第四十四条 仓单交易客户开展标准仓单平台质押业务应按规定向交易所提交申请，交易所审核通过后，为仓单交易客户开通标准仓单平台质押业务权限。

第四十五条 标准仓单平台质押业务流程如下：

（一）仓单交易客户提出质押申请。仓单交易客户通过平台提出质押申请，并提交拟质押的标准仓单。每笔质押申请提交的拟质押标准仓单品种、仓库应相同。

（二）贷款机构确认。贷款机构收到仓单交易客户的申请后，对仓单交易客户提交的质押申请进行确认。

（三）标准仓单质押登记。交易所根据贷款机构确认结果对客户提交质押的标准仓单进行质押登记。

第四十六条 仓单交易客户向贷款机构申请解除标准仓单质押登记，经贷款机构确认后，交易所解除相应标准仓单的质押登记。

第四十七条 仓单交易客户可以与贷款机构协商将质押的标准仓单在平台进行交易用于偿还贷款。

交易达成后，仓单交易客户从扣除发票保证金及相关费用的剩余货款（仓单交易货款-发票保证金-相关费用）中将应还款金额划给贷款机构。剩余货款不足以偿还应还款金额的，仓单交易客户应在发票保证金清退后，将差额部分（应还款金额-已还款金额）划给贷款机构。发票保证金清退后仍不足以偿还应还款金额的，贷款机构应与仓单交易客户自行协商解决。

第四十八条 仓单交易客户到期未清偿债务或者出现其他与贷款机构约定的违约情形时，交易所可以根据仓单交易客户对贷款机构的授权或司法机关的法律文书通过平台协助贷款机构进行违约处置。

第四十九条 质押登记的标准仓单在规定的标准仓单注销期限最后一日前未解除质押登记的，交易所将在标准仓单注销期限最后一日将相应标准仓单解除交易登记并注销。相应标准仓单注销后的提货密码将发送至贷款机构，后续事宜由贷款机构与仓单交易客户协商处理。

第七章 风险控制

第五十条 标准仓单交易实行价格限制。交易所根据相应品种基准价确定价格限制区间。仓单交易客户超过价格限制区间的挂牌申请无效。

第五十一条 基准价是相应品种标的期货合约的前一日结算价。

第五十二条 标的期货合约是指交易所选取的作为某一特定品种标准仓单交易价格限制参考依据的基准期货合约。交易所可以根据市场情况调整该品种对应的标的期货合约。

第五十三条 价格限制区间根据基准价与最大价格波动幅度计算。最大价格波动幅度由交易所根据品种进行设置。最大价格波动幅度包括最大涨幅和最大跌幅。

价格限制区间=[基准价-最大跌幅，基准价+最大涨幅]

出现下列情形之一的，交易所可以调整其最大价格波动幅度：

（一）相应品种标的期货合约调整涨跌停板幅度；

（二）交易所认为市场价格波动明显增大；

（三）交易所认定的其他情形。

第五十四条 标准仓单交易实行风险警示制度。交易所认为必要时，可以分别采取或者同时采取要求仓单交易客户报告情况、谈话提醒、书面警示、发布风险警示公告中的一种或者多种措施，以警示和控制风险。

第五十五条 标准仓单交易实行市场总体规模限制。交易所可以根据品种设置可用于交易的标准仓单市场总体规模上限，当某一品种参与交易的标准仓单总量达到了该品种的市场总体规模上限时，平台不再接受新的交易登记申请。具体品种的规模上限由交易所制定，交易所有权根据风险状况进行调整。

第八章 违规违约处理

第五十六条 仓单交易客户在标准仓单交易过程中，出现以下情形之一的，构成违约。违约方应当按照本办法相关规定继续履约并承担支付违约金等违约责任：

（一）卖方仓单交易客户未在规定时间内按全额货款开具增值税专用发票；

（二）仓单交易客户未按照规定缴纳手续费及其他相关费用；

（三）其他违约行为。

第五十七条 仓单交易客户存在下列情形之一的，交易所可以采取相应违规处理措施：

（一）假借标准仓单交易之名从事洗钱等非法活动的；

（二）实施本办法第五十八条规定的市场禁止行为的；

（三）提交的开户材料及其他资料不真实、准确、完整的；

（四）未按照本办法第八条的规定向交易所履行通知义务的；

（五）未按照本办法第九条的规定办理仓单交易账户注销及相关手续的；

（六）交易所认定的其他违规行为。

第五十八条 市场禁止行为包括但不限于：

（一）单独或者合谋，集中资金优势、仓单优势、信息优势，通过标准仓单交易，影响标准仓单交易价格、交易量的；

（二）蓄意串通，按照事先约定的时间、价格和方式进行相互交易，影响标准仓单交易价格、交易量、转移资金或牟取不正当利益的；

（三）单独或者合谋，通过信息发布扰乱市场秩序，影响标准仓单交易价格的；

（四）单独或者合谋，垄断、囤积交易所大量标准仓单，影响或者企图影响期货市场行情或者交割的；

（五）交易所认定的其他禁止行为。

第五十九条 对于违反本办法的仓单交易客户，交易所视情节轻重对其给予警告、暂停标准仓单交易权限、撤销仓单交易客户参与标准仓单交易的资格的违规处理措施。

对于违反交易所其他业务规则的仓单交易客户按照交易所相关业务规则处理。

第六十条 仓单交易客户交易行为导致标准仓单交易价格异常波动或者瞬间大幅度偏离市场价格，交易所可以采取对挂牌和信息发布予以撤销、对已成交交易的价格不予公布和统计、警告、暂停仓单交易客户部分或者全部交易权限、撤销仓单交易客户参与标准仓单交易的资格等措施。

第六十一条 经交易所调查发现违规行为涉嫌违法犯罪的，交易所将相关线索依法移交行政执法部门或者司法机关处理。

第九章 异常情况处理

第六十二条 标准仓单交易期间，出现下列异常情况之一的，交易所可以对标准仓单交易采取调整开市收市时间、调整价格限制区间、暂停交易、限制出金、撤销挂牌等紧急措施：

（一）地震、水灾、火灾、台风、战争、疫情等不可抗力或者暴力恐怖袭击、网络袭击、停电、通讯故障、计算机系统故障等原因导致交易、结算、交收等业务全部或者部分无法正常进行；

（二）交易所认定的其他情况。

第十章 信息管理

第六十三条 交易所标准仓单交易信息是指在交易所标准仓单交易活动中所产生的所有交易行情、各种交易数据统计资料以及交易所发布的标准仓单交易各种公告信息。

第六十四条 交易所发布的标准仓单交易信息包括但不限于：品种、成交价格、成交量、成交金额等。

信息发布可以根据不同内容按实时、延时、每日、每周、每月、每年定期发布。

第六十五条 仓单交易客户、期货公司会员、综合业务指定存管银行、信息服务机构等单位不得泄露因参与标准仓单交易业务而获取的商业秘密，不得发布虚假的或者带有误导性质的信息。

第六十六条 仓单交易客户、期货公司会员、综合业务指定存管银行、信息服务机构参与交易所的标准仓单交易信息归交易所所有。未经交易所授权许可，任何单位和个人不得发布、经营、增值开发、传播和使用，否则交易所有权追究其法律责任。

第六十七条 为交易所标准仓单交易信息发布及日常信息管理提供软硬件服务的信息服务机构应当保证相关设施的安全运行和交易信息发布的及时性、准确性。

第十一章 附则

第六十八条 本办法的解释权属于大连商品交易所。

第六十九条 本办法自公布之日起实施。

二、大连商品交易所基差交易业务管理办法

1. 总则
2. 为规范大连商品交易所（以下简称交易所）基差交易业务活动，保障参与主体的合法权益，维护基差交易的市场秩序，特制定本办法。
3. 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。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。
4. 基差贸易合同（以下简称合同），是指买卖双方以某期货合约价格为计价基础，加上基差，作为交收结算价格的货物购销合同。上述某期货合约为基差交易的基准期货合约。
5. 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。
6. 参与基差交易的交易商、客户（以下称交易参与者）以及与基差业务相关的其他各类主体应当遵守本办法。
7. 交易参与者管理

第一节 交易商分类

1. 交易商分为AA类、A类和B类三种类型。
2. 交易商的权利包括：
3. 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；
4. AA类、A类、B类交易商具有按照本办法的规定开展相关基差交易的权利；在交易商之间的基差交易中，AA类、A类交易商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。
5. 相关协议规定的其他权利。
6. 交易商的义务包括：
7. 履行协议规定义务；
8. 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；
9. AA类交易商除上述两项义务外，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。
10. 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。

第二节 交易商资格申请

1. 申请成为B类交易商，应当符合以下条件：
2. 具备场外交易会员资格或交易所认可的其他条件；
3. 期货公司风险管理公司申请的，应符合中国期货业协会规定的开展基差贸易业务的条件；
4. 交易所要求的其他条件。
5. 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：
6. 具有较强的基差交易能力；
7. 交易所要求的其他条件。
8. 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：
9. 具有较强的基差报价能力；
10. 交易所要求的其他条件。
11. 申请成为B类交易商，应当向交易所提交以下材料：
12. 最近两个年度涉诉情况说明；
13. 开展基差交易业务相关的制度、部门和人员设置的说明材料；
14. 申请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；
15. 交易所要求的其他材料。
16. 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：
17. 基差交易能力的证明材料；
18. 交易所要求的其他材料。
19. 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：
20. 基差报价能力的证明材料；
21. 交易所要求的其他材料。
22. 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，申请人应当与交易所及相关各方签订协议，参与基差交易。
23. 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，用于弥补该交易商在该品种板块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，或因交易所规定金额提高的，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。
24. 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。
25. 交易商资格终止时,在其处理完基差业务且与其他各方没有纠纷后,交易所清退剩余的风险保障金。

第三节 交易商资格的转换与终止

1. 经交易所批准，交易商可以进行资格类型的转换。
2. 交易商出现以下情形之一的，交易所有权终止该交易商的资格：
3. 主动申请终止交易商资格的；
4. 不再符合所属类型条件的；
5. 无正当理由未按规定履行交易商义务的；
6. 出现重大违法、违规、违约等行为的；
7. 被交易所批准的其他情形。
8. 交易商资格终止的，自主动申请或被交易所通知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。交易商资格终止一年内，交易所不再受理其交易商资格申请。

第四节 客户管理

1. 申请成为客户应当具备以下条件：

（一）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；

（二）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；

（三）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；

（四）与交易商建立互相同意对方为交易对手的认可关系；

（五）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。

1. 申请成为客户应当提交以下书面材料：

（一）营业执照复印件；

（二）综合服务平台用户开户申请表；

（三）申请人的授权书及经办人员的身份证明文件；

（四）无重大违法违规记录承诺函；

（五）申请人和交易商互相认可对方为交易对手的证明材料；

（六）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。

1. 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。
2. 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。
3. 客户存在下列情形之一的，交易所有权取消其资格：

（一）两个自然年度内未在平台开展基差交易业务；

（二）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；

（三）依法被收购、兼并、撤销、解散或者宣告破产；

（四）向交易所提交虚假材料；

（五）本办法规定、交易所认定或协议约定的其他情形。

1. 交易业务
2. 基差交易的交易日与交易所期货交易一致，每一交易日的具体交易时间安排和交易品种由交易所另行公布。
3. 交易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。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参与者做出。
4. 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。
5. 基差交易的方式包括挂牌交易、协商交易，以及平台规定的其他方式。

挂牌交易，是指交易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的交易参与者响应达成的交易。

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

1. 基差交易的报价指令当日有效，交易达成前可撤销。
2. 合同在平台上生成成交记录即成立并生效。合同首次成交时的卖方为合同签发人，合同首次成交后生成唯一的合同编号，转让时该合同编号不变。
3. 交易商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。
4. 转让期内，买方可以将持有的可转让合同转让给平台上的其他交易商。合同转让交易达成时视为合同受让方成为合同新的买方，无须再次经过合同签发人确认。
5. 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。
6. 结算和交收业务
7. 交易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，交易双方自行约定结算方式等合同条款。

委托平台结算的，平台按照本办法相关业务规则办理。

1. 基差交易采用双边结算、逐笔收付制度。平台于每笔交易达成后，按照相关业务规则和交易双方的约定进行资金结算。
2. 基差交易实行履约保证金制度。履约保证金用于担保基差交易的履行。如一方违反合同约定，另一方有权以履约保证金弥补相应损失。履约保证金包括交易保证金和追加保证金。

交易保证金由平台按照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。

1. 信用额度由交易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。
2. 合同首次交易时，平台对交易双方进行信用额度及货币资金检查，信用额度和货币资金不足以覆盖交易保证金的，交易无法达成。合同首次成交后，平台按照合同名义金额的一定比率收取双方交易保证金，公式为：

交易保证金=（基准期货合约上一交易日结算价+首次基差成交价）×交易数量×交易保证金率

首次基差成交价是合同首次成交的基差价格，是最终实物交收结算的基差价格。

1. 交易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

1. 转让或回购价差以货币资金支付，从价差为负值的一方划转给价差为正值的一方。交易达成后，平台清退转让方或回购双方的交易保证金。
2. 对于转让交易，如果价差为负值的一方清算账户的货币资金余额不足以支付应付资金，或受让方扣除应付资金后的信用和货币资金不足以覆盖交易保证金的，则无法达成转让；对于回购交易，如果价差为负值的一方的清算账户货币资金余额不足以支付应付资金的，则无法达成回购。
3. 转让成交后，合同签发人交易保证金不足的，当日结算后平台向其发出追保通知，合同签发人应当在下一交易日开市前将交易保证金补足。
4. 点价按照合同约定在线下完成，点价联系方式由交易双方自行约定。首次点价成功后，交易双方均可在平台进行确认。首次点价确认后，合同进入交收阶段，合同不可转让或回购。
5. 首次点价确认日结算时，买卖双方的交易保证金应当全部以货币资金支付，当日结算后，清退双方信用额度。清算账户货币资金不足的，平台在结算后发出追保通知，交易参与者应当在下一交易日开市前补足。
6. 首次点价确认日至最后交收日闭市前，追保方可以根据合同约定发出追加保证金指令。当日结算时，平台按照指令收取对方追加保证金。清算账户货币资金不足的，平台在结算后发出追保通知，交易参与者应当在下一交易日开市前补足。追保方发出追加保证金指令后，应及时通知对方。
7. 首次点价确认日下一交易日至最后交收日闭市前，卖方可发起交收申请，申请时应输入全额货款。买方应在补齐全额货款后在平台进行确认，确认后平台即收取买方全额货款。买方确认当日为交收日。
8. 最后点价日闭市前，交易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。最后点价日结算时，买卖双方交易保证金应当全部以货币资金支付，当日结算后，清退双方信用额度。清算账户货币资金不足的，平台在结算后发出追保通知，交易参与者应当在下一交易日开市前补足。
9. 最后交收日闭市前，卖方未提出交收申请，或卖方提出申请而买方未确认的，平台将在最后交收日结算时收取买方全额货款，公式为：

全额货款=（最后点价日基准期货合约收盘价+首次基差成交价）×交易数量

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，交易参与者应当在下一交易日开市前补足。

1. 交收日后第2个交易日闭市前，卖方应当向买方转移货权，买方应于收到货权之日后第1个交易日闭市前在平台进行确认。买方确认后，平台向卖方支付全额货款的80%。
2. 货权转移确认后，卖方应在合同约定的时间内开具增值税专用（普通）发票，并发起尾款支付申请，申请时应输入发票载明的最终货物结算金额。买方应在收到卖方发票后对尾款支付申请予以确认，如果发票金额大于全额货款，买方应当在确认前补足差额。买方确认后，平台即划转尾款给卖方。
3. 交易参与者可出资金不超过清算账户货币资金中未被交易保证金占用的部分。当交易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。
4. 交易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参与者。具体执行利率由平台确定、调整并通知。
5. 信息管理
6. 交易所可以于每个交易日发布交易行情，包括但不限于品种、品级、交货地（仓库）、基准合约、基差报价、即时一口价、买卖方向、交易数量（吨）、品级说明、最后点价日、最后交收日等。
7. 因在平台进行交易而产生的一切数据、信息归交易所所有。未经交易所许可，任何自然人、法人或其他组织不得将之用于商业用途。
8. 交易所可授权相关主体转发原始交易行情，或对原始交易行情进行加工后发布。
9. 平台各参与主体不得非法获取、使用平台及他人商业信息及秘密，对于参与平台相关业务过程中获得的商业信息及秘密，应妥善保管，不得擅自向他人披露或允许他人使用。
10. 平台可根据法律法规规定，或应有权机关要求，提供指定信息，并执行相应的保密规定。
11. 平台各参与主体应当妥善保存各自形成的基差交易、结算、交收记录及相关资料，保存期限应当不少于10年。
12. 风险与责任
13. 交易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。
14. 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。
15. 交易所有权对交易参与者在平台上发生的所有交易行为进行监督管理。
16. 交易所有权根据交易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。
17. 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。
18. 基差交易期间，出现下列异常情况之一的，交易所可以对基差交易采取调整开市收市时间、暂停交易、限制出金、撤销挂牌等紧急措施：

（一）地震、水灾、火灾、台风、战争、疫情等不可抗力或者暴力恐怖袭击、网络袭击、停电、通讯故障、计算机系统故障等原因导致交易、结算、交收等业务全部或者部分无法正常进行；

（二）交易所认定的其他情况。

因不可抗力或其他非因交易所过错引发的技术故障交易所不承担责任。

1. 违规处理
2. 交易参与者涉嫌违规的，由交易所进行调查，交易参与者有义务予以配合。
3. 交易参与者有以下行为之一的，交易所有权认定其违规：
   1. 编造或者传播虚假或者误导性信息，影响市场秩序的；
   2. 单独或者合谋，通过交易影响市场价格、转移资金、洗钱或牟取不正当利益的；
   3. 伪造、变造交易记录、会计报表、账册、票证、单据、凭证或其他证明文件等资料，或使用上述伪造、变造材料的；
   4. 未按规定报告相关事项的；
   5. 拒不配合交易所检查、调查，隐瞒事实或提供虚假情况的；
   6. 违反规则且对交易所造成不良影响的其他情形。
4. 交易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：
5. 警告；
6. 通报批评；
7. 限制交易参与者业务范围；
8. 暂停或终止相关资格；
9. 公开谴责；
10. 向征信机构通报;
11. 交易所认为应当采取的其他措施。
12. 交易所认定交易参与者违规的，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：

（一）名称、住所地；

（二）违规事实和认定依据；

（三）采取的措施和依据；

（四）履行方式和期限；

（五）申请复议的途径和期限；

（六）做出处理决定的日期；

（七）交易所认为应当列明的其他事项。

1. 违规处理决定书将以邮寄或电子邮件的形式告知交易参与者。以邮寄方式告知的，邮件签收日或邮件寄出之日起第5个交易日届满时即视为告知，以在先的时间为准。以电子邮件方式告知的，电子邮件发送至交易参与者电子邮箱时即视为告知。交易参与者地址及电子邮箱以交易所留存信息为准。
2. 交易参与者申请复议，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。
3. 交易参与者发生纠纷或涉嫌违规的，在纠纷解决或确认违规行为之前，为防止相关行为后果进一步扩大，交易所有权先行采取下列限制性措施：
4. 限期说明情况；
5. 限制交易权限；
6. 限制出金；
7. 交易所认为应当采取的其他方式。
8. 附则
9. 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。
10. 本办法解释权属于交易所。
11. 本办法自发布之日起实施。

三、大连商品交易所商品互换业务管理办法

（试行）

第一章 总则

1. 为提高大连商品交易所（以下简称交易所）服务实体经济的能力，保障商品互换业务在综合服务平台的有序开展，特制定本办法。
2. 本办法所述商品互换交易，是指根据交易有效约定，交易一方为一定数量的商品、商品指数或价差组合标的，按照每单位固定价格或结算价格定期向另一方支付款项，另一方也为同等数量的该标的按照每单位结算价格定期向交易一方支付款项的交易。
3. 交易所、场外衍生品交易商（以下简称交易商）、综合业务指定存管银行、客户等主体在交易所综合服务平台开展商品互换业务，应当遵守本办法。

第二章 参与主体

1. 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法人可以申请成为交易商。申请成为交易商，应当符合交易所规定的相关条件并履行交易所规定的相关流程。
2. 在综合服务平台开展商品互换业务的客户应当是法人。客户申请开展商品互换业务应当向交易所提交以下书面材料：

（一）营业执照复印件；

（二）客户与交易商签署的相关场外衍生品交易主协议及补充协议复印件；

（三）综合服务平台用户开户申请表；

（四）企业法人的授权书及经办人员的身份证明文件；

（五）交易所要求的其他材料。

以上材料均须加盖申请主体公章。客户应当保证提交的材料真实、准确、完整。

1. 交易商和客户开展商品互换业务前，应当与交易所签订相关协议，明确双方的权利和义务。

交易商和客户应当在综合业务指定存管银行开设或指定银行账户，用于办理商品互换业务的资金往来。

第三章 交易业务

1. 商品互换交易采用双边交易方式，客户只能和与其签署场外衍生品交易主协议及补充协议的交易商开展商品互换交易，客户与客户之间不得开展商品互换交易。
2. 商品互换交易实行交易编码制度，交易编码是指交易所分配给交易商和客户进行商品互换交易的专用代码。客户交易编码是由交易商编号和客户编号两部分组成。交易商交易编码与客户交易编码位数相同。
3. 商品互换的交易标的包括商品、商品指数及价差组合等。价差组合包括但不限于商品间的价差组合、商品指数间的价差组合及商品和商品指数间的价差组合等。交易商使用商品指数及包含商品指数的价差组合作为交易标的开展互换业务，应当获得交易所授权允许。
4. 商品互换业务的交易日与交易所期货交易一致，每一交易日的具体交易时间由交易所另行公布。
5. 在交易时间内，客户可以登录交易所综合服务平台向与其签署场外衍生品交易主协议及补充协议的交易商发布商品互换的交易需求，交易需求包括交易标的、交易期限、买卖方向、交易数量、意向交易价格、到期结算条款、提前平仓条款等。
6. 交易商根据客户发布的交易需求，与客户进行协商。

如果交易商与客户协商达成一致，交易商应当完善和补充协议条款并向客户发起确认，客户应当于当日闭市前反馈确认结果。如确认结果为同意，则视为该笔商品互换交易在交易所综合服务平台登记成功。

1. 商品互换的成交价格确认机制包括两种：

（一）协商确认。交易双方经协商按约定的开仓价格或指数点位成交。

（二）点价交易。由客户指定成交价格或指数点位，当行情触发该成交价格或指数点位时确认成交。

1. 如果交易双方交易成功，交易所形成交易确认书，并向交易双方发送成交确认信息。
2. 交易所对商品互换交易采取持仓限额管理。持仓限额是指交易商、客户未平仓交易名义价值的最大金额。交易所可以视情况，核定和调整交易商、客户的持仓限额。

第四章 结算业务

1. 商品互换交易采取净额结算方式，交易双方相互承担履约责任。
2. 交易所实行交易保证金制度。现金和信用额度可以作为交易保证金，用于商品互换交易的履约担保。交易所为每个交易编码设立单独的结算账户存放和记录现金及信用额度。
3. 客户开仓时，交易所根据交易双方的开仓价格或指数点位计算开仓名义价值，并按照双方约定计算初始保证金。

（一）对于以单一的商品或商品指数为标的的交易：

初始保证金 = 开仓名义价值 × 初始保证金率

其中，每笔交易的初始保证金率由交易双方共同确定。

（二）对于以价差组合为标的的交易，初始保证金的计算方式由交易所制定并另行公布。

每笔交易的组合保证金计算方式和相关参数由交易双方共同选取确定。

1. 交易所按以下方式计算维持保证金。

如果客户为商品互换交易的买方，则

维持保证金=初始保证金 +MAX{0，（开仓名义价值-持仓名义价值）}

若客户为商品互换交易的卖方，则

维持保证金=初始保证金 + MAX{0，（持仓名义价值 –开仓名义价值）}

其中，持仓名义价值是根据交易双方约定的价格基准计算出的名义价值。

1. 在商品互换交易到期日，交易所按照交易双方约定了结到期商品互换交易，计算到期盈亏：

到期盈亏= 到期名义价值 - 开仓名义价值

其中，到期名义价值是根据交易双方约定的结算价格或指数点位计算出的名义价值。

在商品互换交易到期日，如果交易双方另行约定以其他方式了结商品互换交易的，交易所终止该笔交易，并退还保证金及相关款项，后续事宜交由交易双方自行处理。

1. 在商品互换交易到期日的下一交易日收市后，交易所按照交易双方的到期盈亏进行盈亏划转。
2. 客户可以根据交易协议中的提前平仓条款选择提前平仓。客户选择提前平仓时，应当事先通知交易商。客户与交易商协商确定提前平仓价格或指数点位，交易所根据提前平仓价格或指数点位了结该笔交易，计算提前平仓盈亏，并于当日进行盈亏划转。

提前平仓盈亏 = 提前平仓名义价值 - 开仓名义价值

其中，提前平仓名义价值是根据交易双方约定的提前平仓价格或指数点位计算出的名义价值。

1. 每日闭市前，交易双方应当根据当日所有到期盈亏和提前平仓盈亏的净盈亏情况向交易所缴纳足额现金，闭市后交易所根据交易双方当日所有到期交易和提前平仓交易进行净额结算。

如果净亏损方结算账户中的现金不足以支付净亏损，则交易所按有关规定处理。

1. 交易所可以向参与互换业务的交易双方收取手续费，手续费的收取方式和收取标准由交易所另行公布。
2. 每个交易日闭市后，交易所计算每个交易编码的交易保证金、盈亏、手续费等，并从现金中收取盈亏、手续费等必须以现金支付的款项。

其中，盈亏是指发生交易到期和提前平仓时产生的盈利收入或亏损支出。

1. 如果结算后客户交易编码的现金与信用额度之和小于维持保证金，交易所向客户发出追加保证金通知。客户应当于下一交易日开市前满足现金与信用额度之和大于等于维持保证金，否则禁止开新仓。在下一交易日闭市前仍未补足的，按照有关规定处理。
2. 交易所本着准确、快捷的原则为客户、交易商办理出入金业务。
3. 客户、交易商出金应当满足交易所相关规定。每个结算账户的最大可出金额为：

最大可出金额=现金 - MAX{维持保证金 - 信用额度，0}-应划转的净亏损-其他应支付款项

当客户、交易商出现违约情况时，交易所有权拒绝其出金申请。

第五章 违约处理

1. 发生如下情形之一的，视作交易违约：

（一）闭市后客户或交易商结算账户中的现金不足以支付当日净亏损的；

（二）交易所向客户发出追加保证金通知后，客户未能在下一交易日闭市前补足的；

（三）交易所认定的其它情形。

1. 发生交易违约时，交易所根据交易双方之间所有交易的交易标的当日结算价格计算交易双方的净盈亏，并按如下方式进行处理：

（一）如果净亏损方的现金足以支付双方所有交易的净亏损额，则交易所将终止交易双方之间当前所有交易，并将净盈亏进行划转。

（二）如果净亏损方的现金不足以支付双方所有交易的净亏损额，则交易所将终止交易双方之间所有交易的平台服务，并将净亏损方的所有现金划转至净盈利方，不足部分由交易双方根据交易协议约定自行处理。

第六章 附则

1. 本办法的解释权属于交易所。
2. 本办法未尽事宜，按照交易所其他有关规定执行。
3. 本办法自公布之日起实施。

四、大连商品交易所场外期权业务管理办法（试行）

1. 总则
2. 为规范大连商品交易所（以下简称交易所）场外期权业务活动，保障参与主体的合法权益，特制定本办法。
3. 本办法所称场外期权业务，是指买卖双方在交易所综合服务平台（以下简称平台）开展的，规定买方有权按照约定条件向卖方购买或出售约定标的物的交易活动。
4. 交易所、参与主体在平台开展场外期权业务，应当遵守本办法。
5. 参与主体
6. 场外期权业务的参与主体包括场外衍生品交易商与客户。
7. 场外衍生品交易商（以下简称交易商），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。交易商在平台开展场外期权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。
8. 交易商的资格管理、监督管理根据《大连商品交易所场外衍生品交易商管理办法（试行）》的相关规定进行。
9. 除本办法另有规定外，开展场外期权业务的客户应当是法人。客户申请开展场外期权业务应当向交易所提交以下书面材料：

（一）营业执照复印件；

（二）客户与交易商签署的相关场外衍生品交易主协议及补充协议复印件；

（三）综合服务平台用户开户申请表；

（四）交易所要求的其他材料。

以上材料均须加盖申请主体公章。客户应当保证提交的材料真实、准确、完整。

1. 客户提交的申请材料经审核通过后，应当与交易所签署相关协议，明确双方的权利和义务。
2. 客户存在下列情形之一的，交易所有权取消其资格并向市场公告：
3. 两个自然年度内未在平台开展场外期权业务；
4. 存在重大违法违规行为；
5. 依法被收购、兼并、撤销、解散或者宣告破产；
6. 向交易所提交虚假材料；
7. 本办法规定、交易所认定或协议约定的其他情形。
8. 交易业务
9. 场外期权业务采用双边交易方式。客户只能和与其签署场外衍生品交易主协议及附属协议的交易商开展场外期权业务。
10. 场外期权业务实行交易编码制度，交易编码是指交易所分配给交易商和客户进行场外期权业务的专用代码。客户交易编码是由交易商编号和客户编号两部分组成。交易商交易编码与客户交易编码位数相同。
11. 交易商与客户开展场外期权业务前，应分别在平台开立交易账户，在存管银行开立或指定资金账户。开户成功后平台为交易商与客户生成交易编码。交易账户及密码是平台识别交易商与客户身份的依据。交易商与客户应当妥善保管其交易账户及密码，对以交易账户登录信息、交易编码进行的操作、发出的指令和产生的交易结果承担法律责任，不得将其转让或转借他人使用。
12. 场外期权业务的交易日与交易所期货交易一致，每一交易日的具体交易时间由交易所另行公布。
13. 交易商可在平台创设场外期权合约（以下简称合约）。合约内容包括标的物、合约类型、报价单位、到期日、行权价格、行权方式等主要条款以及补充条款。

（一）本办法所称的标的物为商品期货合约或商品指数。

（二）合约类型包括看涨期权和看跌期权。

看涨期权是指买方有权在将来某一时间以特定价格买入标的物，而卖方需要履行相应义务的合约。

看跌期权是指买方有权在将来某一时间以特定价格卖出标的物，而卖方需要履行相应义务的合约。

（三）报价单位与标的物报价单位一致。

（四）到期日是指合约买方能够行使权利的最后一个期货交易日。

（五）行权价格是指由期权合约规定的，买方有权在将来某一时间买入或卖出标的物的价格。

（六）行权方式分为欧式、美式以及交易所规定的其他方式。

欧式期权的买方只可在合约到期日当日行使权利。

美式期权的买方在合约到期日及其之前任一交易日均可行使权利。

（七）补充条款由交易商自行填写，用以约定主要条款未约定事项。

1. 创设合约的方式包括模板创设和自定义创设。

模板创设，是指交易商按照交易所提供的合约模板创设合约的方式。

自定义创设，是指交易商不完全按照交易所提供的合约模板，自行定义合约条款创设合约的方式。

1. 交易商完成合约创设后，向客户发起确认，客户确认结果为同意，则视为双方就该笔场外期权业务在平台完成交易确认。平台形成交易确认书，并向交易双方发送成交确认信息。
2. 结算业务
3. 场外期权业务采用现金净额结算方式。交易双方自行承担履约责任。
4. 场外期权业务实行保证金制度。货币资金、信用额度可以作为保证金，用于场外期权业务的履约担保。交易所为每个交易编码设立单独的结算账户存放和记录货币资金及信用额度。
5. 双方可在合约中约定保证金数额。完成交易确认后，交易所收取保证金。结算账户中的货币资金及信用额度不足以覆盖保证金数额的，交易无法达成。
6. 双方可在合约中约定支付权利金的方式，包括期初支付、延期支付。

期初支付，指买方在交易确认时向卖方支付权利金的方式。合约交易时，交易所校验买方货币资金，不足以覆盖权利金的，交易无法达成。完成交易确认后，交易所即时划转权利金给卖方。

延期支付，指买方在交易确认后至交易了结时支付权利金的方式。由买方发起支付申请，申请当日交易所将权利金划转给卖方。交易了结方式包括平仓、行权和放弃。

买方未在规定时间内发起支付申请，权利金将与平仓盈亏或行权盈亏合并计算，轧差支付。

1. 交易商在到期日及其之前任一交易日，可根据双方约定发起平仓申请并录入平仓盈亏，客户确认平仓申请的当日结算后，交易所划转平仓盈亏。

客户未对平仓申请进行确认的，视为双方未就平仓达成一致，交易所不作处理。

1. 对于模板创设的美式期权合约，买方在合约到期日及其之前任一交易日均可提出行权申请，申请当日结算后，交易所计算行权盈亏，并于申请当日后第N个交易日结算后划转行权盈亏，行权盈亏划转后，清退双方保证金，N由双方在合约中规定。
2. 对于模板创设的欧式期权合约及未行权的美式期权合约，在合约到期日闭市后，交易所进行以下处理：

（一）行权价格小于当日标的物结算价的看涨期权自动申请行权；

（二）行权价格大于当日标的物结算价的看跌期权持仓自动申请行权。

到期日结算后，交易所计算行权盈亏，并于到期日后第N个交易日结算后划转行权盈亏，行权盈亏划转后，清退双方保证金。N由双方在合约中规定。

1. 对于自定义创设的合约，买方可在双方约定的时间内提出行权申请并录入行权盈亏，卖方确认行权申请后，交易所划转行权盈亏，行权盈亏划转后，清退双方保证金。双方就支付行权盈亏存在争议的，其中一方可书面通知交易所。
2. 发生如下情形之一的，视为异常情形，交易所有权采取限制交易权限、限制出金等措施，并根据双方协议或有权机关、仲裁机构的生效法律文件对双方货币资金进行划转。
3. 账户货币资金不足，导致无法按照双方约定支付权利金、平仓盈亏、行权盈亏的；
4. 对于自定义创设合约，其中一方提出争议并书面通知交易所的。
5. 产业服务项目场外期权业务
6. 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。产业服务项目场外期权业务，指获得产业服务项目立项或备案资格的主体（以下简称项目主体）通过交易所场外期权业务运行其项目的活动。
7. 项目主体开展产业服务项目场外期权业务，应当申请获得场外衍生品交易商或客户资格，与交易所签订协议并开户。
8. 保险公司等金融机构日常业务由其分支机构开展且为项目主体的，此类分支机构可申请成为客户，但仅限于在平台开展产业服务项目场外期权业务。
9. 保险公司等金融机构分支机构客户未经交易所允许，在平台开展产业服务项目范围外的场外期权业务，交易所有权取消其客户资格。
10. 产业服务项目场外期权业务其他未涉及事项，按照本办法的相关规定执行。
11. 信息管理
12. 交易所可以于每个交易日发布交易行情，包括但不限于品种、交易标的、合约类型、交易数量、到期日、行权价格、行权方式、权利金等。
13. 因在平台进行交易而产生的一切数据、信息归交易所所有。未经交易所许可，任何自然人、法人或其他组织不得将之用于商业用途。
14. 交易所可授权相关主体转发原始交易行情，或对原始交易行情进行加工后发布。
15. 场外期权业务各参与主体不得非法获取、使用平台及他人商业信息及秘密，对于参与相关业务过程中获得的商业信息及秘密，应妥善保管，不得擅自向他人披露或允许他人使用。
16. 交易所可根据法律法规规定，或应有权机关要求，提供指定信息。
17. 场外期权业务各参与主体应当妥善保存各自形成的交易、结算、交收记录及相关资料，保存期限应当不少于10年。
18. 风险与责任
19. 各参与主体应当履行场外期权业务的各项相关义务，并承担相关风险及责任。
20. 交易所有权对各参与主体在平台上发生的所有交易行为进行监督管理。
21. 交易所有权根据场外期权业务相关规则、参与主体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。
22. 场外期权业务进行期间，出现下列异常情况之一的，交易所可以采取调整开市收市时间、暂停交易、限制出金等紧急措施：

（一）地震、水灾、火灾、台风、战争、疫情等不可抗力或者暴力恐怖袭击、网络袭击、停电、通讯故障计算机系统故障等原因导致交易、结算、交收等业务全部或者部分无法正常进行；

（二）交易所认定的其他情况。

因不可抗力或其他非因交易所过错引发的技术故障交易所不承担责任。

1. 附则
2. 本办法解释权属于交易所。
3. 本办法自发布之日起实施。