附件

**大连商品交易所标准仓单交易管理办法**

**（征求意见稿）**

第一章 总则

第一条 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，保障大连商品交易所场外综合服务平台（以下简称场外平台）标准仓单交易业务的有序开展，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、风险控制及违规违约处理等适用本办法。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等主体在场外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企业法人；

（二）能够开具所参与交易品种的增值税专用发票；

（三）交易所客户、自营会员或者可以合规持有标准仓单的其他主体；

（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）具有所参与交易品种的期货交割记录，银行、证券等金融机构除外；

（六）具有健全的风险管理、财务会计和内部控制制度；

（七）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；

（八）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。

对于非自营会员的交易所客户申请成为仓单交易客户在具备上述条件的基础上，还应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 标准仓单交易采用卖方挂牌交易方式。

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。

第十四条 仓单交易客户通过场外平台将标准仓单进行交易登记后，方可用于标准仓单交易。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告；

（三）交易所认定的其他条件。

第十五条 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。

第十六条 标准仓单交易的报价方式为全价报价。

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。

第十七条 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。

第十八条 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。

第十九条 卖方仓单交易客户在挂牌前应确保持有足额标准仓单。场外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。

第二十条 买方仓单交易客户在摘牌前应确保账户资金余额充足。场外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。

第二十一条 仓单交易客户可以通过场外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

第二十二条 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。

第二十三条 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。

第二十四条 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。

第二十五条 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。

第二十六条 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条、第三十一条的规定，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，由交易所另行公布。

第二十七条 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。

第二十八条 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。

第二十九条 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。

第三十条 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。

第三十一条 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，验证合格后在结算时清退发票保证金。

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 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。

第三十三条 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

第三十四条 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。

第三十五条 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

第三十六条 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。

第三十七条 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。

第三十八条 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。

第三十九条 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。

第四十一条 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 风险控制

第四十二条 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。

第四十三条 基准价是相应品种标的期货合约的前一日结算价。

第四十四条 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。

第四十五条 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。

第四十六条 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。

第四十七条 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，场外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。

第七章 违规违约处理

第四十八条 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。

第四十九条 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。

第五十一条 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。

第五十二条 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。

第五十三条 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。

第八章 异常情况处理

第五十四条 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。

第九章 信息管理

第五十五条 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。

第五十六条 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。

第五十七条 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。

第五十八条 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。

第五十九条 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。

第十章 附则

第六十条 本办法的解释权属于大连商品交易所。

第六十一条 本办法自公布之日起实施。