

大连商品交易所实际控制关系账户管理办法

(根据 2021 年 2 月 5 日《关于发布<大连商品交易所境外特殊参与者管理办法>和相关规则修正案的通知》(大商所发〔2021〕73 号) 修订, 修订部分自发布之日起实施。)

第一章 总则

第一条 为规范实际控制关系账户管理, 维护市场秩序, 促进市场健康发展, 根据《大连商品交易所交易规则》等有关规定, 制定本办法。

第二条 大连商品交易所(以下简称交易所)负责实际控制关系账户的认定和交易监管工作。交易所与中国期货市场监控中心(以下简称监控中心)建立实际控制关系账户信息共享机制, 共同对期货市场实际控制关系账户进行管理。

第三条 非期货公司会员、境外特殊非经纪参与者、客户参与期货交易应当遵守本办法及交易所其他相关规定, 接受交易所对其实际控制关系账户的管理。客户还应当接受期货公司会员、境外特殊经纪参与者、境外中介机构对其实际控制关系账户的管理。

第二章 实际控制关系账户认定标准

第四条 实际控制是指行为人(包括个人、单位)对他人(包括个人、单位)期货账户具有管理、使用、收益或者处分等权限, 从而对他人交易决策拥有决定权的行为或事实。

第五条 根据实质重于形式的原则, 具有下列情形之一的, 应当认定为行为人对他人期货账户的交易具有实际控制关系:

(一) 行为人作为他人的控股股东, 即行为人的出资额占他人资本总额 50%以上或者其持有的股份占他人股本总额 50%以上的股东, 出资额或者持有股份的比例虽然不足 50%, 但依其出资额或者持有的股份所享有的表决权已足以对股东会、股东大会的决议产生重大影响的股东;

(二) 行为人作为他人的开户授权人、指定下单人、资金调拨人、结算单确认人或者其他形式的委托代理人;

(三) 行为人作为他人的法定代表人、主要合伙人、董事、监事、高级管理人员等, 或者行为人与他人的法定代表人、主要合伙人、董事、监事、高级管理人员等一致的;

(四) 行为人与他人之间存在配偶关系；

(五) 行为人与他人之间存在父母、子女、兄弟姐妹等关系，且对他人期货账户的日常交易决策具有决定权或者重大影响；

(六) 行为人通过投资关系、协议、融资安排或者其他安排，能够对他人期货账户的日常交易决策具有决定权或者重大影响；

(七) 行为人对两个或者多个他人期货账户的日常交易决策具有决定权或者重大影响；

(八) 交易所认定的其他情形。

第三章 实际控制关系账户的报备

第六条 客户应当按照本办法和监控中心相关规定通过各自开户的期货公司会员、境外特殊经纪参与者或者境外中介机构履行实际控制关系账户的报备、变更和解除程序。

第七条 符合实际控制关系账户认定标准的非期货公司会员、境外特殊非经纪参与者应当在取得交易所会员资格或者境外特殊非经纪参与者资格后 10 个交易日内直接向交易所进行报备，由交易所将相关报备信息发至监控中心。

第八条 非期货公司会员、境外特殊非经纪参与者实际控制关系发生变更的，应当在发生变更之日起 10 个交易日内主动向交易所报备变更情况，由交易所将相关报备信息发至监控中心。

第九条 申请解除实际控制关系的客户通过其开户的期货公司会员向监控中心提出申请，由监控中心将解除申请转交易所审核。客户应当按照交易所要求通过其开户的期货公司会员、境外特殊经纪参与者或者境外中介机构提交相关说明材料。申请解除实际控制关系的非期货公司会员、境外特殊非经纪参与者直接向交易所提出申请，并应当按照交易所要求提交相关说明材料。

交易所对非期货公司会员、境外特殊非经纪参与者、客户的实际控制关系解除申请进行审核，并有权根据审核需要要求非期货公司会员、境外特殊非经纪参与者和客户提供相关补充材料。

第十条 交易所对日常监控中发现具有疑似实际控制关系且尚未报备的账户，开户人为委托期货公司从事期货交易的客户的，交易所可以直接或通过期货公司会员对相关客户进行询问；开户人为委托境外特殊经纪参与者从事

期货交易的客户的，交易所可以直接或通过境外特殊经纪参与者进行询问；开户人为非期货公司会员的，交易所可直接询问；开户人为境外特殊非经纪参与者的，交易所可直接询问。

客户委托境外中介机构从事期货交易的，期货公司会员或者境外特殊经纪参与者应当及时将交易所相关询问转达该境外中介机构，由该境外中介机构对该客户进行询问。

第十一条 对于交易所的询问，客户、非期货公司会员、境外特殊非经纪参与者应以书面形式及时回复，并提供相关说明材料；相关期货公司会员、境外特殊经纪参与者、境外中介机构应及时将客户的回复及相关说明材料报送交易所。

第十二条 经交易所询问，非期货公司会员、境外特殊非经纪参与者、客户如承认存在实际控制关系的，应按照本办法第六条、第七条的规定进行报备。

经交易所询问，非期货公司会员、境外特殊非经纪参与者、客户如否认存在实际控制关系的，应说明理由并签署《合规声明及承诺书》(见附件)。交易所将对其说明材料进行审核。对于事实清楚、理由充分，确不符合实际控制关系认定标准的，交易所将不按实际控制关系对相关账户进行管理；对于事实、理由不充分的，交易所将进行调查，经调查认为符合实际控制关系认定标准的，交易所所有权责令其进行报备，拒不报备的，交易所所有权对其实际控制关系进行直接认定，并根据本办法第十三条及相关规定进行处理；若经调查暂无法认定是否符合实际控制关系认定标准的，交易所可将其列入重点监控名单。

第十三条 对于具有实际控制关系但不如实报备相关信息、不如实回复交易所询问、隐瞒事实真相、故意回避等不协助报备或不协助调查工作的非期货公司会员、境外特殊非经纪参与者、客户，交易所可以采取谈话提醒、书面警示、暂停开仓等监管措施；情节严重的，交易所将依据《大连商品交易所违规处理办法》有关规定进行处理。

第十四条 期货公司会员、境外特殊经纪参与者、境外中介机构应当告知客户按规定对实际控制关系账户进行报备，切实履行对客户实际控制关系账户的管理职责，及时发现、及时报告、及时制止客户的失信行为。

期货公司会员、境外特殊经纪参与者、境外中介机构应当积极配合客户做好实际控制关系账户报备工作，对实际控制关系账户的报备、管理等材料登记归档、妥善保存并履行相应的保密义务。

第十五条 期货公司会员、境外特殊经纪参与者、境外中介机构具有下列情形之一的，交易所可以责令其整改，并采取谈话提醒、书面警示、约见谈话等监管措施；情节严重的，交易所将依据《大连商品交易所违规处理办法》有关规定进行处理：

- （一）未及时、准确、完整地向客户传达交易所有关实际控制关系账户的规定；
- （二）未及时、准确、完整地实际控制关系账户相关信息录入、更新；
- （三）纵容、诱导、怂恿、协助客户进行虚假申报、隐瞒事实真相；
- （四）未妥善保存客户实际控制关系账户相关资料；
- （五）未按照交易所要求协助询问客户实际控制关系账户情况的或者存在故意拖延、隐瞒和遗漏等行为；
- （六）交易所认定的其他情形。

第四章 实际控制关系账户的管理

第十六条 交易所在执行持仓限额、交易限额、大户报告以及异常交易管理等制度时，对一组实际控制关系账户的委托量、撤单量、成交量以及持仓量等合并计算。

第十七条 一组实际控制关系账户内均为客户的，其合并计算的投机持仓量不得超过单个客户的投机持仓限额；一组实际控制关系账户内包含非期货公司会员或境外特殊非经纪参与者的，其合并计算的投机持仓量不得超过单个非期货公司会员或境外特殊非经纪参与者的投机持仓限额。

第十八条 一组实际控制关系账户的套利持仓量不得超过交易所确定的套利持仓额度，一组实际控制关系账户的套利持仓量和投机持仓量合计不得超过交易所确定的套利持仓额度。

第十九条 一组实际控制关系账户的套期保值持仓量不得超过交易所确定的套期保值持仓额度，一组实际控制关系账户的套期保值持仓量和投机持仓量合计不得超过交易所确定的套期保值持仓额度。

第二十条 一组实际控制关系账户发生持仓超限行为的，交易所将于下一交易日按有关规定执行强行平仓，强行平仓的执行原则如下：

（一）若一组实际控制关系账户投机持仓超仓，则按照上一个交易日结算时该组内客户、境外特殊非经纪参与者或者非期货公司会员投机持仓量由大到小的顺序强行平仓，若投机持仓量相等，则按照客户的客户号、境外特殊

非经纪参与者明细账户号或者非期货公司会员的会员号由小到大的顺序强行平仓。若一组实际控制关系账户套利持仓或套期保值持仓出现超仓，与投机持仓超仓执行相同的强平原则。

（二）若一组实际控制关系账户投机持仓与套期保值持仓合计超仓，由交易所按先投机、后套期保值的原则，再按上一交易日结算时持仓量由大到小的顺序，选择客户、境外特殊非经纪参与者或者非期货公司会员强行平仓；若持仓量相等，则按照客户的客户号、境外特殊非经纪参与者明细账户号或者非期货公司会员的会员号由小到大的顺序强行平仓。

（三）若一组实际控制关系账户超仓，同时账户组内客户、境外特殊非经纪参与者或者非期货公司会员超仓，交易所先对超仓的客户、境外特殊非经纪参与者或者非期货公司会员强行平仓，再对实际控制关系账户强行平仓。

第五章 附则

第二十一条 本办法由交易所负责解释。

第二十二条 本办法自 2018 年 5 月 28 日起实施。