

## 附件 2

# 上海期货交易所实际控制关系账户管理办法

### 目 录

第一章 总则 .....	- 2 -
第二章 实际控制关系账户的认定 .....	- 2 -
第三章 实际控制关系账户的报备 .....	- 3 -
第四章 实际控制关系账户的管理 .....	- 6 -
第五章 附则 .....	- 7 -

## 第一章 总则

第一条 为有效管理实际控制关系账户，维护期货市场秩序，促进期货市场健康发展，根据《上海期货交易所交易规则》、《上海期货交易所风险控制管理办法》（以下简称《风控办法》）、《上海期货交易所违规处理办法》（以下简称《违规处理办法》）等规定，制定本办法。

第二条 期货公司会员应当告知客户具有报备实际控制关系账户的义务，并切实履行对客户实际控制关系账户的管理职责。期货公司会员应当对实际控制关系账户的报备、管理等相关材料登记存档、妥善保管，并对客户申报的内容保密。

第三条 非期货公司会员、客户参与期货交易应当遵守法律、法规、规章和交易所业务规则，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对其实际控制关系账户的管理。

## 第二章 实际控制关系账户的认定

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或者重大影响的行为或事实。

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）中国证监会规定或者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 中国期货市场监控中心（以下简称监控中心）负责实际控制关系账户信息报备工作。具有实际控制关系的控制人和被控制人，均应当通过各自开户的期货公司会员主动向监控中心报备相关信

息。

非期货公司会员应直接向交易所报备，由交易所将相关报备信息发至监控中心。非期货公司会员报备实际控制关系账户情况及提供有关材料时，应当符合监控中心有关规定。

第七条 交易所与监控中心建立实际控制关系账户信息共享机制，按照规定使用实际控制关系账户信息。

第八条 符合实际控制关系账户认定标准的客户应当在签署期货经纪合同后 10 个交易日内完成实际控制关系账户报备。

符合实际控制关系账户认定标准的非期货公司会员应当在成为交易所会员后 10 个交易日内完成实际控制关系账户报备。

第九条 实际控制关系发生变更后，客户、非期货公司会员应当在 10 个交易日内通过相应的实际控制关系报备机构主动向监控中心报备变更情况。

申请新增实际控制关系的客户、非期货公司会员通过相应的实际控制关系报备机构主动向监控中心报备新增情况。

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。

第十条 交易所在日常自律管理中发现客户具有疑似实际控制关系但尚未报备的账户，可以通过期货公司会员书面进行询问。

相关客户应以书面形式及时回复交易所询问，并提供相关材料。

期货公司会员应当及时做好书面说明材料的转递工作。

第十一条 经交易所询问，客户承认具有实际控制关系的，客户应当按照规定的报备流程进行报备；客户否认具有实际控制关系的，应当签署《合规声明及承诺书》(见附件)，交易所对书面说明材料进行审核，分别作出以下处理：

(一) 事实理由不充分，经交易所调查认定具有实际控制关系的，交易所责令报备，并根据本办法第十二条进行处理。

(二) 事实理由充分、确不属于实际控制关系的，交易所不认定为具有实际控制关系。

第十二条 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和不协助调查工作的客户、非期货公司会员，交易所可以采取谈话提醒、书面警示、限制开仓等措施。情节严重的，交易所将依据《违规处理办法》进行处理。

第十三条 期货公司会员具有下列情形之一的，交易所责令改正，并可以采取电话提示、约见谈话、发出警示函、发出意见函等措施：

(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、完整地实际完成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) 未按照规定妥善保存客户资料；

(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

第十四条 交易所在执行持仓限额、交易限额、异常交易行为管理等制度和规定时，对一组实际控制关系账户的交易、持仓等合并计算。

第十五条 一组实际控制关系账户内均为客户的，交易所对该组实际控制关系账户内的非套期保值持仓合并计算后按照《风控办法》规定的一个客户在不同时期的持仓限额加上该时期账户组成员获批的套利交易头寸之总和进行限仓。

一组实际控制关系账户包含非期货公司会员的，交易所对该组实际控制关系账户内的非套期保值持仓合并计算后按照《风控办法》规定的一个非期货公司会员在不同时期的持仓限额加上该时期账户组成员获批的套利交易头寸之总和进行限仓。

第十六条 一组实际控制关系账户单个交易日在某一上市品种或者期货合约上的开仓交易数量合并计算后，不得超过交易所制定的一个客户日内开仓交易量。

第十七条 一组实际控制关系账户的自成交量、报撤单笔数、大额报撤单笔数、日内开仓交易量、持仓量等合并计算后达到《上

海期货交易所异常交易行为管理办法》异常交易行为处理标准的，交易所对该组实际控制关系账户按照异常交易行为采取自律管理措施。

## 第五章 附则

第十八条 除本办法另有规定外，非期货公司成员参照客户的有关规定执行。

第十九条 本办法由交易所负责解释。

第二十条 本办法自 2018 年 5 月 11 日（交易日）起实施。

附件：合规声明及承诺书

附件：

## 合规声明及承诺书

上海期货交易所：

本人声明：不存在因代理、投资、亲属、交叉任职、协议以及其他安排等因素而对他人的期货交易进行实际控制或者施加重大影响的情形；不存在因上述关系而导致本人的期货交易被他人实际控制或者施加重大影响的情形；不存在通过分仓的方式规避交易所持仓限额而超量持仓的情形。

本人承诺：所做上述声明真实、准确、完整，不存在任何虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏；将严格遵守期货法律法规和交易所业务规则的规定，合法合规地参与期货交易；愿意配合交易所及相关期货公司采取的相应措施；完全明白虚假声明可能导致的后果，自愿承担因违法违规行为产生的法律责任并接受交易所的处理措施。

承诺人：

承诺日期：



