附件3

**大连商品交易所交割管理办法**

**（修正案征求意见稿）**

第六条 个人客户持仓和焦炭、焦煤、铁矿石、黄大豆2号非交割单位整数倍持仓不得交割，不具备苯乙烯或液化石油气生产、经营或使用资质的单位客户不得参与苯乙烯相应品种交割。

自交割月份第一个交易日起，交易所对个人客户交割月份合约的持仓予以强行平仓。

对焦炭、焦煤、铁矿石、黄大豆2号、苯乙烯、液化石油气以外品种合约，最后交易日收市后，个人客户交割月份合约的持仓仍未能平仓的，首先由会员代为履约，会员仍未能履约的，则按照本办法第九章有关规定进行处理。

对焦炭、焦煤、铁矿石、黄大豆2号、苯乙烯、液化石油气合约，最后交易日收市后，个人客户交割月份合约的持仓和非交割单位整数倍持仓仍未能平仓的，由交易所按照“不允许交割持仓优先，含有时间最短持仓的交割单位整数倍持仓优先”原则，选择对手方持仓对冲平仓，平仓价格为该合约交割结算价，并对客户持有的不允许交割持仓部分处以按交割结算价计算合约价值20％的罚款，该款项支付给对方。若对冲双方均为持有不允许交割持仓的客户，交易所对双方分别处以按交割结算价计算合约价值20％的罚款，不再支付给对方。

对于苯乙烯、液化石油气合约，不具备苯乙烯相应品种生产、经营或使用资质的单位客户持仓在滚动交割、一次性交割流程下被配对的，交易所在交收日闭市后对其处以按交割结算价计算合约价值20%的罚款，该款项支付给对方。若配对双方均为不得交割的客户，交易所对双方分别处以按交割结算价计算合约价值20％的罚款，不再支付给对方。

第十一条 交易双方达成现货买卖协议后，应向交易所提交下述材料：

（一）期转现申请；

（二）现货买卖协议；

（三）相关的货款证明；

（四）相关的标准仓单、入库单、存货单等货物持有证明。

黄大豆2号、苯乙烯、液化石油气等品种期货业务细则对期转现申请材料另有规定的，适用其规定。

　　第三十九条 滚动交割流程的第一日是配对日。

　　（一）卖方申报交割。进入交割月后，同时持有标准仓单和交割月单向卖持仓的客户可以通过会员提出交割申请，会员在交割月第一个交易日至最后交易日前一交易日闭市前，均可向交易所申报交割。提出交割申请的相应持仓和仓单予以冻结，其卖持仓对应的交易保证金不再收取。对于黄大豆2号品种，只能以厂库标准仓单申报交割。

（二）买方申报意向。持有交割月单向买持仓的买方在交割月第一个交易日至最后交易日前一交易日闭市前可以向交易所申报交割意向。

液化石油气等品种期货业务细则对滚动交割配对日卖方申报交割和买方申报意向另有规定的，适用其规定。

第四十条 配对日闭市后，交易所通过系统，按照“申报意向优先、含有建仓时间最早的持仓优先”原则，确定参与配对的买方持仓。

　　对于选取的买卖双方，交易所先以仓库为单位汇总卖方申报交割的仓单数量，在买方和仓库之间按照“最少配对数”原则进行配对，确定买方交割对应的仓库和在该仓库交割的数量；再将配好仓库的买方与申请交割且持有该仓库仓单的卖方以“最少配对数”原则进行配对，确定交割对应的买卖双方。配对结果一经确定，买卖双方不得变更。

对于集团交割仓库的标准仓单，以分库为单位申报交割意向，进行交割配对。

纤维板、液化石油气等品种期货业务细则对滚动交割配对范围、配对原则和方法另有规定的，适用其规定。

第六十一条 一次性交割是指在合约最后交易日后，交易所组织所有未平仓合约持有者进行交割的交割方式。

　　一次性交割在3个交易日内完成，分别为标准仓单提交日、配对日和交收日（最后交割日）。在合约最后交易日后，所有未平仓合约的持有者须以交割履约，同一客户号买卖持仓相对应部分的持仓视为自动平仓，不予办理交割，平仓价按一次性交割的交割结算价计算。

一次性交割的交割结算价采用该期货合约自交割月第一个交易日起至最后交易日所有成交价格的加权平均价。鸡蛋、乙二醇、苯乙烯、液化石油气等品种期货业务细则对一次性交割的交割结算价另有规定的，适用其规定。

注：阴影部分为新增内容，双划线部分为删除内容。