附件1

**《大连商品交易所液化石油气期货合约》及相关实施细则修正案、修订稿**

**大连商品交易所液化石油气期货合约**

|  |  |
| --- | --- |
| 交易品种 | 液化石油气 |
| 交易单位 | 20吨/手 |
| 报价单位 | 元（人民币）/吨 |
| 最小变动价位 | 1元/吨 |
| 涨跌停板幅度 | 上一交易日结算价的4％ |
| 合约月份 | 1、2、3、4、5、6、7、8、9、10、11、12月 |
| 交易时间 | 每周一至周五上午9:00～11:30，下午13:30～15:00，以及交易所规定的其他时间 |
| 最后交易日 | 合约月份倒数第4个交易日 |
| 最后交割日 | 最后交易日后第3个交易日 |
| 交割等级 | 大连商品交易所液化石油气交割质量标准（F/DCE PG001-2020） |
| 交割地点 | 大连商品交易所液化石油气指定交割仓库 |
| 最低交易保证金 | 合约价值的5％ |
| 交割方式 | 实物交割 |
| 交易代码 | PG |
| 上市交易所 | 大连商品交易所 |

相关实施细则修正案、修订稿详见附件。

附件：1.《大连商品交易所结算管理办法》修正案及修订稿

2.《大连商品交易所交割管理办法》修正案及修订稿

3.《大连商品交易所标准仓单管理办法》修正案及修订稿

4.《大连商品交易所风险管理办法》修正案及修订稿

5.《大连商品交易所套期保值管理办法》修正案及修

订稿

6. 大连商品交易所液化石油气期货业务细则

附件1：

**《大连商品交易所结算管理办法》**

**修正案**

第六十条 交割结算价为该期货合约交割结算的基准价。滚动交割的交割结算价采用该期货合约滚动交割配对日的当日结算价。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。期转现结算价采用买卖双方协议价格。提货单交割的交割结算价采用该期货合约提货单交割配对日的当日结算价。全月每日选择交割的交割结算价采用该期货合约全月每日选择交割配对日的当日结算价。

保税交割的交割结算价见《大连商品交易所交割管理办法》和实行保税交割相关品种期货业务细则的有关规定。

注：阴影部分为新增内容。

**《大连商品交易所结算管理办法》**

**修订稿**

第一章 总则

　　第一条 为规范大连商品交易所（以下简称交易所）的期货结算行为，保护交易当事人的合法权益和社会公众利益，防范和化解期货市场风险，根据《大连商品交易所交易规则》，制定本办法。

　　第二条 结算是指根据交易结果和交易所有关规定对会员交易保证金、盈亏、手续费、交割货款及其它有关款项进行计算、划拨的业务活动。

　　第三条 交易所结算实行保证金制度、当日无负债结算制度和风险准备金制度等。

　　第四条 交易所实行全员结算制度，交易所只对会员进行结算，期货公司会员对其客户、境外经纪机构进行结算，境外经纪机构对其客户进行结算。

第五条 本办法适用于交易所内的一切结算活动，交易所及其工作人员、交易所会员及其工作人员、境外经纪机构、客户和交易所指定期货保证金存管银行（以下简称存管银行）必须遵守本办法。

第二章 结算机构及其职责

　　第六条 交易所作为中央对手方，统一组织期货交易的结算、负责期货交易的保证金管理、风险准备金管理及结算风险的防范。

　　中央对手方是指期货交易达成后介入期货交易双方，成为所有买方的卖方和所有卖方的买方，以净额方式结算，为期货交易提供集中履约保障的法人。

　　第七条 交易所结算业务的主要职责：

　　（一）编制会员的结算账表；

　　（二）办理资金往来汇划业务；

　　（三）统计、登记和报告交易结算情况；

　　（四）处理会员交易中的账款纠纷；

　　（五）办理交割结算业务；

　　（六）控制结算风险，为期货交易提供集中履约担保；

　　（七）按规定管理保证金、风险准备金；

　　（八）按规定办理其他结算业务。

　　第八条 所有在交易所交易系统中成交的合约必须通过交易所进行统一结算。

　　第九条 交易所依据交易所规则对会员、境外经纪机构和客户涉及期货交易的相关资料，包括交易记录、结算资料、财务报表及相关的凭证和账册进行检查时，会员、境外经纪机构和客户应当予以配合。

　　第十条 会员应当设立结算部门。期货公司会员结算部门负责会员与交易所、会员与境外经纪机构、客户之间的结算工作；非期货公司会员结算部门负责会员与交易所之间的结算工作。

　　结算部门应妥善保管交易记录、结算资料、财务报表及相关凭证、账册，以备查询和核实。

　　第十一条 交易所应保证结算资料、财务报表及相关凭证、账册的完整与安全，保存期限应不少于20年。

　　第十二条 结算交割员是经会员单位授权，代表会员办理结算和交割业务的人员。每一会员须指派两名以上(含两名)结算交割员。

　　结算交割员应符合中国证券监督管理委员会(以下简称中国证监会)关于期货从业人员资格的有关规定,经交易所培训合格,取得《大连商品交易所结算交割员培训合格证书》,并经所属会员的法人授权后取得《大连商品交易所结算交割员证》(以下简称《结算交割员证》)。

　　第十三条 结算交割员的业务职责：

　　（一）办理会员出入金业务；

　　（二）获取交易所提供的结算数据，并及时进行核对；

　　（三）办理作为保证金的资产的交存和提取手续；

　　（四）办理实物交割手续；

　　（五）办理其它结算、交割业务。

　　第十四条 结算交割员在交易所办理结算与交割业务时，必须出示《结算交割员证》，否则交易所有权不予办理。

　　第十五条 《结算交割员证》仅限本人使用，不得伪造、涂改、借用，会员在其结算交割员发生变动时，应及时到交易所办理相关手续。

　　第十六条 会员应加强对结算交割员的管理，严格操作规范，特别要防止因密码被盗造成泄密。

　　第十七条 存管银行是指交易所指定的，协助交易所办理期货交易结算业务的银行。

　　交易所有权对存管银行的期货结算业务进行监督。

　　第十八条 银行业金融机构申请交易所期货保证金存管业务资格，以及从事期货保证金存管业务，应当遵守《大连商品交易所指定存管银行管理办法》及交易所其他相关规定。

　　第十九条 结算相关主体及其工作人员应当保守与结算业务有关的商业秘密。

　　第二十条 交易所根据业务需要在各存管银行开设不同币种专用结算账户,用于存放会员保证金及相关款项。

　　第二十一条 会员应当在存管银行开设业务需要币种的保证金专用账户，用于存放保证金及相关款项。其中，在交易所指定的存管银行分支机构开设的保证金专用账户为会员专用资金账户。

　　第二十二条 会员开立、更名、更换或者注销专用资金账户，应当向交易所提出申请，经交易所同意，方可办理。

　　第二十三条 交易所与会员之间期货业务资金的往来结算通过交易所专用结算账户和会员专用资金账户办理。

　　第二十四条 交易所对会员存入交易所专用结算账户的保证金实行分账管理，为每一会员设立明细账户，按日序时登记核算每一会员出入金、盈亏、交易保证金、手续费等。

　　第二十五条 期货公司会员应当对其客户、境外经纪机构的保证金实行分账管理，为其每一客户、境外经纪机构设立明细账户，按日序时登记核算其每一客户、境外经纪机构出入金、盈亏、交易保证金、手续费等。期货公司会员通过保证金专用账户与其客户、境外经纪机构的期货结算账户进行期货业务资金往来。

　　期货公司会员可以以境外经纪机构的名义在内部开设综合资金账户，允许其将一个及以上境外客户的资金合并在综合资金账户中。期货公司会员对境外经纪机构通过综合资金账户进行统一结算和风险控制。

　　境外经纪机构应当对其每个境外客户所交付的保证金实行分账管理，为每一境外客户设立明细账户，按日序时登记核算每一境外客户出入金、盈亏、交易保证金、手续费等。

　　第二十六条 会员在开设专用资金账户时,须向交易所提交《印鉴授权书》等相关资料。

　　第二十七条 《印鉴授权书》中被授权的公章、财务章、法定代表人章或其授权人章为会员的有效印鉴，会员应对使用以上印鉴所产生的一切后果承担责任。

　　第二十八条 会员更名或转让必须向交易所重新提交《印鉴授权书》，并办理相关专用资金账户的变更手续。

　　第二十九条 交易所有权在不通知会员的情况下通过存管银行从会员的专用资金账户中收取各项应收款项,并且有权随时查询该账户的资金情况。

第三章 日常结算

　　第三十条 交易所实行保证金制度。会员应按规定向交易所交纳一定的资金，用于结算和保证履约。

　　保证金分为结算准备金和交易保证金。

　　人民币作为交易所结算币种。经交易所同意，外汇资金、标准仓单、可流通的国债等资产（以下统称为作为保证金的资产）可以作为保证金。

　　第三十一条 结算准备金是指会员为了交易结算在交易所专用结算账户中预先准备的资金，是未被合约占用的保证金。结算准备金的最低余额由交易所决定。

　　第三十二条　期货公司会员结算准备金最低余额为200万元，非期货公司会员结算准备金最低余额为50万元。

　　期货公司会员每接受一家境外经纪机构委托交易结算的，该会员的结算准备金最低余额的相应要求由交易所另行通知。

　　会员结算准备金最低余额应当以人民币自有资金缴纳。

　　第三十三条 交易所根据会员当日结算准备金余额中的货币资金部分，以不低于中国人民银行公布的相应币种的同期银行活期存款利率计算利息，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会员。具体执行利率由交易所确定、调整并公布。

　　第三十四条 交易保证金是指会员在交易所专用结算账户中确保合约履行的资金，是已被合约占用的保证金。当买卖双方成交后,交易所按持仓合约价值的一定比率收取交易保证金。

　　标准仓单交到交易所后，与其所示数量相同的最近交割月份卖持仓交易保证金在结算时不再收取。黄大豆2号、鸡蛋等品种期货业务细则另有规定的，适用其规定。

　　第三十五条 各品种合约的交易保证金收取标准按交易所保证金制度有关规定执行。

　　第三十六条 期货公司会员向其客户收取的保证金属于客户所有，应当存放于会员保证金专用账户，以备随时交付保证金及有关费用。

　　期货公司会员向境外经纪机构收取的保证金属于境外经纪机构所有，应当存放于会员保证金专用账户，以备随时交付保证金及有关费用。

　　期货公司会员除按照中国证监会的规定为其客户、境外经纪机构向交易所交存保证金、进行交易结算外，严禁将保证金挪作他用。

　　第三十七条 期货公司会员向其客户、境外经纪机构收取的交易保证金不得低于交易所向会员收取的交易保证金。

　　第三十八条 交易所根据会员当日成交合约数量或者成交合约金额收取交易手续费。交易所可以针对不同品种、合约、交易类型、交易量和持仓量等制定不同的交易手续费标准。

　　交易所可以根据下单、撤单的笔数或手数等收取申报费、撤单费等费用。

　　交易手续费、申报费、撤单费等费用标准由交易所另行规定，交易所可以根据市场情况对费用收取方式和收取标准进行调整。

　　交易所可以对会员应交纳的交易手续费进行减收，减收方案由交易所另行制定并根据市场情况进行调整。

　　第三十九条 交易所实行当日无负债结算制度。

　　当日无负债结算制度是指每日交易结束后，交易所按当日结算价结算所有合约的盈亏、交易保证金及手续费等费用，对应收应付的款项实行净额一次划转，相应增加或减少会员的结算准备金。

　　第四十条 期货合约当日结算价是指某一期货合约当日成交价格按照成交量的加权平均价。当日无成交价格的，其合约的当日结算价按照下列方法确定：

　　（一）若合约当日有买、卖双方委托报价的，以最高买报价、最低卖报价与该合约上一交易日的结算价三者居中的一个价格作为合约的当日结算价；

　　（二）若合约出现涨（跌）停板单边无连续报价的，以该停板价格作为合约的当日结算价；

　　（三）若合约当日无委托报价，或者有买或卖单方委托报价但未出现涨(跌)停板单边无连续报价的，以当日距无成交合约最近的前一有成交合约作为基准合约计算当日无成交合约结算价：

　　1.若基准合约当日结算价的涨跌幅度（%）小于等于当日无成交合约当日的涨跌停板，则当日无成交合约结算价＝该合约上一交易日的结算价×（1±基准合约结算价的涨跌幅度）。

　　2.若基准合约当日结算价的涨跌幅度（%）大于当日无成交合约当日的涨跌停板，则当日无成交合约结算价＝该合约上一交易日的结算价×（1±该合约的当日涨跌停板幅度）。

　　3.若无法找到基准合约，则当日无成交合约结算价＝上一交易日该合约的结算价；新合约上市第一日若无法找到基准合约，则当日无成交合约结算价=挂盘基准价。

　　新上市合约连续三个交易日无成交，交易所可另行调整结算价。

       交易所进行合约、规则调整的，对于当前无持仓且连续三个交易日无成交的已挂牌合约，交易所可另行调整结算价。

　　第四十一条 期货合约均以当日结算价作为计算当日盈亏的依据。具体计算公式如下：

　　当日盈亏 =平仓盈亏 +持仓盈亏

　　平仓盈亏 =平历史仓盈亏 +平当日仓盈亏

　　平历史仓盈亏 =Σ [(卖出平仓价－上一交易日结算价 )×卖出平仓量]+ Σ [( 上一交易日结算价－买入平仓价 ) ×买入平仓量]

　　平当日仓盈亏 =Σ [(当日卖出平仓价－当日买入开仓价 )×卖出平仓量]+ Σ [( 当日卖出开仓价－当日买入平仓价 ) ×买入平仓量]

　　持仓盈亏 =历史持仓盈亏 +当日开仓持仓盈亏

　　历史持仓盈亏 =Σ [(上一日结算价－当日结算价 )×卖出历史持仓量]+ Σ [( 当日结算价－上一日结算价 ) ×买入历史持仓量]

　　当日开仓持仓盈亏 =Σ [(卖出开仓价－当日结算价 )×卖出开仓量]+ Σ [( 当日结算价－买入开仓价 ) ×买入开仓量]

　　第四十二条 当日结算时的交易保证金超过昨日结算时的交易保证金部分从会员结算准备金中扣划，当日结算时的交易保证金低于昨日结算时的交易保证金部分划入会员结算准备金。当日盈利划入会员结算准备金，当日亏损从会员结算准备金中扣划。

　　手续费等各项费用、交割货款从会员结算准备金中扣划。盈亏、费用、货款、税金和期权权利金等款项应当以人民币货币资金支付。

　　第四十三条 结算准备金余额的具体计算公式如下：

　　当日结算准备金余额=上一交易日结算准备金余额+上一交易日交易保证金－当日交易保证金+当日作为保证金的资产的实际可用金额-上一交易日作为保证金的资产的实际可用金额+当日盈亏+当日期权权利金收支+入金－出金－手续费等

　　作为保证金的资产的实际可用金额具体计算方法见本办法第五章的有关规定。

　　第四十四条 结算完毕后，会员的结算准备金低于最低余额时，该结算结果即视为交易所向会员发出的追加保证金通知。

　　会员应当在下一个交易日开市前补足至结算准备金最低余额。未补足的，若结算准备金余额大于零而低于结算准备金最低余额，禁止开新仓；若结算准备金余额小于零，则交易所将按有关规定对该会员强行平仓。

　　会员的结算准备金中人民币资金低于结算准备金最低余额时，交易所向会员发出追加人民币通知。会员应当在下一个交易日开市前补足人民币资金至结算准备金最低余额。未补足的，交易所可以在下一交易日第二小节闭市后对专用结算账户中该会员的外汇资金或会员专用资金账户中的外汇资金进行强制换汇。

　　第四十五条 交易所本着准确、快捷的原则为会员办理出入金业务。正常情况下，会员在每个交易日闭市之前提出的书面、电子等方式入金申请,交易所将于当日闭市前完成会员入金业务，会员在每个交易日闭市之后提出的书面入金申请,交易所将于下一交易日开市前完成会员入金业务；会员应在每个交易日15:10之前提出书面、电子等方式出金申请,经交易所审核后,于当日15:10后集中办理会员出金划转。特殊情况下，交易所办理出入金业务时间顺延。

　　夜盘交易小节，交易所不受理出金申请、不办理出金业务。

　　第四十六条 会员出金必须符合交易所规定。会员的出金标准为：

　　（一）作为保证金的有价证券实际可用金额大于等于交易保证金的80%时

　　可出金额=实有货币资金-交易保证金×20%-结算准备金最低余额

　　（二）作为保证金的有价证券实际可用金额小于交易保证金的80%时

　　可出金额=实有货币资金-（交易保证金-作为保证金的有价证券实际可用金额）-结算准备金最低余额

　　实有货币资金指实有人民币资金和外汇资金价值按照折扣比率折算后的人民币金额之和，外汇资金的折算方法见本办法第五章的规定。

　　外汇资金折算的人民币金额不可以人民币方式出金，外汇可出金额以交存的外汇资金为限。

　　交易所可根据市场风险状况和允许使用的外汇种类对会员出金标准做适当调整。

　　第四十七条 有下列情况之一的会员、境外经纪机构和客户，交易所可限制会员出金，要求会员限制其客户、境外经纪机构出金，以及要求会员、境外经纪机构配合限制客户出金：

　　（一）涉嫌重大违规，经交易所立案调查的；

　　（二）因投诉、举报、交易纠纷等被司法部门、交易所或其他有关部门正式立案调查，且正处在调查期间；

　　（三）会员未在规定的时间内补足人民币至结算准备金最低余额或不配合交易所为其客户、境外经纪机构进行结购汇时；

　　（四）交易所认为市场出现重大风险的；

　　（五）交易所认为必要的其他情况。

　　第四十八条 当日交易结束后，交易所对每一会员的盈亏、交易手续费、交易保证金等款项进行结算。交易所采用发放结算单据或电子传输等方式向会员提供当日结算数据，包括：《大连商品交易所会员当日成交合约表》、《大连商品交易所会员当日平仓盈亏表》、《大连商品交易所会员当日持仓表》和《大连商品交易所会员资金结算表》等。

　　第四十九条 遇特殊情况造成交易所不能按时提供结算数据，交易所将另行通知提供结算数据的时间。

　　第五十条 会员每日应及时地取得交易所提供的结算数据，做好核对工作，并将之妥善保存，该数据至少保存20年，但对有关期货交易有争议的，应当保存至该争议消除时为止。

　　第五十一条 会员如对结算数据有异议,应不迟于下一交易日开市前三十分钟以书面形式通知交易所。遇特殊情况，会员可在下一交易日开市后二小时内以书面形式通知交易所。如在规定时间内会员没有对结算数据提出异议,则视作会员已认可结算数据的正确性。

　　第五十二条 交易所将在每月的第一个交易日向会员提供上月的《大连商品交易所资金结算核对单(代收据)》(加盖结算专用章),作为会员核查交易账簿记录的依据。

　　第五十三条 发生下列情形之一的，经交易所批准，可进行移仓：

　　（一）期货公司会员发生合并、分立、破产；

　　（二）期货公司会员因故不能从事期货经纪业务；

　　（三）期货公司会员变更与境外经纪机构委托关系的；

　　（四）交易所认可的其他移仓情况。

　　发生（一）、（二）项规定的情形，期货公司会员应当按照国家法律、法规和其他规定予以公告，并将有关公告提交交易所。

　　期货公司会员发生合并时，由期货公司会员提出移仓申请，申请材料中应当包括移入和移出仓位、期货公司会员同意移仓的申请书、境外经纪机构同意移仓的申请书以及客户持仓的详细清单。发生其他情形时，由期货公司会员和其客户、境外经纪机构共同提出移仓申请，申请材料中应当包括移入和移出仓位、期货公司会员同意移仓的申请书、期货公司会员的客户和境外经纪机构同意移仓的申请书以及客户持仓的详细清单。

　　发生（三）项规定的情形，由移入仓位的期货公司会员提出移仓申请，申请材料中应当包括移入和移出仓位的期货公司会员同意移仓的申请书、境外经纪机构同意移仓的申请书、境外经纪机构变更委托关系的声明书以及客户持仓的详细清单。

　　发生（四）项规定的情形，移仓办理由交易所另行规定。

　　在期货公司会员出现破产等重大经营危机但未提出申请的特殊情况下，为保护客户权益，交易所可以启动应急预案，办理客户移仓。这种情况下的办理由交易所另行规定。

　　第五十四条 移仓申请经批准后,交易所将与期货公司会员约定一周内的某一交易日为客户移仓结算日。

　　第五十五条 交易所将在约定日期的当日结算完成后，为期货公司会员实施客户移仓,并提供客户移仓前和移仓后的持仓清单由期货公司会员确认。

　　第五十六条 移仓内容仅包括客户的持仓及相应的交易保证金,不包括当日的盈亏、交易手续费、结算准备金等其他款项。

　　第五十七条 期货公司会员应仔细核对移仓前后客户的移仓情况,一经确认,不得更改。

　　第五十八条 会员当日结算准备金余额低于零或者持有有价证券作为保证金的，不得办理移仓。

第四章 实物交割结算

　　第五十九条 会员进行实物交割,应按规定向交易所交纳交割手续费。具体标准在各品种期货业务细则中载明。

　　交割手续费从会员的结算准备金中扣划。

　　第六十条 交割结算价为该期货合约交割结算的基准价。滚动交割的交割结算价采用该期货合约滚动交割配对日的当日结算价。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。期转现结算价采用买卖双方协议价格。提货单交割的交割结算价采用该期货合约提货单交割配对日的当日结算价。全月每日选择交割的交割结算价采用该期货合约全月每日选择交割配对日的当日结算价。

　　保税交割的交割结算价见《大连商品交易所交割管理办法》和实行保税交割相关品种期货业务细则的有关规定。

　　第六十一条 交割货款按交割结算价加上非基准交割仓库与基准交割仓库的升贴水结算，交易所另有规定的，适用其规定。

　　第六十二条 交割违约按照《大连商品交易所交割管理办法》相关规定执行。

　　第六十三条 发票或者交易所认可的其他单据由交割的卖方客户向相对应的买方客户开具，并由双方会员转交、领取并协助核实，交易所根据双方会员确认结果结清相应的余款。铁矿石等品种期货业务细则对发票开具方式另有规定的，适用其规定。

　　各品种应当开具的发票类型或者交易所认可的其他单据见相应品种期货业务细则。

　　第六十四条 卖方会员未在规定时间提交增值税专用（普通）发票的，自应交而未交增值税专用（普通）发票次日起，交易所向卖方会员按货款金额每日0.5‰的比例收取滞纳金，补偿给买方会员；超过30个自然日，卖方会员仍未提交增值税专用（普通）发票的，视作不交增值税专用（普通）发票，交易所按国家税收政策规定计算的增值税税额收取赔偿金，与滞纳金一并补偿给买方会员。上述款项从该会员在交易所预留的交割货款金额中扣除，剩余货款属于卖方会员。买卖双方另有约定的，遵其约定。铁矿石等品种期货业务细则另有规定的，适用其规定。

　　第六十五条 一次性交割的结算业务按以下规定办理：

　　（一）最后交易日闭市后，买方会员交割月份买持仓的交易保证金转为交割预付款，卖方会员交割月份卖持仓的交易保证金转为交割保证金；卖方会员按时将标准仓单交到交易所后，交易所清退卖方会员交割保证金；黄大豆2号、鸡蛋等品种期货业务细则对交割保证金清退另有规定的，适用其规定；

　　（二）最后交易日结算时，交易所对会员该交割月份持仓按交割结算价进行结算处理，产生的盈亏计入当日平仓盈亏；

　　（三）最后交易日结算时，交易所从会员的结算准备金中扣划交割手续费；

　　（四）最后交易日后第1个交易日闭市前，卖方会员应当将与其交割月份卖持仓相对应的全部标准仓单交到交易所；

　　（五）最后交割日闭市前，买方会员应当将与其交割月份买持仓相对应的货款与交割预付款的差额部分划入交易所的专用结算账户；

　　（六）在规定时间内，卖方会员未能如数交付标准仓单，买方会员未能如数解付货款的，构成交割违约；

　　（七）最后交割日闭市后，交易所将卖方会员提交的标准仓单交付给买方会员，将货款的80%付给卖方会员，余款在卖方会员提交了发票后结清，黄大豆2号、铁矿石和鸡蛋等品种期货业务细则对货款支付另有规定的，适用其规定；

　　（八）配对日后1个交易日内，买方会员应按税务机关的规定将开具发票的具体事项，包括购货单位名称、购货单位地址、金额、纳税人登记号等信息通知卖方会员；交收标的为保税铁矿石的除外。

　　（九）配对日后7个交易日内，卖方会员应当将发票交付买方会员，黄大豆2号、铁矿石和鸡蛋等品种期货业务细则对发票交付另有规定的，适用其规定。

　　第六十六条 滚动交割的结算业务按以下规定办理：

　　（一）配对日闭市后，买方会员配对买持仓的交易保证金转为交割预付款；

　　（二）配对日结算时，交易所对会员该交割月份持仓按交割结算价进行结算处理，产生的盈亏计入当日平仓盈亏；

　　（三）配对日结算时，交易所从会员的结算准备金中扣划交割手续费；

　　（四）交收日闭市前，买方会员须将与其交割买持仓相对应的货款与交割预付款的差额部分划入交易所的专用结算账户；

　　（五）交收日闭市时，买方会员未能如数解付货款的，构成交割违约；

　　（六）交收日闭市后，交易所将卖方会员提交的标准仓单交付买方会员，将货款的80%付给卖方会员，余款在卖方会员提交了增值税专用发票后结清；

　　（七）配对日后1个交易日内，买方会员应按税务机关的规定将开具增值税专用发票的具体事项，如购货单位名称、购货单位地址、纳税人登记号、金额等信息通知卖方会员；

　　（八）配对日后7个交易日内，卖方会员向买方会员提交增值税专用发票。

　　第六十七条 期转现的结算业务按以下规定办理：

　　（一）标准仓单期转现的仓单交收和货款支付由交易所负责办理；

　　（二）非标准仓单期转现的货物交收和货款收付通过交易双方自行办理的，由交易双方自行协商确定；货款收付委托交易所办理的，由交易所代为收付货款，交易所不负责非标准仓单的交收；

　　（三）期转现批准日结算时，交易所将交易双方的期转现持仓按协议价格进行结算处理，产生的盈亏计入当日平仓盈亏；

　　（四）期转现批准日结算时，交易所从会员结算准备金中扣划期转现手续费，标准仓单的期转现手续费按该品种交割手续费标准收取，非标准仓单的期转现手续费按该品种交易手续费标准收取。黄大豆2号等品种期货业务细则对手续费收取另有规定的，适用其规定；

　　（五）期转现批准日11:30前，买方会员将全额货款划入交易所的专用结算账户，标准仓单期转现的卖方会员将相应数量的标准仓单交到交易所；

　　（六）期转现批准日闭市后，交易所将货款的80%付给卖方会员，余款在卖方会员提交了发票后结清，铁矿石等品种期货业务细则对保税期转现货款支付另有规定的，适用其规定；对于标准仓单期转现，交易所还应当将卖方会员提交的标准仓单交付买方会员；

　　（七）期转现批准日后7个交易日内，卖方会员应向买方会员提交发票；铁矿石等品种期货业务细则对保税期转现发票交付另有规定的，适用其规定。

　　第六十八条 标准仓单转让的货款收付业务按以下规定办理：

　　（一）标准仓单转让的货款收付，交易双方可以自行办理，也可以委托交易所办理。委托交易所办理的，交易双方应当通过会员向交易所提交委托申请；

　　（二）委托交易所收付货款的，交易双方应当在标准仓单转让申请中提交委托申请；当日闭市前提交委托申请的，货款收付于当日处理；闭市后提交委托申请的，货款收付于下一交易日处理；

　　（三）处理日当日闭市前，买方会员应当将全额货款划入交易所的专用结算账户，卖方会员应当将相应数量的标准仓单交到交易所；

　　（四）处理日当日闭市时，卖方会员未能如数交付标准仓单，买方会员未能如数解付货款的，视为放弃标准仓单转让申请；

　　（五）处理日当日闭市后，交易所将标准仓单交付买方会员，将货款的80%付给卖方会员，余款在卖方会员提交了增值税专用发票后结清；

　　（六）标准仓单转让日后7个交易日内，卖方会员应当向买方会员提交增值税专用发票。

　　铁矿石等品种期货业务细则对保税标准仓单转让的货款收付业务有规定的，按照其规定执行。

　　对于两个或两个以上标准仓单转让申请，交易双方互负标准仓单转让义务的，根据双方约定并确认，交易所可以在处理日闭市前办理仓单过户和差额货款收付业务。

　　第六十九条 提货单交割的结算业务按以下规定办理：

　　（一）配对日闭市后，买方会员配对买持仓的交易保证金转为交割预付款；卖方会员配对卖持仓的交易保证金转为交割保证金；

　　（二）配对日结算时，交易所对会员申请交割的持仓按交割结算价进行结算处理，产生的盈亏计入当日平仓盈亏；

　　（三）配对日结算时，交易所从会员的结算准备金中扣划交割手续费；

　　（四）通知日后第3个自然日（第3个自然日不是交易日的，顺延至下一个交易日）闭市前，买方会员的交割预付款和卖方会员的交割保证金应按配对合约价值20%补足。闭市后，交易所从相应会员的结算准备金中划转。

　　最后通知日后第3个自然日（第3个自然日不是交易日的，顺延至下一个交易日）闭市前，参与提货单交割的所有买方会员的交割预付款和所有卖方会员的交割保证金应按配对合约价值20%补足。闭市后，交易所从相应会员的结算准备金中划转。

　　（五）交收日闭市前，买方会员须将交割买持仓相对应的货款（包括溢短款和升贴水）与交割预付款的差额部分划入交易所的专用结算账户；

　　（六）交收日闭市后，交易所释放卖方会员交割保证金，交收标的为完税商品的，交易所将全额货款的80%划转给卖方会员，余款在卖方会员提交了增值税专用发票后结清；交收标的为保税商品的，交易所将保税交割货款划转给卖方会员。

　　（七）交收日，买方会员应按税务机关的规定将开具发票或者其他单据的具体事项，如购货单位名称、购货单位地址、金额、开具增值税专用发票所需的纳税人登记号等信息通知卖方会员；交收标的为保税铁矿石的除外。

　　（八）交收标的为完税商品的，交收日后7个交易日内，卖方会员向买方会员提交增值税专用发票；交收标的为保税商品的，卖方会员应当在交收日闭市前向交易所提交增值税普通发票。

　　第七十条 全月每日选择交割的结算业务按以下规定办理：

　　（一）配对日闭市后，买方会员配对买持仓的交易保证金转为交割预付款；卖方会员配对卖持仓的交易保证金转为交割保证金；

　　（二）配对日结算时，交易所对会员该交割月份持仓按交割结算价进行结算处理，产生的盈亏计入当日平仓盈亏；

　　（三）配对日结算时，交易所从会员的结算准备金中扣划交割手续费；

　　（四）交收日闭市前，买方会员应当将与其交割买持仓相对应的货款（包括非基准交割仓库与基准交割仓库的升贴水或指定车板交割场所升贴水）与交割预付款的差额部分划入交易所的专用结算账户；

　　（五）交收日闭市时，买方会员未能如数解付货款的，构成交割违约；

　　（六）交收日闭市后，交易所将卖方会员提交的标准仓单交付给买方会员；交易所向卖方会员支付货款等规定见相关品种期货业务细则；

　　（七）配对日后1个交易日内，买方会员应按税务机关的规定将开具增值税普通发票的具体事项，如购货单位名称、购货单位地址、纳税人登记号、金额等信息通知卖方会员；

　　（八）交易所支付80%货款后7个交易日内，卖方会员应当将实际交割货物相应的增值税普通发票交付买方会员。

第五章 作为保证金的资产

　　第七十一条 经交易所批准，以下资产可以作为保证金：

　　（一）除鸡蛋、黄大豆2号品种外的标准仓单；

　　（二）可流通的国债；

　　（三）外汇资金（币种类别、折算方式和适用范围由交易所另行公布）；

　　（四）交易所另行确定的其他有价证券等资产。

　　以前款规定的有价证券作为保证金的，期限不得超过该有价证券的有效期限，并且作为保证金的金额单笔不得低于10万元。

　　第七十二条 标准仓单作为保证金的，交易所以申请日前一交易日该标准仓单对应品种最近交割月份期货合约的结算价为基准计算价值。

　　国债作为保证金的，交易所以申请日前一交易日该国债在上海证券交易所、深圳证券交易所较低的收盘价为基准计算价值。

　　外汇资金或其他资产作为保证金的基准价由交易所核定。

　　当作为保证金的有价证券的市值涨跌幅度超过10%（含本数）时，交易所可以对该笔有价证券基准价值作相应调整。

　　实行保税交割相关品种期货业务细则对保税标准仓单作为保证金使用的基准计算价值另有规定的，适用其规定。

　　第七十三条 有价证券作为保证金的金额不得高于以下标准中的较低值：

　　(一)有价证券基准计算价值的80％（折扣比率）；

　　(二)会员在期货交易所专用结算账户中的实有货币资金的4倍（配比乘数）。

　　交易所在每日结算时根据以上原则自动调整会员有价证券作为保证金的金额。

　　第七十四条 交易所有权对作为保证金的资产的基准价、折扣比率、配比乘数进行调整，由交易所另行通知。

　　第七十五条 客户、境外经纪机构以资产作为保证金的，会员应当将收到的资产提交交易所；按照规定以外汇资金或者其他资产作为保证金的，视为授权交易所对相应资产进行划转或者作质押处理。

　　标准仓单以外的有价证券作为保证金的，视为授权交易所委托托管机构对其申报账户内的对应有价证券进行划转或者质押登记处理。有价证券的划转、质押登记以及管理等相关业务按照托管机构有关规定办理。

　　第七十六条 有价证券作为保证金的手续：

　　（一）申请

　　会员办理有价证券作为保证金业务时，须向交易所提出申请，经办人须提交单位法定代表人签发的《有价证券作为保证金专项授权书》。会员以客户的有价证券办理作为保证金业务时，应同时提交经客户签章的《客户专项授权书》。

　　（二）验证交存

　　办理标准仓单作为保证金的会员须在申请获交易所批准后办理标准仓单交存手续；其他有价证券的验证交存由交易所另行规定。

　　（三）签订协议

　　核算有价证券作为保证金金额后，会员与交易所签定《大连商品交易所有价证券作为保证金协议书》。

　　（四）会员也可以通过电子方式办理有价证券作为保证金业务。

　　第七十七条 外汇资金作为保证金的手续：

　　会员办理外汇资金作为保证金业务时，应在每个交易日闭市之前以电子或书面方式向交易所提出外汇资金入金申请。交易所将于当日闭市前完成会员外汇资金作为保证金业务，会员在每个交易日闭市之后提出的书面外汇资金入金申请,交易所将于下一交易日开市前完成会员外汇资金作为保证金业务。

　　会员应在每个交易日15:10之前提出外汇资金出金申请,经交易所审核后,于当日15:10后集中办理会员外汇资金划转。

　　夜盘交易小节，交易所只受理外汇资金入金申请，不受理外汇资金出金申请、不办理外汇资金提取业务。

　　第七十八条 会员提取外汇资金造成保证金不足的，不可办理提取手续。

　　第七十九条 有价证券每次作为保证金的最长期限为6个月。期满仍需作为保证金的，应当重新办理手续。

　　第八十条 出现下列情况之一的，交易所可以终止资产作为保证金协议并取消资产作为保证金的金额：

　　（一）办理资产作为保证金的会员提取和运用资金出现较大风险并有可能危及交易所合法权益的；

　　（二）作为保证金的资产出现瑕疵或者发生重大风险的；

　　（三）由于其他原因需要终止和取消的。

　　第八十一条 有价证券作为保证金的，协议期内，会员可申请提前提取有价证券，但提取造成保证金不足的，应当在弥补应交保证金之后，方可解除协议，取回作为保证金的有价证券。

　　第八十二条 有价证券作为保证金的，协议期满，有价证券作为保证金已被清偿时，会员方可终止有价证券作为保证金的协议，取回作为保证金的有价证券。

　　有价证券作为保证金的，协议期满，当会员以有价证券作为保证金不能清偿时，交易所有权按本办法和协议的有关规定依法将有价证券兑现或变现，用于清偿其作为保证金和相关债务。清偿后有余额的，将余额部分退还会员；兑现或变现金额不足以清偿其作为保证金和相关债务的，交易所有权向会员追索。

　　第八十三条 办理资产作为保证金的，会员应当向交易所缴纳手续费，同时承担该资产在作为保证金期内发生的其他费用，如标准仓单对应的仓储费，需兑现或变现时发生的费用以及标准仓单以外的有价证券作为保证金业务中托管机构收取的有关费用。手续费由交易所按不高于中国人民银行公布的同期贷款利率计算并按月收取。具体计算金额和收费标准由交易所确定、调整并另行通知。

　　第八十四条 当会员不履行或不能完全履行交易保证金债务时，交易所有权将该作为保证金的资产变现，从所得的款项中优先受偿交易保证金债务和相关交易债务。会员应当承担处置作为保证金的资产时产生的损失及费用。

　　第八十五条 夜盘交易小节，交易所不受理有价证券作为保证金相关业务申请、不办理相关业务。遇有特殊情况的，交易所可以延长受理有价证券等资产作为保证金相关业务申请的时间。

　　第八十六条 按照交易所业务规则达成的交易即具有法律效力，不因交易者主体资格瑕疵、意思表示不真实或者保证金来源的权属争议而无效或者可变更可撤销，交易产生的损失由该交易者自行承担。

第六章 风险与责任

　　第八十七条 会员应当履行其在交易所成交的合约相关义务和责任，承担相关风险。

　　交易所组织期货交易，已经成交的交易指令、了结的期货交易持仓、收取的保证金、已经划转或者完成质押处理的作为保证金的资产、配对完成的标准仓单等交易、结算和交割行为或者财产的法律属性，以及采取的违约处理措施，不因会员进入破产程序而使得相关行为或者财产的法律属性被撤销或者无效。

　　会员进入破产程序，交易所仍可以按照交易规则及其实施细则，对该会员未了结的合约进行净额结算。

　　第八十八条 指定存管银行发生破产或者其他债权债务纠纷的，保证金不属于其破产财产，不属于冻结或者划拨的财产范围。

　　第八十九条 指定交割仓库发生破产或者其他债权债务纠纷的，期货市场参与者存放的非指定交割仓库所有的期货商品，不属于指定交割仓库的破产财产和查封、扣押的财产范围。

　　第九十条 风险防范实行分级负责制。交易所防范会员的风险，会员防范其客户及境外经纪机构的风险。境外经纪机构防范其客户的风险。

　　第九十一条 会员不能履行合约相关义务和责任时，交易所有权对其采取下列保障措施：

　　（一）动用会员的结算准备金；

　　（二）暂停开仓交易；

　　（三）按规定强行平仓，直至用平仓后释放的保证金能够履行合约相关义务和责任为止；

　　（四）将交存的作为保证金的资产处置变现，用变现所得履行合约相关义务和责任。

　　第九十二条 如采取前条措施后会员仍欠资金，交易所将按以下步骤履行合约相关义务和责任：

　　（一）取消该会员资格，用该会员的会员资格费抵偿；

　　（二）动用风险准备金进行履约赔偿；

　　（三）动用交易所的自有资产进行履约赔偿。

　　交易所履行合约相关义务和责任后，通过法律程序对会员进行追偿。

　　第九十三条 交易所实行风险准备金制度。风险准备金是指由交易所设立，用于为维护期货市场正常运转提供财务担保和弥补因交易所不可预见风险带来的亏损的资金。

　　第九十四条 风险准备金的来源：

　　（一）交易所按向会员收取手续费收入20%的比例，从管理费用中提取；

　　（二）符合国家财政政策规定的其他收入。

　　第九十五条 风险准备金应当单独核算，专户存储，除用于弥补风险损失外，不得挪作他用。

　　第九十六条 风险准备金的动用应当经交易所理事会批准，报告中国证监会后按规定的用途和程序进行。

第七章 附则

　　第九十七条 本办法中所称时间均为北京时间，除本办法有明确的规定外，“日”均指交易日。

　　第九十八条 违反本办法规定的，交易所按《大连商品交易所违规处理办法》的有关规定处理。

　　第九十九条 各品种期货业务细则有特别规定或者交易所对期权交易业务有特别规定的，适用其规定。

　　第一百条 本办法解释权属于大连商品交易所。

　　第一百零一条 本办法自公布之日起实施。

附件2：

**《大连商品交易所交割管理办法》**

**修正案**

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。

**《大连商品交易所交割管理办法》**

**修订稿**

第一章 总则

　　第一条 为保证大连商品交易所(以下简称交易所)期货交割业务的正常进行，规范实物交割行为，根据《大连商品交易所交易规则》，制定本办法。

　　第二条 交易所上市的商品期货合约采用实物交割方式。实物交割是指交易双方按照合约和规则的规定通过该期货合约所载商品所有权的转移,了结未平仓合约的过程。

　　第三条 客户的实物交割应当由会员办理，并以会员名义在交易所进行。

　　委托境外经纪机构从事期货交易的客户的交割应当委托其境外经纪机构办理，境外经纪机构再委托会员办理，以会员名义在交易所进行。

　　第四条 期货实物交割可以采用标准仓单交割和标准仓单以外的交割方式。

　　第五条 期货实物交割可以适用期货转现货（以下简称期转现）、提货单交割、滚动交割、全月每日选择交割、一次性交割以及交易所规定的其他流程。

　　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。

　　第七条 交易所上市的商品期货合约的交割业务按本办法进行，交易所、会员、境外经纪机构、客户、指定交割仓库、指定车板交割场所、指定质量检验机构等交割业务参与者应当遵守本办法。

第二章 期转现

　　第八条 期转现是指持有同一交割月份合约的交易双方通过协商达成现货买卖协议，并按照协议价格了结各自持有的期货持仓，同时进行数量相当的货款和实物交换。

　　第九条 期转现分为标准仓单期转现和非标准仓单期转现。标准仓单期转现根据标准仓单类型分为完税标准仓单期转现和保税标准仓单期转现（以下简称保税期转现）。

　　第十条 提出期转现申请的客户必须是单位客户，期转现的期限为该合约上市之日起至交割月份前一个月倒数第三个交易日（含当日）。黄大豆2号、鸡蛋等品种期货业务细则对期转现的期限另有规定的，适用其规定。

　　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。

　　第十二条 采用标准仓单进行期转现时，会员应在交易日11:30前向交易所提出申请，交易所在申请的当日内予以审批。

　　批准日11:30前，卖方会员应将相应数量的标准仓单交到交易所，买方会员应将按协议价格计算的全额货款划入交易所帐户。

　　第十三条 采用非标准仓单进行期转现时，交易所在收到申请后的三个交易日内予以审批。

　　第十四条 标准仓单期转现的仓单交收和货款支付由交易所负责办理，具体流程见《大连商品交易所结算管理办法》。手续费按交割手续费标准收取，黄大豆2号等品种期货业务细则另有规定的，适用其规定。

　　第十五条 非标准仓单期转现的货物交收和货款收付通过交易双方自行办理的，由交易双方自行协商确定；货款收付委托交易所办理的，具体流程见《大连商品交易所结算管理办法》。手续费按交易手续费标准收取，黄大豆2号等品种期货业务细则另有规定的，适用其规定。交易所对非标准仓单期转现的货物交收和货款支付不承担担保责任。

　　采用非标准仓单进行期转现时，交易双方应在现货交易结束后向交易所提交货物交收证明，货款收付自行办理的，还应当向交易所提交货款支付证明；交易所有权对交易双方的现货行为进行监督和核查。

　　第十六条 期转现批准日结算时，交易所将交易双方的期转现持仓按协议价格进行结算处理，产生的盈亏计入当日平仓盈亏。

　　第十七条 期转现的持仓从当日持仓量中扣除，交易结果不计入当日结算价和成交量。每个交易日结束后，交易所将当日执行的期转现有关信息予以公布。

　　第十八条 对非善意的期转现行为，按照《大连商品交易所违规处理办法》中的有关规定处理。

　　第十九条 实行保税交割相关品种期货业务细则对保税期转现有规定的，按照其规定执行。

第三章 提货单交割

　　第二十条 提货单交割是指在交割月前一个月的规定时间内，由买卖双方主动申请、经交易所组织配对并监督、按照规定程序进行货物交收的实物交割方式。

　　提货单交割的商品可以是完税商品，也可以是保税商品。同一批提货单交割的商品应当同为完税商品或者保税商品。

　　适用提货单交割的品种由交易所在相关品种期货业务细则中规定。

　　交货地点在交易所指定交割地点中选择，具体指定交割地点由交易所另行公布。

　　第二十一条 提货单是指在买方完成商品验收、确认合格、并经存货港口对物权转移确认后，卖方签发给买方的实物提货凭证。

　　提货单的内容包括：买方名称、卖方名称、存货港口名称、货物名称、数量、品质、存放地点、货物状态（完税商品或保税商品）、签发日期等。提货单须经买方、卖方、存货港口盖章确认。

　　第二十二条 提货单交割由会员代境外经纪机构、客户办理，非期货公司会员可自行办理。委托境外经纪机构进行期货交易的客户，提货单交割由境外经纪机构办理，境外经纪机构再委托会员办理。

　　客户提出提货单交割申请的总量不得超过其同方向持仓。

　　每笔提货单交割申请的数量见相关品种期货业务细则。

　　第二十三条 提货单交割的申请及配对按照如下规定进行：

　　（一）买方客户在交割月前一个月第10个交易日至交割月前一个月第14个交易日期间内，每个交易日闭市前可以通过会员提出多笔包含数量和交收地点的意向申请，每笔申请只能提一个交收地点；交易所于当日闭市后汇总买方的申请数量和地点，并通过电子仓单系统、交易所网站等对外公布。

　　（二）卖方客户在买方提意向申请的第2个交易日下午14:00前，根据上一个交易日公布的买方意向，可以通过会员向交易所提出多笔包含数量和交收地点的申请，申请中也可以包含配对时参考的意向买方，单笔申请最多可以包含两个意向地点和两个意向买方。

　　（三）卖方提出申请当日为配对日。配对日闭市后，交易所参考卖方提出的意向买方和意向地点，按照最大交割数量原则组织配对。配对结果一经确定，买卖双方不得变更。

　　第二十四条 配对日闭市后，交割配对持仓按配对日的结算价平仓。交割结算价为配对日的当日结算价。买持仓的交易保证金转为交割预付款，卖持仓的交易保证金转为交割保证金。

　　客户在提申请时应同时向交易所提交联系人及相应的联系方式，交易所于配对日闭市后，通过电子仓单系统将配对结果、联系人和联系方式发送给买卖双方会员，配对结果同时通过交易所网站等对外公布。系统一经发送，即视为已经送达。买卖双方收到配对信息后，应主动沟通协商货物交收事宜。

　　第二十五条 船预计到港或在港货物验收前3个自然日（若第3个自然日不是交易日，则提前至上一个交易日）为通知日。

　　卖方会员通过电子仓单系统将交货地点、货物预计到港日期、数量、船名、提单号、货物状态（完税商品或保税商品）等信息发送至交易所。通知日闭市后，交易所通过电子仓单系统发送给买方会员。如果货物到港日期等信息发生变更，卖方应及时通知买方。

　　第二十六条 通知日后第3个自然日（第3个自然日不是交易日的，顺延至下一个交易日）闭市前，买方的交割预付款和卖方的交割保证金应按配对合约价值20%补足。闭市后，交易所从相应会员的结算准备金中划转。

　　第二十七条 最后通知日为交割月前一个月倒数第3个交易日。卖方仍未发送通知信息的，在最后通知日后第3个自然日（第3个自然日不是交易日的，顺延至下一个交易日）闭市前，买方的交割预付款和卖方的交割保证金应按配对合约价值20%补足。闭市后，交易所从相应会员的结算准备金中划转。

　　第二十八条 货物交收确认可以按照以下程序进行：

　　（一）卖方应最少在卸货前（或货物检验前）10小时通知买方，买卖双方到场监收。

　　（二）买方委托的质检机构应在卸货过程中或堆垛过程中进行抽样。检验项目按期货交割质量标准进行。抽样样品留存2个月。检验费用由买方负担，其他费用由卖方负担。

　　（三）货物检重以地磅或双方认可的其他计重方式为准。首先根据装船时检验的水分，按照合约的规定对重量进行折算，足量称重，最终依据为货物交收时质检机构出具的水分检验结果，允许3%的溢短。折算时均按四舍五入取整。

　　例.假设应交收的干基重量10000吨，装船水分检验结果为6%，卸船时质检机构的水分检验结果为8%，则卸货时应按10000÷（1-6%）=10638（吨）足量验重，假设实际卸货重量为a吨，则最后实际交收重量为a×（1-8%）吨，溢短为[a×（1-8%）-10000]（吨）。

　　（四）卸货完成当日，卖方根据港口出具的磅单，通过电子仓单系统填写交收明细，买方应在当天进行确认，逾期未确认的交易所视为买方无异议。

　　交收标的为完税商品的，在买方完成品质检验、卖方完成报关后，买方、卖方、港口三方就货物交收事宜进行确认；交收标的为保税商品的，买方完成品质检验后，买方、卖方、港口三方就货物交收事宜进行确认。确认后卖方会员最迟于下一交易日14:00前，通过电子仓单系统填写《交收确认通知单》，买方会员应在卖方填写《交收确认通知单》当日14:30前完成确认，逾期未确认的交易所视为买方无异议。同时，买方将三方确认后的有效提货单通过传真或其他书面方式报送交易所，原件由客户留存备查。

　　交收标的为保税商品的，买方需要进口报关的，买方应当在《保税交割结算单》（报关专用）开具日10个工作日（含）内，持《保税交割结算单》（报关专用），按照海关相关规定办理进口报关手续。

　　第二十九条 买卖双方不按以上程序进行交收确认的，双方应通过电子仓单系统于确认当日14:00前填写《交收确认通知单》，同时应签订《交收商品品质、数量确认书》（交收商品品质、数量确认书详见相关品种期货业务细则），并以传真或其他书面方式报送交易所，交易所不再受理由于交收品质和数量引发的争议申请，原件应在三个工作日内送达交易所。

　　第三十条 交易所在收到《交收确认通知单》当日闭市后，通过会员服务系统向买方会员发送货款补齐通知，包括溢短款和升贴水。完税商品货款按交割结算价计算。保税商品货款按交割结算价扣除进口环节增值税、进口关税、消费税等税款后计得的保税交割结算价计算；保税商品升贴水按升贴水扣除进口环节增值税、进口关税、消费税等税款后计得的保税升贴水计算。

　　保税交割结算价=[(交割结算价-相关费用)/(1+进口增值税税率)-消费税]/(1+进口关税税率)；

　　保税升贴水=升贴水/(1+进口增值税税率)/(1+进口关税税率)

　　本条第二款所指的“相关费用”包括商品进口报关、报检及代理服务等费用，由交易所另行发布；公式适用于消费税从量计征，关税从价计征的期货品种，其他品种的保税交割结算价计算公式由交易所另行规定。

　　第三十一条 交易所收到《交收确认通知单》下一个交易日为交收日。

　　交收日闭市前，买方会员应将交割买持仓相对应的货款（包括溢短款和升贴水）与交割预付款的差额部分划入交易所的专用结算账户，交收标的为保税商品的，卖方会员应将增值税普通发票交付交易所；闭市后，交收标的为完税商品的，交易所释放卖方交割保证金，并将全额货款的80%划转给卖方，其余货款在卖方提交了增值税专用发票后结清；交收标的为保税商品的，交易所释放卖方交割保证金，并将保税货款划转给卖方。

　　交收标的为完税商品的，发票或者交易所认可的其他单据由交割的卖方客户向相对应的买方客户开具，并由双方会员转交、领取并协助核实。

　　交收标的为保税商品的，境内卖方客户应向卖方会员开具增值税普通发票，境外卖方客户或境外经纪机构应向卖方会员开具相应的收款凭证；卖方会员应向交易所开具增值税普通发票；交易所应向买方会员开具增值税普通发票；买方会员应向买方客户、境外经纪机构开具增值税普通发票。

　　第三十二条 买方应在完成抽样后次日起7个工作日内且在最后交易日前一个交易日前，分别向交易所和卖方提交质检报告，买方会员通过电子仓单系统填写交收商品品质检验信息，卖方应在买方填写品质检验信息的下一个交易日闭市前对检验结果进行确认。

　　卖方如对买方出具的检验结果有异议，应在买方提交检验报告的下一个交易日闭市前向交易所提出复检申请。交易所在指定质量检验机构中选取复检机构，以卸货时的抽样存样的复检结果为解决争议的依据。逾期未提出申请的，视作对检验结果无异议。

　　卖方提出争议时，复检费用先由卖方先行垫付，复检结果与原检验结果的差异在相关标准规定的合理误差范围内的，由此产生的费用（包含检验费、差旅费等）由卖方负担；否则，该费用由买方负担。

　　第三十三条 交收标的为保税商品的，交易所为卖方开具《保税交割结算单》（税务专用、记账专用），为买方开具《保税交割结算单》（记账专用），作为客户申报纳税的凭据；对于有报关进口需求的，交易所为买方开具《保税交割结算单》（报关专用），作为买方办理进口报关的凭据。《保税交割结算单》中除了价格信息外，还包括仓库名称、实际数量、交割时间、交割方式、保税升贴水信息等内容，交割方式中应当标注“提货单交割”。

　　第三十四条 最后交易日闭市前，交易所未收到《交收确认通知单》的，闭市后交易所根据不同情况按照以下规定进行处理：

　　（一）由于买方原因导致双方无法如期完成交收确认的，交易所处以买方交割结算价计算的合约价值20%的惩罚性违约金，并支付给卖方，退还卖方交割保证金，终止交割。

　　（二）由于天气、压港等原因导致双方无法如期完成交收确认的，卖方应在导致延误当日告知交易所，交易所根据实际情况确认最终交收时间。

　　（三）由于卖方除天气之外等原因导致双方无法如期完成交收确认的，交易所处以卖方按交割结算价计算的合约价值20%的惩罚性违约金，并支付给买方，退还买方交割预付款，终止交割。

　　（四）由于品质检验争议导致双方无法如期完成交收确认的，复检结果与大连商品交易所交割质量标准相符的，继续交割；不符合的，处以卖方按交割结算价计算的合约价值20%的惩罚性违约金，并支付给买方，退还买方交割预付款，终止交割。

　　第三十五条 提货单交割违约是指在规定期限内，买方未能如数解付货款，卖方未能在规定地点如数交付符合期货交割质量标准的商品。

　　买方构成交割违约的，交易所处以买方按交割结算价计算的违约部分合约价值20%的惩罚性违约金，并支付给卖方，同时释放卖方的交割保证金，交割终止。

　　买方交割违约合约数量计算公式如下：

　　交收标的为完税商品的，买方交割违约合约数量（手）=[应交货款（元）-已交货款（元）]÷[交割结算价（元/吨）×（1-20%）+升贴水（元/吨）]÷交易单位（吨/手）。

　　交收标的为保税商品的，买方交割违约合约数量（手）=[应交货款（元）-已交货款（元）]÷[保税交割结算价（元/吨）×（1-20%）+保税升贴水（元/吨）]÷交易单位（吨/手）。

　　卖方构成交割违约的，交易所处以卖方按交割结算价计算的违约部分合约价值20%的惩罚性违约金，并支付给买方，同时释放买方的货款，交割终止。

　　卖方交割不足部分合约数量（手）=[应交的商品重量（吨）-已交的重量（吨）]÷交易单位（吨/手）

　　若买卖双方都违约的，交易所对双方按交割结算价计算的违约部分合约价值5%分别处以罚款。

第四章 滚动交割

　　第三十六条 适用滚动交割的品种由交易所在相关品种期货业务细则中规定。

　　第三十七条 滚动交割是指在交割月第一个交易日至最后交易日的前一交易日期间，由持有标准仓单（已冻结的除外，下同）和交割月单向卖持仓的卖方客户主动提出，并由交易所组织匹配双方在规定时间完成交割的交割方式。

　　滚动交割的交割结算价采用该期货合约滚动交割配对日的当日结算价。

　　第三十八条 滚动交割由客户提出交割申请，会员代客户办理。

　　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。

　　第四十一条 配对日闭市后，买方会员的配对买持仓的交易保证金转为交割预付款。

　　第四十二条 配对日闭市后，配对持仓从交割月合约的持仓量中扣除，不再受持仓限额限制。《交割通知单》和配对结果等滚动交割信息随配对日结算单通过会员服务系统发送给买卖双方会员，会员服务系统一经发送，即视为已经送达。配对结果等信息通过相关公共媒体和信息商对社会公众发布。

　　第四十三条 配对结果确定后，买方应及时向卖方提供有关增值税专用发票开具内容的事项，卖方在配对日后7个交易日内将增值税专用发票交付买方。

　　交割增值税专用发票由交割的卖方客户向相对应的买方客户开具，客户开具的增值税专用发票由双方会员转交、领取并协助核实。

　　会员迟交或未提交增值税专用发票的，按《大连商品交易所结算管理办法》有关规定处理。

　　第四十四条 配对日后（不含配对日）第2个交易日为交收日。交收日闭市之前，买方会员须补齐与其配对交割月份合约持仓相对应的全额货款，办理交割手续。

　　第四十五条 交收日闭市后，交易所将卖方交割的仓单分配给对应的配对买方。

　　第四十六条 交收日闭市后，交易所将卖方会员提交的标准仓单交付买方会员，将货款的80%付给卖方会员，余款在卖方会员提交了增值税专用发票后结清。

　　第四十七条 滚动交割违约是指在规定期限内，买方未能如数解付货款。构成交割违约的，按本办法第九章的有关规定处理，其中违约合约价值按配对日结算价计算，交割违约处理在滚动交割的交收日后进行。

　　第四十八条 实行保税交割相关品种期货业务细则对保税标准仓单滚动交割有规定的，按照其规定执行。

第五章 全月每日选择交割

　　第四十九条 适用全月每日选择交割的品种由交易所在相关品种期货业务细则中规定。

　　第五十条 全月每日选择交割是指在交割月第一个交易日至最后交易日的前一交易日，由符合相关品种期货业务细则规定条件的持有交割月单向卖持仓的卖方客户主动提出标准仓单交割或者车板交割申请，并由交易所组织匹配买卖双方在规定时间完成交割的交割方式。

　　全月每日选择交割可以采用标准仓单交割和车板交割。车板交割是指卖方在交易所指定车板交割场所将货物装载至买方车板，完成实物交收的方式。指定车板交割场所是指经交易所认可，为车板交割提供交割服务的指定交割地点。

　　全月每日选择交割的交割结算价采用该期货合约全月每日选择交割配对日的当日结算价。

　　第五十一条 全月每日选择交割由客户提出交割申请，会员代客户办理。

　　第五十二条 全月每日选择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，卖方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的前一交易日，均可向交易所申报交割。其中，采用标准仓单交割的，会员应当在上述每个交易日闭市前申报；采用车板交割的，会员应当在上述每个交易日11:30前申报，交易所于当日闭市前完成审核。提出交割申请的相应标准仓单予以冻结，其卖持仓对应的交易保证金不予清退。

　　（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的前一交易日闭市前可以向交易所申报交割意向。

　　第五十三条 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，交易所先以交割仓库或者车板交割场所为单位汇总卖方申报交割的数量，在买方和交割仓库或者车板交割场所之间按照“最少配对数”原则进行配对，确定买方交割对应的交割仓库或者车板交割场所，以及在该交割仓库或者车板交割场所交割的数量；再将配好交割仓库或者车板交割场所的买方，与申请交割且持有该交割仓库标准仓单或者具有车板交割资格并经交易所审核通过的卖方，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。

　　第五十四条 配对日闭市后，买方会员配对买持仓的交易保证金转为交割预付款，卖方会员配对卖持仓的交易保证金转为交割保证金。

　　第五十五条 配对日闭市后，配对持仓从交割月合约的持仓量中扣除。《交割通知单》和配对结果等全月每日选择交割信息随配对日结算单通过会员服务系统发送给买卖双方会员，会员服务系统一经发送，即视为已经送达。配对结果等信息通过相关公共媒体和信息商对社会公众发布。

　　第五十六条 配对日后1个交易日内，买方会员应按税务机关的规定将开具增值税普通发票的具体事项通知卖方会员，卖方会员在交易所支付80%货款后7个交易日内将实际交割货物相应的增值税普通发票交付买方会员。

　　交割增值税普通发票由交割的卖方客户向相对应的买方客户开具，客户开具的增值税普通发票由双方会员转交、领取并协助核实。

　　会员迟交或未提交增值税普通发票的，按《大连商品交易所结算管理办法》有关规定处理。

　　第五十七条 配对日后第2个交易日为交收日。

　　经配对采用标准仓单交割的，交收日闭市前，买方会员应当补齐与其配对交割月份合约持仓相对应的全额货款（包括非基准交割仓库与基准交割仓库的升贴水）；交收日闭市后，交易所将卖方交割的标准仓单过户给对应的配对买方。交易所向卖方会员支付货款的具体规定见相关品种期货业务细则。

　　经配对采用车板交割的，交收日闭市前，买方会员应当补齐与其配对交割月份合约持仓相对应的全额货款（包括指定车板交割场所升贴水）；交收日闭市后，交易所将车板交割配对结果通知相应的指定车板交割场所及指定质量检验机构。交易所向卖方会员支付货款以及买卖双方货物交收的具体规定见相关品种期货业务细则。

　　第五十八条 车板交割的货款收付和货物交收，买卖双方可以协商自行办理，并应当在交收日闭市前通过会员向交易所提交相关协议和情况说明。

　　如果买卖双方协商自行办理货款收付，则交易所在交收日闭市后清退卖方会员交割保证金，退还买方会员交割预付款，交易所不再负责办理货款收付以及相关的货物交收和发票流转等业务，对买卖双方的货款收付、货物交收和发票流转不承担担保责任。

　　如果买卖双方协商自行办理货物交收，但通过交易所办理货款收付，则买方会员应当在交收日闭市前补足全额货款，交易所按照相关品种期货业务细则规定的时间将全额货款划转至卖方会员，交易所对买卖双方的货款收付、货物交收和相关发票流转不承担担保责任。

　　第五十九条 全月每日选择交割流程下，标准仓单交割违约按照本办法第九章有关规定处理，车板交割违约按照相关品种期货业务细则规定处理。

第六章 一次性交割

　　第六十条 交易所上市的所有商品期货合约适用一次性交割。

　　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。

　　第六十二条 最后交易日闭市后，交易所将交割月份买持仓的交易保证金转为交割预付款。

　　第六十三条 一次性交割流程第一日是标准仓单提交日。

　　最后交易日后第一个交易日闭市前，卖方会员应当将与其交割月份合约持仓相对应的全部标准仓单交到交易所，最后交易日后第一个交易日闭市后，交易所公布各交割仓库或分库交割品种与标准仓单数量信息。

　　对于黄大豆2号等品种，卖方会员还应当按照其品种期货业务细则的规定提交其他材料。

　　第六十四条 一次性交割流程第二日是配对日。

　　最后交易日后第二个交易日闭市前，买方可以根据交易所公布的信息，提出交割意向申报。买方可以申报两个交割意向,包括第一意向和第二意向。闭市后交易所分配标准仓单时，将保税标准仓单按照“境外买方客户优先”、“意向优先”原则进行分配。其中，意向优先性顺序为：对任一买方，先考虑其第一意向，第一意向未得到满足或未全部得到满足，再考虑其第二意向；对任一交割仓库，先考虑将该仓库作为第一意向的买方，若有剩余仓单，再考虑将该仓库作为第二意向的买方。

　　配对日闭市后，交易所按照如下原则和步骤进行交割配对：

　　第一步：汇总标准仓单。交易所以仓库为单位汇总卖方的标准仓单；

　　第二步：匹配境外买方和保税标准仓单。对任一保税交割仓库，若提出交割意向境外买方持仓数量合计小于其保税标准仓单数量，则所有境外买方意向均满足；若提出交割意向境外买方持仓数量合计大于其保税标准仓单数量，则按照“平均持仓时间长优先”的原则确定参与交割配对的境外买方。然后将意愿未被满足的境外买方持仓和未分配的保税标准仓单，以“最少配对数”原则进行分配，确定境外买方交割对应的保税交割仓库和在该仓库交割的数量。

　　第三步：匹配剩余买方和剩余交割仓库。对剩余的任一交割仓库，若提出交割意向买方持仓数量合计小于其标准仓单数量，则所有买方意向均满足；若提出交割意向买方持仓数量合计大于其标准仓单数量，则按照“平均持仓时间长优先”的原则确定参与交割配对的买方。

　　其中：平均持仓时间是以“天”为单位，每手持仓时间的加权平均数。平均持仓时间相同的，持有建仓时间早的买方优先。具体公式为：

　　                                  ∑买方每手持仓时间

　　买方平均持仓时间= ────────────

　　                                      买方总持仓量

　　交易所将满足买方意向后剩余的仓库仓单，与未提交割意向和所提交割意向未被满足的买方持仓，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。

　　第四步，匹配买卖双方。交易所将配好仓库的买方与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。

　　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。

　　配对结果一经确定，买卖双方不得变更。配对结果等信息通过会员服务系统发送给买卖双方会员，会员服务系统一经发送，即视为已经送达。

　　第六十五条 一次性交割流程第三日是交收日，即最后交割日（最后交易日后第三个交易日）。

　　最后交割日闭市前，买方会员应当补齐与其交割月份合约持仓相对应的差额货款。

　　最后交割日闭市后，交易所将卖方会员提交的标准仓单交付买方会员，将货款的80%付给卖方会员，余款在卖方会员提交了发票后结清。黄大豆2号、铁矿石和鸡蛋等品种期货业务细则对货款支付另有规定的，适用其规定。

　　第六十六条 配对结果确定后，买方应当在配对日后1个交易日内，按照税务机关的规定将开具发票的具体事项，包括购货单位名称、地址、金额、纳税人登记号等信息通知卖方。交收标的为保税铁矿石的除外。

　　卖方会员应当在配对日后7个交易日内将发票交付买方会员。黄大豆2号、铁矿石和鸡蛋等品种期货业务细则对发票交付另有规定的，适用其规定。

　　第六十七条 发票由交割的卖方客户向相对应的买方客户开具，并由双方会员转交、领取并协助核实。

　　会员迟交或未提交交易所规定的发票的，按《大连商品交易所结算管理办法》有关规定处理。

　　铁矿石等品种期货业务细则对发票开具方式另有规定的，适用其规定。

　　第六十八条 实行保税交割相关品种期货业务细则对保税标准仓单一次性交割有规定的，按照其规定执行。

第七章 保税交割

　　第六十九条 保税交割是指以海关特殊监管区域或保税监管场所内处于保税监管状态的期货合约所载商品作为交割标的物进行期货交割的过程。

　　第七十条 保税交割仓库是指经交易所审定注册的，具有保税功能，为期货合约履行保税交割的指定交割地点。

　　第七十一条 保税标准仓单是指由交易所统一制定的，指定保税交割仓库按照交易所规定的程序为保税商品提交注册申请后，经交易所注册的符合期货合约规定质量标准的实物提货凭证。

　　第七十二条 实行保税交割的品种由交易所另行公布，其实物交割可用保税标准仓单或完税标准仓单。

　　第七十三条 以保税标准仓单参与交割的, 按照实行保税交割相关品种期货业务细则的有关规定办理。

　　以保税商品参与提货单交割的，按照本办法第三章规定办理。

第八章 交割费用

　　第七十四条 进行实物交割的双方应分别向交易所交纳交割手续费。

　　交割手续费、取样及检验费、仓储及损耗费等费用见各品种期货业务细则规定。

　　第七十五条 指定交割仓库的入库、出库费用实行最高限价。

　　交易所将根据市场情况对各品种指定交割仓库的入库、出库最高费用标准进行不定期核定和公布。

　　新增指定交割仓库的入库、出库最高费用标准自交易所公布之日起实施。

　　第七十六条 指定交割仓库杂项作业服务收费实行最高限价。各指定交割仓库杂项作业服务最高收费标准由交易所制定并公布。

　　第七十七条 从标准仓单仓储及损耗费付止日后次日起至标准仓单注销之日止，每月发生的仓储及损耗费由交易所于下月初3个交易日内向标准仓单所属会员收取。交易所通过会员确认货主收到仓储及损耗费发票后，向指定交割仓库支付仓储及损耗费。标准仓单仓储及损耗费付止日前和标准仓单注销日后次日起，发生的仓储及损耗费用由交割仓库与货主结清。

　　第七十八条 涉及集团交割仓库的交割业务，仓储及损耗费支付给分库；出入库、杂项作业费等交易所规定的相关费用，由货主同分库结算；仓储及损耗费、出入库费、杂项作业费等的发票由分库开具；质量升贴水差价款和发票由分库代收代转。

　　非东北地区分库仓单，经货主选择在东北地区的对应分库提货时，相关款项结算与发票开具的具体规定由交易所另行公布。

　　第七十九条 交易所可根据国家政策规定和市场情况调整以上各项费用的收费标准。交易所将及时通知会员和指定交割仓库。

　　第八十条 指定交割仓库对交易所未作规定的收费项目参照有关行业规定的收费标准收取。

第九章 交割违约

　　第八十一条 具有下列行为之一的，构成交割违约：

　　（一）在规定期限内，卖方未能如数交付标准仓单的；

　　（二）在规定期限内，买方未能如数解付货款的。

　　交易所对提货单交割违约、车板交割违约等另有规定的，适用其规定。

　　第八十二条 卖方交割违约合约数量的公式为：

　　卖方交割违约合约数量（手）=应交标准仓单数量（手）-已交标准仓单数量（手）

　　买方交割违约合约数量按以下公式计算：

　　买方接到的是完税标准仓单的：买方交割违约合约数量（手）=[应交货款（元）-已交货款（元）]÷[交割结算价（元/吨）×（1-20%）+非基准交割仓库与基准交割仓库的升贴水（元/吨）]÷交易单位（吨/手）。

　　买方接到的是保税标准仓单的：买方交割违约合约数量（手）=[保税应交货款（元）-已交货款（元）]÷[保税交割结算价（元/吨）×（1-20%）+非基准交割仓库与基准交割仓库的升贴水（元/吨）/(1+进口增值税税率)/(1+进口关税税率)]÷交易单位（吨/手）。

　　买方接到的是铁矿石保税标准仓单的：买方交割违约合约数量（手）=[保税应交货款（元）-已交货款（元）]÷ [保税交割结算价（元/吨）×（1-20%）+保税升贴水（元/吨）]÷交易单位（吨/手）。

　　第八十三条 发生交割违约后，交易所于合约最后交割日（滚动交割的交收日）结算后通知违约方和相对应的守约方。违约通知通过会员服务系统随当日结算数据发送，会员服务系统一经发送，即视为已经送达。

　　第八十四条 构成交割违约的,由违约方支付违约部分合约价值20%的违约金给守约方,买卖双方终止交割。

　　第八十五条 按本办法规定出现终止交割情形时，交易所的担保责任了结。

　　第八十六条 若买卖双方都违约的，交易所按终止交割处理，并对双方分别处以违约部分合约价值5%的罚款。

　　第八十七条 会员发生部分交割违约时,违约会员所接标准仓单或所得货款可用于违约处理。

　　第八十八条 会员在实物交割环节上蓄意违约的，按《大连商品交易所违规处理办法》第二十九条规定执行。

第十章 附则

　　第八十九条 交易所在夜盘交易小节不办理交割及标准仓单、非标准仓单、提货单等相关业务。

　　第九十条 违反本办法规定的，则交易所按《大连商品交易所违规处理办法》的有关规定处理。

　　第九十一条 各品种期货业务细则有特别规定的，适用其规定。

　　第九十二条 本办法的解释权属于大连商品交易所。

　　第九十三条 本办法自公布之日起实施。

附件3：

**《大连商品交易所标准仓单管理办法》**

**修正案**

第六条 标准仓单自交易所注册之日起生效。经交易所注册后，标准仓单可用于交割、交易、转让、提货、作为保证金等。黄大豆2号、鸡蛋、苯乙烯、液化石油气等品种期货业务细则对标准仓单使用另有规定的，适用其规定。

第十一条 交易所上市的所有商品期货合约都可以注册仓库标准仓单。注册仓库标准仓单的品种由交易所在相关品种期货业务细则中规定。

第二十七条 标准仓单转让应当通过会员提交标准仓单转让申请，办理过户手续，同时结清有关费用。未办理过户手续而转让的标准仓单，发生的一切后果由标准仓单持有人自负。苯乙烯、液化石油气等品种期货业务细则对标准仓单转让申请另有规定的，适用其规定。

……

第六十二条 对于液化石油气品种，交割商品质量争议按照以下规定处理：

液化石油气从厂库出库时，若货主按照《大连商品交易所液化石油气期货业务细则》相关规定选择取样，则货主可以对出库商品质量提出异议，申请检验样品，并以该样品的检验结果作为解决争议的依据。若未按规定选择取样，则视为对出库商品质量无异议。

货主对出库商品质量提出异议后，首先与厂库协商解决。协商不成的，货主应当在封存样品（不含当日）后的2个交易日内，以书面形式对该样品提出检验申请。检验申请应当说明需要检验的商品数量及指标，留存联系方式，并加盖货主公章。交易所在指定质量检验机构中选取检验机构进行检验，单项质量指标的检验结果为取样当天所有样品相应指标的平均值。未在规定时间内以规定方式提出样品检验申请的，视为货主对出库商品质量无异议。检验费用由货主先行垫付。

复检结果与厂库认定的交割等级相符的，由此产生的取样费、检验费、仓储费等相关费用由货主承担；复检结果与厂库认定的交割等级不相符但符合交割质量标准的，厂库按照样品检验结果与货主结算质量升贴水，由此产生的取样费、检验费、仓储费等相关费用及损失由厂库承担；复检结果不符合交割质量标准的，由双方协商解决，若协商不一致，由此产生的取样费、检验费、仓储费等相关费用及损失由厂库承担。

注：阴影部分为新增内容，双划线部分为删除内容，“……”（省略号）含义为该条款未修改的其他内容；出现条款增删的，其他条款顺序依次顺延。

**《大连商品交易所标准仓单管理办法》**

**修订稿**

第一章 总则

　　第一条 为保障大连商品交易所（以下简称交易所）期货交割业务的正常进行，加强标准仓单管理，根据《大连商品交易所交易规则》制定本办法。

　　第二条 交易所上市的商品期货合约标准仓单生成、流通、注销等业务按本办法执行。

　　第三条 交易所建立电子仓单系统，对本办法规定的与标准仓单有关的各项业务进行管理。交易所、会员、境外经纪机构、指定交割仓库、指定质量检验机构、相关银行等标准仓单业务参与者应当通过电子仓单系统办理与标准仓单有关的各项业务。

　　第四条 交易所、会员、境外经纪机构、客户、指定交割仓库、指定质量检验机构、相关银行等标准仓单业务参与者办理与标准仓单有关的各项业务应当遵守本办法。

第二章 一般规定

　　第五条 标准仓单是交易所指定交割仓库按照交易所规定的程序提交注册申请后，经交易所注册的符合期货合约规定质量标准的实物提货凭证。

　　标准仓单按期货商品存放地点分为仓库标准仓单和厂库标准仓单。标准仓单按期货商品完税状态分为保税标准仓单和完税标准仓单。以保税标准仓单参与交割，实行保税交割相关品种期货业务细则有规定的，按照相关规定执行。

　　第六条 标准仓单自交易所注册之日起生效。经交易所注册后，标准仓单可用于交割、交易、转让、提货、作为保证金等。黄大豆2号、鸡蛋、苯乙烯、液化石油气等品种期货业务细则对标准仓单使用另有规定的，适用其规定。

　　第七条 标准仓单注册后在电子仓单系统中以电子形式存在。

　　交易所可以根据会员申请打印标准仓单持有凭证。标准仓单持有凭证代表打印时点可流通的标准仓单数量。标准仓单持有凭证打印后，电子仓单系统中相应的标准仓单予以冻结。会员持有的标准仓单持有凭证应当由专人保管，不得涂改、伪造。如有遗失、毁损或者灭失等情形的，会员应当及时到交易所办理挂失、补办等手续。

　　会员办理与标准仓单持有凭证相对应的标准仓单的交割、交易、转让、作为保证金、注销等仓单业务或者申请打印新的标准仓单持有凭证时，应当将原标准仓单持有凭证交回交易所。

　　第八条 会员或者客户使用标准仓单对外提供担保的，应当在交易所办理标准仓单质权登记手续。未经交易所登记的，不得对外提供担保。

　　会员或者客户在开通质权行使通道的银行发生标准仓单质押融资的，经交易所批准，可以在该银行的质权行使通道下进行货款划转和标准仓单交付；银行行使质权时，可以通过标准仓单转让或者其他约定的方式处置已质押的标准仓单。银行在货款划转、标准仓单交付以及增值税专用（普通）发票流转中的权利义务，比照《大连商品交易所结算管理办法》会员相关规定执行。

　　第九条 标准仓单作为保证金按照《大连商品交易所结算管理办法》有关规定执行。

　　第十条 集团交割仓库的标准仓单应当标注分库名称。涉及集团交割仓库的交割预报、货物入库、质量检验、标准仓单注册与注销、货物出库等交割业务，由分库办理，集团交割仓库复核。

第三章 标准仓单的生成

第一节 仓库标准仓单

　　第十一条 注册仓库标准仓单的品种由交易所在相关品种期货业务细则中规定。

　　第十二条 货主向指定交割仓库发货前，应当由会员向交易所办理交割预报。交易所应当在收到办理交割预报申请后的3个交易日内予以答复，并按“择优分配、统筹安排”的原则安排指定交割仓库。货主应当向交易所安排的指定交割仓库发货。除本办法和黄大豆2号等品种期货业务细则另有规定外，未办理交割预报的商品不得用于交割。

　　已经交割过的商品如在原指定交割仓库继续进行交割，不需办理交割预报。

　　第十三条 会员办理交割预报时，应当交纳交割预报定金。交割预报定金见各品种期货业务细则相关规定。

　　第十四条 交割预报自办理之日起有效，有效期为30个自然日。在有效期内按照交割预报执行的，交割预报定金在商品入库后予以返还；部分执行的，按照实际到货量予以返还；未在有效期内执行的，交割预报定金不予返还，未返还的交割预报定金罚没给对应指定交割仓库。

　　第十五条 办理完交割预报的货主应当按照各品种期货业务细则的规定将相关信息通知指定交割仓库，指定交割仓库应当合理安排接收商品入库。

　　第十六条 交割商品入库后，会员通过电子仓单系统办理返还交割预报定金。

　　第十七条 货主未向交易所安排的指定交割仓库发货的，应当重新办理交割预报，同时该批商品应当倒运到交易所新安排的指定交割仓库进行交割，由此产生的费用及出现的后果由货主承担。

　　第十八条 入库商品应当经过质量、数量或者重量的检验、检重或者检测，具体见各品种期货业务细则相关规定。入库过程中，包装不符合相关品种期货业务细则有关规定的，指定交割仓库应当拒收并及时通知货主。

　　入库商品质量、数量或者重量检验、验收合格的，指定交割仓库在与会员或者客户结清有关费用后，可以通过电子仓单系统提交标准仓单注册申请。

　　标准仓单注册申请经会员确认后，交易所对标准仓单进行注册。

　　第十九条 达不到期货标准的商品，货主如提出委托处理，指定交割仓库可视其自身的整理能力及商品的实际情况处理，处理费用由货主承担。

第二节 厂库标准仓单

　　第二十条 注册厂库标准仓单的品种由交易所在相关品种期货业务细则中规定。

　　第二十一条 会员或者客户与厂库结清货款等费用后，厂库可以通过电子仓单系统提交标准仓单注册申请。

　　申请注册标准仓单的厂库应当向交易所提供交易所认可的银行履约担保函或者其它担保方式。

　　标准仓单注册申请经会员确认，且厂库已经向交易所提供相关担保后，交易所对标准仓单进行注册。

　　第二十二条 当商品市值发生较大波动时，交易所可以根据市场变化情况要求厂库调整银行履约担保函或者其它担保方式所担保的数额。

　　第二十三条 单一厂库标准仓单的最大数量是指当前已注册且尚未注销的标准仓单的最大数量。

　　厂库标准仓单的最大数量的确定和调整，需经交易所批准并予以公布。

第四章 标准仓单的流通

　　第二十四条 标准仓单流通是指标准仓单用于在交易所履行合约的实物交割、标准仓单交易及标准仓单在交易所外转让。

　　第二十五条 标准仓单进行实物交割的，按照《大连商品交易所交割管理办法》和各品种期货业务细则相关规定办理。

　　第二十六条 有关标准仓单交易的组织和实施办法由交易所另行制定、公布。

　　第二十七条 标准仓单转让应当通过会员提交标准仓单转让申请，办理过户手续，同时结清有关费用。未办理过户手续而转让的标准仓单，发生的一切后果由标准仓单持有人自负。苯乙烯、液化石油气等品种期货业务细则对标准仓单转让申请另有规定的，适用其规定。

　　标准仓单转让的货款收付，交易双方可以自行办理，也可以委托交易所办理。委托交易所办理的，交易双方应当通过会员向交易所提交委托申请，货款支付及增值税专用发票流转按照《大连商品交易所结算管理办法》相关规定处理。标准仓单转让手续费由交易所另行公布。铁矿石保税标准仓单的转让按照《大连商品交易所铁矿石期货业务细则》和《大连商品交易所结算管理办法》相关规定执行。

第五章 标准仓单的注销

第一节 仓库标准仓单

　　第二十八条 仓库标准仓单注销是指仓库标准仓单合法持有人办理标准仓单退出流通手续的过程。

　　第二十九条 标准仓单持有人注销标准仓单，应当通过会员办理。

　　第三十条 会员到交易所申请注销标准仓单的，交易所注销相应的标准仓单，结清有关费用，并开具《提货通知单》。

　　会员通过电子仓单系统申请注销标准仓单的，交易所注销相应的标准仓单，结清有关费用，通过电子仓单系统向会员发送提货密码，并向会员和指定交割仓库发送提货通知。

　　保税标准仓单的注销，实行保税交割相关品种期货业务细则有规定的，按照相关规定执行。

　　第三十一条 货主提货时，应当向指定交割仓库提供提货人身份证、提货人所在单位证明、《提货通知单》或者提货密码，同时与指定交割仓库结清自标准仓单注销日次日至提货日的有关费用。

　　第三十二条 货主应当在交易所规定的期间内提货，逾期未提货的，标准仓单相应的期货商品转为现货，指定交割仓库不保证全部商品质量符合期货标准。

　　标准仓单相应的期货商品转为现货后，如需再次生成标准仓单，应当按照期货合约标准重新检验，并按照第三章第一节有关规定办理。鸡蛋等品种期货业务细则另有规定的，适用其规定。

　　第三十三条 标准仓单应当在交易所规定的期限内进行注销，标准仓单注销期限见各品种期货业务细则相关规定。

第二节 厂库标准仓单

　　第三十四条 厂库标准仓单注销是指厂库标准仓单合法持有人办理标准仓单退出流通手续的过程。

　　第三十五条 标准仓单持有人注销标准仓单，应当通过会员办理。

　　第三十六条 会员到交易所申请注销标准仓单的，交易所注销相应的标准仓单，结清有关费用，并开具《提货通知单》。

　　会员通过电子仓单系统申请注销标准仓单的，交易所注销相应的标准仓单，结清有关费用，通过电子仓单系统向会员发送提货密码，并向会员和厂库发送提货通知。

　　第三十七条 货主提货时，应当向厂库提供提货人身份证、提货人所在单位证明、《提货通知单》或者提货密码，同时与厂库结清自标准仓单注销日次日起的有关费用。

　　第三十八条 商品重量与数量以厂库核对为准。

　　第三十九条 厂库应当保证期货商品的质量符合交易所规定的交割标准。

　　第四十条 交易所应当确定并公布厂库的日发货速度。厂库的日发货速度是指厂库每天在24时之前安排期货商品发货的最低数量。

　　交易所可以调整厂库的日发货速度，并应当予以公布。

　　第四十一条 多个货主同时提货，且提货总量超出厂库日发货速度的，厂库应当根据各个货主的提货数量按比例安排发货。

　　第四十二条 厂库应当如实记录向各货主发出的期货商品数量，以备交易所核查。

　　第四十三条 厂库和货主应当妥善保管商品发货和提货的单据，作为解决纠纷的依据。

　　第四十四条 厂库以不高于日发货速度向货主发货时，货主因运输能力等原因无法按时提货，货主应当按照相关品种期货业务细则规定向厂库支付滞纳金。

　　第四十五条 货主应当在相关品种期货业务细则规定的提货期限内到厂库提货。未在规定的提货期限内提货的，按照相关品种期货业务细则有关规定处理。

　　第四十六条 厂库未按规定的日发货速度发货，但按时完成了所有商品的发货，厂库应当按日出库速度应发而未发的商品数量，向货主支付赔偿金，具体金额计算方法见相关品种期货业务细则。

　　第四十七条 厂库未按时完成所有商品的发货，在按第四十六条规定进行赔偿的基础上，同时还应当按商品总量应发而未发的商品数量，向货主支付赔偿金，具体金额计算方法见相关品种期货业务细则；并按照以下程序进行处理：

　　（一）交易所向货主提供其它厂库或其它地点的相同质量和数量的现货商品，并承担调整交货地点和延期发货产生的全部费用。

　　（二）交易所无法提供上述商品时，向货主返还货款并支付赔偿金，具体金额计算方法见相关品种期货业务细则。

　　第四十八条 当厂库发生第四十六条、第四十七条中的违约行为时，首先由厂库向货主支付赔偿金。厂库未支付的或者支付数额不足的，交易所按照以下步骤向货主支付赔偿金：

　　（一）动用厂库交具的银行保函和其他保证方式支付；

　　（二）动用风险准备金支付；

　　（三）动用交易所自有资产支付；

　　（四）通过包括法律程序在内的其他手段向厂库追索。

　　第四十九条 因天气原因导致无法装卸时，厂库和货主不需支付滞纳金或者赔偿金。

　　第五十条 厂库和货主经双方协商同意，可以另行确定发货时间和发货速度，不需按本办法中的有关规定办理。厂库和货主应当进行书面确认并妥善保存，以备核查。

　　第五十一条 厂库未按交易所的规定进行检验、检重或者检测数量、发货时，交易所将按照《大连商品交易所违规处理办法》有关规定进行处罚。

　　第五十二条 标准仓单注销过程中出现的其它问题，由交易所参照本办法中的有关规定进行处理。

　　第五十三条 标准仓单应当在交易所规定的期限内进行注销，标准仓单注销期限见相关品种期货业务细则有关规定。

第六章 争议与处理

　　第五十四条 标准仓单注册申请人申请注册标准仓单时违反国家法律法规、国家强制性标准和相关规定的，由标准仓单注册申请人承担责任。

　　标准仓单注册申请人申请注册标准仓单时不符合期货交割质量标准的，由标准仓单注册申请人承担责任。

　　第五十五条 商品入库、出库，货主应当到库监收监发。货主不到库监收监发的，则视为货主对指定交割仓库所收所发的实物重量、质量没有异议。

　　厂库交割时，货主对出库商品质量有异议的，首先与厂库协商解决。协商不成的，对于鸡蛋品种，货主应当在发货日当天以书面形式向交易所提出质量异议，并说明需要复检的质量指标；对于棕榈油、焦煤、铁矿石品种，货主应当在发货日起5个工作日内以书面形式向交易所提出质量异议；对于豆粕、豆油、焦炭、玉米淀粉、粳米品种，货主应当在发货日起10个工作日内以书面形式向交易所提出质量异议。未在规定时间内提出异议的，视为货主认可出库商品质量。

　　第五十六条 当货主与指定交割仓库就豆粕、豆油、棕榈油、焦炭、焦煤、铁矿石、鸡蛋、玉米淀粉、粳米的检验结果发生争议时，由交易所指定的质量检验机构进行复检，复检结果为解决争议的依据。

　　当货主与指定交割仓库就黄大豆1号、玉米的检验结果发生争议时，可以在接到商品检验报告或者标准仓单注销之日起10个工作日内向交易所提出复检申请，由交易所指定的质量检验机构进行复检，复检结果为解决争议的依据。逾期未提出申请的，则视为对所交割商品质量无异议。

　　第五十七条 黄大豆1号、玉米、豆粕、豆油、棕榈油、焦炭、焦煤、铁矿石、鸡蛋、玉米淀粉、粳米复检费用由提出争议者先行垫付。复检结果与指定交割仓库的检验结果相符，由此产生的一切费用（检验费和差旅费等）和损失由提出争议者负担；复检结果与指定交割仓库的检验结果不相符，由此产生的一切费用（检验费和差旅费等）和损失由指定交割仓库负担。

　　第五十八条 对于黄大豆2号品种，交割商品质量争议按照以下规定处理：

　　（一）仓库入库时，货主或者指定交割仓库对商品检验报告的检验结论有异议的，应当在接到商品检验报告之日起10个工作日内以书面形式向交易所提出复检申请，由交易所在指定质量检验机构中选取检验机构进行复检，复检结果为解决争议的依据。未在规定时间内提出复检申请的，视为同意商品检验报告的检验结论。复检费用由提出争议者先行垫付。复检结果与商品检验报告的检验结论相符的，由此产生的一切费用（检验费和差旅费等）由提出争议者负担；不相符的，由此产生的一切费用（检验费和差旅费等）由原质量检验机构负担。

　　（二）仓库出库时，货主对指定交割仓库认定的交割等级有异议的，应当在标准仓单注销之日起10个工作日内以书面形式向交易所提出复检申请，由交易所在指定质量检验机构中选取检验机构进行复检，复检结果为解决争议的依据。未在规定时间内提出复检申请的，视为对指定交割仓库认定的交割等级无异议。复检费用由提出争议者先行垫付。复检结果与指定交割仓库认定的交割等级相符的，由此产生的一切费用（检验费和差旅费等）由货主负担；不相符的，由此产生的一切费用（检验费和差旅费等）和损失由指定交割仓库负担。

　　（三）厂库出库时，货主只能就黄大豆2号委托加工后的豆粕和豆油提出质量异议。货主有异议的，首先与厂库协商解决。协商不成的，货主应当在发货日起10个工作日内以书面形式向交易所提出质量异议。未在规定时间内提出异议的，视为货主认可出库商品质量。交易所在指定质量检验机构中选取检验机构进行检验，并以出库时保留样品的检验结果作为解决争议的依据。检验费用由货主先行垫付。检验结果与交易所规定的豆粕、豆油交割质量标准相符的，由此产生的一切费用（检验费和差旅费等）由货主负担；不相符的，由此产生的一切费用（检验费和差旅费等）和损失由厂库负担。

　　第五十九条 对于胶合板、纤维板品种，交割商品质量争议按照以下规定处理：

　　（一）仓库商品出库时，货主对出库商品质量有异议的，应当在标准仓单注销之日起10个工作日内且货物已交付但未出库的情况下，以书面形式向交易所提出复检申请。复检申请应当说明需要复检的商品数量、质量指标、复检商品的生产厂家、生产日期和货物所在垛位号等，留存联系方式，并加盖货主公章。交易所委托指定质量检验机构进行复检，复检结果为解决争议的依据。未在规定时间内以规定方式提出申请的，视为货主对出库商品质量无异议。复检费用由货主先行垫付。复检结果与胶合板或纤维板交割质量标准相符的，由此产生的检验费、差旅费、仓储费和倒垛费等仓库相关费用、抽样损耗由货主负担；不相符的，由此产生的检验费、差旅费、仓储费和倒垛费等仓库相关费用、抽样损耗由指定交割仓库负担，仓库可以换货或者回购，回购货款=胶合板或纤维板期货最近交割月交割结算价的120%×复检不符合交割质量标准的商品数量。若换货，仓库应在收到争议复检报告后15个工作日内完成备货。交易所委托指定质检机构对所换货物进行检验，若所换货物符合胶合板或纤维板交割质量标准，则货主不得拒收，并应当在收到换货质检报告后10个工作日内到仓库提货，逾期未提货的，仓库不保证全部商品质量符合期货标准。换货产生的检验费、仓储费和倒垛费等仓库相关费用、抽样损耗由仓库承担。若所换货物仍不符合胶合板或纤维板交割质量标准，则仓库应当回购，回购货款=胶合板或纤维板期货最近交割月交割结算价的120%×换货检验不符合交割质量标准的商品数量，相应货物归仓库所有。

仓库商品出库时，货主对纤维板是否为连续压机厂库生产的产品有异议的，由该产品生产厂库进行判定，以厂库判定为准，经厂库判定为非本企业产品，厂库应在15个工作日内换货。

　　（二）厂库商品出库时，厂库应当在货主的监督下进行抽样，经双方确认后将样品封存。货主对出库商品质量有异议的，首先与厂库协商解决。协商不成的，货主应当在与厂库按照前述规定封存样品（不含当日）后的10个工作日内，以书面形式对该样品提出复检申请。复检申请应当说明需要复检的商品数量、质量指标、复检商品的生产厂家、生产日期和货物所在垛位号（如有）等，留存联系方式，并加盖货主公章。交易所委托指定质量检验机构对样品进行复检，复检结果为解决争议的依据。未在规定时间内以规定方式提出申请的，视为货主对出库商品质量无异议。复检费用由货主先行垫付。复检结果与胶合板或纤维板交割质量标准相符的，由此产生的检验费、差旅费、仓储费和倒垛费等厂库相关费用、抽样损耗由货主负担。复检结果与胶合板或纤维板交割质量标准不相符的，由此产生的检验费、差旅费、仓储费和倒垛费等厂库相关费用、抽样损耗由厂库承担，厂库可以换货或者回购，回购货款=胶合板或纤维板期货最近交割月交割结算价的120%×复检不符合交割质量标准的商品数量。若换货，厂库应在收到争议复检报告后15个工作日内完成备货，交易所委托指定质检机构对所换货物进行检验，若所换货物符合胶合板或纤维板交割质量标准，则货主不得拒收，并应当在收到换货质检报告后10个工作日内到厂库提货，逾期未提货的，厂库不保证全部商品质量符合期货标准。换货产生的检验费、仓储费和倒垛费等厂库相关费用、抽样损耗由厂库承担；若所换货物仍不符合胶合板或纤维板交割质量标准，厂库应当回购，回购货款=胶合板或纤维板期货最近交割月交割结算价的120%×换货检验不符合交割质量标准的商品数量，相应货物归厂库所有。

　　第六十条 对于乙二醇、苯乙烯品种，交割商品质量争议按照以下规定处理：

　　（一）仓库商品入库时，货主或者指定交割仓库对商品检验报告的检验结论有异议的，应当在接到商品检验报告之日起10个工作日内以书面形式向交易所提出复检申请。复检申请应当说明需要复检的商品数量和货物所在储罐号等，留存联系方式，并加盖货主公章。由交易所在指定质量检验机构中选取检验机构进行复检，复检结果为解决争议的依据。未在规定时间内提出复检申请的，视为同意商品检验报告的检验结论。复检费用由提出争议者负担。

　　（二）仓库商品出库时，货主对出库商品质量有异议的，应当在标准仓单注销之日起10个工作日内且货物已交付但未出库的情况下，以书面形式向交易所提出复检申请。复检申请应当说明需要复检的商品数量和货物所在储罐号等，留存联系方式，并加盖货主公章。交易所在指定质量检验机构中选取检验机构进行复检，复检结果为解决争议的依据。未在规定时间内以规定方式提出申请的，视为货主对出库商品质量无异议。复检费用由货主先行垫付。复检结果与交割质量标准相符的，由此产生的检验费、差旅费、仓储费等仓库相关费用由货主负担；不相符的，由此产生的检验费、差旅费、仓储费等仓库相关费用和损失由指定交割仓库负担。

　　（三）厂库商品出库时，厂库应当在货主的监督下进行抽样，经双方确认后将样品封存。货主对出库商品质量有异议的，首先与厂库协商解决。对于乙二醇品种，协商不成的，货主应当在与厂库按照前述规定封存样品后（不含当日）的10个工作日内，以书面形式对该样品提出复检申请。对于苯乙烯品种，协商不成的，货主应当在与厂库按照前述规定封存样品后（不含当日）的5个工作日内，以书面形式对该样品提出复检申请。复检申请应当说明需要复检的商品数量和货物所在储罐号（如有）等，留存联系方式，并加盖货主公章。交易所在指定质量检验机构中选取检验机构进行复检，复检结果为解决争议的依据。未在规定时间内以规定方式提出申请的，视为货主对出库商品质量无异议。复检费用由货主先行垫付。复检结果与交割质量标准相符的，由此产生的检验费、差旅费、仓储费等相关费用由货主负担；复检结果与交割质量标准不相符的，由此产生的检验费、差旅费、仓储费等相关费用和损失由厂库承担。

　　第六十一条 对于线型低密度聚乙烯、聚氯乙烯、聚丙烯品种，交割商品质量争议按照以下规定处理：

　　（一）仓库商品入库时，除免检入库的商品外，货主或者指定交割仓库对商品检验报告的检验结论有异议的，应当在接到商品检验报告之日起10个工作日内以书面形式向交易所提出复检申请。复检申请应当说明需要复检的商品数量、复检商品的生产厂家及牌号和货物所在垛位号等，留存联系方式，并加盖提出争议者公章。由交易所在指定质量检验机构中选取检验机构进行复检，复检结果为解决争议的依据。未在规定时间内以规定方式提出复检申请的，视为同意商品检验报告的检验结论。复检费用由提出争议者负担。

　　（二）仓库商品出库时，货主对出库商品质量有异议的，应当在标准仓单注销之日起10个工作日内且货物已交付但未出库的情况下，以书面形式向交易所提出复检申请。复检申请应当说明需要复检的商品数量、复检商品的生产厂家及牌号和货物所在垛位号等，留存联系方式，并加盖货主公章。交易所在指定质量检验机构中选取检验机构进行复检，复检结果为解决争议的依据。未在规定时间内以规定方式提出申请的，视为货主对出库商品质量无异议。复检费用由货主先行垫付。

　　对于非免检入库的商品，复检结果与交割质量标准相符的，由此产生的检验费、差旅费、仓储费等相关费用由货主负担；不相符的，由此产生的检验费、差旅费、仓储费等相关费用和损失由指定交割仓库负担；复检结果与交割质量标准虽相符，但非标准仓单注册申请人承诺交割注册品牌的，指定交割仓库应当在200元/吨范围内向货主先行承担赔偿责任，并有权向标准仓单注册申请人或其他责任人追偿，生产厂家应当予以配合。

　　对于免检入库的商品，争议检验结果与交割质量标准相符的，由此产生的费用由货主负担；不相符的，该费用由生产厂家承担。免检入库的线型低密度聚乙烯、聚氯乙烯、聚丙烯争议检验结果与交割质量标准不相符，或虽相符但非标准仓单注册申请人承诺免检注册品牌的，除货主和生产厂家另有约定的以外，生产厂家应当在收到或应当收到争议检验结果之日起15个自然日内在原交割地点为货主换货，逾期未完成换货的，按照每日2元/吨的标准向货主支付赔偿金，生产厂家在收到或应当收到争议检验结果之日起60个自然日内未完成换货的，应当向货主赔偿所有损失。生产厂家向货主先行承担上述责任后，有权向标准仓单注册申请人或其他责任人追偿。

　　（三）厂库商品出库时，厂库应当在货主的监督下进行抽样，经双方确认后将样品封存。货主对出库商品质量有异议的，首先与厂库协商解决。协商不成的，货主应当在与厂库按照前述规定封存样品后（不含当日）的10个工作日内，以书面形式对该样品提出复检申请。复检申请应当说明需要复检的商品数量、复检商品的生产厂家及牌号和货物所在垛位号（如有）等，留存联系方式，并加盖货主公章。交易所在指定质量检验机构中选取检验机构进行复检，复检结果为解决争议的依据。未在规定时间内以规定方式提出申请的，视为货主对出库商品质量无异议。复检费用由货主先行垫付。复检结果与交割质量标准相符的，由此产生的检验费、差旅费、仓储费等相关费用由货主负担；复检结果与交割质量标准不相符的，由此产生的检验费、差旅费、仓储费等相关费用和损失由厂库承担。

第六十二条 对于液化石油气品种，交割商品质量争议按照以下规定处理：

液化石油气从厂库出库时，若货主按照《大连商品交易所液化石油气期货业务细则》相关规定选择取样，则货主可以对出库商品质量提出异议，申请检验样品，并以该样品的检验结果作为解决争议的依据。若未按规定选择取样，则视为对出库商品质量无异议。

货主对出库商品质量提出异议后，首先与厂库协商解决。协商不成的，货主应当在封存样品（不含当日）后的2个交易日内，以书面形式对该样品提出检验申请。检验申请应当说明需要检验的商品数量及指标，留存联系方式，并加盖货主公章。交易所在指定质量检验机构中选取检验机构进行检验，单项质量指标的检验结果为取样当天所有样品相应指标的平均值。未在规定时间内以规定方式提出样品检验申请的，视为货主对出库商品质量无异议。检验费用由货主先行垫付。

复检结果与厂库认定的交割等级相符的，由此产生的取样费、检验费、仓储费等相关费用由货主承担；复检结果与厂库认定的交割等级不相符但符合交割质量标准的，厂库按照样品检验结果与货主结算质量升贴水，由此产生的取样费、检验费、仓储费等相关费用及损失由厂库承担；复检结果不符合交割质量标准的，由双方协商解决，若协商不一致，由此产生的取样费、检验费、仓储费等相关费用及损失由厂库承担。

　　第六十三条 买方或者卖方与指定交割仓库之间产生交割纠纷，首先由双方自行协商解决，达不成一致意见的，应当在发生交割纠纷后15日内以书面形式提请交易所调解，逾期交易所不再受理调解申请。调解不成的，可通过法律途径解决。交易所不受理已经出库的交割商品的质量和数量的争议。

第七章 附则

　　第六十四条 违反本办法规定的，交易所按《大连商品交易所违规处理办法》有关规定处理。

　　第六十五条 各品种期货业务细则有特别规定的，适用其规定。

　　第六十六条 本办法解释权属于大连商品交易所。

　　第六十七条 本办法自公布之日起实施。

附件4：

**《大连商品交易所风险管理办法》**

**修正案**

第二十九条 除鸡蛋、乙二醇品种外，各品种期货合约一般月份（合约上市至交割月份前一个月第十四个交易日）非期货公司会员和客户持仓限额见下表：（单位：手）

|  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- |
| 品种 | 合约单边持仓规模 | 非期货公司会员 | 客户 |
| …… | …… | …… | …… |
| 液化石油气 | 单边持仓≤80,000 | 8,000 | 8,000 |
| 单边持仓＞80,000 | 单边持仓×10% | 单边持仓×10% |

除鸡蛋、乙二醇品种外，各品种期货合约自交割月份前一个月第十五个交易日至交割月期间非期货公司会员和客户持仓限额见下表，交割月份个人客户持仓限额为0：（单位：手）

|  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- |
| 品种 | 时间段 | 非期货公司会员 | 客户 |
| …… | …… | …… | …… |
| 液化石油气 | 交割月前一个月第十五个交易日起 | 1,000 | 1,000 |
| 交割月份 | 500 | 500 |

……

注：阴影部分为新增内容， “……”（省略号）含义为该条款未修改的其他内容。

**《大连商品交易所风险管理办法》**

**修订稿**

第一章 总则

　　第一条 为了加强期货交易风险管理，维护期货交易各方的合法权益，保证大连商品交易所(以下简称交易所)期货交易正常的进行，根据《大连商品交易所交易规则》，制定本办法。

　　第二条 交易所风险管理实行保证金制度、涨跌停板制度、限仓制度、交易限额制度、大户报告制度、强行平仓制度和风险警示制度。

　　第三条 交易所、会员、境外经纪机构和客户必须遵守本办法。境外经纪机构应当辅助其委托交易结算的期货公司会员做好境外客户的强行平仓、大户报告、风险提示等工作。期货公司会员应当将涉及境外经纪机构客户的“强行平仓通知书”、强行平仓结果、风险提示函等及时通知境外经纪机构。

第二章 保证金制度

　　第四条 交易所实行保证金制度。各品种期货合约的最低交易保证金为合约价值的5%。

　　新开仓交易保证金按前一交易日结算时交易保证金收取。

　　交易所可以根据市场情况调整各合约交易保证金标准。

　　第五条 自交易所上市的商品期货合约进入交割月份前一个月第十五个交易日起，交易所将分时间段逐步提高该合约的交易保证金。合约在某一交易时间段的交易保证金标准自该交易时间段起始日前一交易日结算时起执行。

　　交易所上市的商品期货合约临近交割期时交易保证金收取标准为：

|  |  |
| --- | --- |
| 交易时间段 | 交易保证金(元/手) |
| 交割月份前一个月第十五个交易日 | 合约价值的10% |
| 交割月份第一个交易日 | 合约价值的20% |

　　第六条 交易所可根据合约持仓量的增加提高交易保证金标准，并向市场公布。

　　第七条 交易所可以分时间段根据合约持仓量的变化调整该合约的交易保证金。

　　对于乙二醇期货合约，自交割月前一个月第一个交易日至该月第十四个交易日期间，若某日结算时该合约的单边持仓量达到120,000手及以上，则自当日结算时至该月第十四个交易日结算时，该合约的交易保证金按照合约价值的10%收取。自交割月前一个月第十五个交易日至该月最后一个交易日期间，若某日结算时该合约的单边持仓量达到80,000手及以上，则自当日结算时至该月最后一个交易日结算时，该合约的交易保证金按照合约价值的20%收取。

　　第八条 当某期货合约出现涨跌停板的情况，则该期货合约的交易保证金按本办法第三章的有关规定执行。

　　第九条 当某期货合约连续三个交易日按结算价计算的涨（跌）幅之和达到合约规定的最大涨跌幅的2倍，连续四个交易日按结算价计算的涨（跌）幅之和达到合约规定的最大涨跌幅的2.5倍，连续五个交易日按结算价计算的涨（跌）幅之和达到合约规定的最大涨跌幅的3倍时，交易所有权根据市场情况，采取单边或双边、同比例或不同比例、部分会员或全部会员提高交易保证金的措施。提高交易保证金的幅度不高于合约规定交易保证金的1倍。

　　交易所采取上述措施须事先报告中国证监会。

　　第十条 如遇法定节假日休市时间较长，交易所可以根据市场情况在休市前调整合约交易保证金标准和涨跌停板幅度。

　　第十一条 交易所可以制定组合持仓的交易保证金标准。组合持仓是指按照交易所规定方式建立的符合条件的持仓组合。交易期间，非期货公司会员和客户可以通过交易所提供的套利交易指令下单和向交易所申请对符合条件的持仓进行组合确认两种方式建立组合持仓；结算时，交易所可以将符合条件的持仓按照一定规则自动组合成组合持仓。

　　适用于组合持仓的品种、合约、组合类型、组合方式、组合优先级、交易保证金标准等，由交易所另行公布。交易所可以根据市场情况进行调整。

　　第十二条 交易期间建立的组合持仓，按前一个交易日结算时的组合持仓交易保证金标准收取保证金，保证金不足的按照《大连商品交易所结算管理办法》等规则规定执行。

　　结算时，交易所对组合持仓按照当日公布的组合持仓交易保证金标准收取保证金。

　　第十三条  同一交易编码持仓平仓，交易所在计算保证金时,视为先平非组合持仓后平组合持仓，组合持仓内部按照组合优先级从低到高顺序进行平仓。

　　第十四条 对同时满足本办法有关调整交易保证金规定的合约，其交易保证金按照规定交易保证金数值中的较大值收取。

第三章 涨跌停板制度

　　第十五条 交易所实行价格涨跌停板制度，由交易所制定各期货合约的每日最大价格波动幅度。交易所可以根据市场情况调整各合约涨跌停板幅度。

　　对同时满足本办法有关调整涨跌停板幅度规定的合约，其涨跌停板幅度按照规定涨跌停板幅度数值中的较大值确定。

　　第十六条 各品种期货合约交割月份以前的月份涨跌停板幅度为上一交易日结算价的4%，交割月份的涨跌停板幅度为上一交易日结算价的6%。

　　新上市期货合约的涨跌停板幅度为合约规定涨跌停板幅度的两倍，如合约有成交则于下一交易日恢复到合约规定的涨跌停板幅度；如合约无成交，则下一交易日继续执行前一交易日涨跌停板幅度。

　　第十七条 当某期货合约以涨跌停板价格申报时，成交撮合原则实行平仓优先和时间优先的原则。

　　第十八条 涨(跌)停板单边无连续报价是指某一期货合约在某一交易日收市前5分钟内出现只有停板价位的买入(卖出)申报、没有停板价位的卖出(买入)申报,或者一有卖出(买入)申报就成交、但未打开停板价位的情况。

　　第十九条 当交易所上市的商品期货合约在某一交易日（该交易日记为第N个交易日，之后第1个、第2个、第3个交易日分别记为第N+1、第N+2、第N+3个交易日，以此类推）出现涨跌停板单边无连续报价的情况，则该合约第N+1个交易日涨跌停板幅度在第N个交易日涨跌停板幅度的基础上增加3个百分点（例，如果第N个交易日涨跌停板幅度为前一交易日结算价的4%，则第N+1个交易日涨跌停板幅度则为第N个交易日结算价的7%，下同）。第N个交易日结算时，该合约交易保证金标准为在第N+1个交易日涨跌停板幅度的基础上增加2个百分点（例，如果第N+1个交易日涨跌停板幅度为第N个交易日结算价的7%，则第N个交易日结算时，该合约保证金标准为合约价值的9%，下同）。若该合约调整后的交易保证金标准低于第N个交易日前一交易日结算时的交易保证金标准，则按第N个交易日前一交易日结算时该合约交易保证金标准收取；若第N个交易日为该合约上市挂盘后第1个交易日，则该合约上市挂盘当日交易保证金标准视为该合约第N个交易日前一交易日结算时的交易保证金标准。

　　若第N+1个交易日出现与第N个交易日同方向涨跌停板单边无连续报价的情况，则该合约第N+2个交易日涨跌停板幅度在第N+1个交易日涨跌停板幅度的基础上增加2个百分点。第N+1个交易日结算时，该合约交易保证金标准为在第N+2个交易日涨跌停板幅度的基础上增加2个百分点。若该合约调整后的交易保证金标准低于第N个交易日结算时的交易保证金标准，则按第N个交易日结算时该合约的交易保证金标准收取。

　　若第N+2个及以后交易日出现与第N+1个交易日同方向涨跌停板单边无连续报价情况，则从第N+3个交易日开始，涨跌停板幅度和交易保证金标准与第N+2个交易日一致，直至合约不再出现同方向涨跌停板单边无连续报价的情况。

　　第二十条 当第N+1个及以后交易日出现与前一交易日反方向涨跌停板单边无连续报价的情况，则该交易日视为第N个交易日。

　　第二十一条 当第N+1个及以后交易日未出现涨跌停板单边无连续报价的情况，则该交易日结算时交易保证金恢复到正常水平，下一交易日的涨跌停板幅度恢复到正常水平。

　　第二十二条 若某期货合约在第N+2个交易日出现与第N+1个交易日同方向涨跌停板单边无连续报价的情况时，若第N+2个交易日是该期货合约的最后交易日，则该合约直接进入交割；若第N+3个交易日是该期货合约的最后交易日，则第N+3个交易日该合约按第N+2个交易日的涨跌停板和保证金水平继续交易。除上述两种情况之外，交易所可在第N+2个交易日收市后决定并公告，对该合约实施下列措施中的一种或多种化解市场风险：

　　（一）单边或双边、同比例或不同比例、部分会员或全部会员提高交易保证金；

　　（二）调整涨跌停板幅度；

　　（三）暂停部分会员或全部会员开新仓；

　　（四）限制出金；

　　（五）限期平仓；

　　（六）强行平仓；

　　（七）在第N+2个交易日收市后强制减仓。

　　第二十三条 强制减仓是指交易所将当日以涨跌停板价申报的未成交平仓报单,以当日涨跌停板价与该合约净持仓盈利客户(或非期货公司会员，下同)按持仓比例自动撮合成交。同一客户持有双向头寸, 则其净持仓部分的平仓报单参与强制减仓计算，其余平仓报单与其对锁持仓自动对冲。具体强制减仓方法如下：

　　（一）申报平仓数量的确定:

　　在第N +2个交易日收市后,已在计算机系统中以涨跌停板价申报无法成交的、且客户合约的单位净持仓亏损大于或等于第N +2个交易日结算价的5%（棕榈油合约标准为4%）的所有持仓。

　　若客户不愿按上述方法平仓可在收市前撤单,不作为申报的平仓报单。

　　（二）客户单位净持仓盈亏的确定:

    客户该合约持仓盈亏总和

　　客户该合约单位净持仓盈亏= ──────────────────

　                                              客户该合约净持仓量×交易单位

　　客户该合约持仓盈亏总和，是指客户该合约的全部持仓按其实际成交价与当日结算价之差计算的盈亏总和。

　　（三）净持仓盈利客户平仓范围的确定:

　　根据上述方法计算的客户单位净持仓盈利大于零的客户的所有投机持仓以及客户单位净持仓盈利大于或等于第N +2个交易日结算价的7%的保值持仓都列入平仓范围。

　　（四）平仓数量的分配原则及方法:

　　1. 平仓数量的分配原则

　　（1）在平仓范围内按盈利的大小和投机与保值的不同分成四级,逐级进行分配。

　　首先分配给属平仓范围内单位净持仓盈利大于或等于第N+2个交易日结算价的6%以上的投机持仓（以下简称盈利6%以上的投机持仓）;

　　其次分配给单位净持仓盈利大于或等于第N+2个交易日结算价的3%以上而小于6%的投机持仓（以下简称盈利3%以上的投机持仓）;

　　再次分配给单位净持仓盈利小于第N+2个交易日结算价的3%而大于零的投机持仓（以下简称盈利大于零的投机持仓）;

　　最后分配给单位净持仓盈利大于或等于第N+2个交易日结算价的7%的保值持仓（以下简称盈利7%保值持仓）。

　　（2）以上各级分配比例均按申报平仓数量(剩余申报平仓数量)与各级可平仓的盈利持仓数量之比进行分配。

　　2. 平仓数量的分配方法及步骤:

　　若单位净持仓盈利6%以上的投机持仓数量大于或等于申报平仓数量,则根据申报平仓数量与单位净持仓盈利6%以上的投机持仓数量的比例,将申报平仓数量向单位净持仓盈利6%以上的投机持仓分配实际平仓数量;

　　若单位净持仓盈利6%以上的投机持仓数量小于申报平仓数量, 则根据单位净持仓盈利6%以上的投机持仓数量与申报平仓数量的比例，将单位净持仓盈利6%以上的投机持仓数量向申报平仓客户分配实际平仓数量。再把剩余的申报平仓数量按上述的分配方法向单位净持仓盈利3%以上的投机持仓分配;若还有剩余,则再向单位净持仓盈利大于零的投机持仓分配;若还有剩余,则再向单位净持仓盈利7%的保值持仓分配。若还有剩余则不再分配。

　　分配平仓数量以“手”为单位,不足一手的按如下方法计算：首先对每个交易编码所分配到的平仓数量的整数部分进行分配，然后按小数部分由大到小的顺序“进位取整”进行分配。

　　（五）强制减仓的执行

　　强制减仓于第N +2个交易日收市后由交易系统按强制减仓原则自动执行，强制减仓结果作为第N +2个交易日会员的交易结果。

　　（六）强制减仓的价格

　　强制减仓的价格为该合约第N +2个交易日的涨(跌)停板价。

　　（七）由上述减仓造成的经济损失由会员、境外经纪机构及客户承担。

　　第二十四条 该合约在采取上述措施后若风险仍未释放，则交易所宣布为异常情况，并按有关规定采取风险控制措施。

第四章 限仓制度

　　第二十五条 交易所实行限仓制度。限仓是指交易所规定会员或客户可以持有的，按单边计算的某一合约投机头寸的最大数额。具有实际控制关系的客户和非期货公司会员的持仓合并计算。

　　第二十六条 限仓实行以下基本制度：

　　（一）根据不同期货品种的具体情况，分别确定每一品种每一月份期货合约的限仓数额；

　　（二）某一月份期货合约在其交易过程中的不同阶段，分别适用不同的限仓数额，进入交割月份的期货合约限仓数额从严控制；

　　（三）套期保值、套利持仓根据《大连商品交易所套期保值管理办法》、《大连商品交易所套利交易管理办法》等有关规定进行管理。

　　第二十七条 同一客户在不同期货公司会员处开有多个交易编码，各交易编码上所有持仓头寸的合计数，不得超出一个客户的限仓数额。

　　第二十八条  非期货公司会员和客户采取不同的限仓要求：

　　鸡蛋、乙二醇以外品种期货合约上市交易的一般月份（合约上市至交割月份前一个月第十四个交易日）期间，当该合约的单边持仓量达到一定规模起，非期货公司会员和客户按单边持仓量的一定比例确定限仓数额；在该合约的单边持仓量达到该规模前，非期货公司会员和客户该合约限仓数额以绝对量方式规定。在期货合约进入交割月份前一个月第十五个交易日至交割月期间，非期货公司会员和客户限仓数额以绝对量方式规定。鸡蛋品种非期货公司会员和客户的限仓数额以绝对量方式规定。乙二醇品种非期货公司会员和客户的限仓数额，在合约上市至交割月前一个月最后一个交易日期间根据合约的单边持仓量规定；交割月期间以绝对量方式规定。

　　第二十九条  除鸡蛋、乙二醇品种外，各品种期货合约一般月份（合约上市至交割月份前一个月第十四个交易日）非期货公司会员和客户持仓限额见下表：（单位：手）

|  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- |
| 品种 | 合约单边持仓规模 | 非期货公司会员 | 客户 |
| 黄大豆1号 | 单边持仓≤200,000 | 40,000 | 20,000 |
| 单边持仓＞200,000 | 单边持仓×20% | 单边持仓×10% |
| 黄大豆2号 | 单边持仓≤200,000 | 20,000 | 20,000 |
| 单边持仓＞200,000 | 单边持仓×10% | 单边持仓×10% |
| 豆粕 | 单边持仓≤400,000 | 80,000 | 40,000 |
| 单边持仓＞400,000 | 单边持仓×20% | 单边持仓×10% |
| 玉米 | 单边持仓≤400,000 | 80,000 | 40,000 |
| 单边持仓＞400,000 | 单边持仓×20% | 单边持仓×10% |
| 豆油 | 单边持仓≤200,000 | 40,000 | 20,000 |
| 单边持仓＞200,000 | 单边持仓×20% | 单边持仓×10% |
| 棕榈油 | 单边持仓≤100,000 | 20,000 | 10,000 |
| 单边持仓＞100,000 | 单边持仓×20% | 单边持仓×10% |
| 线型低密度聚乙烯 | 单边持仓≤100,000 | 20,000 | 10,000 |
| 单边持仓＞100,000 | 单边持仓×20% | 单边持仓×10% |
| 聚氯乙烯 | 单边持仓≤200,000 | 40,000 | 20,000 |
| 单边持仓＞200,000 | 单边持仓×20% | 单边持仓×10% |
| 焦炭 | 单边持仓≤50,000 | 5,000 | 5,000 |
| 单边持仓＞50,000 | 单边持仓×10% | 单边持仓×10% |
| 焦煤 | 单边持仓≤80,000 | 8,000 | 8,000 |
| 单边持仓＞80,000 | 单边持仓×10% | 单边持仓×10% |
| 铁矿石 | 单边持仓≤400,000 | 40,000 | 40,000 |
| 单边持仓＞400,000 | 单边持仓×10% | 单边持仓×10% |
| 纤维板 | 单边持仓≤300,000 | 30,000 | 30,000 |
| 单边持仓＞300,000 | 单边持仓×10% | 单边持仓×10% |
| 胶合板 | 单边持仓≤60,000 | 6,000 | 6,000 |
| 单边持仓＞60,000 | 单边持仓×10% | 单边持仓×10% |
| 聚丙烯 | 单边持仓≤200,000 | 20,000 | 20,000 |
| 单边持仓＞200,000 | 单边持仓×10% | 单边持仓×10% |
| 玉米淀粉 | 单边持仓≤150,000 | 15,000 | 15,000 |
| 单边持仓＞150,000 | 单边持仓×10% | 单边持仓×10% |
| 粳米 | 单边持仓≤200,000 | 20,000 | 20,000 |
| 单边持仓＞200,000 | 单边持仓×10% | 单边持仓×10% |
| 苯乙烯 | 单边持仓≤120,000 | 12,000 | 12,000 |
| 单边持仓＞120,000 | 单边持仓×10% | 单边持仓×10% |
| 液化石油气 | 单边持仓≤80,000 | 8,000 | 8,000 |
| 单边持仓＞80,000 | 单边持仓×10% | 单边持仓×10% |

　　除鸡蛋、乙二醇品种外，各品种期货合约自交割月份前一个月第十五个交易日至交割月期间非期货公司会员和客户持仓限额见下表，交割月份个人客户持仓限额为0：（单位：手）

|  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- |
| 品种 | 时间段 | 非期货公司会员 | 客户 |
| 黄大豆1号 | 交割月前一个月第十五个交易日起 | 10,000 | 5,000 |
| 交割月份 | 5,000 | 2,500 |
| 黄大豆2号 | 交割月前一个月第十五个交易日起 | 4,500 | 4,500 |
| 交割月份 | 1,500 | 1,500 |
| 豆粕 | 交割月前一个月第十五个交易日起 | 15,000 | 7,500 |
| 交割月份 | 5,000 | 2,500 |
| 豆油 | 交割月前一个月第十五个交易日起 | 6,000 | 3,000 |
| 交割月份 | 2,000 | 1,000 |
| 棕榈油 | 交割月前一个月第十五个交易日起 | 3,000 | 1,500 |
| 交割月份 | 1,000 | 500 |
| 玉米 | 交割月前一个月第十五个交易日起 | 30,000 | 15,000 |
| 交割月份 | 10,000 | 5,000 |
| 线型低密度聚乙烯 | 交割月前一个月第十五个交易日起 | 6,000 | 3,000 |
| 交割月份 | 2,000 | 1,000 |
| 聚氯乙烯 | 交割月前一个月第十五个交易日起 | 10,000 | 5,000 |
| 交割月份 | 5,000 | 2,500 |
| 焦炭 | 交割月前一个月第十五个交易日起 | 900 | 900 |
| 交割月份 | 300 | 300 |
| 焦煤 | 交割月前一个月第十五个交易日起 | 1,500 | 1,500 |
| 交割月份 | 500 | 500 |
| 铁矿石 | 交割月前一个月第十五个交易日起 | 6,000 | 6,000 |
| 交割月份 | 2,000 | 2,000 |
| 纤维板 | 交割月前一个月第十五个交易日起 | 800 | 800 |
| 交割月份 | 200 | 200 |
| 胶合板 | 交割月前一个月第十五个交易日起 | 80 | 80 |
| 交割月份 | 20 | 20 |
| 聚丙烯 | 交割月前一个月第十五个交易日起 | 5,000 | 5,000 |
| 交割月份 | 2,500 | 2,500 |
| 玉米淀粉 | 交割月前一个月第十五个交易日起 | 4,500 | 4,500 |
| 交割月份 | 1,500 | 1,500 |
| 粳米 | 交割月前一个月第十五个交易日起 | 2,000 | 2,000 |
| 交割月份 | 1,000 | 1,000 |
| 苯乙烯 | 交割月前一个月第十五个交易日起 | 2,000 | 2,000 |
| 交割月份 | 1,000 | 1,000 |
| 液化石油气 | 交割月前一个月第十五个交易日起 | 1,000 | 1,000 |
| 交割月份 | 500 | 500 |

　　鸡蛋期货合约非期货公司会员和客户持仓限额见下表，交割月份个人客户持仓限额为0：（单位：手）

|  |  |  |
| --- | --- | --- |
| 交易时间段 | 非期货公司会员 | 客户 |
| 合约上市起 | 1,200 | 1,200 |
| 交割月前一个月第一个交易日起 | 400 | 400 |
| 交割月前一个月第十个交易日起 | 120 | 120 |
| 交割月份 | 20 | 20 |

　　乙二醇期货合约非期货公司会员和客户持仓限额按如下规定，交割月份个人客户持仓限额为0：（单位：手）

　　（一）自合约上市至交割月份前一个月第十四个交易日期间，若该合约的单边持仓量小于或等于80,000手，则持仓限额为8,000手；若该合约的单边持仓量大于80,000手，则持仓限额为单边持仓量的10%。

　　自交割月份前一个月第一个交易日至该月第十四个交易日期间，若某日结算时该合约的单边持仓量大于120,000手，则自当日结算时起持仓限额为3,000手，并持续适用至该月第十四个交易日。

　　（二）自交割月份前一个月第十五个交易日至该月最后一个交易日期间，持仓限额为3,000手；若某日结算时该合约的单边持仓量超过80,000手，则自当日结算时起持仓限额调整至1,000手，并持续适用至该月最后一个交易日。

　　（三）交割月份持仓限额为1,000手。

　　第三十条  非期货公司会员或客户的持仓数量不得超过交易所规定的持仓限额，超过持仓限额的，不得同方向开仓交易。对超过持仓限额的非期货公司会员或客户，交易所将于下一交易日按有关规定执行强行平仓。

　　一个客户在不同期货公司会员处开有多个交易编码，其持仓量合计超出限仓数额的，由交易所指定有关期货公司会员对该客户超额持仓执行强行平仓。

　　对超过持仓限额的非期货公司会员或者客户，交易所还可以采取电话提示、要求报告情况、要求提交书面承诺、列入重点监管名单、限制开仓等措施。

第五章  交易限额制度

　　第三十一条 交易所实行交易限额制度。交易限额是指交易所规定会员或者客户对某一合约在某一期限内开仓的最大数量。交易所可以根据市场情况，对不同上市品种、合约，对部分或者全部的会员、客户，制定交易限额，具体标准由交易所另行公布。

　　套期保值交易和做市交易的开仓数量不受本条前款限制。

　　第三十二条 非期货公司会员或者客户的开仓数量不得超过交易所规定的交易限额。对超过交易限额的非期货公司会员或者客户，交易所可以采取电话提示、要求报告情况、要求提交书面承诺、列入重点监管名单、暂停开仓交易等措施。

第六章 大户报告制度

　　第三十三条 交易所实行大户报告制度。当非期货公司会员或客户某品种持仓合约的投机头寸达到交易所对其规定的投机头寸持仓限量80%以上（含本数）时, 非期货公司会员或客户应向交易所报告其资金情况、头寸情况，客户须通过期货公司会员报告；委托境外经纪机构从事期货交易的客户，应当委托其境外经纪机构报告，境外经纪机构再委托期货公司会员报告。

　　非期货公司会员、客户应当保证所提供的大户持仓报告和其他材料的真实性、准确性和完整性。

　　交易所可根据市场风险状况，调整改变持仓报告水平。

　　第三十四条 非期货公司会员或客户的持仓达到交易所报告界限的，非期货公司会员或客户应主动于下一交易日15:00时前向交易所报告。如需再次报告或补充报告，交易所将通知有关会员。

　　第三十五条 达到交易所报告界限的非期货公司会员应向交易所提供下列材料：

　　（一）填写完整的《非期货公司会员大户报告表》（见附件2），内容包括会员名称、会员号、合约代码、现有持仓、持仓性质、持仓保证金、可动用资金、持仓意向、预报交割数量、申请交割数量；

　　（二）资金来源说明；

　　（三）交易所要求提供的其他材料。

　　第三十六条 达到交易所报告界限的客户应提供下列材料：

　　（一）填写完整的《客户大户报告表》（见附件3），内容包括会员名称、会员号、客户名称和编码、合约代码、现有持仓、持仓性质、持仓保证金、可动用资金、持仓意向、预报交割数量、申请交割数量等；

　　（二）资金来源说明；

　　（三）开户材料及当日结算单据；

　　（四）交易所要求提供的其他材料。

　　第三十七条 期货公司会员、境外经纪机构应对达到交易所报告界限的客户所提供的有关材料进行初审，然后由期货公司会员转交交易所。期货公司会员、境外经纪机构应保证客户所提供的材料的真实性和准确性。

　　第三十八条 交易所将不定期地对会员、境外经纪机构或客户提供的材料进行核查。

　　第三十九条 客户在不同期货公司会员处开有多个交易编码，各交易编码持有头寸合计达到报告界限，由交易所指定并通知有关期货公司会员，负责报送该客户应报告情况的有关材料。

第七章 强行平仓制度

　　第四十条 为控制市场风险，交易所实行强行平仓制度。强行平仓是指当会员、客户违规时，交易所对有关持仓实行平仓的一种强制措施。

　　第四十一条 当会员、客户出现下列情形之一时，交易所有权对其持仓进行强行平仓：

　　（一）会员结算准备金余额小于零，并未能在规定时限内补足的；

　　（二）非期货公司会员和客户持仓量超出其限仓规定的；

　　（三）因违规受到交易所强行平仓处罚的；

　　（四）根据交易所的紧急措施应予强行平仓的；

　　（五）其他应予强行平仓的。

　　第四十二条 强行平仓的执行原则：

　　强行平仓先由会员自己执行，除交易所特别规定外，对开设夜盘交易的品种，其时限为夜盘交易小节、第一节和第二节交易时间内；对未开设夜盘交易的品种，其时限为第一节和第二节交易时间内。若时限内会员未执行完毕，则第三节起由交易所强制执行。因结算准备金小于零而被要求强行平仓的，在保证金补足至最低结算准备金余额前，禁止相关会员的开仓交易。

　　属第四十一条第（三）、（四）、（五）项的强行平仓，其强行平仓时间由交易所另行通知。

　　（一）由会员单位执行的强行平仓头寸的确定

　　1. 属第四十一条第（一）、（二）项的强行平仓，其需强行平仓头寸由会员单位自行确定，只要强行平仓结果符合交易所规则即可。

　　2. 属第四十一条第（三）、（四）、（五）项的强行平仓，其需强行平仓头寸由交易所确定。

　　（二）由交易所执行的强行平仓头寸的确定

　　1. 属第四十一条第（一）项的强行平仓，交易所以该会员在13：00的结算准备金余额为依据，计算会员应追加的交易保证金，该会员所有客户按交易保证金等比例平仓原则进行强行平仓：

　　平仓比例 = 会员应追加交易保证金 /会员交易保证金总额×100%

　　客户应平仓释放交易保证金 = 该客户交易保证金总额×平仓比例

　　客户需要强行平仓的头寸的总体确定原则为先非组合持仓、后组合持仓。其中：

　　（1）平非组合持仓时，按先期货、后期权的原则选择强行平仓合约。

　　平非组合持仓中的期货持仓时，按先投机、后套期保值，再按上一交易日结算时合约总持仓量由大到小顺序选择强行平仓合约。

　　平非组合持仓中的期权持仓时,按先期权卖持仓、后期权买持仓，先投机、后套期保值，再按上一交易日结算时合约总持仓量由大到小顺序选择强行平仓合约。

　　（2）平组合持仓时，按组合优先级由低到高顺序选择强行平仓合约。

　　若多个会员需要强行平仓的，按追加保证金由大到小的顺序，先平需要追加保证金大的会员。

　　2. 属第四十一条第（二）项的强行平仓：若既有投机持仓超仓也有保值持仓超仓，则按先投机持仓后保值持仓的顺序强行平仓。

　　若客户在多个期货公司会员处持有投机持仓，则按该客户投机持仓数量由大到小的顺序选择期货公司会员强行平仓。若多个客户投机持仓超仓，则按客户投机超仓数量由大到小顺序强行平仓。

　　3. 属第四十一条第（三）、（四）、（五）项的强行平仓，强行平仓头寸由交易所根据涉及的会员和客户具体情况确定。

　　若会员同时满足第四十一条第（一）、（二）项情况，交易所先按第（二）项情况确定强行平仓头寸，再按第（一）项情况确定强行平仓头寸。

　　第四十三条 强行平仓的执行：

　　（一）通知。

　　交易所以“强行平仓通知书”（以下简称通知书）的形式向有关会员下达强行平仓要求。通知书除交易所特别送达以外，通过会员服务系统随当日结算数据发送，有关会员可以通过会员服务系统获得。

　　（二）执行及确认。

　　1. 开市后，有关会员必须首先自行平仓，直至达到平仓要求；

　　2. 超过会员自行强行平仓时限而未执行完毕的，剩余部份由交易所直接执行强行平仓；

　　3. 强行平仓执行完毕后，由交易所记录执行结果并存档；

　　4. 强行平仓结果随当日成交记录发送，有关会员可以通过会员服务系统获得。

　　第四十四条 强行平仓的委托价格为该合约的涨（跌）停板价格，强行平仓的成交价格通过市场交易形成。

　　第四十五条 如因价格涨跌停板或其他市场原因而无法在当日完成全部强行平仓的，交易所根据结算结果，对该会员或客户做出相应的处理。

　　第四十六条 由于价格涨跌停板限制或其他市场原因，有关持仓的强行平仓只能延时完成的，因此发生的亏损，仍由直接责任人承担；未能完成平仓的，该持仓持有者须继续对此承担持仓责任或交割义务。

　　第四十七条 除第四十一条第（三）项外，强行平仓产生的盈利或者亏损均归持仓人。持仓人是客户的，强行平仓后发生的亏损，由该客户开户所在期货公司会员先行承担后，自行向该客户追索；持仓人是境外经纪机构客户的，境外经纪机构应辅助其委托交易结算的期货公司会员强行平仓，强行平仓后发生的亏损，由为该境外经纪机构交易结算的期货公司会员先行承担后,自行向该境外经纪机构追索，境外经纪机构承担损失后，自行向该客户追索。

　　本办法第四十一条第（三）项实施的强行平仓，亏损由相应的会员或客户承担，盈利计入交易所营业外收入。

　　会员或客户强行平仓产生的盈利或者亏损根据《大连商品交易所结算管理办法》平仓盈亏有关规定计算。

第八章 异常情况处理

　　第四十八条 在期货交易过程中，当出现以下情形之一的，交易所可以宣布进入异常情况，采取紧急措施化解风险：

　　（一）地震、水灾、火灾等不可抗力或计算机系统故障等不可归责于交易所的原因导致交易无法正常进行；

　　（二）会员出现结算、交割危机，对市场正在产生或者将产生重大影响；

　　（三）期货价格出现同方向连续涨跌停板,有根据认为会员、境外经纪机构或者客户违反交易所交易规则及其实施细则并且对市场正在产生或者即将产生重大影响；

　　（四）交易所规定的其他情况。

　　出现前款第（一）项异常情况时，交易所总经理可以采取调整开市收市时间、暂停交易的紧急措施；出现前款第（二）、（三）、（四）项异常情况时，理事会可以决定采取调整开市收市时间、暂停交易、调整涨跌停板幅度、调整交易保证金、暂停开新仓、限期平仓、强行平仓、限制出金等紧急措施。

　　第四十九条 在棕榈油期货交易过程中，因战争、社会动荡、自然灾害等因素对棕榈油进口正在产生或者即将产生重大影响时，交易所可以宣布进入异常情况，交易所总经理可以采取调整开市收市时间、暂停交易、终止交易的紧急措施。终止交易当天结算时，棕榈油各合约月份全部持仓按照上一交易日结算价进行平仓。

　　第五十条 在铁矿石期货交易过程中，因战争、社会动荡、自然灾害等因素对铁矿石进口正在产生或者即将产生重大影响时，交易所可以宣布进入异常情况，交易所总经理可以采取调整开市收市时间、暂停交易、终止交易的紧急措施。终止交易当天结算时，铁矿石各合约月份全部持仓按照上一交易日结算价进行平仓。

　　第五十一条 交易所宣布异常情况并决定采取紧急措施前必须报告中国证监会。

　　对棕榈油、铁矿石合约采取终止交易紧急措施的，应当经中国证监会批准。

　　第五十二条 在鸡蛋期货交易过程中，当发生重大疫情且一定比例交割仓库库区处于疫区时，交易所可以宣布进入异常情况，交易所总经理可以采取暂停交易、终止交易的紧急措施。终止交易当天结算时，鸡蛋各合约月份全部持仓按照上一交易日结算价进行平仓。

　　第五十三条 交易所宣布进入异常情况并决定暂停交易时，暂停交易的期限不得超过3个交易日，但经中国证监会批准延长的除外。

　　第五十四条 发生技术故障，存在下列情形时，交易所不承担责任：

　　（一）因不可抗力引发的技术故障；

　　（二）非因交易所过错引发的技术故障；

　　（三）法律、法规、规章规定的其他免责情形。

第九章 风险警示制度

　　第五十五条 交易所实行风险警示制度。当交易所认为必要时，可以分别或同时采取要求报告情况、谈话提醒、发布风险提示函等措施中的一种或多种，以警示和化解风险。

　　第五十六条 出现下列情形之一的，交易所可以要求会员、境外经纪机构或客户报告情况，或约见指定的会员、境外经纪机构高管人员或客户谈话提醒风险：

　　（一）合约价格出现异常变动；

　　（二）品种、合约成交持仓比出现异常变动；

　　（三）会员或客户交易行为异常；

　　（四）会员、境外经纪机构或客户持仓变化较大；

　　（五）会员、境外经纪机构或客户持仓量过大，或持仓占比过高；

　　（六）会员、境外经纪机构或客户成交量过大，或成交占比过高；

　　（七）会员资金变化较大；

　　（八）会员、境外经纪机构或客户涉嫌违规；

　　（九）会员、境外经纪机构或客户被投诉；

　　（十）会员、境外经纪机构或客户涉及司法调查或诉讼案件；

　　（十一）交易所认定的其他情形。

　　交易所要求会员、境外经纪机构或客户报告情况的，会员、境外经纪机构或客户应当按照交易所要求的时间、内容和方式如实报告。

　　交易所实施谈话提醒的，会员、境外经纪机构或客户应当按照交易所要求的时间、地点和方式认真履行。

       交易所如果使用电话提示方式，应保留电话录音；如果使用视频谈话方式，应保存相关视频；如果使用现场谈话方式，应保存谈话记录。

　　第五十七条 发生下列情形之一的，交易所可以向全体或部分会员、境外经纪机构和客户发出风险提示函：

　　（一）期货市场交易出现异常变化；

　　（二）国内外期货或现货市场发生较大变化；

　　（三）会员、境外经纪机构或客户涉嫌违规；

　　（四）会员、境外经纪机构或客户交易存在较大风险；

　　（五）交易所认定的其他异常情形。

第十章 附则

　　第五十八条 违反本办法规定的，交易所按《大连商品交易所违规处理办法》的有关规定处理。

　　第五十九条  交易所对期权交易风险管理有特别规定的，适用其规定。

　　第六十条 本办法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。

附件：1. 连续三个涨跌停板后平仓数量的分配方法及步

骤（略）

　　 2．大连商品交易所非期货公司会员大户报告表

（略）

　　 3．大连商品交易所客户大户报告表（略）

附件5：

**《大连商品交易所套期保值管理办法》**

**修正案**

第十三条  交易所对增加一般月份套期保值持仓额度的申请，按主体资格是否符合，套期保值品种、交易部位、买卖数量、套期保值时间与其生产经营规模、历史经营状况、资金等情况是否相适应进行审核，确定其一般月份套期保值持仓增加额度。

　　……

　　非期货公司会员和客户一般月份套期保值持仓进入交割月份时，交易所将按其一般月份套期保值持仓数量与该品种交割月份投机持仓限额中的较低标准，转化为交割月份套期保值持仓增加额度，焦炭、焦煤、纤维板、胶合板、鸡蛋、乙二醇、粳米、苯乙烯、液化石油气品种除外。

　　……

注：阴影部分为新增内容， “……”（省略号）含义为该条款未修改的其他内容。

**《大连商品交易所套期保值管理办法》**

**修订稿**

第一章  总则

　　第一条  为充分发挥期货市场的套期保值功能，促进期货市场的规范发展，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  套期保值实行资格认定和额度管理制度。按照合约月份的不同，套期保值持仓额度分为一般月份套期保值持仓额度(自合约上市之日起至交割月份前第一个月最后一个交易日)和交割月份套期保值持仓额度。

　　第三条  会员、境外经纪机构、客户在大连商品交易所（以下简称交易所）从事套期保值业务，应当遵守本办法。

第二章 资格认定

　　第四条  从事套期保值交易的非期货公司会员和客户应当具备与套期保值交易品种相关的生产经营资格。

　　第五条  从事套期保值交易的非期货公司会员和客户，应当向交易所提交下列申请材料：

　　（一）套期保值交易资格申请表，主要包括申请人基本信息、申请品种及交易所要求的其他信息；

　　（二）企业营业执照副本复印件；

　　（三）交易所要求的其他材料。

　　客户应当通过期货公司会员提交申请，其申请资料经期货公司会员审核后，由期货公司会员代客户按本办法向交易所办理申报手续；非期货公司会员直接向交易所办理申报手续。委托境外经纪机构从事期货交易的客户申请套期保值资格的，应当委托其境外经纪机构办理，境外经纪机构再委托期货公司会员办理。

　　第六条  交易所在收到完整的申请材料后5个工作日内进行审核并予以答复。

第三章  持仓额度

　　第七条  非期货公司会员和客户取得套期保值交易资格后，可以在相关品种的期货、期权合约上进行套期保值交易。

　　取得套期保值交易资格的非期货公司会员和客户，可通过交易指令直接建立套期保值持仓，也可通过对历史投机持仓确认的方式建立套期保值持仓。

　　第八条  未取得套期保值持仓增加额度的，非期货公司会员和客户的套期保值持仓额度在数量上等同于投机持仓限额。

　　非期货公司会员和客户可以申请增加套期保值持仓额度。取得套期保值持仓增加额度的，非期货公司会员和客户的套期保值持仓额度在数量上等同于投机持仓限额与套期保值持仓增加额度之和。

　　非期货公司会员和客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，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。

　　第九条  客户应当通过期货公司会员提交增加套期保值持仓额度的申请，其申请资料经期货公司会员审核后，由期货公司会员代客户按本办法向交易所办理申报手续；非期货公司会员直接向交易所办理申报手续。委托境外经纪机构从事期货交易的客户申请套期保值额度的，应当委托其境外经纪机构办理，境外经纪机构再委托期货公司会员办理。

　　第十条  申请增加一般月份套期保值持仓额度，应当向交易所提交下列材料：

　　（一）增加套期保值持仓额度申请表，主要包括申请人基本信息、申请品种和数量及交易所要求的其他信息。

　　（二）所申请品种近一年的现货经营业绩及套期保值期间的现货经营计划；

　　（三）交易所要求的其他材料。

　　上述材料如果已经提交给交易所，则无需再次提交。

　　第十一条  申请增加交割月份套期保值持仓额度，应当向交易所提交下列材料：

　　（一）增加套期保值持仓额度申请表，主要包括申请人基本信息、申请品种和数量及交易所要求的其他信息。

　　（二）已持有的及拟持有的现货证明材料及用途说明；

　　（三）所申请品种近一年的现货经营业绩及套期保值期间的现货经营计划；

　　（四）交易所要求的其他材料。

　　上述材料如果已经提交给交易所，则无需再次提交。

　　第十二条  申请增加一般月份套期保值持仓额度的截止日为套期保值合约交割月份前第二个月的最后交易日，逾期交易所不再受理增加该合约一般月份套期保值持仓额度的申请。申请人可以一次申请增加多个合约的一般月份套期保值持仓额度。

　　申请增加交割月份套期保值持仓额度的截止日为套期保值合约交割月份前第一个月的最后交易日，逾期交易所不再受理该合约交割月份套期保值持仓额度的申请。

　　第十三条  交易所对增加一般月份套期保值持仓额度的申请，按主体资格是否符合，套期保值品种、交易部位、买卖数量、套期保值时间与其生产经营规模、历史经营状况、资金等情况是否相适应进行审核，确定其一般月份套期保值持仓增加额度。

　　对增加交割月份套期保值持仓额度的申请，交易所将按照申请人的交易部位和数量、现货经营状况，对应合约的持仓状况、可供交割品的数量以及期现价格是否背离等因素，确定其交割月份套期保值持仓增加额度。

　　非期货公司会员和客户一般月份套期保值持仓进入交割月份时，交易所将按其一般月份套期保值持仓数量与该品种交割月份投机持仓限额中的较低标准，转化为交割月份套期保值持仓增加额度，焦炭、焦煤、纤维板、胶合板、鸡蛋、乙二醇、粳米、苯乙烯、液化石油气品种除外。

　　套期保值持仓增加额度不得超过申请人所提供的套期保值证明材料中所申报的数量。申请人全年各期货、期权合约月份一般月份套期保值持仓累计不得超过其当年生产能力、当年生产计划。

　　第十四条  对增加一般月份套期保值额度的申请，交易所在收到完整的申请材料后5个工作日内进行审核并予以答复。对增加交割月份套期保值额度的申请，交易所在收到完整的申请材料后，于该合约交割月前第一个月的第一个交易日起进行审核，并在5个交易日内予以答复。

　　第十五条  交易所可以对套期保值交易的保证金、手续费采取优惠措施。

第四章  监督管理

　　第十六条  交易所对非期货公司会员和客户提供的有关生产经营状况、资信情况及期货、期权、现货市场交易行为可随时进行监督和调查，非期货公司会员和客户应予协助和配合。

　　交易所可以要求具有套期保值交易资格的非期货公司会员和客户报告现货、期货、期权交易情况。

　　第十七条  交易所对非期货公司会员和客户套期保值交易情况进行监督管理。

　　第十八条  具有套期保值交易资格的非期货公司会员和客户在企业情况发生重大变化时，或者有影响套期保值交易资格的情况发生时，应及时向交易所报告。非期货公司会员和客户需要调整套期保值持仓额度时，应当及时向交易所提出变更申请。

　　第十九条  交易所可以根据市场情况和套期保值企业的生产经营状况对非期货公司会员和客户套期保值交易资格和套期保值持仓可增加的额度进行调整。

　　第二十条  为化解市场风险，按有关规定实施减仓时，按先投机持仓后套期保值持仓的顺序进行减仓。

　　第二十一条  非期货公司会员和客户套期保值持仓与投机持仓合计超过交易所规定标准的，应当在下一交易日第二节交易结束前自行调整；逾期未进行调整或调整后仍不符合要求的，交易所可以强行平仓。

　　第二十二条  具有套期保值交易资格的非期货公司会员和客户频繁进行开平仓交易的，影响或者企图影响市场价格的，交易所可以对其采取谈话提醒、书面警示、调整或者取消其套期保值持仓增加额度、取消套期保值交易资格，必要时可以采取限制开仓、限期平仓、强行平仓等措施，并按《大连商品交易所违规处理办法》的有关规定处理。

　　第二十三条  非期货公司会员和客户在申请套期保值交易资格，申请增加套期保值持仓额度和交易时，有欺诈或违反交易所规定行为的，交易所可以不受理其增加套期保值持仓额度的申请、调整或者取消已批准的套期保值持仓增加额度、取消其套期保值交易资格，必要时可以采取限制开仓、限期平仓、强行平仓等处置措施，并按《大连商品交易所违规处理办法》的有关规定处理。

第五章  附 则

　　第二十四条  本办法解释权属于大连商品交易所。

　　第二十五条  本办法自公布之日起实施。

附件6：

**大连商品交易所液化石油气期货业务细则**

第一章 总则

第一条 为规范大连商品交易所（以下简称交易所）液化石油气期货合约交易行为，根据《大连商品交易所交易规则》和《大连商品交易所液化石油气期货合约》，制定本细则。

第二条 交易所、会员、客户、指定交割仓库、指定质量检验机构、指定期货保证金存管银行及期货市场其他参与者应当遵守本细则。

第三条 本细则未规定的，按照交易所相关业务规则的规定执行。

第二章 合约主要条款和相关参数

第四条 液化石油气期货合约交割标准品、替代品的质量标准和质量升贴水详见附件1《大连商品交易所液化石油气交割质量标准（F/DCE PG001-2020）》。

第五条 液化石油气期货合约采用实物交割。

第六条 液化石油气指定交割仓库分为基准交割仓库和非基准交割仓库（详见附件2《大连商品交易所液化石油气指定交割仓库名录》),交易所可视情况对液化石油气指定交割仓库进行调整。

第七条 液化石油气期货合约的合约月份为1、2、3、4、5、6、7、8、9、10、11、12月。

第八条 液化石油气期货合约的交易单位为20吨/手。

第九条 液化石油气期货合约的报价单位为元（人民币）/吨。

第十条 液化石油气期货合约的最小变动价位为1元/吨。

第十一条 液化石油气期货合约的交易指令每次最大下单数量为1000手。

第十二条 液化石油气期货合约的交易保证金标准、涨跌停板幅度和持仓限额，按照《大连商品交易所风险管理办法》相关规定执行。

第十三条 液化石油气期货合约的最后交易日为合约月份倒数第4个交易日。

第十四条 液化石油气期货合约的最后交割日为最后交易日后第3个交易日。

第十五条 液化石油气期货合约的交易代码为PG。

第三章 交割与结算

**第一节 一般规定**

第十六条 液化石油气期货合约适用期货转现货（以下简称期转现）、滚动交割和一次性交割，除本细则规定外，具体流程按照《大连商品交易所交割管理办法》、《大连商品交易所结算管理办法》相关规定执行。

第十七条 提出期转现申请的，交易双方除了按照《大连商品交易所交割管理办法》规定提交期转现相关材料，还应当提交合法有效的液化石油气生产、经营或使用资质证明。

参与滚动交割和一次性交割的，客户应当通过会员在交收日14:30前向交易所提交合法有效的液化石油气生产、经营或使用资质证明。未在规定时间内提交的，视为不具备液化石油气生产、经营或使用资质，并按照《大连商品交易所交割管理办法》相关规定处理。

办理标准仓单转让业务的，交易双方应当在标准仓单转让申请中，通过会员向交易所提交合法有效的液化石油气生产、经营或使用资质证明。

第十八条 参与滚动交割的，配对日卖方申报交割和买方申报意向按照如下规定进行：

（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，每个交易日11:30前均可向交易所申报交割。提出交割申请的相应标准仓单予以冻结，其卖持仓对应的交易保证金不再收取。交易所对上述申请进行审核，并在每个交易日13:30后公布通过审核的卖方交割申请。公布后的交割申请不得撤销，当日有效。

交割配对时卖方客户单向卖持仓小于卖方客户申报并通过审核数量的，交易所将禁止该客户在该品种上滚动交割的卖方申报，期限为自本次申报之日起一年。

（二）买方申报意向。持有交割月单向买持仓的买方，可以根据交易所公布的卖方交割申请，在交割月第一个交易日至最后交易日前一交易日闭市前向交易所申报两个交割意向，包括第一意向和第二意向，其优先性顺序为：对任一买方，先考虑其第一意向，第一意向未得到满足或未全部得到满足，再考虑其第二意向；对任一指定交割仓库，先考虑将其作为第一意向的买方，若有剩余标准仓单，再考虑将其作为第二意向的买方。申报意向当日有效。

第十九条 配对日闭市后，交易所通过系统，按照如下原则和步骤进行交割配对：

第一步：汇总申报交割的标准仓单。交易所以指定交割仓库为单位汇总卖方申报交割的标准仓单。

第二步：匹配买方和指定交割仓库。对任一指定交割仓库，若提出交割意向买方持仓数量合计小于等于其相关标准仓单数量，则所有买方意向均满足；若提出交割意向买方持仓数量合计大于其相关标准仓单数量，则按照“平均持仓时间长优先”的原则确定参与交割配对的买方。

其中：平均持仓时间以“天”为单位，每手持仓时间的加权平均数。平均持仓时间相同的，持有建仓时间早的买方优先。具体公式为：

对于满足买方意向后剩余的标准仓单，交易所再按照“含有建仓时间最早的持仓优先”原则，从未提交割意向和所提意向未被满足的买方持仓中确定参与配对的买方；再按“最少配对数”原则确定买方交割对应的指定交割仓库，以及在该指定交割仓库所交割的数量。

第三步：匹配买卖双方。交易所将配好指定交割仓库的买方与持有相应标准仓单的卖方以“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。

第二十条 一次性交割的交割结算价采用该期货合约交割月最后十个交易日所有成交价格的加权平均价，若交割月不足十个交易日，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。

第二十一条 液化石油气期货合约的交割单位为20吨。

第二十二条 液化石油气标准仓单为厂库标准仓单。

第二十三条 液化石油气期货合约质量升贴水的差价款由货主同指定交割仓库结算。

第二十四条 液化石油气期货合约实际交割总净重不得少于标准仓单对应货物总重。

第二十五条 液化石油气交割开具增值税专用发票。

第二十六条 液化石油气交割手续费为1元/吨，取样及检验收费实行最高限价，由交易所制定并公布；仓储费收取标准为1元/吨·天；无损耗费。

**第二节 标准仓单交割**

第二十七条 标准仓单生成、流通、注销等相关业务，本细则未规定的，适用《大连商品交易所标准仓单管理办法》相关规定。

第二十八条 液化石油气标准仓单在每年的3月份最后1个交易日之前（含当日）应当进行标准仓单注销。

第二十九条 液化石油气从厂库出库时，货主应当在标准仓单注销日后（不含注销日）的7个自然日内（含当日）到厂库提货。厂库应当在标准仓单注销日后（不含注销日）的7个自然日内（含当日）开始发货。

厂库应当按照合约要求的交割质量标准发货，并应当向货主出具符合交易所要求的品质凭证，作为结算质量升贴水的依据。

第三十条 货主有权决定是否对厂库每日出库货物进行取样，并应当在货物出库前2个自然日之前以书面形式告知厂库。因货主原因导致无法取样的，视为货主选择不取样。

若货主选择取样，货主应当在每日货物出库前2个自然日之前委托指定质量检验机构取样并支付相应费用。指定质量检验机构应当在货物出库当天到场取样，经货主、厂库确认后将样品封存，并将样品保留至样品封存日后（不含当日）第3个交易日（含当日），作为发生质量争议时的处理依据；若货主选择不取样，则视为对厂库出库货物质量无异议。

第三十一条 指定质量检验机构应当在交易所认可的厂库取样点取样，每个客户每天取样数量不得超过3个。

第三十二条 厂库以不高于日发货速度向货主发货时，货主因运输能力等原因无法按时提货，货主应当向厂库支付滞纳金。滞纳金按照如下方法确定：

（一）从开始提货之日（含当日）起，每日按照截至当日应提而未提的商品数量乘以相应的滞纳金标准计算出当日滞纳金金额；

（二）直至完成提货之日（不含当日），在加总每日滞纳金金额的基础上，计算出货主应当向厂库支付的滞纳金总额。

滞纳金标准为6元/吨·天。

第三十三条 在提货期限届满之日后（不含当日）且在标准仓单注销日后（不含注销日）的27个自然日内（含当日）到厂库提货，货主应当向厂库支付滞纳金，厂库仍应按照期货标准承担有关的商品质量、发货时间和发货速度的责任，直至发完全部期货商品。

滞纳金按照如下方法确定：

（一）从提货期限届满之日（含当日）起，每日按照截至当日应提而未提的商品数量乘以相应的滞纳金标准计算出当日滞纳金金额；

（二）直至完成提货之日（不含当日），在加总每日滞纳金金额的基础上，计算出货主应当向厂库支付的滞纳金总额。

滞纳金标准为6元/吨·天。

第三十四条 在标准仓单注销日后（不含注销日）的27个自然日后（不含当日）到厂库提货，货主应当以下述公式的计算方法向厂库支付滞纳金，同时厂库将不再按照期货标准承担有关的商品质量、发货时间和发货速度的责任。

滞纳金金额=6元/吨·天×全部的商品数量×27天

第三十五条 厂库未按规定的日发货速度发货，但按时完成了所有商品的发货，厂库应当向货主支付赔偿金。

赔偿金金额=该商品最近已交割月份交割结算价×按日出库速度应发而未发的商品数量×5%

第三十六条 厂库未按时完成所有商品的发货，在按本细则第三十五条规定进行赔偿的基础上，同时还应当向货主支付赔偿金，赔偿金金额=该商品最近已交割月份交割结算价×按商品总量应发而未发的商品数量×5%；并按照以下程序进行处理：

（一）交易所向货主提供其它厂库或其它地点的相同质量和数量的现货商品，并承担调整交货地点和延期发货产生的全部费用。

（二）交易所无法提供上述商品时，向货主返还货款并支付赔偿金。

返还货款和赔偿金的金额=该商品最近已交割月份交割结算价×按商品总量应发而未发的商品数量×120%

第三十七条 当厂库发生本细则第三十五条、第三十六条中的违约行为时，首先由厂库向货主支付赔偿金。厂库未支付的或者支付数额不足的，交易所按照《大连商品交易所标准仓单管理办法》相关规定处理。

第三十八条 液化石油气出库时，指定交割仓库应当核验货主的液化石油气生产、经营或使用资质，以及相应运输方的运输资质。

第四章 附则

第三十九条 违反本细则规定的，交易所按照《大连商品交易所违规处理办法》和其他业务规则的有关规定处理。

第四十条 本细则解释权属于大连商品交易所。

第四十一条 本细则自公布之日起实施。

附件：1. 大连商品交易所液化石油气交割质量标准

（F/DCE PG 001-2020）

2. 大连商品交易所液化石油气指定交割仓库

名录（略）

附件1

**大连商品交易所液化石油气**

**交割质量标准**

（F/DCE PG 001-2020）

1 范围

1.1本标准规定了用于大连商品交易所交割的液化石油气质量指标、取样及检验、贮存等要求。

1.2 本标准适用于大连商品交易所液化石油气期货合约交割标准品和替代品。

2 规范性引用文件

下列文件中的条款通过本标准的引用而成为本标准的条款。凡是注日期的引用文件，其随后所有的修改单（不包括勘误的内容）或修订版均不适用于本标准。凡是不注日期的引用文件，其最新版本适用于本标准。

GB 11174-2011 液化石油气

SH/T 0233-1992 液化石油气采样法

3 术语和定义

应符合GB 11174-2011及其引用标准中术语和定义的有关规定。

4 质量要求

4.1 标准品质量要求

|  |  |  |
| --- | --- | --- |
| 项目 | | 要求 |
| 密度（15℃）/（kg/m3） | | 报告 |
| 蒸气压（37.8℃）/kPa | | ≤1380 |
| 组分 | |  |
|  | C3烃类组分（体积分数）/% | ≥20且≤60 |
|  | （C3+C4）烃类组分（体积分数）/% | ≥95 |
|  | C5及C5以上烃类组分（体积分数）/% | ≤3.0 |
| 残留物 | |  |
|  | 蒸发残留物（mL/100mL） | ≤0.05 |
|  | 油渍观察 | 通过 |
| 铜片腐蚀（40℃，1h）/级 | | ≤1 |
| 总硫含量（mg/m3） | | ≤343 |
| 硫化氢（需满足下列要求之一） | |  |
|  | 乙酸铅法 | 无 |
|  | 层析法/(mg/m3) | ≤10 |
| 游离水 | | 无 |

4.2 替代品质量差异与升贴水

|  |  |  |
| --- | --- | --- |
| 序号 | 项目 | 升扣价（元/吨） |
| 1 | 同时满足下述指标要求：  （1）蒸气压（37.8℃）≤485 kPa  （2）组分  C3烃类组分（体积分数）≤5%  (C3+C4)烃类组分（体积分数）≥95%  C5及C5以上烃类组分（体积分数）≤2.0% | 扣价150 |
| 2 | 同时满足下述指标要求：  （1）蒸气压（37.8℃）≤1380 kPa  （2）组分 | 扣价150 |
|
| C3烃类组分（体积分数）＞5%且＜20% |
| (C3+C4)烃类组分（体积分数）≥95% |
| C5及C5以上烃类组分（体积分数）≤3.0% |
| 3 | 同时满足下述指标要求：  （1）蒸气压（37.8℃）≤1430kPa  （2）组分  C3烃类组分（体积分数）≥95%  C4及C4以上烃类组分（体积分数）≤2.5%  C5及C5以上烃类组分（体积分数）不做要求 | 扣价100 |

4.3若同时交割满足4.2第1项和第3项要求的替代品（可以在一个交割单位内同时交割），且第3项替代品重量占第1项和第3项替代品总重量的比例≥20%且≤50%，则扣价0元/吨。

5 取样及检验规则

5.1 取样按照SH/T 0233-1992的规定执行。

5.2 质量指标检验按GB 11174-2011执行。

6 贮存

液化石油气应装入液化石油气储罐或液化石油气专用钢瓶储存。

7 附加说明

本标准由大连商品交易所负责解释。