附件1

《大连商品交易所风险管理办法》修正案

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。

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。

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。

……

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，若该期间内某日的上一交易日结算时该合约的单边持仓量大于达到120,000手及以上，则自该日起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，直至该月第十四个交易日。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，若该期间内某日的上一交易日结算时该合约的单边持仓量大于达到80,000手及以上，则自该日起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，直至该月最后一个交易日。

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。；

（四）做市商持仓根据《大连商品交易所做市商管理办法》等有关规定进行管理。

第二十八条 非期货公司会员和客户采取不同的如下限仓要求：

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大于一定规模起数量时，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小于等于该规模前数量时，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。

合约在某一交易时间段的限仓数额自该交易时间段起始日前一交易日结算时起执行。依据合约单边持仓量确定某日某合约的限仓数额时，该单边持仓量取该日前一交易日结算时的持仓量。

第二十九条  各品种期货合约持仓限额如下：

（一）除鸡蛋、乙二醇以外的品种

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

　　2.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 |

（二）鸡蛋品种

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 |

（三）乙二醇品种

乙二醇期货合约非期货公司会员和客户持仓限额见下表按如下规定，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。

|  |  |  |  |  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- |
| 品种 | 一般规定 | | | | 特别规定 | | | |
| 时间段 | 合约单边持仓量 | 非期货公司会员 | 客户 | 时间段 | 合约单边持仓量 | 非期货公司会员 | 客户 |
| 乙二醇 | 合约上市至交割月份前一个月第十四个交易日 | 单边持仓量≤80,000 | 8,000 | | 交割月份前一个月第一个交易日至该月第十四个交易日 | 单边持仓量＞120,000 | 3000（维持该标准，直至该月第十四个交易日） | |
| 单边持仓量＞80,000 | 单边持仓量×10% | |
| 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 | —— | 3000 | | 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 | 单边持仓量＞80,000 | 1000（维持该标准，直至该月最后一个交易日） | |
| 交割月份 | —— | 1000 | | —— | —— | —— | —— |

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。