

编制说明

2016 版《大交所规则》的修订，本次修改主要涉及《大连商品交易所结算细则》、《大连商品交易所交割细则》、《大连商品交易所风险管理办法》、《大连商品交易所标准仓单管理办法》、《大连商品交易所保税交割实施细则》、《《大连商品交易所异常交易管理办法（试行）》有关监管标准及处理程序》等六部规则。

特此说明

编者

2016 年 8 月

目 录

大连商品交易所章程.....	3
大连商品交易所交易规则.....	10
大连商品交易所信息管理办法.....	19
大连商品交易所交易细则.....	21
大连商品交易所结算细则.....	33
大连商品交易所交割细则.....	48
大连商品交易所会员管理办法.....	126
大连商品交易所套期保值管理办法.....	134
大连商品交易所套利交易管理办法.....	138
大连商品交易所违规处理办法.....	141
大连商品交易所指定交割仓库管理办法.....	148
大连商品交易所焦炭套期保值管理办法.....	153
大连商品交易所期货合约文本.....	156
大连商品交易所风险管理办法.....	196
关于发布施行《大连商品交易所异常交易管理办法（试行）》的通知.....	214
大连商品交易所指定存管银行管理办法.....	217
《大连商品交易所异常交易管理办法（试行）》有关监管标准及处理程序.....	226
关于有关实际控制关系账户监管标准的通知.....	229
关于实际控制关系账户投机持仓合并计算相关规则的通知.....	235
大连商品交易所标准仓单管理办法.....	236
聚氯乙烯交割注册品牌管理办法.....	245
大连商品交易所保税交割实施细则.....	257

大连商品交易所章程

(2003年4月7日大连商品交易所第二届会员大会第一次会议修订, 2004年2月1日起实施)

第一章 总 则

第一条 为了促进社会主义市场经济的发展, 充分发挥期货市场的功能, 保证期货交易的正常进行, 维护期货交易当事人的合法权益和社会公众的利益, 根据国家有关法律、法规和政策, 制定本章程。

第二条 大连商品交易所(以下简称交易所)是经中国证券监督管理委员会(以下简称中国证监会)审批, 在国家工商行政管理局登记注册的期货交易所。

第三条 交易所接受中国证监会的监督管理。

第四条 交易所遵循公开、公平、公正和诚实信用的原则组织期货交易。

第五条 本章程适用于交易所内一切业务活动, 交易所、交易所会员及其工作人员必须遵守本章程。

第二章 设立、变更与终止

第六条 交易所中文名称为: 大连商品交易所; 英文名称为 Dalian Commodity Exchange, 英文缩写为 DCE。

第七条 交易所住所为大连市沙河口区会展路18号。

第八条 交易所营业期限为50年。

第九条 交易所是指依照《期货交易管理暂行条例》和《期货交易所管理办法》设立的, 履行《期货交易管理暂行条例》和《期货交易所管理办法》规定的职能, 按照本章程实行自律性管理的法人。

第十条 总经理为交易所法定代表人。

第十一条 交易所注册资本为人民币9500万元。注册资本划分为均等份额, 由会员出资认缴。

第十二条 交易所职能:

- (一) 提供期货交易的场所、设施及相关服务;
- (二) 制定并实施交易所的业务规则;
- (三) 设计期货合约、安排期货合约上市;
- (四) 组织、监督期货交易、结算和交割;
- (五) 制定并实施风险管理制度, 控制市场风险;
- (六) 保证期货合约的履行;
- (七) 发布市场信息;
- (八) 监管会员期货业务, 查处会员违规行为;
- (九) 指定交割仓库并监管其期货业务;
- (十) 指定结算银行并监督其与本所有关的期货结算业务;
- (十一) 中国证监会规定的其他职能。

第十三条 交易所名称、注册资本、注册地址、法定代表人的变更, 按有关规定办理变更手续。

第十四条 交易所因下列情况之一终止：

- (一) 章程规定的营业期限届满，会员大会决定不再延续；
- (二) 会员大会决定解散；
- (三) 合并或者分立需要解散；
- (四) 中国证监会决定关闭。

因前款第(一)、(二)、(三)项解散的，由中国证监会批准。

交易所终止，应当成立清算组，进行清算。

清算组制定的清算方案，应当报中国证监会批准。

第三章 会 员

第十五条 会员是指根据期货交易有关法律、法规和本章程的有关规定，经交易所审查批准，在本交易所进行期货交易活动的企业法人。

第十六条 会员分为期货经纪公司会员和非期货经纪公司会员。

第十七条 申请成为交易所会员必须具备下列条件：

- (一) 中华人民共和国境内登记注册的企业法人；
- (二) 承认并遵守交易所的章程和业务规则；
- (三) 拥有规定限额以上的注册资本和净资产；
- (四) 具有良好的信誉和经营历史，最近三年内无严重违法记录或被期货交易所除名的记录；
- (五) 有健全的组织机构和财务管理制度及完善的期货业务管理制度；
- (六) 有期货从业资格的人员，固定的经营场所和必要设施；
- (七) 申请期货经纪公司会员的，须持有中国证监会核准的《期货经纪业务许可证》；
- (八) 中国证监会和交易所规定的其它条件。

第十八条 交易所接纳会员，须经会员资格审查委员会预审，理事会批准，并报中国证监会备案，同时制发会员证书，并予以公布。

第十九条 会员享有下列权利：

- (一) 参加会员大会，行使选举权、被选举权和表决权；
- (二) 在交易所内进行规定品种的期货交易；
- (三) 使用交易所提供的交易设施，获得有关期货交易的信息和服务；
- (四) 按规定转让会员资格；
- (五) 联名提议召开临时会员大会；
- (六) 按照本章程和交易规则行使申诉权；
- (七) 交易所章程规定的其他权利。

第二十条 会员应当履行下列义务：

- (一) 遵守国家有关法律、法规、规章和政策；
- (二) 遵守交易所章程、业务规则及有关决定；
- (三) 按规定交纳各种费用；
- (四) 出席会员大会，执行会员大会、理事会的决议；
- (五) 接受交易所监督管理；
- (六) 交易所章程规定的其他义务。

第二十一条 交易所会员实行总数控制。会员数目的上限由理事会确定，会员大会通过。

第二十二条 每个会员须向交易所出资认缴 50 万元，取得会员资格，同时取得一个场内交易席位。

会员因业务需要可增加交易席位。增加交易席位的，须按交易所有关规定办理手续。

第二十三条 会员资格应当按照交易所规定条件和程序转让；转让方必须事先向交易所提交有关报告，受让方应当符合本章程**第十七条**规定。受让方向交易所提出入会申请并提交相关文件、资料，经交易所理事会审查批准后方可履行转让手续。

第二十四条 会员因故被取消会员资格的，按有关规定办理手续。

第二十五条 兼并会员的法人或与会员合并后新设立的法人需要承继会员资格的，必须向交易所提出申请，经交易所理事会审查批准后，方可承继会员资格。

兼并会员的法人或与会员合并后新设立的法人，有优先取得会员资格的权利。

第二十六条 交易所会员被取消资格或会员资格发生变更时，应报中国证监会备案。

第二十七条 交易所应制定会员管理办法，对会员进行管理。

第二十八条 交易所可以根据交易、结算业务的需要，设立特别会员。特别会员的种类、资格条件以及权利、义务另行规定。

第四章 会员大会

第二十九条 会员大会是交易所的权力机构，由全体会员组成。

会员大会行使下列职权：

- （一）审议通过交易所章程和交易规则及其修改草案；
- （二）选举和更换会员理事；
- （三）审议批准理事会、总经理的工作报告；
- （四）审议批准交易所的财务预算方案、决算报告；
- （五）审议交易所风险准备金使用情况；
- （六）决定增加或者减少交易所注册资本；
- （七）决定交易所的合并、分立、解散和清算事项；
- （八）决定交易所理事会提交的其他重大事项；
- （九）本章程规定的其他职权。

第三十条 会员大会由理事会召集，一般情况下每年召开一次。

有下列情形之一的，应当召开临时会员大会：

- （一）会员理事人数不足本章程规定人数的三分之二时；
- （二）三分之一以上会员联名提议时；
- （三）理事会认为必要时。

第三十一条 会员大会由理事长主持。理事长因特殊原因不能履行职权时，由理事长指定的副理事长或者其他理事主持。召开会员大会，应当将会议审议的事项于会议召开 10 日以前通知会员。临时会员大会不得对通知中未列明的事项作出决议。

第三十二条 会员大会必须有三分之二以上会员参加方为有效。每一会员享有一票表决权。

会员大会对交易所合并、分立、解散和清算、增加或者减少交易所注册资本形成决议，必须经全体会员三分之二以上通过，会员大会形成的其他决议必须经全体会员二分之一以上通过。

第三十三条 会员参加会员大会，应当由其法定代表人出席。法定代表人因故不能出席会员大会的，会员可以委托代理人出席会员大会，代理人应当向交易所提交会员授权委托书，并在授权范围内行使表决权。

第三十四条 会员大会应当对表决事项制作会议纪要，由出席会议的理事签名。

会员大会结束后 10 日内，交易所应当将会员大会全部文件报中国证监会备案。

第五章 理事会

第三十五条 理事会是会员大会的常设机构，对会员大会负责。

理事会行使下列职权：

- (一) 召集会员大会，并向会员大会报告工作；
- (二) 选举理事长、副理事长；
- (三) 通过对理事会成员的不信任案，并提请有关机构审议批准；
- (四) 拟定交易所章程、交易规则及其修改草案，提交会员大会通过；
- (五) 审议总经理提出的财务预算方案、决算报告，提交会员大会通过；
- (六) 审议交易所合并、分立、解散和清算的方案，提交会员大会通过；
- (七) 决定专门委员会的设置；
- (八) 决定会员的接纳；
- (九) 决定对违规会员的处罚；
- (十) 决定交易所的变更事项；
- (十一) 审定根据交易规则制定的细则和办法；
- (十二) 审定风险准备金的使用和管理办法；
- (十三) 审定总经理提出的交易所发展规划和年度工作计划；
- (十四) 监督总经理组织实施会员大会决议和理事会决议的情况；
- (十五) 监督交易所高级管理人员和其他工作人员遵守国家有关法律、法规、规章、政策和交易所章程、业务规则的情况；
- (十六) 组织交易所年度财务会计报告的审计工作，决定会计师事务所的聘用和变更事项；
- (十七) 本章程规定和会员大会授予的其他职权。

前款有关职权，理事会可授予专门委员会或总经理行使。

第三十六条 理事会由 13 名理事组成。其中会员理事为 9 名、非会员理事为 4 名。理事每届任期 3 年，理事连续任职不得超过 2 届。

会员理事由理事会或者五分之一以上会员联合提名，由会员大会差额选举产生。非会员理事由中国证监会委派。交易所总经理为当然理事。

第三十七条 理事会设理事长 1 人、副理事长 1 至 2 人。理事长、副理事长由中国证监会提名，理事会选举产生。理事长不得兼任总经理。

第三十八条 理事长行使下列职权：

- (一) 主持会员大会、理事会会议和理事会的日常工作；
- (二) 组织协调专门委员会的工作；
- (三) 检查理事会决议的实施情况并向理事会报告。

副理事长协助理事长工作，理事长因故临时不能履行职权时，由理事长指定的副理事长或理事代其履行职权。

第三十九条 理事会会议至少每半年召开 1 次。每次会议应当于会议召开 10 日以前通知全体理事。

有下列情形之一的，应当召开理事会临时会议：

- (一) 中国证监会提议；
- (二) 三分之一以上理事联名提议。

根据本条第二款第(一)项召开理事会会议的，会议通知时间不受本条第一款规定限制。

第四十条 理事会会议须有三分之二以上理事出席方为有效，其决议须经全体理事二分之一以上表决通过。

理事会会议结束后 10 日内,理事会应当将会议决议及其他会议文件报中国证监会备案。

第四十一条 理事会会议,应当由理事本人出席。理事因故不能出席,应当以书面形式委托其他理事代为出席,委托书中应当载明授权范围。每位理事只能接受一位理事的授权。

会员理事因人事变动,不能履行会员理事职责的,可由理事会推举适当人选,并经理事会通过后,通告全体会员。

理事会应当对会议表决事项作成会议记录,由出席会议的理事和记录员在会议记录上签名。

第四十二条 理事会下设监察、交易、交割、会员资格审查、调解、财务、技术等专门委员会。

专门委员会为议事机构,协助理事会开展工作,专门委员会对理事会负责,专门委员会的职责由理事会规定。

第四十三条 各专门委员会委员由交易所会员、交易所工作人员和社会知名人士组成,由理事会任命,每届任期 3 年。

第四十四条 各专门委员会分别设主任 1 人,副主任若干人,主任由会员担任,1 名副主任由交易所工作人员担任,负责处理日常工作。主任、副主任均由专门委员会选举产生,理事会任命。交易所总经理、副总经理、理事会成员不得兼任各专门委员会正、副主任职务。根据理事会工作需要,专门委员会正、副主任可列席理事会会议。

第六章 总经理

第四十五条 交易所设总经理 1 人,副总经理若干人。总经理和副总经理由中国证监会任免。总经理每届任期 3 年,连任不得超过 2 届。

第四十六条 总经理行使下列职权:

- (一) 组织实施会员大会、理事会通过的制度和决议;
- (二) 主持交易所日常工作;
- (三) 根据章程和交易规则组织拟定有关细则和办法;
- (四) 拟定并实施经批准的交易所发展规划、年度工作计划;
- (五) 拟定交易所财务预算方案、决算报告;
- (六) 拟定交易所合并、分立、解散和清算的方案;
- (七) 拟定交易所变更方案;
- (八) 决定交易所机构设置方案,聘任和解聘工作人员;
- (九) 决定交易所员工的工资和奖惩;
- (十) 章程规定或者理事会授予的其他职权。

总经理因故临时不能履行职责时,由总经理指定的副总经理代其履行职责。

第四十七条 总经理的任期经济责任审计按照中国证监会的有关规定执行。

第七章 业务管理

第四十八条 期货交易必须按规定通过交易所进行。

期货交易实行价格优先、时间优先的撮合成交原则。

第四十九条 交易所实行保证金制度、风险准备金制度、每日无负债结算制度、涨跌停板制度、实物交割制度、套期保值头寸审批制度、信息披露制度、投资者交易编码制度、投机头寸限仓制度、大户报告制度、强行平仓制度、市场禁入制度等,对期货交易进行管理和风险控制。

第八章 财务管理

第五十条 交易所财务实行独立核算、自负盈亏,按国家有关财务制度的规定进行管理。

第五十一条 交易所按照国家有关规定,每一年度结束后三个月内向中国证监会和有关部门报送经具有证券、期货相关业务资格的会计师事务所审计的财务报告。

第五十二条 交易所按照国家规定制定内部审计制度。

第五十三条 交易所按规定向会员收取年会费,每个期货经纪公司会员的年会费为2万元,每个非期货经纪公司会员的年会费为1万元。

第五十四条 经理事会批准,交易所以其收入抵补各项费用开支,实现的税后净利润,根据有关财务规定转作盈余公积金用于弥补以后年度亏损。

第五十五条 经理事会批准,交易所可从年度净利润中按有关规定提取一定数额的公益金,用于交易所购建职工集体福利设施支出。

第五十六条 为保证交易所正常运行,交易所按规定提取风险准备金。风险准备金应按国家有关规定管理和使用。

第九章 处罚与争议处理

第五十七条 交易所可以根据本章程和业务规则,对期货市场参与者的违规、违约行为进行处理。

第五十八条 交易所对违规行为,视情节轻重和后果大小,可单处或并处警告、通报批评、暂停开仓交易、强行平仓、暂停期货业务、罚款、没收违规所得、取消会员资格或市场禁止进入等处罚。

第五十九条 交易所对违约行为,视情节轻重和后果大小,单处或并处警告、通报批评、支付违约金、支付赔偿金、取消会员资格或市场禁止进入等处罚。

第六十条 交易所及其工作人员不得参与期货交易。交易所工作人员不得以任何形式在会员单位及其他与期货交易有关的营利性单位兼职。交易所工作人员违反本章程和业务规则的,给予纪律处分。

第六十一条 交易所工作人员的配偶及直系亲属不得参与本交易所的期货交易。交易所工作人员的配偶及直系亲属违反本规定的,给予该工作人员纪律处分。

第六十二条 指定交割仓库及其工作人员不得参与本交易所的期货交易。

指定交割仓库违反本章程和业务规则的,交易所视情节轻重和后果大小,可单处或并处警告、通报批评、暂停交割业务、罚款、没收违规所得、取消指定交割仓库资格或市场禁止进入等处罚。

指定交割仓库的工作人员违反本章程和业务规则的,交易所责成指定交割仓库对其进行纪律处分。

第六十三条 会员、投资者、指定交割仓库、指定结算银行之间因期货交易发生争议,协商无效的,可以提请交易所调解或者直接依法提请仲裁或诉讼。

会员与交易所之间发生争议,协商无效的,可以依法提请仲裁或诉讼。

第六十四条 交易所应当对违反交易所业务规则的行为制定查处办法,并报中国证监会批准。

第十章 附 则

第六十五条 交易所可依据本章程制订有关业务规则和实施细则。

第六十六条 本章程中所称“以上、以下”均包括本数。

-
- 第六十七条 本章程的解释权属于大连商品交易所理事会。
- 第六十八条 本章程的制定和修改经会员大会通过，报中国证监会批准。
- 第六十九条 本章程自 2004 年 2 月 1 日起实施。

大连商品交易所交易规则

(2003年4月7日大连商品交易所第二届会员大会第一次会议修订, 2004年2月1日起实施)

第一章 总 则

第一条 为规范期货交易行为, 保护期货交易当事人的合法权益和社会公众利益, 根据国家有关法律、法规、政策和《大连商品交易所章程》, 制定本交易规则。

第二条 大连商品交易所(以下简称交易所)的主要业务是: 根据公开、公平、公正和诚实信用的原则, 组织经中国证券监督管理委员会(以下简称中国证监会)批准的期货交易。

第三条 本交易规则适用于交易所内的一切交易活动, 交易所、会员、投资者、指定交割仓库、指定结算银行及其工作人员必须遵守本交易规则。

第二章 上市品种和期货合约

第四条 交易所上市品种为大豆、豆粕、啤酒大麦以及经中国证监会批准的其他期货品种。

第五条 交易日为每周一至周五(国家法定假日除外)。每一交易日各品种的交易时间安排, 由交易所另行公告。

第六条 期货合约是指由交易所统一制定的、规定在将来某一特定的时间和地点交割一定数量和质量商品的标准化合约。

第七条 期货合约的主要条款包括: 合约名称、交易品种、交易单位、报价单位、最小变动价位、每日价格最大波动限制(又称涨跌停板)、合约交割月份、交易时间、最后交易日、交割日期、交割品级、交割地点、最低交易保证金、交易手续费、交割方式、交易代码。期货合约的附件与期货合约具有同等法律效力。

第八条 最小变动价位是指该期货合约的单位价格涨跌变动的最小值。

第九条 每日价格最大波动限制是指期货合约在一个交易日中的交易价格不得高于或者低于规定的涨跌幅度, 超过该涨跌幅度的报价将被视为无效, 不能成交。

第十条 期货合约交割月份是指该合约规定进行实物交割的月份。

第十一条 最后交易日是指某一期货合约在合约交割月份中进行交易的最后一个交易日。

第十二条 期货合约的交易单位为“手”, 期货交易必须以“一手”的整数倍进行, 不同交易品种每手合约的商品数量, 在该品种的期货合约中载明。

第十三条 期货合约以人民币计价, 计价单位为元。

第三章 交易大厅管理

第十四条 交易大厅是期货合约集中交易的场所。交易所按有关规定对交易大厅进行管理。

根据中国证监会的有关规定, 交易所允许符合条件的会员通过远程交易席位, 参加交易所的集中竞价交易。

第十五条 出市代表是受会员委派并代表会员在交易大厅接受本会员的交易指令进行

期货交易的人员。会员可指派若干名出市代表。

第十六条 出市代表应符合中国证监会关于期货从业人员资格的有关规定,经交易所培训考核合格,取得《大连商品交易所出市代表证》。

第十七条 出市代表不得接受其他单位、个人的交易指令或者为其提供咨询意见,不得为自己进行期货交易。

第十八条 出市代表有使用交易所提供的各项服务设施、对交易活动提出意见和建议的权利,同时有遵守交易所业务规定、服从管理和爱护公用设施的义务。

第十九条 交易期间交易所派出交易主持人一名及场务执行人员若干名。

第二十条 交易主持人和场务执行人员是主持交易活动和维护交易秩序的场务管理人员,其主要职责如下:

- (一) 宣布开市、收市;
- (二) 执行按规定调整的涨、跌停板;
- (三) 监督和按规定执行强行平仓;
- (四) 按规定控制交易席位的交易权限;
- (五) 管理交易大厅;
- (六) 维护交易秩序;
- (七) 经总经理授权处理其他有关事务。

第二十一条 进入交易大厅限于下列人员:

- (一) 会员出市代表;
- (二) 交易所场务管理人员;
- (三) 交易所特许人员。

第二十二条 出市代表须按规定着装并佩戴证件,按规定时间进场。

第二十三条 交易所场务管理人员应按规定着装,并佩戴标志进场。

第二十四条 特许人员进入交易大厅,应事先征得同意,并由交易所人员陪同,进场后不得参与或妨碍交易活动。

第二十五条 交易所场务执行人员对出市代表在交易过程中违反交易大厅管理办法和有关纪律,有权向其提出警告,情节严重者可责令其离场,并按有关规定予以处罚。

第四章 经纪与自营

第二十六条 交易所会员分期货经纪公司会员(以下简称经纪会员)和非期货经纪公司会员(以下简称非经纪会员)。

交易所可以根据交易、结算业务的需要设立特别会员。

第二十七条 投资者委托经纪会员进行期货交易的,必须事先在经纪会员处办理开户登记。投资者分单位投资者和个人投资者。

第二十八条 经纪会员在接受投资者开户申请时,须向投资者提供《期货交易风险说明书》。个人投资者应在仔细阅读并理解后,在该《期货交易风险说明书》上签字;单位投资者应在仔细阅读并理解后,由法定代表人(负责人)在该《期货交易风险说明书》上签字并盖公章。

第二十九条 经纪会员在接受投资者开户申请时,双方须签署期货经纪合同。个人投资者应在该合同上签字,单位投资者应由法定代表人(负责人)在该合同上签字并盖公章。

第三十条 经纪会员应按交易所规定将投资者登记表、营业执照影印件、身份证影印件等资料报交易所备案。

第三十一条 交易所实行投资者交易编码制度,经纪会员和投资者必须遵守一户一码制

度，不得混码交易。

第三十二条 经纪会员接受投资者委托交易可以按规定通过书面、电话、计算机、网上委托及中国证监会规定的其他方式进行。

第三十三条 经纪会员的业务人员在接受投资者书面委托时，应依序编号，由业务人员签字并标记时间，其中一联交投资者收执。

第三十四条 交易指令的种类：

（一）限价指令：指执行时必须按限定价格或更好价格成交的指令；

（二）取消指令：指投资者要求将某一指定指令取消的指令；

（三）交易所规定的其他指令。

第三十五条 交易指令当日有效。在指令成交前，投资者可提出变更和撤消指令。

第三十六条 经纪会员对其代理投资者的所有指令，必须通过交易所集中撮合交易。

第三十七条 经纪会员应向投资者收取手续费，代收国家规定应由投资者上交的税费。

第三十八条 经纪会员有责任如实向投资者提供本公司的资信和业务情况及信息、咨询等相关服务。

第三十九条 经纪会员在每日交易闭市后应当为投资者准备交易结算报告。投资者有权按照期货经纪合同约定的时间和方式知悉交易结算报告的内容。

第四十条 经纪会员应按投资者的委托进行交易，并为投资者保守交易秘密。

第四十一条 经纪会员对其名下期货交易先行承担全部责任，投资者对自己委托的期货交易负全部责任。

投资者有向交易所反映委托交易业务中存在问题的权利。

第四十二条 非经纪会员进行自营期货交易的，须在交易所指定结算银行单独开设自营专用资金帐户，存入足够的资金。

第五章 交易业务

第四十三条 期货交易是指在期货交易所内集中买卖某种期货合约的交易活动。

第四十四条 期货合约的交易价格是指该期货合约的交割标准品在基准交割仓库交货的含增值税价格。

第四十五条 期货合约的交割标准品由交易所在期货合约中载明。替代品的升、贴水由交易所另行规定，并报中国证监会备案。

第四十六条 非基准交割仓库交割与基准交割仓库交割的升、贴水标准由交易所另行规定，并报中国证监会备案。

第四十七条 开盘价是指某一期货合约开市前五分钟内经集合竞价产生的成交价格。集合竞价未产生成交价格的，以集合竞价后第一笔成交价为开盘价。

第四十八条 收盘价是指某一期货合约当日交易的最后一笔成交价格。

第四十九条 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，以上一交易日的结算价作为当日结算价。

第五十条 新上市合约的挂盘基准价由交易所确定。

第五十一条 会员进行期货交易应按规定向交易所交纳交易手续费。

第五十二条 会员进行实物交割应按规定向交易所交纳交割手续费。交割手续费标准由交易所另行制定。

第五十三条 交易所实行涨跌停板制度。当某一期货合约在某一交易日收盘前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时，交易所确定该合约在该交易日收市时出现涨(跌)

停板，并按交易所制定的有关规定处理。

第五十四条 交易所实行保证金制度。保证金是指交易者按照规定标准交纳的资金，用于结算和保证履约。

第五十五条 保证金分为结算准备金和交易保证金。

结算准备金是指会员为了交易结算在交易所专用结算帐户预先准备的资金，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。

交易保证金是指会员在交易所专用结算帐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。交易所可调整交易保证金水平，具体实施细则另行制定。

第五十六条 会员应在交易所指定结算银行开设专用资金帐户，会员专用资金帐户只能用于会员与投资者、会员与交易所之间期货业务的资金往来结算。

第五十七条 经纪会员应当将投资者交纳的保证金存放于会员专用资金帐户，以备随时交付保证金及有关费用。经纪会员不得挪用投资者资金。

第五十八条 根据中国证监会规定，经交易所批准，会员可用标准仓单或交易所允许的其他质押物充作交易保证金。

第五十九条 经纪会员在受理投资者委托指令后，应及时将投资者的指令输入交易席位上的计算机终端进行竞价交易。

第六十条 交易所计算机自动撮合系统将买卖申报指令以价格优先、时间优先的原则进行排序，当买入价大于、等于卖出价则自动撮合成交。撮合成交价等于买入价(bp)、卖出价(sp)和前一成交价(cp)三者中居中的一个价格。即：

当 $bp \geq sp \geq cp$ ，则：最新成交价=sp

$bp \geq cp \geq sp$ ，最新成交价=cp

$cp \geq bp \geq sp$ ，最新成交价=bp

第六十一条 当结算准备金低于开仓最低额度时，交易所的交易系统不接受开仓申报。

第六十二条 买卖申报经计算机撮合成交即生效，其信息通过计算机成交回报系统发送至会员的计算机联网终端上。会员在收到成交回报信息时应及时通知投资者。

第六十三条 申报买卖的数量如未能一次全部成交，其余量仍存于交易所计算机主机内，继续参加当日竞价交易。

第六十四条 每日交易结束，会员可通过交易所会员服务系统获得成交记录。会员应及时核对，如有异议应在当日以书面形式向交易所提出。

第六十五条 交易所对期货交易、结算、交割资料的保存期限应当不少于 20 年。

经纪会员对投资者的开户资料、指令记录、交易结算记录以及其他业务记录的保存期限应当不少于 5 年。

第六十六条 交易所实行套期保值头寸审批制度。交易所对套期保值申请者的经营范围和以前年度经营业绩资料、现货购销合同等能够表明其现货经营情况的资料进行审核，确定其套期保值额度。

投资者申请套期保值额度必须委托经纪会员办理。

第六十七条 套期保值额度按交易所有关规定使用。

第六章 风险控制

第六十八条 交易所实行投机头寸限仓制度，套期保值头寸不限仓。规定一般月份合约和交割月前一个月份合约同时按会员和投资者编码限仓，经纪会员的限仓由交易所根据其注册资本、信誉、抗风险能力、以前年度交易情况和投资者数量核定。交割月份合约实行对会

员和投资者绝对量限仓。投资者在不同经纪会员处开户,其持仓量应合并计算。具体实施细则另行制定。

第六十九条 交易所实行强行平仓制度,对会员或投资者违规超仓的或者未按规定及时追加交易保证金的,以及其他违规行为的,交易所对违规会员采取强行平仓措施。具体实施细则另行制定。

第七十条 强行平仓盈利按有关规定处理。发生的费用及损失由违规者承担。因市场原因无法强行平仓造成的损失扩大部分也由违规者承担。

第七十一条 当期货价格出现同方向连续涨跌停板或市场风险明显增大时,交易所可以采取调整涨跌停板幅度、提高交易保证金及按一定原则减仓等措施释放交易风险。采取风险控制措施后仍然无法释放风险时,交易所应宣布进入异常情况,由交易所理事会决定采取进一步的风险控制措施。

第七十二条 会员无法履约时,交易所采取下列保障措施:

- (一) 暂停开仓业务;
- (二) 按规定强行平仓,并用平仓后释放的保证金履约赔偿;
- (三) 依法处置质押物;
- (四) 用该会员的会员资格转让所得款项和其它资金履约赔偿;
- (五) 交易所代其履约后,依法追偿。

第七十三条 交易所实行大户报告制度。当会员或者投资者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最大持仓限制标准 80%时,会员或投资者应向交易所报告其资金情况、头寸情况,投资者须通过经纪会员报告。交易所可根据市场风险状况,调整持仓报告标准。

报告内容:

- (一) 会员或投资者名称、住所、经营范围;
- (二) 持仓方向、品种、月份、数量;
- (三) 持仓意向;
- (四) 资金来源和追加保证金的能力;
- (五) 实际拥有的交货或接货能力;
- (六) 交易所要求申报的其他内容。

第七十四条 有根据认为会员或者投资者违反交易所业务规则并且对市场正在产生或者将产生重大影响,为防止违规行为后果进一步扩大,交易所可以对该会员或者投资者采取下列临时处置措施:

- (一) 限制入金;
- (二) 限制出金;
- (三) 限制开新仓;
- (四) 提高保证金比例;
- (五) 限期平仓;
- (六) 强行平仓。

前款第(一)、(二)、(三)项临时处置措施可以由交易所总经理决定。其他临时处置措施由交易所理事会决定,并及时报告中国证监会。

第七章 结算业务

第七十五条 交易所实行每日无负债结算制度。

第七十六条 当日交易结束后,交易所对每一会员的盈亏、交易保证金、税金、交易手

续费等款项进行结算。会员可通过会员服务系统获取相关的结算数据。

第七十七条 当日盈亏为平仓盈亏与持仓盈亏之和。

第七十八条 会员的保证金余额低于交易所规定的结算准备金最低余额的，应当追加保证金。

第七十九条 会员必须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，则交易所将对该会员强行平仓。

第八十条 经纪会员应详细记载交易业务，按日序时登记投资者买卖合约的开仓、平仓、持仓、交割情况，及时准确地反映投资者盈亏、费用以及资金、收付等财务状况，控制投资者的交易风险。

第八十一条 会员必须妥善保管结算方面的资料、凭证、帐册以备查询和检查。有关资料必须保存 5 年以上。

第八十二条 交易所应当按有关规定提取、管理和使用风险准备金。风险准备金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。

第八章 交割业务

第八十三条 实物交割是指期货合约到期时，根据交易所的规则和程序，交易双方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。

第八十四条 各期货合约最后交易日后未平仓合约必须进行交割。到期合约的交割只能以会员的名义进行。投资者交割须通过会员办理。

第八十五条 交易所按照“最少配对数”的原则通过计算机对未平仓合约进行交割配对。

第八十六条 会员进行实物交割必须在交易所规定的时间内将货款或交割单据交到交易所。

第八十七条 在交易所规定的时间内，卖方会员交出标准仓单和相应的增值税专用发票后，交易所付给卖方会员货款；买方会员补齐交割款项后，交易所付给买方会员标准仓单，一收一付，先收后付。

第八十八条 交易所在收到卖方会员标准仓单或买方会员货款后将应清退的保证金部分划转卖方会员或买方会员。

第八十九条 买方会员办理交割时，对交割商品如有异议，应在交易所规定的时间内申请复检。

第九十条 交割结算价为该期货合约交割结算的基准价。

第九十一条 交割商品入库前，必须办理交割预报，交易所按“择优分配、统筹安排”的原则安排指定交割仓库。未办理交割预报入库的商品不能用于交割。

第九十二条 标准仓单是由交易所统一制定，指定交割仓库在完成入库商品验收，确认合格后签发给货主的实物提货凭证，标准仓单经交易所注册后方可用于交割。

第九十三条 指定交割仓库是经交易所指定的为期货合约履行实物交割的交割地点。

交易所对指定交割仓库实行年审制。

第九十四条 指定交割仓库可在交易所所在地设立办事机构，在交易所统一协调下处理交割事务。

第九十五条 指定交割仓库有下列行为之一的，交易所所有权责成其整改或赔偿经济损失，情节严重的，取消其指定交割仓库资格，直至追究法律责任：

（一）出具虚假仓单；

（二）违反交易所业务规则，限制交割商品的入库、出库；

- (三) 泄露与期货交易有关的商业秘密;
- (四) 参与期货交易;
- (五) 其他违反交易所有关规定的行为。

第九十六条 在实物交割时, 卖方会员未能在规定时间内如数交付标准仓单的; 买方会员未能在规定时间内如数交付货款的, 即为交割违约。

第九十七条 会员在实物交割中发生违约行为, 交易所可采用征购和竞卖的方式处理违约事宜, 违约会员应承担由征购和竞卖产生的费用和损失。交易所对违约会员还可处以支付违约金、赔偿金等处罚, 具体按交易所制定的有关交割违约处理办法处理。

第九十八条 会员不得因其投资者违约而不履行合约交割责任, 对不履行交割责任的, 交易所所有权强制执行。

第九十九条 由于指定交割仓库的过错造成标准仓单持有人不能行使或不能完全行使标准仓单权利的, 指定交割仓库应当承担赔偿责任; 赔偿不足的部分由交易所按有关规定补充赔偿, 补充赔偿后交易所所有权对指定交割仓库进行追偿。

第九章 异常情况处理

第一百条 在期货交易过程中, 如果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) 当出现本规则第七十一条情况并采取相应措施后仍未化解风险;
- (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、提高交易保证金、限期平仓、强行平仓、限制出金等紧急措施。

第一百零一条 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。

第一百零二条 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。

第十章 信息管理

第一百零三条 交易所对当日交易的价格行情以及必要的统计资料等其他有关信息予以发布。

第一百零四条 交易所发布的信息包括: 商品名称、合约交割月份、开盘价、最新价、涨跌、收盘价、结算价、最高价、最低价、成交量、持仓量及其持仓变化、会员成交量和持仓量排名、各指定交割仓库经交易所核准可供交割的库容量、标准仓单数量及其增减量等其他需要公布的信息。

信息发布应根据不同内容按实时、每日、每周、每月、每年定期发布。

第一百零五条 交易所应当采取有效通讯手段, 建立同步报价和即时成交回报系统。

第一百零六条 交易所的行情发布正常, 但因公共媒体转发发生故障, 影响会员和投资者交易, 交易所不承担责任。

第一百零七条 交易所、会员和指定交割仓库不得发布虚假的或带有误导性质的信息。

第一百零八条 交易所、会员、指定交割仓库、指定结算银行不得泄露业务中获取的商

业秘密。

交易所在经批准的情况下，可以向有关监管部门或其他相关单位提供相关信息，并执行相应的保密规定。

第一百零九条 为保证交易数据的安全，交易所必须建立异地数据备份。

第十一章 监督管理

第一百一十条 交易所依据本规则及有关规定，对涉及本所期货交易的业务活动进行监督管理。

第一百一十一条 交易所监督管理的主要内容是：

- （一）监督、检查期货市场政策、法规和交易规则的落实执行情况，控制市场风险；
- （二）监督、检查各会员业务行为及内部管理情况；
- （三）监督、检查各会员的财务、资信状况；
- （四）监督、检查各指定交割仓库和指定结算银行与期货有关的业务活动；
- （五）调解、处理期货交易纠纷，调查处理各种违规案件；
- （六）协助司法机关、行政执法机关依法执行公务；
- （七）对其他违背“公开、公平、公正”原则、制造市场风险的行为进行监控。

第一百一十二条 交易所每年对会员遵守交易所业务规则的情况进行抽样或者全面检查，并将检查结果上报中国证监会。

第一百一十三条 交易所发现有涉嫌违规行为的，应立案调查。

第一百一十四条 交易所履行监督管理职责时，可按有关规定行使调查、取证等权力，会员应当配合。

第一百一十五条 会员、投资者、指定交割仓库和指定结算银行应当接受交易所对其期货业务的监督管理。对于不如实提供资料、隐瞒事实真相、故意回避等不协助或妨碍交易所工作人员行使职权的，交易所按有关规定采取必要的限制性措施或处罚。

第一百一十六条 会员、投资者、指定交割仓库和指定结算银行在从事期货相关业务时涉嫌重大违规，交易所立案调查的，为防止违规行为后果进一步扩大，交易所可采取相应措施。

第一百一十七条 对期货交易过程中发生的重大问题，经理事会决定，可由会员代表、交易所工作人员及有关人士组成特别调查委员会。特别调查委员会存续期间，按本规则行使监督管理权。特别调查委员会实行回避制度。

第一百一十八条 交易所工作人员不能正确履行监督管理职责的，会员、投资者、指定交割仓库和指定结算银行有权向交易所或中国证监会投诉、举报。经查证属实的，应严肃处理。

第一百一十九条 交易所应制定违规查处办法对违规行为进行处理。

第十二章 争议处理

第一百二十条 会员、投资者、指定交割仓库和指定结算银行之间发生的有关期货业务纠纷，可自行协商解决，也可提请交易所调解。

第一百二十一条 提请交易所调解的当事人，应提出书面调解申请。交易所的调解意见经当事人确认，在调解意见书上签章后生效。

第一百二十二条 当事人也可依法向仲裁机构申请仲裁或向人民法院提起诉讼。

第十三章 附 则

- 第一百二十三条 交易所可根据本交易规则制定实施细则。
- 第一百二十四条 本交易规则解释权属于大连商品交易所理事会。
- 第一百二十五条 本交易规则的制定和修改须经会员大会通过，报中国证监会批准。
- 第一百二十六条 本规则自 2004 年 2 月 1 日起实施。

大连商品交易所信息管理办法

（2004年8月23日大连商品交易所第二届理事会第五次会议审议通过，2004年8月24日起实施）

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）信息的真实、准确和完整，规范交易所信息的发布、传播和使用，保护交易所的信息知识产权，根据《大连商品交易所交易规则》，制定本办法。

第二条 本办法所称信息是指在交易所期货交易活动中所产生的所有上市品种的期货交易行情、各种期货交易数据统计资料、交易所发布的各种公告和通知，以及中国证监会指定披露的其他相关信息。

第三条 交易所对信息享有所有权，交易所可以独立、与第三方合作或委托第三方对交易所信息进行经营管理。交易所对外信息实行有偿服务。

第四条 未经交易所授权许可，任何组织和个人不得以商业目的经营、传播和使用交易所信息。

第五条 本办法适用于交易所信息的发布、传播和使用。交易所、会员、信息公司、软件开发商、客户，以及其他传播和使用交易所信息的组织和个人必须遵守本办法。

第二章 信息内容及发布

第六条 交易所实行信息披露制度，交易所根据有关规定向会员和社会公众发布信息。

第七条 交易所根据信息内容实时、每日、每周、每月、每年发布信息。

第八条 实时信息是指与集中交易所显示的行情基本同步且连续的市场行情信息，即实时行情。主要内容有：

实时行情（见附件1）：商品名称、交割月份、最新价、涨跌、成交量、持仓量、申买价、申卖价、申买量、申卖量、结算价、开盘价、收盘价、最高价、最低价、前结算价。

第九条 每日信息是指每个交易日结束后发布的有关当日的期货交易信息。

每日信息主要内容有：

（一）每日行情（见附件2）：商品名称、交割月份、开盘价、最高价、最低价、收盘价、前结算价、结算价、涨跌、成交量、持仓量、持仓量变化、成交额。

（二）所有合约、所有会员的成交量、买卖持仓量及套期保值持仓量。

（三）交割信息：滚动交割、集中交割配对日结算后发布配对双方会员号、客户号、配对数量等信息；期转现交易的当日结算后发布配对双方会员号、客户号、配对数量等信息。

第十条 每周信息是指每周最后一个交易日结束后发布的有关本周的期货交易信息。

每周信息主要内容有：

（一）每周行情（见附件3）：商品名称、交割月份、周开盘价、最高价、最低价、周收盘价、涨跌（本周收盘价与上周末结算价之差）、持仓量、持仓量变化（本周末持仓量与上周末持仓量之差）、周末结算价、成交量、成交额。

（二）交割信息：每周最后交易日发布标准仓单数量及与上次发布数量相比的增减量。

第十一条 每月信息是指每月最后一个交易日结束后发布的有关本月的期货交易信息。

每月信息主要内容有：

每月行情（见附件 4）：商品名称、交割月份、月开盘价、最高价、最低价、月末收盘价、涨跌（本月末收盘价与上月末结算价之差）、持仓量、持仓量变化（本月末持仓量与上月末持仓量之差）、月末结算价、成交量、成交额。

第十二条 交易所通过会员服务系统、交易所互联网站等方式发布信息，并通过经交易所授权的信息公司、公共媒体等组织或个人发布信息。

第十三条 因不可抗力或不可归责于交易所的原因造成的信息传递中断，交易所不承担法律责任，但交易所将及时向公众作出解释，并尽快使之恢复正常。

第十四条 交易所、会员、信息公司、软件开发商等组织和个人对不宜公开的商业秘密等信息负有保密义务。交易所在经批准的情况下，可以向有关监管部门或其他相关单位提供相关信息，并执行相应的保密规定。

第十五条 交易所、会员、信息公司、公共媒体等组织和个人，均不得发布虚假的或带有误导性质的信息。

第三章 信息传播及使用

第十六条 欲传播交易所信息的组织和个人，必须向交易所提出书面申请，并与交易所签订交易所信息传播合同。欲使用交易所信息的组织和个人，必须从交易所和经交易所授权许可的组织和个人处获得。

第十七条 任何组织和个人传播交易所信息时，应保证其真实、准确、完整，并且在传播过程中明确说明信息来源于交易所。

第十八条 传播交易所信息的组织和个人，应防止其传播对象未经交易所许可进行交易所信息的再传播，并协助交易所对其传播对象进行监管。

第十九条 交易所所有权对传播和使用交易所信息的组织和个人进行调查，调查的范围包括信息传播和使用目的、方式、客户情况以及收费情况等内容。

第二十条 会员从交易所获得的信息只供其自身和客户交易使用，传播和使用范围只限于会员营业场所。

第二十一条 未经交易所许可，会员不得自行或与第三方合作再传播或经营交易所信息。会员对交易所提供的信息数据接口负有安全保密责任。

第四章 监督管理

第二十二条 对未经交易所许可，擅自传播和使用交易所信息的组织和个人，交易所除有权终止其传播和使用交易所信息外，保留通过法律途径追究其责任的权利。

第二十三条 已获交易所许可传播和使用交易所信息的组织和个人，如违反本办法，交易所将根据已签署的交易所信息传播和使用合同进行处理。

第二十四条 交易所会员如违反本办法，交易所将根据《大连商品交易所违规处理办法》，给予相应处罚。

第五章 附 则

第二十五条 本办法解释权属于大连商品交易所。

第二十六条 本办法自公布之日起实施。

大连商品交易所交易细则

(自 2015 年 5 月 8 日起施行)

第一章 总 则

第一条 为了规范期货交易行为，保护期货交易各方的合法权益，保障大连商品交易所（以下简称交易所）期货交易的顺利进行，根据《大连商品交易所交易规则》，制定本细则。

第二条 交易所、会员、客户应当遵守本细则。

第二章 席位管理

第三条 交易席位是会员将交易指令输入交易所计算机交易系统参与交易的通道。

交易席位分为场内交易席位和远程交易席位。远程交易是指会员在其营业场所，通过与交易所计算机交易系统联网的通信系统直接输入交易指令、参与交易所交易的一种交易方式。

第四条 会员在取得会员资格后，即取得一个场内交易席位。经交易所批准，可以增加交易席位。

会员增加交易席位应当向交易所缴纳席位使用费，具体标准由交易所制定并公布。

第五条 会员增加交易席位仅是增加该会员的交易通道，交易所对会员的持仓限额、风险控制及其他有关方面的管理规定不变。

第六条 会员申请增加场内交易席位，应当具备以下条件：

- （一）经营状况良好；
- （二）自申请之日起前三个月成交量连续排名前 50 位，或者从事交易所期货交易的单量较多；
- （三）交易所要求应具备的其他条件。

第七条 会员申请增加场内交易席位，应当通过会员服务系统与交易所签订协议，并向交易所提交增加交易席位申请，申请内容主要包括席位类型、接受回报范围等。

必要时，交易所可以要求会员提供其他资料。

第八条 增加场内交易席位申请经交易所同意后，会员应当在 10 个交易日内到交易所办理有关入场手续。无故逾期的，交易所所有权取消其申请增加的场内交易席位。

第九条 会员申请远程交易席位，应当具备下列条件：

- （一）经营状况良好；
- （二）申请经营机构所在地的通讯、资金划拨条件能满足交易所期货交易运作要求；
- （三）有健全的远程交易管理制度；
- （四）远程交易系统的建设和管理应符合中国证监会和交易所相关技术管理规范的要求。

第十条 会员申请远程交易席位，应当通过会员服务系统与交易所签订协议，并向交易所提交下列材料：

- （一）增加交易席位申请，申请内容主要包括席位类型、接受回报范围、安装地址、营业执照号等；
- （二）申请经营机构营业执照复印件；
- （三）远程交易系统基础设施及人员情况表；
- （四）交易所要求提供的其他资料。

第十一条 交易所应当自收到会员提交的远程交易席位申请材料之日起 20 个交易日内作出批复。

第十二条 会员应当在收到交易所同意其进行远程交易的批复后 10 个交易日内，向交易所缴纳席位使用费。无故逾期的，交易所所有权取消其申请的远程交易席位。

第十三条 会员提出远程交易系统开通申请后，由交易所通知会员具体开通日期。

第十四条 开通远程交易的会员，其场内交易席位继续保留，在交易时间内，会员远程交易席位不能正常使用时，会员应当通过场内交易席位进行交易。

会员如不委派出市代表进场，远程交易席位不能正常使用时，后果自负。

第十五条 会员应当加强对其远程交易的管理和远程交易系统的维护，并对交易所提供的软件接口和文档资料负有保密义务。主要设施需要更换或作技术调整时，应当事先征得交易所的同意。远程交易席位迁移出原登记备案地，应当事先报交易所审批。交易所所有权对远程交易席位的使用情况进行监督检查。

第十六条 有下列情况之一的，交易所可以取消会员增加的交易席位：

- （一）申请材料不真实的；

- (二) 将席位全部或者部分以出租或者承包等形式交由其他机构和个人使用的;
- (三) 管理混乱或者有严重违规行为的;
- (四) 已不具备使用增加交易席位条件的;
- (五) 利用增加交易席位从事交易以外的其他活动的;
- (六) 会员申请取消的;
- (七) 交易所认为应予以取消的其他情况。

第十七条 会员终止使用或者被交易所取消增加交易席位的, 使用费不予返还。

第十八条 如会员丧失交易所会员资格, 则其拥有的交易席位全部终止使用。

第十九条 由于计算机终端、通讯系统等交易设施发生故障, 致使 10%以上的会员不能交易时, 交易所应暂停交易, 直至故障消除为止。

第二十条 交易所在夜盘交易小节不办理席位申请、变更和撤销业务。

第三章 出市代表管理

第二十一条 出市代表是受会员委派并代表会员在交易大厅接受本会员的交易指令进行期货交易的人员, 其在交易大厅与交易有关的行为由会员负责。

第二十二条 出市代表应当具备下列条件:

- (一) 年满十八周岁, 具有完全民事行为能力;
- (二) 经交易所专业培训并取得合格证书;
- (三) 品行端正, 有良好的职业道德;
- (四) 没有刑事处罚记录。

第二十三条 办理出市代表证件应当通过会员服务系统录入交易所要求的身份证、期货从业资格证等相关信息。

第二十四条 每个交易席位限两名出市代表进场, 特殊情况应当经交易所批准。

第二十五条 出市代表可在每个交易日开市前 30 分钟内进入交易大厅做开市准备, 收市后 30 分钟内离开交易大厅。出市代表不得随意出入交易大厅, 特殊情况应当经场务管理人员批准。

交易期间出市代表不能空缺, 因空缺出现的后果由会员负责。

第二十六条 出市代表应当佩带有效证件、着指定的专用服装出入交易大厅。

第二十七条 出市代表应当爱护交易大厅内的各种设施,严格按照交易所有关交易大厅计算机设备管理规定操作,损坏者要照价赔偿并按有关规定处罚。

第二十八条 出市代表携带交易设备进出交易大厅应当经交易所批准。

第二十九条 出市代表应当服从交易所场务管理人员的管理。

第三十条 出市代表应当将交易所文件、通知等材料及时送交所在会员。

第三十一条 会员应当妥善保管交易密码,因交易密码泄露造成的后果由会员承担。

第三十二条 出市代表不得有下列行为:

- (一) 接受其他单位、个人的交易指令;
- (二) 为其他单位、个人提供咨询意见;
- (三) 为自己进行期货交易;
- (四) 借用、盗用其他会员的电话或交易终端;
- (五) 伪造、转借出市代表证;
- (六) 交易所禁止的其他行为。

第三十三条 会员辞退、更换出市代表或者出市代表离开原会员应当及时到交易所办理撤销委托手续,并交还出市代表证。会员如未能及时收回出市代表证,应当通知交易所有关部门,得到回执后,即可免除会员责任。因未及时处理撤销手续或者退回出市代表证所造成的后果由会员承担。

第三十四条 除会员合并、分立、破产以及经原会员同意外,被撤销出市代表授权的人员,交易所在三个月内不受理其到其他会员处任出市代表的注册申请。

第四章 交易时间、行情信息、交易指令和竞价原则

第三十五条 期货交易每周设 5 个交易日(遇国家法定假日除外),每一个交易日分为夜盘和日盘交易时段,夜盘交易设一个夜盘交易小节,具体交易时间由交易所另行通知;日盘交易分三个交易小节,分别为第一节 9:00-10:15、第二节 10:30-11:30 和第三节 13:30-15:00。开展夜盘交易的品种由交易所另行公布。

会员在完成人员配备、交易设施和业务制度等各项准备工作后,方可开展夜盘交易。夜盘交易只能通过远程交易席位进行。

第三十六条 交易所应当及时发布以下与交易有关的信息:

（一）开盘价。开盘价是指某一期货合约开市前五分钟内经集合竞价产生的成交价格。集合竞价未产生成交价格的，以开市后竞价交易第一笔成交价为开盘价。第一笔成交价格按《大连商品交易所交易规则》第六十条规定确定，此时前一成交价为上一交易日收盘价，新上市合约前一成交价为挂盘基准价。

（二）收盘价。收盘价是指某一期货合约当日交易的最后一笔成交价格。无成交合约当日收盘价为当日结算价。

（三）最高价。最高价是指一定时间内某一期货合约成交价中的最高成交价格。

（四）最低价。最低价是指一定时间内某一期货合约成交价中的最低成交价格。

（五）最新价。最新价是指某交易日某一期货合约交易期间的即时成交价格。

（六）涨跌。涨跌是指某交易日某一期货合约交易期间的最新价与上一交易日结算价之差。

（七）最高买价。最高买价是指某一期货合约当日买方申请买入的即时最高价格。

（八）最低卖价。最低卖价是指某一期货合约当日卖方申请卖出的即时最低价格。

（九）申买量。申买量是指某一期货合约当日交易所交易系统中未成交的最高价位申请买入的下单数量。

（十）申卖量。申卖量是指某一期货合约当日交易所交易系统中未成交的最低价位申请卖出的下单数量。

（十一）结算价。结算价是指某一期货合约当日交易期间成交价格按成交量的加权平均价。无成交合约当日结算价按照《大连商品交易所结算细则》相关规定确定。结算价是进行当日未平仓合约盈亏结算和确定下一交易日涨跌停板幅度的依据。

（十二）成交量。成交量是指某一合约在当日所有成交合约的双边数量。

（十三）持仓量。持仓量是指期货交易者的未平仓合约的双边数量。

第三十七条 新上市合约的挂盘基准价由交易所确定并提前公布。挂盘基准价是确定新上市合约第一个交易日涨（跌）停板的依据。

第三十八条 新上市合约的涨跌停板为合约规定的涨跌停板的两倍，如有成交，于下一交易日恢复到合约规定的涨跌停板；如当日无成交，下一交易日继续执行前一交易日涨跌停板。如连续三个交易日无成交，交易所可以对挂盘基准价作适当调整。

对曾经有成交而目前无持仓的合约，交易所可以公布新的基准价。

第三十九条 交易指令的种类：

（一）限价指令：指交易所计算机撮合系统执行指令时按限定价格或更好价格成交的指令。

（二）市价指令：指交易所计算机撮合系统执行指令时以涨（跌）停板价格参与交易的买（卖）指令。

（三）市价止损（盈）指令：指当市场价格触及客户预先设定触发价格时，交易所计算机撮合系统将其立即转为市价指令的指令。

（四）限价止损（盈）指令：指当市场价格触及客户预先设定触发价格时，交易所计算机撮合系统将其立即转为限价指令的指令。

（五）套利交易指令：交易所对指定合约提供套利交易指令，交易所计算机撮合系统收到指令后将指令内各成分合约按规定比例同时成交。套利交易指令分为同品种跨期套利和跨品种套利交易指令，各指令具体内容如下：

名 称

交易方式（从买方角度）

报价方式

同品种跨期套利交易指令

买入近月份合约，卖出同等数量远月份合约。

买（卖）套利价格 = 近月合约买（卖）申报价格 - 远月合约卖（买）申报价格

两个品种间套利交易指令

买入某品种某月份合约，卖出另一品种相同或不同月份合约。

买（卖）套利价格 = 第一品种买（卖）申报价格 - 第二品种卖（买）申报价格

压榨利润套利交易指令

卖大豆合约、买相同月份或不同月份豆粕和豆油合约

买（卖）套利价格 = 豆粕合约买（卖）申报价格 + 豆油合约买（卖）申报价格 - 大豆合约卖（买）申报价格

（六）交易所规定的其他指令。

鸡蛋合约交易指令每次最大下单数量为 300 手，焦炭合约交易指令每次最大下单数量为 500 手。黄大豆 1 号、黄大豆 2 号、豆粕、豆油、棕榈油、线型低密度聚乙烯、聚氯乙烯、焦煤、铁矿石、纤维板、胶合板、聚丙烯、玉米淀粉合约交易指令每次最大下单数量为 1000 手，玉米合约交易指令每次最大下单数量为 2000 手。

第四十条 市价指令和限价指令可以附加立即全部成交否则自动撤销和立即成交剩余指令自动撤销两种指令属性。

第四十一条 开设夜盘交易的品种，其开盘集合竞价在夜盘交易时段开市前 5 分钟内进行，日盘交易时段不再集合竞价。未开设夜盘交易的品种，其开盘集合竞价在日盘交易时段开市前 5 分钟内进行。集合竞价前 4 分钟为期货合约买、卖指令申报时间，后 1 分钟为集合竞价撮合时间。

第四十二条 在集合竞价申报和开市后竞价交易期间，交易所计算机撮合系统接受交易指令申报，交易指令的种类由交易所规定，并向市场公布。

在集合竞价撮合和竞价交易暂停期间，交易所计算机撮合系统不接受交易指令申报。

第四十三条 交易所计算机撮合系统自动将买卖申报指令按价格优先、时间优先的原则进行排序，当买入价大于、等于卖出价则自动撮合成交。同一交易编码同一合约持仓平仓顺序按开仓时间先开先平。

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，交易所强行平仓申报单优先其他平仓申报单。

第四十四条 集合竞价采用最大成交量原则，即以此价格成交能够得到最大成交量。高于集合竞价产生的价格的买入申报全部成交；低于集合竞价产生的价格的卖出申报全部成交；等于集合竞价产生的价格的买入或者卖出申报，至少有一方申报量完全成交。若有多个价位满足最大成交量原则，则开盘价取与前一交易日结算价最近的价格；新上市合约开盘价取与挂盘基准价最近的价格。

第四十五条 开盘集合竞价中的未成交申报单自动参与开市后竞价交易。

第四十六条 开市后撮合成交价等于买入价(bp)、卖出价(sp)和前一成交价(cp)三者中居中的一个价格。即：

当 $bp \geq sp \geq cp$ ，则最新成交价=sp；

当 $bp \geq cp \geq sp$ ，则最新成交价=cp；

当 $cp \geq bp \geq sp$ ，则最新成交价=bp。

第五章 交易编码制度

第四十七条 交易所实行交易编码制度。交易编码是指会员按照本细则编制的用于客户

进行期货交易的专用代码。

第四十八条 交易编码分非期货公司会员交易编码和客户交易编码。交易编码由会员号和客户号两部分组成。

第四十九条 客户交易编码由十二位数字构成,前四位数是会员号,后八位数是客户号。如客户交易编码为 000100001535,则会员号为 0001,客户号为 00001535。

第五十条 非期货公司会员交易编码和客户交易编码位数相同,但后八位是其会员号,如非期货公司会员的会员号为 120,则其非期货公司会员交易编码为 012000000120。

第五十一条 非期货公司会员交易编码与客户交易编码互不占用。

第五十二条 一个客户在交易所内只能有一个客户号,但可以在不同的期货公司会员开户。交易编码只能是会员号不同,而客户号必须相同。

第五十三条 期货公司会员应当按会员服务系统中关于客户资料录入的提示,输入客户资料信息的电子文档,不得跳栏或者漏输。期货公司会员变更客户资料或者注销交易编码,应当及时通过会员服务系统更换相应的资料信息。

期货公司会员通过以上电子文档方式将客户开户、变更及销户资料向交易所备案。期货公司会员应当保证备案客户资料的真实、准确。

第五十四条 期货公司会员在会员服务系统中录入客户开户资料后,客户交易编码由会员服务系统自动生成,经交易所确认后方可使用。

第五十五条 期货公司会员应当建立客户开户、变更及销户资料档案。客户开户资料包括:个人客户为《期货市场个人客户开户登记表》(见附件 1)和本人身份证复印件等;单位客户为《期货市场单位客户开户登记表》(见附件 2)和具有中国法人资格或其他经济组织资格的合法证件复印件等;客户销户资料包括:《期货市场客户销户申请表》(见附件 3)等。

期货公司会员对上述资料的保管期限不得少于 20 年。

第五十六条 有下列情况之一的,客户交易编码予以注销:

- (一) 客户备案资料不真实的;
- (二) 客户被认定为市场禁入者的;
- (三) 客户在期货公司已办理销户手续的;
- (四) 其他应予以注销的情形。

应注销的交易编码,期货公司会员应当在结算后通过会员服务系统销户。

第五十七条 客户提供虚假的开户资料或者期货公司会员协助客户使用虚假资料开户的，交易所责令期货公司会员限期平仓，平仓后注销该客户交易编码，同时按《大连商品交易所违规处理办法》的有关规定进行处理。

第五十八条 会员或者客户应当本着诚实信用原则，妥善管理交易编码。会员或者客户因交易编码管理不当，导致交易编码被他人利用实施违规行为的，交易所将根据有关规定进行处理。

第六章 附 则

第五十九条 本细则中所称时间均为北京时间，除本细则有明确的规定外，“日”均指交易日。

第六十条 违反本细则规定的，交易所按《大连商品交易所违规处理办法》的有关规定处理。

第六十一条 本细则解释权属于大连商品交易所。

第六十二条 本细则自公布之日起实施。（2015 年 5 月 4 日大商所发[2015]114 号文件发布修订部分自 2015 年 5 月 8 日起施行）

附件 1:
期货市场个人客户开户登记表

会员名称						
会员号	上海期货 交易所		大连商品 交易所		郑州商品 交易所	
个人开户申请（申请人填写）						
姓 名		性 别		年 龄		职 业
身份证号码				联系电话		
联系地址				邮政编码		
指令下达人						
姓 名		身份证号码			联系电话	
联系地址				邮政编码		
资金调拨人						
姓 名		身份证号码			联系电话	
联系地址				邮政编码		
结算单确认人						
姓 名		身份证号码			联系电话	
联系地址				邮政编码		
本人有能力承担风险，并保证资金来源的合法性和所提供资料的真实性。						
申请人签名：				申请日期： 年 月 日		
同意开户记录（会员填写）						
客 户 交易编码	上海期货 交易所		大连商品 交易所		郑州商品 交易所	
审批意见：						
会员盖章：		负责人签字：		审批日期： 年 月 日		

第一联：申请人留存

第二联：会员留存

附件 2:
期货市场单位客户开户登记表

会员名称						
会员号	上海期货交易所		大连商品交易所		郑州商品交易所	
单位客户开户申请（申请单位填写）						
单位名称				单位性质		
营业执照号（正本）				税务登记号		
法定代表人				注册资本		
开户银行				银行帐号		
经营范围						
联系地址				邮政编码		
联系人				联系电话		
开户授权人						
姓名		身份证号码			联系电话	
联系地址				邮政编码		
指令下达人						
姓名		身份证号码			联系电话	
联系地址				邮政编码		
资金调拨人						
姓名		身份证号码			联系电话	
联系地址				邮政编码		
结算单确认人						
姓名		身份证号码			联系电话	
联系地址				邮政编码		
本单位有能力承担风险，并保证资金来源的合法性和所提供资料的真实性。 申请单位盖章： 法定代表人签字： 申请日期： 年 月 日						
同意开户记录（会员填写）						
客户交易编码	上海期货交易所		大连商品交易所		郑州商品交易所	
审批意见： 会员盖章： 负责人签字： 审批日期： 年 月 日						

第一联：申请单位留存 第二联：会员留存

附件 3:

期货市场客户销户申请表

会员名称						
会 员 号	上海期货 交易所		大连商品 交易所		郑州商品 交易所	
个人客户销户申请（申请人填写）						
姓 名			身份证号码			
投 资 者 交易编码	上海期货 交易所		大连商品 交易所		郑州商品 交易所	
单位客户销户申请（申请单位填写）						
单位名称			营业执照注册号			
投 资 者 交易编码	上海期货 交易所		大连商品 交易所		郑州商品 交易所	
销户原因：						
1. 客户个案资料有误的； 2. 客户在期货公司已办理销户手续的； 3. 被认定为市场禁入者的； 4. 客户未办理撤户手续，但一年以上未发生任何交易的； 5. 在交易所规定的期限内不能补充客户交易编码资料的。						
本人/单位愿意注销在上述期货交易所的交易编码。 申请人签名： 法定代表人： 申请单位盖章： 申请日期： 年 月 日						
同意销户记录（会员填写）						
投 资 者 交易编码	上海期货 交易所		大连商品 交易所		郑州商品 交易所	
审批意见：						
会员盖章： 负责人签字： 审批日期： 年 月 日						

第一联：期货公司留存 第二联：申请人/申请单位留存

大连商品交易所结算细则

(2016年2月5日)

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》，制定本细则。

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，期货公司会员对客户进行结算。

第五条 本细则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、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）必须遵守本细则。

第二章 结算机构及其职责

第六条 交易所负责期货交易的统一结算、保证金管理、风险准备金管理及结算风险的防范。

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，保证期货合约的履行；
- （七）按规定管理保证金、风险准备金。

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的结算资料、财务报表及相关的凭证和账册进行检查时，会员应当予以配合。

第十条 会员必须设立结算部门。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) 办理有价证券的充抵保证金手续；
- (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。

交易所所有权对存管银行的期货结算业务进行监督。

第十八条 存管银行须符合以下条件：

- (一) 是全国性的商业银行，资金雄厚，信誉良好；
- (二) 在全国各主要城市设有分支机构和营业网点；
- (三) 有先进、快速的异地资金划拨手段；
- (四) 有完善的保证金管理制度；

(五) 有懂得期货知识、风险防范意识强的专业技术人员;

(六) 交易所认为必须具备的其他条件。

符合以上条件, 并经交易所同意成为存管银行后, 存管银行与交易所应签订相应协议, 明确双方的权利和义务, 以规范相关业务行为。

第十九条 存管银行的权利:

(一) 开设交易所专用结算账户和会员专用资金账户;

(二) 吸收交易所和会员的存款;

(三) 了解会员在交易所的资信情况。

第二十条 存管银行的义务:

(一) 向交易所提供会员专用资金账户的资金情况;

(二) 根据交易所提供的票据或指令优先划转会员的资金, 并及时将资金划转结果和相关账户变动信息反馈给交易所;

(三) 协助交易所核查会员资金的来源和去向;

(四) 向交易所及时通报本所标准仓单的质押情况及会员在资金结算方面的不良行为和风险;

(五) 在交易所出现重大风险时, 必须协助交易所化解风险;

(六) 根据中国证监会或交易所的要求, 对会员专用资金账户中的资金实行必要的监管措施;

(七) 保守交易所和会员的商业秘密;

(八) 接受交易所对其期货业务进行监督。

第二十一条 交易所在各存管银行开设专用结算账户, 用于存放会员保证金及相关款项。

第二十二条 会员须在存管银行开设专用资金账户, 用于存放保证金及相关款项。

第二十三条 会员应在其专用资金账户开户及变更前到结算部申请, 经交易所同意, 方可办理。

第二十四条 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。

第二十五条 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。

第二十六条 期货公司会员对客户存入会员专用资金账户的保证金实行分账管理, 为每

一客户设立明细账户，按日序时登记核算每一客户出入金、盈亏、交易保证金、手续费等。

第二十七条 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。

第二十八条 《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。

第二十九条 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。

第三十条 交易所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

第三十一条 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。

经交易所同意，会员可用标准仓单、可流通的国债和中国证监会认定的其他有价证券充抵保证金。

第三十二条 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。

第三十三条 期货公司会员结算准备金最低余额为 200 万元，以期货公司会员自有资金足额缴纳；非期货公司会员结算准备金最低余额为 50 万元。会员必须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。

第三十四条 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。

第三十五条 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，鸡蛋品种除外。

第三十六条 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。

第三十七条 期货公司会员代理客户交易，向客户收取的保证金属于客户所有，必须存放于会员专用资金账户，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客户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。

第三十八条 期货公司会员向客户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。

第三十九条 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，收取标准由交易所另行规定。

第四十条 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。

第四十一条 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 $\times$ （1 $\pm$ 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 $\times$ （1 $\pm$ 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。。

第四十二条 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 = $\sum [(\text{卖出平仓价} - \text{上一交易日结算价}) \times \text{卖出平仓量}] + \sum [(\text{上一交易日结算价} - \text{买入平仓价}) \times \text{买入平仓量}]$

平当日仓盈亏 = $\sum [(\text{当日卖出平仓价} - \text{当日买入开仓价}) \times \text{卖出平仓量}] + \sum [(\text{当日卖出开仓价} - \text{当日买入平仓价}) \times \text{买入平仓量}]$

持仓盈亏 = 历史持仓盈亏 + 当日开仓持仓盈亏

历史持仓盈亏 = $\sum [(\text{上一日结算价} - \text{当日结算价}) \times \text{卖出历史持仓量}] + \sum [(\text{当日结算价} - \text{上一日结算价}) \times \text{买入历史持仓量}]$

当日开仓持仓盈亏 = $\sum [(\text{卖出开仓价} - \text{当日结算价}) \times \text{卖出开仓量}] + \sum [(\text{当日结算价} - \text{买入开仓价}) \times \text{买入开仓量}]$

第四十三条 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。

手续费等各项费用从会员结算准备金中扣划。

第四十四条 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 + 当日实际可用充抵金额 - 上一交易日实际可用充抵金额 + 当日盈亏 + 入金 - 出金 - 手续费等

实际可用充抵金额的具体计算方法见本细则第五章的有关规定。

第四十五条 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。

第四十六条 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。

第四十七条 会员出金必须符合交易所规定。会员的出金标准为：

（一）当实际可用充抵金额大于等于交易保证金的 80%时

可出金额=货币资金-交易保证金×20%-结算准备金最低余额

（二）当实际可用充抵金额小于交易保证金的 80%时

可出金额=货币资金-（交易保证金-实际可用充抵金额）-结算准备金最低余额

交易所可根据市场风险状况对会员出金标准做适当调整。

第四十八条 有下列情况之一的会员和客户，交易所可限制会员出金：

（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）交易所认为必要的其他情况。

第四十九条 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。

第五十条 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。

第五十一条 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。

第五十二条 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。

第五十三条 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。

第五十四条 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）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，由期货公司会员和客户共同提出移仓申请，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、客户同意移仓的申请书以及客户持仓的详细清单。

第五十五条 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。

第五十六条 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。

第五十七条 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。

第五十八条 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。

第五十九条 会员当日结算准备金余额低于零或者持有有价证券充抵保证金的，不得办理移仓。

第四章 实物交割结算

第六十条 会员进行实物交割，应按规定向交易所交纳交割手续费。具体标准在交割细则中载明。

交割手续费从会员的结算准备金中扣划。

第六十一条 交割结算价根据不同交割方式确定。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。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。

第六十二条 交割款项按交割结算价结算。

第六十三条 在交割期内，买方会员未能如数解付货款，卖方会员未能如数交付标准仓单或提货单的，构成交割违约。

第六十四条 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。

对于鸡蛋以及交收标的为保税铁矿石以外的品种，开具增值税专用发票。

鸡蛋品种开具增值税普通发票。

铁矿石品种,交收标的为保税商品时,开具其他形式的发票或者交易所认可的其他单据。

第六十五条 卖方会员未在规定时间内提交增值税专用发票(普通)发票的,自应交而未交增值税专用发票(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发票(普通)发票的,视作不交增值税专用发票(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。

交割标的为保税铁矿石的,自卖方应交而未交发票或者交易所认可的其他单据的次日起,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,卖方会员仍未提交发票或者交易所认可的其他单据的,视作不交发票或者交易所认可的其他单据,交易所向卖方会员按货款金额 5%的比例收取赔偿金,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。

第六十六条 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;鸡蛋以外的品种,卖方会员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;鸡蛋品种,标准仓单交到交易所后,不清退卖方会员交割保证金;

(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。对于鸡蛋

以及交收标的为保税铁矿石以外的品种，交易所将货款的 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；对于铁矿石品种，交收标的为保税商品时，交易所将货款的 80%付给卖方会员，余款在卖方会员提交了其他形式的发票或者交易所认可的其他单据后结清；对于鸡蛋品种，买方客户对鸡蛋质量无异议的，在最后交割日后第 4 个交易日闭市后，交易所清退卖方会员交割保证金，将货款的 80%付给卖方会员，余款在卖方会员提交了增值税普通发票后结清；若买方客户对鸡蛋质量有异议或发生疫情的，按照《大连商品交易所交割细则》相关规定处理。

(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或者其他单据的具体事项，包括购货单位名称、购货单位地址、金额、开具增值税专用（普通）发票所需的纳税人登记号等信息通知卖方会员；

(九)对于鸡蛋以及交收标的为保税铁矿石以外的品种，配对日后 7 个交易日内，卖方会员应当将增值税专用发票交付买方会员；对于铁矿石品种，交收标的为保税商品时，配对日后 7 个交易日内，卖方会员应当将其他形式的发票或者交易所认可的其他单据交付买方会员；对于鸡蛋品种，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。

第六十七条 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。

第六十八条 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支付由交易双方自行协商确定,交易所对此不承担保证责任;

(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;

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

(六)标准仓单期转现批准日闭市后,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,对于交收标的为铁矿石以外的品种,余款在卖方会员提交了增值税专用发票后结清;对于铁矿石品种,交收标的为保税商品时,余款在卖方会员提交了其他形式的发票或者交易所认可的其他单据后结清;

(七)标准仓单期转现批准日后 7 个交易日内,卖方会员应向买方会员提交增值税专用发票。

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，并将全额货款的 80% 划转给卖方会员，交收标的为完税商品的，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，余款在卖方会员提交了其他形式的发票或者交易所认可的其他单据后结清；

(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；

(八) 交收日后 7 个交易日内，交收标的为完税商品的，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，卖方会员向买方会员提交其他形式的发票或者交易所认可的其他单据。

第五章 有价证券充抵保证金

第七十条 经交易所批准，以下有价证券可以充抵保证金：

- (一) 除鸡蛋品种外的标准仓单；
- (二) 可流通的国债；
- (三) 中国证监会认定的其他有价证券。

以前款规定的有价证券充抵保证金的，充抵的期限不得超过该有价证券的有效期限，并且每次充抵保证金的金额不得低于 10 万元。

第七十一条 标准仓单充抵保证金的，交易所以充抵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。

国债充抵保证金的，交易所以充抵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。

当充抵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。

第七十二条 有价证券充抵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%；
- (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。

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的充抵金额。

第七十三条 期货交易的相关亏损、费用、货款和税金等款项，应当以货币资金支付，不得以有价证券充抵的金额支付。

第七十四条 客户以有价证券充抵保证金的，会员应当将收到的有价证券提交交易所。

第七十五条 有价证券的充抵手续：

（一）申请：

会员办理有价证券充抵业务时，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《有价证券充抵专项授权书》。会员以客户的有价证券办理充抵业务时，应同时提交经客户签章的《客户专项授权书》。

（二）验证交存：

办理标准仓单充抵的会员须在充抵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：

核算有价证券充抵金额后，会员与交易所签定《大连商品交易所所有价证券充抵交易保证金协议书》。

（四）会员也可以通过电子方式办理充抵业务。

第七十六条 有价证券每次充抵最长期限为 6 个月。期满再次充抵的，应当重新办理手续。

第七十七条 出现下列情况之一的，交易所可以终止充抵协议并取消充抵额度：

- （一）办理充抵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）由于其他原因需要停止充抵的。

第七十八条 协议期内，会员可申请提前解除充抵，但应当在弥补应交保证金之后，方可解除充抵协议，取回充抵的有价证券。

第七十九条 协议期满，有价证券所充抵的保证金已被清偿时，会员方可终止充抵协议，取回充抵的有价证券。

充抵期满，当会员以有价证券充抵的保证金不能清偿时，交易所所有权按本细则和充抵协议的有关规定依法将充抵的有价证券兑现或变现，用于清偿其充抵的保证金和相关债务。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充抵的保证金和相关债务的，交易所所有权向会员追索。

第八十条 办理有价证券充抵保证金的，会员应当交纳充抵手续费，同时承担该有价证券在充抵期内发生的其他费用，如标准仓单对应的仓储费，以及需兑现或变现时发生的费用。充抵手续费标准由交易所确定。

第八十一条 当会员不履行或不能完全履行交易保证金债务时，交易所有权将该有价证券变现，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。

第八十二条 夜盘交易小节，交易所不受理有价证券充抵和解除充抵的业务申请、不办理相关业务。

第六章 风险与责任

第八十三条 会员对其在交易所成交的合约负有承担风险的责任。

第八十四条 风险防范实行两级负责制。交易所防范会员的风险，会员防范客户的风险。

第八十五条 会员不能履行合约责任时，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约为止；
- （四）将充抵的有价证券变现，用变现所得履约赔偿。

第八十六条 如采取前条措施后会员仍欠资金，交易所将按以下步骤履约赔偿：

- （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；
- （四）通过法律程序,继续对该会员追偿。

第八十七条 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。

第八十八条 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。

第八十九条 风险准备金必须按规定存储、管理。

第九十条 风险准备金的动用必须按规定的程序进行，按规定的用途使用，并报中国证监会备案。

第七章 附则

第九十一条 本细则中所称时间均为北京时间，除本细则有明确的规定外，“日”均指交易日。

第九十二条 违反本细则规定的，交易所按《大连商品交易所违规处理办法》的有关规

定处理。

第九十三条 本细则解释权属于大连商品交易所。

第九十四条 本细则自公布之日起实施。

大连商品交易所交割细则

(2016 年 2 月 5 日)

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》, 制定本细则。

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。

第四条 个人客户持仓和焦炭、焦煤、铁矿石非交割单位整数倍持仓不得交割。

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, 则按照本细则第二十四章有关规定进行处理。

对焦炭、焦煤、铁矿石合约, 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。

第五条 交易所上市的商品期货合约的交割业务按本细则进行, 交易所、会员、客户、指定交割仓库、指定质量检验机构等交割业务参与者应当遵守本细则。

第二章 期货转现货

第六条 期货转现货(以下简称期转现)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。

第七条 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)。《大连商

品交易所保税交割实施细则》对保税期转现具体流程有规定的，按照其规定执行。

鸡蛋品种只允许非标准仓单期转现。

第八条 提出期转现申请的客户必须是单位客户，鸡蛋以外的品种，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），鸡蛋品种非标准仓单期转现的期限为该合约上市之日起至最后交易日倒数第四个交易日（含当日）。

第九条 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。

第十条 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。

第十一条 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。

第十二条 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细则》和《大连商品交易所保税交割实施细则》，手续费按交割手续费标准收取。

第十三条 非标准仓单期转现的货物交收和货款支付由交易双方自行协商确定，交易所对此不承担保证责任，手续费按交易手续费标准收取。

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和货款支付证明。交易所所有权对交易双方的现货行为进行监督和核查。

第十四条 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。

第十五条 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。

第三章 提货单交割

第十六条 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。

铁矿石合约可采用提货单交割，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。

第十七条 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。

第十八条 提货单交割由会员代客户办理，非期货公司成员可自行办理。

客户提出提货单交割申请的总量不得超过其同方向持仓。

铁矿石合约每笔提货单交割申请的数量为 1 万吨或其整数倍。

第十九条 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。

第二十一条 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。

第二十二条 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。

第二十三条 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。

第二十四条 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。检验项目按本细则规定的铁矿石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 $10000 \div (1-6\%) = 10638$ （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 $a \times (1-8\%)$ 吨，溢短为 $[a \times (1-8\%) - 10000]$ （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。

第二十五条 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》（铁矿石合约的交收商品品质、数量确认书详见附件 20），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。

第二十六条 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。

第二十七条 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；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，并将全额货款的 80%划转给卖方，其余货款在卖方提交了其他形式的发票或者交易所认可的其他单据后结清。

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。

第二十八条 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。

第二十九条 交收标的为保税商品的，交易所按保税交割结算价为卖方开具《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，交易所按保税交割结算价为买方开具《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、交割方式等内容，交割方式中应当标注“提货单交割”。

第三十条 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。

第三十一条 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

第三十二条 黄大豆 1 号、黄大豆 2 号、豆粕、豆油、玉米、玉米淀粉合约适用滚动交割。

第三十三条 滚动交割是指在交割月第 1 个交易日至第 9 个交易日期间，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内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。

第三十四条 滚动交割由客户提出交割申请，会员代客户办理。

第三十五条 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。

（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。

第三十六条 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。

第三十七条 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。

第三十八条 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。

第三十九条 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细则》有关规定处理。

第四十条 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。

第四十一条 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。

第四十二条 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。

第四十三条 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，按本细则第二十四章的有关规定处理，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。

第五章 一次性交割

第四十四条 交易所上市的所有商品期货合约适用一次性交割。

第四十五条 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。

第四十六条 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。

第四十七条 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交割品种与标准仓单数量信息。

第四十八条 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，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：匹购买方和交割仓库。对任一交割仓库，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：

$$\text{买方平均持仓时间} = \frac{\sum \text{买方每手持仓时间}}{\text{买方总持仓量}}$$

交易所将满足买方意向后剩余的仓库仓单，与未提交交割意向和所提交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。

第三步，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。

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。

第四十九条 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。

对于鸡蛋以及交收标的为保税铁矿石以外的品种，交易所将货款的 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；对于铁矿石品种，交收标的为保税商品的，交易所将货款的 80%付给卖方会员，余款在卖方会员提交了其他形式的发票或者交易所认可的其他单据后结清。

对于鸡蛋品种，最后交割日后第 4 个交易日闭市前，买方客户对鸡蛋质量无异议的，交易所在闭市后清退卖方交割保证金，将货款的 80%付给卖方会员，余款在卖方会员提交了增值税普通发票后结清。最后交割日后第 4 个交易日闭市前，买方客户对某个交割仓库某批次鸡蛋质量有异议的，可以申请对该批次鸡蛋复检，该交割仓库中与其配对的卖方全部货款暂不支付。最后交割日后第 7 个交易日闭市前，交易所公布争议复检结果，若复检合格，交易所在闭市后清退卖方交割保证金，将该部分货款的 80%付给卖方会员，余款在卖方会员提交了增值税普通发票后结清。若根据《大连商品交易所交割细则》附件 23 鸡蛋交割质量标准中 4.3 的规定，卫生指标复检不合格，在最后交割日后第 12 个交易日闭市前，卖方在原交割仓库或买卖双方协商交割地点更换合格货物，换货时应当委托交易所指定质检机构，对鸡蛋全部交割质量指标检验，并且检验合格，交易所在最后交割日后第 12 个交易日闭市后，清退卖方交割保证金，将该部分货款的 80%付给卖方会员，余款在卖方会员提交了增值税普通发票后结清；卖方不能按时提供合格货物，则交割终止，交易所将卖方该部分鸡蛋合约价值 20%的交割保证金支付给买方，提货通知单对应的该部分货物归还卖方，退还买方货款。若卫生指标合格，仅其他指标存在问题，交易所在最后交割日后第 7 个交易日闭市后，清退卖方交割保证金，将该部分货款的 80%付给卖方会员，余款在卖方会员提交了增值税普通发票后结清，并按照本细则有关规定解决质量争议。

第五十条 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或者交易所认可的其他单据的具体事项，包括购货单位名称、地址、金额、开具增值税专用（普通）发票所需的纳税人登记号等信息通知卖方。对于鸡蛋以及交收标的为保

税铁矿石以外的品种，卖方应当在配对日后 7 个交易日内将增值税专用发票交付买方；对于铁矿石品种，交收标的为保税商品的，卖方应当在配对日后 7 个交易日内将其他形式的发票或者交易所认可的其他单据交付买方；对于鸡蛋品种，卖方在交易所支付 80% 货款后 7 个交易日内将相应的增值税普通发票交付买方。

第五十一条 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。

会员迟交或未提交交易所规定的发票或者其他单据的，按《大连商品交易所结算细则》有关规定处理。

第六章 黄大豆 1 号交割

第五十二条 黄大豆 1 号合约交割标准品、替代品的质量标准和质量升扣价详见附件 1 《大连商品交易所黄大豆 1 号交割质量标准（FA/DCE D001-2012）》。

黄大豆 1 号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 《大连商品交易所黄大豆 1 号指定交割仓库名录》），交易所可视情况对黄大豆 1 号指定交割仓库进行调整。

第五十三条 黄大豆 1 号合约升贴水的差价款由货主同指定交割仓库结算。

第五十四条 黄大豆 1 号可以采用散粮或麻袋包装进行交割。

第五十五条 黄大豆 1 号采用麻袋包装的，麻袋规定为长 $107 \pm 5\text{cm}$ 、宽 $74 \pm 3\text{cm}$ 不破、不漏的麻袋。麻袋卫生要求为无毒害物质污染，无油污，无霉变，无严重的煤灰、石灰、铁锈、泥土、水渍等污染。交易所可根据现货市场情况对包装物标准进行调整。

包装物上或随行文件中应注明产品的名称、类别、等级、产地、收获年度和月份。

包装物价格由交易所另行规定。包装费用由货主同指定交割仓库结算。

第五十六条 黄大豆 1 号包装物数量按每吨 11 条麻袋计算。麻袋重量按每条 0.9 公斤计重。

第五十七条 麻袋缝口可以是机器缝口或手工缝口。机器缝口必须达到两头锁紧双趟标准；手工缝口必须达到双线 16 针以上(含 16 针)标准。麻袋缝口质量达不到标准，可由指定交割仓库调换麻袋或对缝口加针，由此发生的费用由卖方货主承担。

第五十八条 黄大豆 1 号合约的交易价格为散粮价格。

第五十九条 会员办理交割预报时，应当按 10 元/吨向交易所交纳交割预报定金。

第六十条 办理完交割预报的货主在发货前，应当将车船号、品种、数量、到货时间等

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。

第六十一条 黄大豆 1 号收发重量以指定交割仓库检重为准。

第六十二条 指定交割仓库按照交易所有关规定对入库的黄大豆 1 号进行检验。检验结果为合格的，指定交割仓库将有关检验报告报交易所。交易所或者交易所委托质量检验机构对入库商品进行核查，确认无误后方为入库商品检验合格。

第六十三条 黄大豆 1 号标准仓单在每年的 3 月份最后 1 个交易日之前应当进行标准仓单注销。

第六十四条 黄大豆 1 号出库时，持有《提货通知单》或者提货密码的货主应当在实际提货日 3 个自然日前与指定交割仓库联系有关出库事宜，并在标准仓单注销日后 10 个工作日内（含当日）到指定交割仓库提货。

第七章 黄大豆 2 号交割

第六十五条 黄大豆 2 号合约交割标准品、替代品的质量标准和质量差异升扣价详见附件 3《大连商品交易所黄大豆 2 号交割质量标准（FB/DCE D001-2013）》。

黄大豆 2 号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 4《大连商品交易所黄大豆 2 号指定交割仓库名录》），交易所可视情况对黄大豆 2 号指定交割仓库进行调整。

第六十六条 黄大豆 2 号合约升贴水的差价款由货主同指定交割仓库结算。

第六十七条 黄大豆 2 号可以采用散粮或包粮进行交割，包粮的包装物为麻袋。包装物价格由交易所确定并在黄大豆 2 号合约上市时提前公布。

第六十八条 黄大豆 2 号合约的交易价格为散粮价格。包装款由货主同指定交割仓库结算。

第六十九条 麻袋规定为长 $107 \pm 5\text{cm}$ 、宽 $74 \pm 3\text{cm}$ 不破、不漏的麻袋。麻袋卫生要求为无毒害物质污染，无油污，无霉变，无严重的煤灰、石灰、铁锈、泥土、水渍等污染。交易所可根据现货市场情况对包装物标准进行调整。

包装物上或随行文件中应注明产品的名称、类别、等级、产地、收获年度和月份。

第七十条 黄大豆 2 号的包装物数量按每吨 11 条麻袋计算。麻袋重量按每条 0.9 公斤计重。

麻袋缝口可以是机器缝口或手工缝口。机器缝口必须达到两头锁紧双趟标准；手工缝口必须达到双线 16 针以上(含 16 针)标准。麻袋缝口质量达不到标准，可由指定交割仓库调换

麻袋或对缝口加针，由此发生的费用由卖方货主承担。

第七十一条 会员办理交割预报时，应当按 10 元/吨向交易所交纳交割预报定金。

第七十二条 办理完交割预报的货主在发货前，应当将车船号、品种、数量、到货时间等通知指定交割仓库，指定交割仓库应当合理安排接收商品入库。

第七十三条 黄大豆 2 号收发重量以指定交割仓库检重为准。

第七十四条 指定交割仓库按照交易所有关规定对入库的黄大豆 2 号进行检验。检验结果为合格的，指定交割仓库将有关检验报告报交易所。交易所或者交易所委托质量检验机构对入库商品进行核查，确认无误后方为入库商品检验合格。

第七十五条 黄大豆 2 号标准仓单在每年的 3 月份最后 1 个交易日之前应当进行标准仓单注销。

第七十六条 黄大豆 2 号出库时，持有《提货通知单》或者提货密码的货主应当在实际提货日 3 个自然日前与指定交割仓库联系有关出库事宜，并在标准仓单注销日后 10 个工作日内（含当日）到指定交割仓库提货。

第八章 豆粕交割

第七十七条 豆粕交割标准品的质量标准详见附件 5《大连商品交易所豆粕交割质量标准(F/DCE D001-2006)》。

豆粕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 6《大连商品交易所豆粕指定交割仓库名录》），交易所可视情况对豆粕指定交割仓库进行调整。

第七十八条 用于交割的豆粕在入库时，货主需向指定交割仓库提交豆粕的生产厂家、生产日期、产品检验员以及是否转基因的证明和标识，厂家质量检验报告复印件等。

第七十九条 豆粕包装为新的编织袋，编织袋的有效宽度为 625mm-725mm，有效长度为 1075mm-1225mm。编织袋要求不破、不漏。对包装物的卫生要求为无毒害物质污染，无油污，无霉变，无严重的煤灰、石灰、铁锈、泥土、水渍等污染。同一客户同一批次入库的豆粕包装要求规格统一。交易所可根据现货市场情况对包装物标准进行调整。

豆粕的每一袋包装上必须印有品名、厂家名称、厂家地址、厂家电话、重量的标识，并在编织袋上缝制印有生产日期的标签。

第八十条 豆粕包装物不计算件数，编织袋包装价格包含在合约交易价格中。

第八十一条 会员办理交割预报时，应当按 10 元/吨向交易所交纳交割预报定金。

第八十二条 办理完交割预报的货主在发货前，应当将车船号、品种、数量、到货时间

等通知指定交割仓库，指定交割仓库应当合理安排接收商品入库。

第八十三条 豆粕收发重量以指定交割仓库检重为准，检重时以地磅计量为准。

第八十四条 指定交割仓库按照交易所有关规定对入库的豆粕进行检验。检验结果为合格的，指定交割仓库将有关检验报告报交易所。交易所或者交易所委托质量检验机构对入库商品进行核查，确认无误后方为入库商品检验合格。

第八十五条 指定交割仓库按照交易所有关规定对入库的豆粕进行检验时，原则上以垛为单位进行抽样，但对同一厂家生产的同一批次的商品，以不超过 200 吨为单位进行抽样。

第八十六条 豆粕仓库标准仓单的申请注册日期距离商品生产日期不得超过 45（含 45）个自然日。

第八十七条 豆粕标准仓单在每年的 3、7、11 月份最后 1 个交易日之前应当进行标准仓单注销。

第八十八条 豆粕从仓库出库时，持有《提货通知单》或者提货密码的货主应当在实际提货日 3 个自然日前与指定交割仓库联系有关出库事宜，并在标准仓单注销日后 10 个工作日内（含当日）到指定交割仓库提货。

第八十九条 豆粕从厂库出库时，货主应当在标准仓单注销日后（不含注销日）的 4 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 4 个自然日内（含当日）开始发货。

豆粕出库时，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，并将样品保留至发货日后的 30 个自然日，作为发生质量争议时的处理依据。

第九章 豆油交割

第九十条 豆油交割标准品的质量标准详见附件 7《大连商品交易所豆油交割质量标准》。

豆油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 8《大连商品交易所豆油指定交割仓库名录》），交易所可视情况对豆油指定交割仓库进行调整。

第九十一条 会员办理交割预报时，应当按 30 元/吨向交易所交纳交割预报定金。

第九十二条 办理完交割预报的货主在发货前，应当将车船号、品种、数量、到货时间等通知指定交割仓库，指定交割仓库应当合理安排接收商品入库。

第九十三条 豆油收发重量以指定交割仓库检重为准，检重时汽运以地磅计量为准，火

车运输以火车罐打尺计量为准，船运以储油罐打尺计量为准。

第九十四条 指定交割仓库按照交易所有关规定对入库的豆油进行检验。检验结果为合格的，指定交割仓库将有关检验报告报交易所。交易所或者交易所委托质量检验机构对入库商品进行核查，确认无误后方为入库商品检验合格。

第九十五条 指定交割仓库按照交易所有关规定对入库的豆油进行检验时，应当以一个油池、一个油罐、一个车槽为一个检验单位。

第九十六条 豆油标准仓单在每年的3月份最后1个交易日之前应当进行标准仓单注销。

第九十七条 对于有精炼能力的仓库，豆油仓库标准仓单注销后，货主提出精炼要求的，仓库有义务代为进行大豆原油的精炼，精炼产品、精炼损耗和精炼费用由仓库和货主协商确定。

对于有精炼能力的厂库，豆油厂库标准仓单注销后，如果货主提出精炼要求，厂库有义务向其提供符合要求的精炼豆油，精炼产品、精炼损耗和精炼费用由厂库和货主协商确定。在这种情况下，发货时间和发货速度不需按交易所有关规定办理。厂库和货主应当进行书面确认并妥善保管，以备核查。

第九十八条 豆油从仓库出库时，持有《提货通知单》或者提货密码的货主应当在实际提货日3个自然日前与指定交割仓库联系有关出库事宜，并在标准仓单注销日后10个工作日内（含当日）到指定交割仓库提货。

第九十九条 豆油从厂库出库时，货主应当在标准仓单注销日后（不含注销日）的4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4个自然日内（含当日）开始发货。

豆油出库时，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，并将样品保留至发货日后的30个自然日，作为发生质量争议时的处理依据。

第十章 棕榈油交割

第一百条 棕榈油交割标准品的质量标准详见附件9《大连商品交易所棕榈油交割质量标准（F/DCE P002-2011）》。

棕榈油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10《大连商品交易所棕榈油指定交割仓库名录》），交易所可视情况对棕榈油指定交割仓库进行调整。

棕榈油合约升贴水的差价款由货主同指定交割仓库结算。

第一百零一条 会员办理交割预报时，应当按30元/吨向交易所交纳交割预报定金。

第一百零二条 办理完交割预报的货主在发货前，应当将车船号、品种、数量、到货时间等通知指定交割仓库，指定交割仓库应当合理安排接收商品入库。

第一百零三条 棕榈油收发重量以指定交割仓库检重为准，检重时汽运以地磅计量为准，火车运输以火车罐打尺计量为准，船运以储油罐打尺计量为准。

第一百零四条 指定交割仓库按照交易所有关规定对入库的棕榈油进行检验。检验合格后，指定交割仓库将有关检验报告报交易所。

第一百零五条 指定交割仓库按照交易所有关规定对入库的棕榈油进行检验时，应当以一个油池、一个油罐、一个车槽为一个检验单位。

第一百零六条 棕榈油标准仓单在每个交割月份最后交割日后 3 个交易日内应当进行标准仓单注销。

第一百零七条 棕榈油从仓库出库时，持有《提货通知单》或者提货密码的货主应当在实际提货日 5 个自然日前与指定交割仓库联系有关出库事宜，并在标准仓单注销日后 10 个工作日内（含当日）到指定交割仓库提货。

第一百零八条 棕榈油从厂库出库时，货主应当在标准仓单注销日后（不含注销日）的 4 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 4 个自然日内（含当日）开始发货。

棕榈油出库时，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，并将样品保留至发货日后的 15 个自然日，作为发生质量争议时的处理依据。

第十一章 玉米交割

第一百零九条 玉米合约交割标准品、替代品的质量标准和质量差异升扣价详见附件 11《大连商品交易所玉米交割质量标准（FC/DCE D001-2015）》。

玉米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 12《大连商品交易所玉米指定交割仓库名录》），交易所可视情况对玉米指定交割仓库进行调整。

第一百一十条 玉米合约升贴水的差价款由货主同指定交割仓库结算。

第一百一十一条 玉米可以采用散粮或包粮进行交割，包粮的包装物为麻袋。包装物价格由交易所确定并在玉米合约上市时提前公布。

第一百一十二条 玉米合约的交易价格为散粮价格。包装款由货主同指定交割仓库结算。

第一百一十三条 麻袋规定为长 $107 \pm 5\text{cm}$ 、宽 $74 \pm 3\text{cm}$ 不破、不漏的麻袋。麻袋卫生要求为无毒害物质污染，无油污，无霉变，无严重的煤灰、石灰、铁锈、泥土、水渍等污染。

交易所可根据现货市场情况对包装物标准进行调整。

包装物上或随行文件中应注明产品的名称、类别、等级、产地、收获年度和月份。

第一百一十四条 玉米的包装物数量按每吨 12 条麻袋计算。麻袋重量按每条 0.9 公斤计重。

麻袋缝口可以是机器缝口或手工缝口。机器缝口必须达到两头锁紧双趟标准；手工缝口必须达到双线 16 针以上(含 16 针)标准。麻袋缝口质量达不到标准，可由指定交割仓库调换麻袋或对缝口加针，由此发生的费用由卖方货主承担。

第一百一十五条 会员办理交割预报时，应当按 10 元/吨向交易所交纳交割预报定金。

第一百一十六条 办理完交割预报的货主在发货前，应当将车船号、品种、数量、到货时间等通知指定交割仓库，指定交割仓库应当合理安排接收商品入库。

玉米入库时，对于设立延伸库区的指定交割仓库，货主可以选择在主体库区或者在延伸库区入库。选择在延伸库区入库的货主应当与指定交割仓库协商向延伸库区发货的数量、主体库区与延伸库区的升贴水。指定交割仓库为在延伸库区入库的货物申请注册标准仓单的，应当向交易所提供交易所认可的银行履约担保函、现金保证金或者交易所认可的其它担保方式。标准仓单注册申请经会员确认，且指定交割仓库已经向交易所提供相关担保后，交易所审核通过后对标准仓单进行注册。

第一百一十七条 玉米收发重量以指定交割仓库检重为准。

第一百一十八条 指定交割仓库按照交易所有关规定对入库的玉米进行检验。检验结果为合格的，指定交割仓库将有关检验报告报交易所。交易所或者交易所委托质量检验机构对入库商品进行核查，确认无误后方为入库商品检验合格。

第一百一十九条 玉米标准仓单在每年的 3 月份最后 1 个交易日之前应当进行标准仓单注销。

第一百二十条 货物存放在有延伸库区的指定交割仓库的，客户在仓单注销前应与指定交割仓库联系确认如下事项：

（一）货物全部在主体库区的，按照第一百二十一条执行；

（二）货物全部或部分在延伸库区的，货主可以选择在主体库区或者有货物的延伸库区提货。货主选择在主体库区提货的，指定交割仓库负责将货物运达主体库区，运输等费用由指定交割仓库承担；货主选择在延伸库区提货的，应当与指定交割仓库协商确认在延伸库区提货的数量、主体库区与延伸库区的升贴水。货主应当在确认以上事项后 1 个工作日内注销

仓单。

货主未在标准仓单注销前与指定交割仓库联系确认的,视为在主体库区提货。

第一百二十一条 玉米出库时,持有《提货通知单》或者提货密码的货主应当在实际提货日 3 个自然日前与指定交割仓库联系有关出库事宜,并在标准仓单注销日后 10 个工作日内(含当日)到指定交割仓库提货。

第一百二十二条 延伸库区的货物在主体库区出库时,指定交割仓库应当在标准仓单注销后 10 个自然日内将商定数量的货物全部运达主体库区。货物由延伸库区向主体库区运输期间,指定交割仓库不收取仓储费,并向货主支付延时补偿金。

延时补偿金=0.5 元/吨?天×商定由延伸库区运达主体库区的商品数量×天数

货物全部运达后,指定交割仓库以传真方式通知货主提货并电话确认,传真发出时间即为货物运达时间。货主应当在接到指定交割仓库的提货通知后 10 个工作日内到主体库区提货。指定交割仓库自通知货主提货后的第 4 个工作日开始,按现货标准收取仓储费。

指定交割仓库超过 10 个自然日未将货物运到主体库区的,对于未运达数量,应当向货主支付违约金。

违约金=商定但未由延伸库区运达主体库区的商品数量×最近已交割月份交割结算价×5%

指定交割仓库支付违约金后,对于未由延伸库区运达主体库区的商品,货主可以选择以下两种方式进行处理:

(一)指定交割仓库向客户提供相同质量和数量的现货商品,并承担延期发货产生的全部费用。

(二)货主自行到延伸库区提货,指定交割仓库承担延期发货产生的全部费用。

(玉米延伸交割自 C1701 合约开始施行)

第十二章 线型低密度聚乙烯交割

第一百二十三条 线型低密度聚乙烯合约标准交割品的质量标准和包装物要求详见附件 13《大连商品交易所线型低密度聚乙烯交割质量标准(F/DCE L001-2007)》。

原产厂家认定的不合格产品和以回收料为原料生产的线型低密度聚乙烯不允许交割。

交易所推荐境内厂家生产的推荐牌号的线型低密度聚乙烯,货主能够提供符合交割质量标准的生产厂家出具的产品质量证明原件和《质量承诺书》(具体格式见附件 33)原件及交易所规定的其他材料的,经指定交割仓库审核同意后,可免于质量检验。推荐厂家推荐牌号的

企业资格与名录由交易所确定并公布。产品质量证明应载有生产厂家、牌号、批号、签证日期、质量测试项目、质量测试结果和质量检验结论等信息。

线型低密度聚乙烯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 14《大连商品交易所线型低密度聚乙烯指定交割仓库名录》），交易所可视情况对线型低密度聚乙烯指定交割仓库进行调整。

第一百二十四条 线型低密度聚乙烯包装物价格包含在线型低密度聚乙烯合约价格中。

第一百二十五条 线型低密度聚乙烯交割品每袋净重 $25 \pm 0.2\text{Kg}$ ，每吨 40 袋，不计溢短。

第一百二十六条 会员办理交割预报时，应当按 30 元/吨向交易所交纳交割预报定金。

第一百二十七条 办理完交割预报的货主在发货前，应当将车船号、品种、数量、到货时间等通知指定交割仓库，指定交割仓库应当合理安排接收商品入库。

第一百二十八条 指定交割仓库应当委托交易所指定的质量检验机构对入库商品进行质量检验。检验费用由货主承担，由指定交割仓库负责转交。

第一百二十九条 质量检验应当以同一厂家、同一牌号进行组批，每批 300 吨，超过 300 吨的应分若干批检验，不足 300 吨的按一批检验。

第一百三十条 交易所指定的质量检验机构完成入库线性低密度聚乙烯质量检验后，应当出具检验报告正本一份，副本三份，并将正本提交指定交割仓库，向交易所和货主分别提交副本一份。

第一百三十一条 指定交割仓库应当按照交易所有关规定对入库线型低密度聚乙烯的厂家、牌号、质量、包装及相关材料和凭证进行验收。

第一百三十二条 线型低密度聚乙烯收发数量以指定交割仓库核对为准。

第一百三十三条 境内生产的线型低密度聚乙烯申请注册仓库标准仓单的，申请注册日期距商品生产日期不得超过 180（含 180）个自然日。

境外生产的线型低密度聚乙烯申请注册仓库标准仓单的，申请注册日期距商品《进口货物报关单》进口日期（或者《进境货物备案清单》进境日期）不得超过 180（含 180）个自然日。

第一百三十四条 线型低密度聚乙烯标准仓单在每年的 3 月份最后 1 个交易日之前应当进行标准仓单注销。

第一百三十五条 线型低密度聚乙烯出库时，持有《提货通知单》或者提货密码的货主应当在实际提货日 3 个自然日前与指定交割仓库联系有关出库事宜，并在标准仓单注销日后

10 个工作日内（含当日）到指定交割仓库提货。

第十三章 聚氯乙烯交割

第一百三十六条 聚氯乙烯标准品为质量标准符合国家标准《悬浮法通用型聚氯乙烯树脂（GB/T 5761-2006）》的 SG5 型一等品。优等品作为替代品允许交割，优等品和一等品之间不设等级升贴水。

聚氯乙烯交割品应当是在交易所注册的生产厂家生产的交割注册品牌的商品。满足交易所规定条件的交割注册品牌可以申请免检注册品牌。交割注册品牌、免检注册品牌、相关生产厂家以及品牌升贴水由交易所另行公布。

（聚氯乙烯交割注册品牌制度自 V1604 合约开始施行）

第一百三十七条 免检注册品牌的聚氯乙烯入库时，货主能够提供生产厂家出具的产品质量证明原件及交易所规定的其他材料的，可免于质量检验。

产品质量证明应载有生产厂家、牌号、批号、签证日期、质量测试项目、质量测试结果和质量检验结论等信息。

第一百三十八条 聚氯乙烯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 15《大连商品交易所聚氯乙烯指定交割仓库名录》），交易所可视情况对聚氯乙烯指定交割仓库进行调整。

第一百三十九条 聚氯乙烯交割品要求使用原生产厂家或者其认可的包装，包装袋上应标明商标、产品名称、产品标准号、净质量、生产厂名称及地址，并标识产品型号。

包装材料为内衬塑料薄膜袋的牛皮纸袋、聚丙烯编制袋或牛皮纸与聚丙烯编制物复合袋，应保证产品在正常贮运中包装不破损，产品不被污染，不泄漏。每袋净重 $25 \pm 0.2\text{kg}$ ，每吨 40 袋，不计溢短。

第一百四十条 聚氯乙烯包装物价格包含在聚氯乙烯合约价格中。

第一百四十一条 会员办理交割预报时，应当按 30 元/吨向交易所交纳交割预报定金。

第一百四十二条 办理完交割预报的货主在发货前，应当将车船号、品种、数量、到货时间等通知指定交割仓库，指定交割仓库应当合理安排接收商品入库。

第一百四十三条 指定交割仓库应当委托交易所指定的质量检验机构对入库商品进行质量检验。检验费用由货主承担，由指定交割仓库负责转交。

第一百四十四条 质量检验应当以同一厂家、同一牌号进行组批，每批 300 吨，超过 300 吨的应分若干批检验，不足 300 吨的按一批检验。

检验方法按 GB/T 5761-2006 中第 5 项规定的试验方法执行，采样规则要求符合 GB/T 6679-2003 固体化工产品采样通则。

第一百四十五条 交易所指定的质量检验机构完成入库聚氯乙烯质量检验后，应当出具检验报告正本一份，副本三份，并将正本提交指定交割仓库，向交易所和货主分别提交副本一份。

第一百四十六条 指定交割仓库应当按照交易所有关规定对入库聚氯乙烯的厂家、牌号、质量、包装及相关材料和凭证进行验收。

注册聚氯乙烯期货标准仓单时，货主应提供对应的增值税专用发票复印件，指定交割仓库应当核实货物来源。

第一百四十七条 聚氯乙烯收发数量以指定交割仓库核对为准。

第一百四十八条 境内生产的聚氯乙烯申请注册仓库标准仓单的，申请注册日期距商品生产日期不得超过 120（含 120）个自然日。

境外生产的聚氯乙烯申请注册仓库标准仓单的，申请注册日期距商品《进口货物报关单》进口日期（或者《进境货物备案清单》进境日期）不得超过 120（含 120）个自然日。

第一百四十九条 聚氯乙烯标准仓单在每年的 3 月份最后 1 个交易日之前应当进行标准仓单注销。

第一百五十条 聚氯乙烯出库时，持有《提货通知单》或者提货密码的货主应当在实际提货日 3 个自然日前与指定交割仓库联系有关出库事宜，并在标准仓单注销日后 10 个工作日内（含当日）到指定交割仓库提货。

第十四章 焦炭交割

第一百五十一条 焦炭合约交割标准品、替代品的质量标准和质量升贴水详见附件 16 《大连商品交易所焦炭交割质量标准（F/DCE J001-2011）》。

焦炭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 17 《大连商品交易所焦炭指定交割仓库名录》),交易所可视情况对焦炭指定交割仓库进行调整。

第一百五十二条 焦炭合约升贴水的差价款由货主同指定交割仓库结算。

第一百五十三条 焦炭合约交割单位为 1000 吨。

第一百五十四条 会员办理交割预报时，应当按 30 元/吨向交易所交纳交割预报定金。

第一百五十五条 办理完交割预报的货主应当在入库前 3 个自然日之前，将车船号、品种、数量、到货时间等通知指定交割仓库，指定交割仓库应当合理安排接收商品入库。

第一百五十六条 指定交割仓库应当委托交易所指定的质量检验机构对入库商品进行质量检验。

货主应当在入库前 3 个自然日之前，将到货方式、到货数量、到货时间通知指定交割仓库。指定交割仓库应当在收到货主入库通知后，将以上信息通知指定质量检验机构，并在委托质检协议中列明。委托质检协议中还应当明确昼夜作业费用、指定交割仓库通知指定质量检验机构焦炭入库的方式、检验数量、出具检验报告的时间以及因指定质量检验机构未及时到场造成损失的责任承担等内容。检验费用由货主承担，由指定交割仓库负责转交。

第一百五十七条 焦炭抽样应当在入库堆垛时的焦炭流中进行。

最小抽样数量为 3000 吨，不足 3000 吨的按照 3000 吨计算费用。

第一百五十八条 焦炭收发重量以指定交割仓库检重为准，检重时以地磅或轨道衡计量为准。指定交割仓库根据交易所指定的质量检验机构出具的焦炭水分检验结果，按照焦炭合约的规定对重量进行折算，并以此作为出具仓单的依据。

第一百五十九条 交易所指定的质量检验机构完成入库焦炭质量检验后，应当出具检验报告正本一份，副本三份，并将正本提交指定交割仓库，向交易所和货主分别提交副本一份。

第一百六十条 指定交割仓库应当按照交易所有关规定对入库焦炭的质量等相关材料和凭证进行验收。

第一百六十一条 焦炭标准仓单在每年的 3 月份最后 1 个交易日之前应当进行标准仓单注销。

第一百六十二条 焦炭从仓库出库时，持有《提货通知单》或者提货密码的货主应当在实际提货日 3 个自然日前与指定交割仓库联系有关出库事宜，并在标准仓单注销日后 10 个工作日内（含当日）到指定交割仓库提货。

第一百六十三条 焦炭出库时，指定交割仓库应当向货主出具由指定交割仓库检验的水分实测结果，并出示仓单注册时的质量检验报告。

指定交割仓库按照水分实测结果和《大连商品交易所焦炭交割质量标准（F/DCE J001-2011）》规定，折算成出库重量后足量发货。

指定交割仓库可以依据仓单注册时的质量检验报告与客户结算质量升贴水，也可以经双方协商抽样、留样，在出库后的 15 日内双方对焦炭质量无异议的，依据仓单注册时的质量检验报告与客户结算质量升贴水；一方或双方对焦炭质量有异议的，以此样品检验结果作为与客户结算质量升贴水的依据。

第一百六十四条 货主对指定交割仓库实测水分有争议的，应当选择指定质检机构到场检验，并以该检验结果作为出库计重依据。

货主对焦炭质量检验结果有争议的，可以选择以下两种方式之一抽样、留样，并依据《大连商品交易所标准仓单管理办法》第五十四规定，以该样品检验结果作为解决争议的依据：

- （一）继续出库，并选择指定质检机构到场在焦炭流中抽样、留样；
- （二）选择指定质检机构采取开垛、倒垛等方式抽样。

质量检验费用由货主先行垫付。检验结果与指定交割仓库出示的检验结果相符，由此产生的一切费用（检验费和差旅费等）和损失由货主负担；检验结果与指定交割仓库出示的检验结果不相符，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。

第一百六十五条 焦炭从厂库出库时，货主应当在标准仓单注销日后（不含注销日）的 4 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 4 个自然日内（含当日）开始发货。

厂库发货时应当向货主提供对应货物的厂家质检报告原件，作为结算质量升贴水的依据。

焦炭出库时，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，并将样品保留至发货日后的 30 个自然日，作为发生质量争议时的处理依据。

第十五章 焦煤交割

第一百六十六条 焦煤合约交割标准品、替代品的质量标准和质量升贴水详见附件 18 《大连商品交易所焦煤交割质量标准（F/DCE JM001-2013）》。

焦煤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 19 《大连商品交易所焦煤指定交割仓库名录》),交易所可视情况对焦煤指定交割仓库进行调整。

第一百六十七条 焦煤合约升贴水的差价款由货主同指定交割仓库结算。

第一百六十八条 焦煤合约交割单位为 6000 吨。

第一百六十九条 会员办理交割预报时，应当按 30 元/吨向交易所交纳交割预报定金。

第一百七十条 办理完交割预报的货主应当在入库前 3 个自然日之前，将车船号、品种、数量、到货时间等通知指定交割仓库，指定交割仓库应当合理安排接收商品入库。

第一百七十一条 指定交割仓库应当委托交易所指定的质量检验机构对入库商品进行质量检验。

货主应当在入库前 3 个自然日之前，将到货方式、到货数量、到货时间通知指定交割仓

库。指定交割仓库应当在收到货主入库通知后，将以上信息通知指定质量检验机构，并在委托质检协议中列明。委托质检协议中还应当明确昼夜作业费用、指定交割仓库通知指定质量检验机构焦煤入库的方式、检验数量、出具检验报告的时间以及因指定质量检验机构未及时到场造成损失的责任承担等内容。检验费用由货主承担，由指定交割仓库负责转交。

第一百七十二条 焦煤抽样应当在入库堆垛时的焦煤流中进行。

第一百七十三条 焦煤收发重量以指定交割仓库检重为准，检重时以地磅或轨道衡计量为准。指定交割仓库根据交易所指定的质量检验机构出具的焦煤水分检验结果，按照《大连商品交易所焦煤交割质量标准（F/DCE JM001-2013）》的规定对重量进行折算，并以此作为出具仓单的依据。

第一百七十四条 交易所指定的质量检验机构完成入库焦煤质量检验后，应当出具检验报告正本一份，副本三份，并将正本提交指定交割仓库，向交易所和货主分别提交副本一份。

第一百七十五条 指定交割仓库应当按照交易所有关规定对入库焦煤的质量等相关材料和凭证进行验收。

第一百七十六条 焦煤标准仓单在每个交割月份最后交割日后 3 个工作日内应当进行标准仓单注销。

第一百七十七条 焦煤从仓库出库时，持有《提货通知单》或者提货密码的货主应当在实际提货日 3 个自然日前与指定交割仓库联系有关出库事宜，并在标准仓单注销日后 10 个工作日内（含当日）到指定交割仓库提货。

第一百七十八条 焦煤出库时，指定交割仓库应当向货主出具由指定交割仓库检验的水分实测结果，并出示仓单注册时的质量检验报告。

指定交割仓库按照水分实测结果和《大连商品交易所焦煤交割质量标准（F/DCE JM001-2013）》规定，折算成出库重量后足量发货。

指定交割仓库可以依据仓单注册时的质量检验报告与客户结算质量升贴水。双方也可以协商抽样、留样，在出库后的 15 日内双方对焦煤质量无异议的，依据仓单注册时的质量检验报告与客户结算质量升贴水；一方或双方对焦煤质量有异议的，以此样品检验结果作为与客户结算质量升贴水的依据。样品检验结果与仓单注册时检验结果存在差异但在国标误差规定范围内的，以仓单注册时的质量检验报告为准。

第一百七十九条 货主对指定交割仓库实测水分有争议的，应当选择指定质检机构到场检验，并以该检验结果作为出库计重依据。

货主对焦煤质量检验结果有争议的，可以选择以下两种方式之一抽样、留样：

- （一）继续出库，并选择指定质检机构到场在焦煤流中抽样、留样；
- （二）选择指定质检机构采取开垛、倒垛等方式抽样。

双方应当依据《大连商品交易所标准仓单管理办法》第五十四条规定，以该样品检验结果作为解决争议的依据，如果该样品检验结果与仓单注册时检验结果存在差异但在国标误差规定范围内的，则视为与指定交割仓库出示的检验结果相符，并以此作为解决争议的依据。

质量检验费用由货主先行垫付。检验结果与指定交割仓库出示的检验结果相符，由此产生的一切费用（检验费和差旅费等）和损失由货主负担；检验结果与指定交割仓库出示的检验结果不相符，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。

第一百八十条 焦炭从厂库出库时，货主应当在标准仓单注销日后（不含注销日）的 4 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 4 个自然日内（含当日）开始发货，根据货主合理要求提供送货服务，并与货主协商运费、损耗等。

厂库应当按合约要求的入库质量标准发货，并应当向货主提供对应货物的厂家质检报告原件，作为结算质量升贴水的依据。

焦煤出库时，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，并将样品保留至发货日后的 15 个自然日，作为发生质量争议时的处理依据。

第十六章 铁矿石交割

第一节 一般规定

第一百八十一条 铁矿石交割可以采用提货单交割或标准仓单交割。

提货单交割和完税标准仓单交割按照本细则相关规定执行。保税标准仓单交割按照《大连商品交易所保税交割实施细则》相关规定执行。

第一百八十二条 铁矿石合约交割标准品、替代品的质量标准和质量升贴水详见附件 21 《大连商品交易所铁矿石交割质量标准（F/DCE I001-2013）》。

第二节 铁矿石标准仓单交割

第一百八十三条 铁矿石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 22 《大连商品交易所铁矿石指定交割仓库名录》),交易所可视情况对铁矿石指定交割仓库进行调整。

第一百八十四条 铁矿石交割升贴水的差价款由货主同指定交割仓库结算。

第一百八十五条 铁矿石合约交割单位为 10000 吨。

第一百八十六条 会员办理交割预报时，应当按 20 元/吨向交易所交纳交割预报定金。

第一百八十七条 办理完交割预报的货主应当在入库前 3 个自然日之前，将车船号、品种、数量、到货时间等通知指定交割仓库，指定交割仓库应当合理安排接收商品入库。

第一百八十八条 指定交割仓库应当委托交易所指定的质量检验机构对入库商品进行质量检验。

货主应当在入库前 3 个自然日之前，将到货方式、到货数量、到货时间通知指定交割仓库。指定交割仓库应当在收到货主入库通知后，将以上信息通知指定质量检验机构，并在委托质检协议中列明。委托质检协议中还应当明确昼夜作业费用、指定交割仓库通知指定质量检验机构铁矿石入库的方式、检验数量、出具检验报告的时间以及因指定质量检验机构未及时到场造成损失的责任承担等内容。检验费用由货主承担，由指定交割仓库负责转交。

第一百八十九条 铁矿石抽样应当在入库堆垛时的铁矿石流中进行。

第一百九十条 铁矿石收发重量以指定交割仓库检重为准，检重时以地磅、轨道衡、水尺或其他买卖双方认可的计量方式为准。指定交割仓库根据交易所指定的质量检验机构出具的铁矿石水分检验结果，按照干基对重量进行折算，并以此作为出具标准仓单的依据。

第一百九十一条 交易所指定的质量检验机构完成铁矿石质量检验后，应当出具检验报告正本一份，副本三份，并将正本提交指定交割仓库，向交易所和货主分别提交副本一份。

第一百九十二条 指定交割仓库应当按照交易所有关规定对入库铁矿石的质量等相关材料和凭证进行验收。

第一百九十三条 铁矿石标准仓单在每年的 3 月份最后 1 个交易日之前应当进行标准仓单注销。

第一百九十四条 铁矿石从仓库出库时，持有《提货通知单》或者提货密码的货主应当在实际提货日 3 个自然日前与指定交割仓库联系有关出库事宜，并在标准仓单注销日后 10 个工作日内（含当日）到指定交割仓库提货。

第一百九十五条 铁矿石出库时，指定交割仓库应当向货主出具由指定交割仓库检验的水分实测结果，并出示仓单注册时的质量检验报告。

指定交割仓库按照水分实测结果和《大连商品交易所铁矿石交割质量标准（F/DCE I001-2013）》规定，折算成出库重量后足量发货。

指定交割仓库可以依据仓单注册时的质量检验报告与客户结算质量升贴水，也可以经双方协商抽样、留样，在出库后的 15 个自然日内双方对铁矿石质量无异议的，依据仓单注册

时的质量检验报告与客户结算质量升贴水；一方或双方对铁矿石质量有异议的，以此样品检验结果作为指定交割仓库与客户结算质量升贴水的依据。

第一百九十六条 货主对指定交割仓库实测水分有争议的，应当选择指定质检机构到场检验，并以该检验结果作为出库计重依据。

货主对铁矿石质量检验结果有争议的，可以选择以下两种方式之一抽样、留样，并依据《大连商品交易所标准仓单管理办法》第五十四条规定，以该样品检验结果作为解决争议的依据：

- （一）继续出库，并选择指定质检机构到场在矿石流中抽样、留样；
- （二）选择指定质检机构采取开垛、倒垛等方式抽样。

质量检验费用由货主先行垫付。检验结果与指定交割仓库出示的检验结果相符，由此产生的一切费用（检验费和差旅费等）和损失由货主负担；检验结果与指定交割仓库出示的检验结果不相符，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。

第一百九十七条 铁矿石从厂库出库时，货主应当在标准仓单注销日后（不含注销日）的 4 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 4 个自然日内（含当日）开始发货。

厂库应当按合约要求的交割质量标准发货，并应当向货主提供对应货物的厂家质检报告原件，作为结算质量升贴水的依据。

铁矿石出库时，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，并将样品保留至发货日后的 15 个自然日，作为发生质量争议时的处理依据。

第十七章 鸡蛋交割

（注：自 JD1703 合约开始执行修订后的鸡蛋交割制度，详见大商所发[2015]290 号文件）

第一百九十八条 鸡蛋合约交割标准品、替代品的质量标准和质量升贴水详见附件 23 《大连商品交易所鸡蛋交割质量标准（F/DCE JD001-2013）》。

鸡蛋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 24 《大连商品交易所鸡蛋指定交割仓库名录》），交易所可视情况对鸡蛋指定交割仓库进行调整。

第一百九十九条 交易所推荐品牌鸡蛋符合规定条件时，可免检入库，鸡蛋推荐品牌的企业资格、免检条件和名录交易所另行公布。

第二百条 鸡蛋合约升贴水的差价款由货主同指定交割仓库结算。

第二百零一条 同一货主入库的鸡蛋应采用重量统一的纸箱和蛋托包装，纸箱和蛋托质

量应符合鸡蛋交割质量标准规定。

第二百零二条 鸡蛋合约交割单位为 5 吨。

第二百零三条 会员办理交割预报时，应当按 30 元/吨向交易所交纳交割预报定金。

第二百零四条 办理完交割预报的货主应当在入库前 3 个自然日之前，将车船号、品种、数量、到货时间等通知指定交割仓库，指定交割仓库应当合理安排接收商品入库。

第二百零五条 鸡蛋入库质量检验由指定交割仓库委托交易所指定的质量检验机构进行。

货主应当在到货前 3 个自然日之前，将到货方式、到货数量、到货时间通知指定交割仓库。指定交割仓库应当在收到货主入库通知后，将以上信息通知指定质量检验机构，并在委托质检协议中列明。委托质检协议中还应当明确检验费用、昼夜作业费用、出具检验报告的时间以及因指定质量检验机构未及时到场造成损失的责任承担等内容。检验费用由货主承担，由指定交割仓库负责转交。

第二百零六条 鸡蛋入库时，货主应当提供防疫证、来自非疫区证明和车辆消毒证原件，并将三证提交指定交割仓库保管。

第二百零七条 鸡蛋入库最早抽样时间为交割月首个交易日，抽样应当在卸货过程中、恒温库外进行。鸡蛋质量检验应以 5 吨的整数倍进行组批。

第二百零八条 鸡蛋收发重量以指定交割仓库检重为准，检重时以指定交割仓库地磅或轨道衡计量为准。指定交割仓库对鸡蛋包装物抽样检验重量，并根据包装物重量检验结果，折算入库鸡蛋净重，作为出具仓单的依据。

第二百零九条 鸡蛋应当整箱入库，入库重量与实际交割量差不应超过±20 千克。不足或多余部分，指定交割仓库按照以下方式与货主结算：最后交易日闭市前入库的，按照入库日该交割月份鸡蛋合约前一交易日结算价结算；最后交易日闭市后入库的，按照该交割月份鸡蛋合约交割结算价结算。

第二百一十条 交易所指定的质量检验机构完成入库鸡蛋质量检验后，应当出具检验报告正本一份，副本三份，并将正本提交指定交割仓库，向交易所和货主分别提交副本一份。

第二百一十一条 指定交割仓库应当按照交易所有关规定对入库鸡蛋的质量等相关材料和凭证进行验收。

第二百一十二条 鸡蛋标准仓单的最早申请注册日为交割月的首个交易日，仓单注册日距检验报告出具日期不应超过 2 个交易日。

第二百一十三条 鸡蛋标准仓单在每个交割月份最后交割日后 1 个交易日内应当进行标准仓单注销。

第二百一十四条 鸡蛋从仓库出库时，持有《提货通知单》或者提货密码的货主应当在实际提货日 3 个自然日前与指定交割仓库联系有关出库事宜，并在标准仓单注销日后 3 个交易日内（含当日）到指定交割仓库提货。

第二百一十五条 鸡蛋应当整箱出库，出库时，指定交割仓库应当向货主出示仓单注册时的质量检验报告，并依此与客户结算质量升贴水。

指定交割仓库应当向货主提供出库鸡蛋的防疫证、来自非疫区证明和车辆消毒证。

第二百一十六条 自标准仓单注册日至最后交割日期间的鸡蛋重量损耗由卖方客户承担，鸡蛋每天重量损耗比例交易所另行公布。

鸡蛋重量损耗在鸡蛋入库时由交割仓库代收，出库时转交买方客户。弥补鸡蛋重量损耗可以为现金结算或提供与交割品同一批次的鸡蛋。若采用现金结算，出库时指定交割仓库按照以下方式与买方结算，并将重量损耗部分货款与相应的增值税普通发票同时转交给买方：最后交易日闭市前注册仓单的，按照仓单注册日该交割月份鸡蛋合约前一交易日结算价结算；最后交易日闭市后注册仓单的，按照该交割月份鸡蛋合约交割结算价结算。

第二百一十七条 货主对出库鸡蛋的质量有异议的，应当在最后交割日后第 4 个交易日闭市前且货物未出库情况下提出。货主应当向交易所书面说明需要复检的质量指标，并由交易所选择指定质检机构到场检验，争议复检的数量应以交割单位的整数倍提出。鸡蛋复检所抽样品出库到检验机构过程中应采用 0-5℃ 恒温运输，否则复检结果视为无效。

复检一切相关费用（检验费和差旅费等）由买方垫付，复检结果与出库质量要求相符的，相关复检费用由买方承担。复检结果与出库质量要求不相符的，其中卫生指标不符，由此产生的一切费用（检验费和差旅费等）和损失由卖方负担；若卫生指标符合，仅感官指标、蛋重、新鲜度等指标不符，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。

第二百一十八条 鸡蛋从厂库出库时，货主应当在标准仓单注销日后（不含注销日）的 3 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 4 个自然日内（含当日）开始发货。

厂库发货时，应当向货主提供对应货物的厂家质检报告原件，作为结算质量升贴水的依据。

鸡蛋出库时，厂库不进行抽样留样。

第十八章 疫情处理

第二百一十九条 本章适用于鸡蛋品种。

第二百二十条 疫情信息以及疫区认定以农业部公开发布的信息为准，疫区认定信息公布日后下一个自然日起，处于疫区的交割仓库停止办理交割货物入库业务，交割厂库停止签发仓单。

第二百二十一条 若疫区认定信息公布在最后交割日闭市前，对于处在疫区的卖方仓单，卖方应当到最后交割日后第 12 个交易日闭市前，在非疫区交易所指定的交割地点或买卖双方协商交割地点更换合格货物，换货时应当委托交易所指定质检机构，对鸡蛋全部交割质量指标检验，并且检验合格，交易所在最后交割日后第 12 个交易日闭市后，清退卖方交割保证金，将该部分货款的 80%付给卖方会员，余款在卖方会员提交了增值税普通发票后结清；卖方不能按时提供合格货物，则交割终止，交易所将卖方该部分鸡蛋合约价值 20%的交割保证金支付给买方，提货通知单对应的该部分货物归还卖方，退还买方货款。

第二百二十二条 若疫区认定信息公布在最后交割日闭市后至最后交割日后第 4 个交易日闭市前，若货物尚未出库，则交易所对处于疫区的交割货物的卫生指标进行检验，由卖方承担检验费用。检验合格的，交易所在最后交割日后第 7 个交易日闭市后，清退卖方交割保证金，将该部分货款的 80%支付给卖方，余款在卖方提交增值税普通发票后结清；检验不合格的，卖方应当到最后交割日后第 12 个交易日闭市前，在非疫区交易所指定的交割地点或买卖双方协商交割地点更换合格货物，换货时应当委托交易所指定质检机构，对鸡蛋全部交割质量指标检验，并且检验合格，交易所在最后交割日后第 12 个交易日闭市后，清退卖方交割保证金，将该部分货款的 80%付给卖方会员，余款在卖方会员提交了增值税普通发票后结清；卖方不能按时提供合格货物，则交割终止，交易所将卖方该部分鸡蛋合约价值 20%的交割保证金支付给买方，提货通知单对应的该部分货物归还卖方，退还买方货款。

第二百二十三条 农业部疫情解除公告发布下一交易日起，暂停业务的交割仓库或厂库恢复办理交割业务。

第十九章 纤维板交割

第二百二十四条 纤维板合约标准交割品、替代品的质量标准和包装要求详见附件 25 《大连商品交易所纤维板交割质量标准（F/DCE FB001-2013）》。

纤维板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 26 《大连商品交

易所纤维板指定交割仓库名录》），交易所可视情况对纤维板指定交割仓库进行调整。

第二百二十五条 纤维板合约升贴水的差价款由货主同指定交割仓库结算。

第二百二十六条 纤维板交割单位为 500 张，标准品每 80 张为一个包装单位，替代品每 70 张为一个包装单位，即一捆，外围覆盖防潮塑料层。同一客户同一批入库的纤维板要求为同一厂家同一规格。交割时应按捆入库，不足一捆的应按照交割质量标准进行包装。

第二百二十七条 纤维板包装物价格包含在纤维板合约价格中。

第二百二十八条 会员办理交割预报时，应当按 0.2 元/张向交易所交纳交割预报定金。

第二百二十九条 办理完交割预报的货主在发货前，应当将车船号、品种、数量、到货时间等通知指定交割仓库，指定交割仓库应当合理安排接收商品入库。

第二百三十条 指定交割仓库应当委托交易所指定的质量检验机构对入库商品进行质量检验。检验费用由货主承担，由指定交割仓库负责转交。

第二百三十一条 纤维板的质量检验应以同一厂家、同一批号、同一生产日期进行组批，每批 3000 张，超过 3000 张的应分若干批检验，不足 3000 张的按一批检验。

第二百三十二条 交易所指定的质量检验机构完成入库纤维板质量检验后，应当出具检验报告正本一份，副本三份，并将正本提交指定交割仓库，向交易所和货主分别提交副本一份。

第二百三十三条 指定交割仓库应当按照交易所有关规定对入库纤维板的厂家、批号、质量、包装及相关材料和凭证进行验收。

第二百三十四条 纤维板收发数量以指定交割仓库核对为准。

第二百三十五条 纤维板标准仓单的申请注册日期距商品生产日期不得超过 60（含 60）个自然日。

第二百三十六条 纤维板标准仓单在每年的 3、7、11 月份最后 1 个交易日之前应当进行标准仓单注销。

第二百三十七条 纤维板出库时，持有《提货通知单》或者提货密码的货主应当在实际提货日 3 个自然日前与指定交割仓库联系有关出库事宜，并在标准仓单注销日后 10 个工作日内（含当日）到指定交割仓库提货。

第二十章 胶合板交割

第二百三十八条 胶合板合约标准交割品、替代品的质量标准和包装要求详见附件 27 《大连商品交易所胶合板交割质量标准（F/DCE BB001-2013）》。

胶合板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 28《大连商品交易所胶合板指定交割仓库名录》），交易所可视情况对胶合板指定交割仓库进行调整。

第二百三十九条 胶合板合约升贴水的差价款由货主同指定交割仓库结算。

第二百四十条 胶合板交割单位为 500 张，标准品每 80 张为一个包装单位，替代品每 70 张为一个包装单位，即一捆，外围覆盖防潮塑料层。同一客户同一批入库的胶合板要求为同一厂家同一规格。交割时按捆入库，不足一捆的应按照交割质量标准进行包装。

第二百四十一条 胶合板包装物价格包含在胶合板合约价格中。

第二百四十二条 会员办理交割预报时，应当按 0.2 元/张向交易所交纳交割预报定金。

第二百四十三条 办理完交割预报的货主在发货前，应当将车船号、品种、数量、到货时间等通知指定交割仓库，指定交割仓库应当合理安排接收商品入库。

第二百四十四条 指定交割仓库应当委托交易所指定的质量检验机构对入库商品进行质量检验。检验费用由货主承担，由指定交割仓库负责转交。

第二百四十五条 胶合板的质量检验应以同一厂家、同一规格、同一生产日期进行组批，每批 3000 张，超过 3000 张的应分若干批检验，不足 3000 张的按一批检验。

第二百四十六条 交易所指定的质量检验机构完成入库胶合板质量检验后，应当出具检验报告正本一份，副本三份，并将正本提交指定交割仓库，向交易所和货主分别提交副本一份。

第二百四十七条 指定交割仓库应当按照交易所有关规定对入库胶合板的厂家、质量、包装及相关材料和凭证进行验收。

第二百四十八条 胶合板收发数量以指定交割仓库核对为准。

第二百四十九条 胶合板仓库标准仓单的申请注册日期距商品生产日期不得超过 60（含 60）个自然日。

第二百五十条 胶合板标准仓单在每年的 3、7、11 月份最后 1 个交易日之前应当进行标准仓单注销。

第二百五十一条 对于有饰面加工能力的厂库，胶合板标准仓单注销后，如果货主提出饰面要求，厂库有义务在其加工能力范围内提供符合要求的饰面胶合板，加工费用由厂库和货主协商确定。在这种情况下，发货时间和发货速度不需按本办法中的有关规定办理。厂库和货主应进行书面确认并妥善保存，以备核查。

第二百五十二条 胶合板从仓库出库时，持有《提货通知单》或者提货密码的货主应当

在实际提货日 3 个自然日前与指定交割仓库联系有关出库事宜，并在标准仓单注销日后 10 个工作日内（含当日）到指定交割仓库提货。

第二百五十三条 胶合板从厂库出库时，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。

胶合板出库时，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，并将样品保留至发货日后的 30 个自然日，作为发生质量争议时的处理依据。

第二十一章 聚丙烯交割

第二百五十四条 聚丙烯合约标准交割品的质量标准和包装物要求详见附件 29《大连商品交易所聚丙烯交割质量标准（F/DCE PP001-2014）》。

原产厂家认定的不合格产品和以回收料为原料生产的聚丙烯不允许交割。

交易所推荐境内厂家生产的推荐牌号的聚丙烯，货主能够提供符合交割质量标准的生产厂家出具的产品质量证明原件和《质量承诺书》（具体格式见附件 33）原件及交易所规定的其他材料的，经交割仓库审核同意后，可免于质量检验。推荐厂家推荐牌号的企业资格与名录由交易所确定并公布。产品质量证明应载有生产厂家、牌号、批号、签证日期、质量测试项目、质量测试结果和质量检验结论等信息。

第二百五十五条 聚丙烯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 30《大连商品交易所聚丙烯指定交割仓库名录》），交易所可视情况对聚丙烯指定交割仓库进行调整。

第二百五十六条 聚丙烯包装物价格包含在聚丙烯合约价格中。

第二百五十七条 聚丙烯交割品每袋净重 $25 \pm 0.2\text{Kg}$ ，每吨 40 袋，不计溢短。

第二百五十八条 会员办理交割预报时，应当按 30 元/吨向交易所交纳交割预报定金。

第二百五十九条 办理完交割预报的货主在发货前，应当将车船号、品种、数量、到货时间等通知指定交割仓库，指定交割仓库应当合理安排接收商品入库。

第二百六十条 指定交割仓库应当委托交易所指定的质量检验机构对入库商品进行质量检验。检验费用由货主承担，由指定交割仓库负责转交。

第二百六十一条 质量检验应以同一厂家、同一牌号进行组批，每批 300 吨，超过 300 吨的应分若干批检验，不足 300 吨的按一批检验。

第二百六十二条 交易所指定的质量检验机构完成入库聚丙烯质量检验后，应当出具检

验报告正本一份，副本三份，并将正本提交指定交割仓库，向交易所和货主分别提交副本一份。

第二百六十三条 指定交割仓库应当按照交易所有关规定对入库聚丙烯的厂家、牌号、质量、包装及相关材料和凭证进行验收。

第二百六十四条 聚丙烯收发数量以指定交割仓库核对为准。

第二百六十五条 境内生产的聚丙烯申请注册仓库标准仓单的，申请注册日期距商品生产日期不得超过 180（含 180）个自然日。

境外生产的聚丙烯申请注册仓库标准仓单的，申请注册日期距商品《进口货物报关单》进口日期（或者《进境货物备案清单》进境日期）不得超过 180（含 180）个自然日。

第二百六十六条 聚丙烯标准仓单在每年的 3 月份最后 1 个交易日之前应当进行标准仓单注销。

第二百六十七条 聚丙烯出库时，持有《提货通知单》或者提货密码的货主应当在实际提货日 3 个自然日前与指定交割仓库联系有关出库事宜，并在标准仓单注销日后 10 个工作日内（含当日）到指定交割仓库提货。

第二十二章 玉米淀粉交割

第二百六十八条 玉米淀粉合约交割标准品质量标准和包装物要求详见附件 31《大连商品交易所玉米淀粉交割质量标准（F/DCE CS001-2014）》。

玉米淀粉交割品应当以国产玉米为原料生产加工而成，且产地在中国境内。

玉米淀粉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 32《大连商品交易所玉米淀粉指定交割仓库名录》），交易所可视情况对玉米淀粉指定交割仓库进行调整。

第二百六十九条 玉米淀粉合约升贴水的差价款由货主同指定交割仓库结算。

第二百七十条 玉米淀粉收发重量以指定交割仓库检重为准，检重时以指定交割仓库地磅或轨道衡计量为准，包装物不计入重量，指定交割仓库清点货物袋数后，按照 40 千克装每袋扣除 0.1 千克，830 千克装每袋扣除 2.5 千克，折算入库玉米淀粉净重作为出具标准仓单的依据。

第二百七十一条 玉米淀粉交割品每袋净重 40 ± 0.5 千克或 830 ± 5 千克。交割品为 40 千克装的，实际交割总净重不得少于标准仓单对应货物总重，并且两者之差不得多于 40 千克；交割品为 830 千克装的，实际交割总净重不得少于标准仓单对应货物总重，并且两者之差不得多于 830 千克。多出部分，按照最近交易月份玉米淀粉合约前一交易日结算价结算，

相应货款和增值税专用发票由交割仓库代收代转。

第二百七十二条 会员办理交割预报时，应当按 10 元/吨向交易所交纳交割预报定金。

第二百七十三条 办理完交割预报的货主应当在入库前 3 个自然日之前，将车船号、品种、数量、到货时间等通知指定交割仓库，指定交割仓库应当合理安排接收商品入库。

第二百七十四条 指定交割仓库应当委托交易所指定的质量检验机构对入库商品进行质量检验。货主应当在入库前 3 个自然日之前，将包装规格、到货方式、到货数量、到货时间通知指定交割仓库。指定交割仓库应当在收到货主入库通知后，将以上信息通知指定质量检验机构，并在委托质检协议中列明。委托质检协议中还应当明确昼夜作业费用、检验数量、出具检验报告的时间以及因指定质量检验机构未及时到场造成损失的责任承担等内容。检验费用由货主承担，由指定交割仓库负责转交。

第二百七十五条 玉米淀粉入库抽样应在入库堆垛前进行，已经交割过的商品如在原指定交割仓库继续进行交割，可采取开垛、倒垛等方式抽样。玉米淀粉检验应以同一厂家、同一包装规格的产品进行组批，每批 300 吨，超过 300 吨的应分为若干批检验，不足 300 吨的按一批检验，每批抽样数量详见附件 31《大连商品交易所玉米淀粉交割质量标准（F/DCE CS001-2014）》。

第二百七十六条 交易所指定的质量检验机构完成玉米淀粉检验后，应当出具检验报告正本一份，副本三份，并将正本提交指定交割仓库，向交易所和货主分别提交副本一份。

第二百七十七条 指定交割仓库应当按照交易所有关规定对入库商品的厂家、产地、生产日期等相关材料和凭证进行验收。

第二百七十八条 玉米淀粉包装物价格包含在玉米淀粉合约价格中。

第二百七十九条 玉米淀粉仓库标准仓单的申请注册日期距离商品生产日期不得超过 90（含 90）个自然日。

第二百八十条 玉米淀粉标准仓单在每年的 3、7、11 月份最后 1 个交易日之前应当进行标准仓单注销。

第二百八十一条 玉米淀粉从仓库出库时，持有《提货通知单》或者提货密码的货主应当在实际提货日 3 个自然日前与指定交割仓库联系有关出库事宜，并在标准仓单注销日后 10 个工作日内（含当日）到指定交割仓库提货。

第二百八十二条 玉米淀粉从厂库出库时，货主应当在标准仓单注销日后（不含注销日）的 4 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 4

个自然日内（含当日）开始发货。

玉米淀粉出库时，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，并将样品保留至发货日后的 30 个自然日，作为发生质量争议时的处理依据。

第二十三章 交割费用

第二百八十三条 进行实物交割的双方应分别向交易所交纳交割手续费。

黄大豆 1 号交割手续费为 4 元/吨；检验费为 2 元/吨。

黄大豆 2 号交割手续费为 4 元/吨；检验费为 3 元/吨。

豆粕、豆油、棕榈油交割手续费为 1 元/吨；豆粕检验费为 3 元/吨；豆油检验费为 3 元/吨；棕榈油检验费为 3 元/吨。

玉米交割手续费为 1 元/吨；检验费为 1 元/吨。

线型低密度聚乙烯、聚氯乙烯、聚丙烯交割手续费为 2 元/吨；取样及检验收费实行最高限价，由交易所制定并公布。

焦炭、焦煤交割手续费为 1 元/吨。

铁矿石交割手续费为 0.5 元/吨。

鸡蛋交割手续费为 1 元/吨，检验费交易所另行公布。

纤维板、胶合板交割手续费为 0.01 元/张；取样及检验收费实行最高限价，由交易所制定并公布。

玉米淀粉交割手续费为 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。

第二百八十四条 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。

第二百八十五条 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。

第二百八十六条 黄大豆 1 号、黄大豆 2 号仓储及损耗费（包括储存费、保管损耗、熏蒸费）收取标准为 0.40 元 / 吨天，5 月 1 日至 10 月 31 日期间，每天加收 0.10 元 / 吨的高温季节储存费。

豆粕仓储及损耗费（包括储存费、保管损耗、熏蒸费）收取标准为 0.50 元 / 吨天。

豆油、棕榈油仓储及损耗费（包括储存费、保管损耗）收取标准为 0.90 元/吨天。

玉米仓储及损耗费（包括储存费、保管损耗、熏蒸费）收取标准为 0.50 元 / 吨天，5 月 1 日至 10 月 31 日期间，每天加收 0.10 元 / 吨的高温季节储存费。

线型低密度聚乙烯、聚氯乙烯、聚丙烯仓储费收取标准为 1 元/吨天。

焦炭、焦煤仓储费收取标准为 1 元/吨天。

铁矿石仓储费收取标准为 0.5 元/吨天。

鸡蛋、纤维板、胶合板仓储费，玉米淀粉仓储及损耗费收取标准由交易所公布。

第二百八十七条 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。线型低密度聚乙烯、聚氯乙烯、纤维板、胶合板、聚丙烯标准仓单无损耗费。

第二百八十八条 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。

第二百八十九条 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。

第二十四章 交割违约

第二百九十条 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。

第二百九十一条 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）] ÷ （1-20%） ÷ 交割结算价（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）] ÷ （1-20%） ÷ 保税交割结算价（元/吨） ÷ 交易单位（吨/手）。

第二百九十二条 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。

第二百九十三条 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。

第二百九十四条 按本细则规定出现终止交割情形时,交易所的担保责任了结。

第二百九十五条 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。

第二百九十六条 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。

第二百九十七条 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》第二十五条规定执行。

第二十五章 附则

第二百九十八条 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。

第二百九十九条 违反本细则规定的,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。

第三百条 本细则的解释权属于大连商品交易所。

第三百零一条 本办法自公布之日起实施。

(注:铁矿石保税交割制度自 I1606 合约开始施行。本细则附件 2、4、6、8、10、12、14、15、17、19、22、24、26、28、30、32 分别为黄大豆 1 号、黄大豆 2 号、豆粕、豆油、棕榈油、玉米、线型低密度聚乙烯、聚氯乙烯、焦炭、焦煤、铁矿石、鸡蛋、纤维板、胶合板、聚丙烯、玉米淀粉指定交割仓库名录,因市场发展需要,相关品种交割仓库将不定期进行调整,用户如需了解相关品种的最新交割仓库名录,请访问本网站“业务指引/交割业务指引 /仓库名录”栏目获取交割仓库最新信息)

附件 1:

大连商品交易所黄大豆 1 号交割质量标准

(FA/DCE D001-2012)

1 范围

本标准规定了用于大连商品交易所黄大豆 1 号期货合约的交割质量指标、分级标准及检验方法。

本标准适用于大连商品交易所黄大豆 1 号期货合约交割标准品和替代品。

本标准所称黄大豆为种皮为黄色、淡黄色，脐为黄褐、淡褐、深褐、黑色或其它颜色。

2 引用标准

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 1352-2009 大豆

国粮发〔2000〕143 号 《粮油储存品质判定规则》（试行）

3 术语和定义

本标准采用的术语和定义按 GB 1352-2009 和国粮发〔2000〕143 号解释。

4 质量要求和卫生要求

4.1 黄大豆 1 号交割标准品品质技术要求：

完整粒率 (%)	种皮	损伤粒率 (%)		杂质含量 (%)	水分含量 (%)	色泽、气味
		合计	其中：热损粒			
≥ 85.0	黄色、淡黄色 混有异色粒限度为 5.0%	≤ 3.0	≤ 0.5	≤ 1.0	≤ 13.0	正常

4.2 黄大豆 1 号期货合约质量差异升扣价：

项目	质量标准 (%)	允许范围 (%)	升扣价 (元/吨)
完整粒率	≥ 85.0	≥ 90.0	10

			≥ 80.0 且 < 85.0	-40
损伤粒率	合计	≤ 3.0	> 3.0 且 ≤ 8.0	0
			> 8.0 且 ≤ 10.0	-20
	其中: 热损粒	≤ 0.5	> 0.5 且 ≤ 3.0	0
水分含量		≤ 13.0	> 13.0 且 ≤ 14.0	-60

4. 3 转基因大豆不得以标准品或替代品交割。

4. 4 卫生标准和动植物检疫项目按 GB1352-2009 执行。

4. 5 储存品质技术要求: 入库指标, 宜存; 出库指标, 宜存或不宜存

5 检验方法及规则

按照 GB 1352-2009 和国粮发[2000] 143 号执行。

6 附加说明

本标准由大连商品交易所负责解释。

附件 3:

大连商品交易所黄大豆 2 号交割质量标准

(FB/DCE D001-2013)

1 范围

本标准规定了用于大连商品交易所黄大豆 2 号期货合约的交割质量指标、分级标准及检验方法。

本标准适用于大连商品交易所黄大豆 2 号期货合约交割标准品和替代品。

本标准所称黄大豆为种皮为黄色、淡黄色，脐为黄褐、淡褐、深褐色、黑色等。

2 引用标准

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。

SN/T 0798-1999 进出口粮油、饲料检验 检验名词术语

SN/T 0799-1999 进出口粮油、饲料检验 检验一般规则

SN/T 0800.1-1999 进出口粮油、饲料检验 抽样和制样方法

SN/T 0803.1-1999 进出口油料 粗脂肪检验方法

GB/T 5511-2008 谷物和豆类 氮含量测定和粗蛋白质含量计算 凯氏法

SN/T 0803.7-1999 进出口油料 水分及挥发物检验方法

SN/T 0803.6-1999 进出口油料 杂质检验方法

SN/T 0803.2-1999 进出口油料 不完善粒检验方法

国粮发 [2000]143 号 《粮油储存品质判定规则》（试行）

3 定义

本标准采用下列定义。

3.1 粗脂肪：按 SN/T 0798-1999 关于粗脂肪的解释执行。

3.2 粗蛋白：按 SN/T 0798-1999 关于粗蛋白的解释执行。

3.3 水分及挥发物：按 SN/T 0798-1999 关于水分及挥发物的解释执行。

3.4 杂质：按 SN/T 0798-1999 关于杂质的解释执行。

3.5 破碎粒、损伤粒、热损粒：按 SN/T 0798-1999 关于破碎粒、损伤粒、热损粒的解释执行。

3.6 色泽气味：按 SN/T 0798-1999 关于色泽气味的解释执行。

3.7 储存品质控制指标：按国粮发[2000]143 号《粮油储存品质判定规则》（试行）关于储存品质控制指标的解释执行。

4 质量指标

4.1 黄大豆 2 号期货合约交割标准品品质技术要求：

粗脂肪 (湿基) %	粗蛋白 (湿基) %	水分及 挥发物 %	杂质%	破碎 粒%	损伤粒%		色泽 气味
					总量	其中：热损 粒%	
≥18.5	≥34.5	≤13.5	≤2.0	≤20.0	≤3.0	≤0.5	正常

4.2 黄大豆 2 号期货合约质量差异升扣价：

项 目		质量标准%	允许范围%	升扣价(元/吨)
粗脂肪(湿基)		≥18.5	≥16.5 且 <18.5	-120
粗蛋白(湿基)		≥34.5	≥33.5 且 <34.5	-50
水分及挥发物		≤13.5	11、1、3 月合约交割的国产 包粮大豆≤14.5	-50
损伤粒	总量	≤3.0	≤8.0	-30
	其中：热损粒	≤0.5	≤5.0	

4.3 大豆储存品质控制指标：入库指标，宜存；出库指标：宜存或不宜存。

4.4 散粮交割大豆出库破碎粒总量允许范围为≤25%。

4.5 卫生检验和动植物检疫按照国家有关标准和规定执行。

5 检验方法

5.1 检验的一般规则按 SN/T 0799-1999 执行。

5.2 抽样和制样方法按 SN/T 0800.1-1999 执行。

5.3 粗脂肪检验按 SN/T 0803.3-1999 执行。

5.4 粗蛋白检验按 GB/T 5511-2008 执行。

5.5 水分及挥发物检验按 SN/T 0803.7-1999 执行。

5.6 杂质检验按 SN/T 0803.6-1999 执行。

5.7 破碎粒、损伤粒、热损粒检验按 SN/T 0803.2-1999 执行。

5.8 色泽气味检验按 SN/T 0798-1999 和 SN/T 0800.1-1999 执行。

5.9 储存品质控制指标检验按国粮发[2000]143 号《粮油储存品质判定规则》（试行）执行。

6 附加说明：本标准由大连商品交易所负责解释。

附件 5:

大连商品交易所豆粕交割质量标准

(F/DCE D001-2006)

DCE QUALITY SPECIFICATION OF THE DELIVERY SOYBEAN MEAL

1 主题内容与适用范围

1.1 本标准规定了用于大连商品交易所交割的豆粕的质量要求、试验方法、检验规则、标签、包装、运输和贮存。

1.2 大连商品交易所豆粕期货合约中所规定的豆粕是指以大豆为原料，以预压-浸提或浸提法取油后所得饲料用大豆粕，产地不限。

1.3 本标准适用于大连商品交易所豆粕期货合约交割标准品。

2 规范性引用文件

应符合 GB/T 19541—2004 中规范性引用文件的有关规定。

3 术语和定义

应符合 GB/T 19541—2004 中术语和定义的有关规定。

4 要求

4.1 感官性状：本品呈浅黄褐色或浅黄色不规则的碎片状、粉状或粒状，无发酵、霉变、非挤压性结块、虫蛀及异味异臭。

4.2 夹杂物：应符合 GB/T 19541—2004 中夹杂物的有关规定。

4.3 标准品的质量指标：

质量指标	标准品
水分 (%)	≤13.0
粗蛋白质 (%)	≥43.0
粗纤维 (%)	≤7.0
粗灰分 (%)	≤7.0
尿素酶活性 (以氨态氮计) [mg/(min•g)]	≤0.3
注：粗蛋白质、粗纤维、粗灰分三项指标均以 87%干物质为基础计算。	

4.4 卫生标准：应符合 GB/T 19541—2004 中卫生标准的有关规定。

5 试验方法、检验规则、标签、包装、运输和贮存

包装按《大连商品交易所黄大豆 2 号、豆粕、豆油、玉米交割细则》的规定执行，其它应符合 GB/T 19541—2004 中试验方法、检验规则、标签、运输和贮存的有关规定。

6 附加说明

6.1 本标准由大连商品交易所负责解释。

6.2 本标准自 2007 年 3 月合约开始实施。

附件 7:

大连商品交易所豆油交割质量标准

1. 主题内容与适用范围

1.1 本标准规定了用于大连商品交易所交割的豆油质量指标与分级标准。

1.2 大连商品交易所豆油期货合约中所规定的大豆原油是指以大豆为原料加工的不能供人类直接食用的大豆油，产地不限。

1.3 本标准适用于大连商品交易所豆油期货合约交割标准品。

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 1535 大豆油

SN/T 0798 进出口粮油、饲料检验 检验名词术语

GB 5537 植物油脂检验 磷脂测定法

3. 术语和定义

3.1 含磷量：符合 SN/T 0798 中的相关规定。

3.2 其他术语和定义：符合 GB1535 中的相关规定。

4. 质量要求

4.1 特征指标：符合 GB1535 中的相关规定。

4.2 质量等级指标：

项目	质量指标
气味、滋味	具有大豆原油固有的气味、滋味，无异味
水分及挥发物 (%) ≤	0.20
不溶性杂质 (%) ≤	0.20
酸值 (mg KOH/g) ≤	3.0
过氧化值 (mmol/kg) ≤	7.5
溶剂残留量 (mg/kg) ≤	100
含磷量 (mg/kg) ≤	200

4.3 卫生指标：按 GB 1535 中的规定执行。

4.4 其他：按 GB 1535 中的规定执行。

5. 检验方法、检验规则、标签

5.1 含磷量检验 按 GB 5537 执行。

5.2 其他：按 GB 1535 中的规定执行。

6. 附加说明

本标准由大连商品交易所负责解释。

附件 9:

大连商品交易所棕榈油交割质量标准

(F/DCE P002-2011)

1 主题内容与适用范围

1.1 本标准规定了用于大连商品交易所交割的棕榈油质量指标。

1.2 本标准适用于大连商品交易所棕榈油期货合约交割标准品。

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 15680-2009 棕榈油

GB 3102.3-93 力学的量和单位

化工标准名词术语

3 术语和定义

3.1 符合 GB 15680-2009 棕榈油

3.2 符合 GB 3102.3-93 力学的量和单位

3.3 符合化工标准名词术语

4 质量要求

4.1 特征指标

项 目	特征指标
折光指数（40℃）	1.458-1.460
相对密度（比重）（40℃/20℃水）	0.899-0.920

碘值 (g/100g) $\geq$		56
皂化值 (以氢氧化钾计) (mg/g)		194-202
不皂化物【g/kg (%)】 $\leq$		13 (1.3)
脂 肪 酸 组 成	癸酸 C10:0 (%)	ND
	月桂酸 C12:0 (%)	0.1-0.5
	豆蔻酸 C14:0 (%)	0.5-1.5
	棕榈酸 C16:0 (%)	38.0-43.5
	棕榈一烯酸 C16:1 (%)	ND-0.6
	十七烷酸 C17:0 (%)	ND-0.2
	十七碳一烯酸 C17:1 (%)	ND-0.1
	硬脂酸 C18:0 (%)	3.5-5.0
	油酸 C18:1 (%)	39.8-46.0
	亚油酸 C18:2 (%)	10.0-13.5
	亚麻酸 C18:3 (%)	ND-0.6
	花生酸 C20:0 (%)	ND-0.6
	花生一烯酸 C20:1 (%)	ND-0.4
	山嵛酸 C22:0 (%)	ND-0.2
注: ND 表示未检出, 定义为 $\leq 0.05\%$		

4.2 质量指标

项 目	质量指标	
熔点 (°C) $\leq$	24	
酸值 (以氢氧化钾计) (mg/g) $\leq$	入库: 0.20	出库: 0.23
过氧化值【mmol/kg (meq/kg)】 $\leq$	入库: 2.5 (5)	出库: 5 (10)
色泽(罗维朋比色槽 133.4mm) $\leq$	入库: 黄 30; 红 3.0	出库: 黄 35; 红 3.5
气味、滋味	具有棕榈油固有的气味、滋味, 无异味	
透明度	40°C 澄清、透明	
水分及挥发物 (%) $\leq$	0.05	
不溶性杂质(杂质) (%) $\leq$	0.05	

4.3 棕榈油期货合约质量替代品和升贴水:

在酸值检验项目中，入库时仅 $0.20 \text{ (mg/g)} < \text{酸值} \leq 0.23 \text{ (mg/g)}$ 或者出库时仅 $0.23 \text{ (mg/g)} < \text{酸值} \leq 0.25 \text{ (mg/g)}$ ，其他指标符合基准交割品质量要求的棕榈油，可以替代交割，贴水为 15 元/吨。

入库或出库时，若酸值 $> 0.20 \text{ (mg/g)}$ ，则均以原油标示。

4.4 卫生指标：按 GB 15680-2009 规定执行。

4.5 真实性要求：按 GB 15680-2009 规定执行。

5 检验方法、检验规则按 GB 15680-2009 规定执行。

6 贮存和运输

6.1 贮存

应贮存在低温、干燥、清洁及避光的地方。不得与有害、有毒物品一同存放。

6.2 运输

运输中应注意安全，防止日晒、雨淋、渗漏、污染和标签脱落。散装运输要有专车，保持车辆清洁、卫生。

7 附加说明

本标准由大连商品交易所负责解释。

附件 11:

大连商品交易所玉米交割质量标准

(FC/DCE D001-2009)

1 范围

本标准规定了用于大连商品交易所交割的黄玉米质量指标、分级标准及检验方法。

本标准适用于大连商品交易所玉米期货合约交割标准品和替代品。

2 引用标准

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 1353-2009 玉米

GB/T 20570-2006 玉米储存品质判定规则

3 定义

本标准采用的定义按 GB 1353-2009 和 GB/T 20570-2006 解释。

4 质量指标

4.1 玉米期货合约交割标准品品质技术要求：

容重/（g/L）	杂质含量 （%）	水分含量 （%）	不完善粒含量（%）		色泽、气味
			总量	其中：生霉粒	
≥650	≤1.0	≤14.0	≤8.0	≤2.0	正常

4.2 玉米期货合约质量差异扣价：

项目	标准品质量要求	替代品质量要求	替代品扣价（元/吨）
容重/（g/L）	≥650	≥620 且 <650	-20
水分含量/（%）	≤14.0	>14.0 且 <14.5	0
生霉粒（%）	≤2.0	>2.0 且 ≤4.0	-25

4.3 玉米储存品质技术要求：入库指标，宜存；出库指标，宜存或轻度不宜存。

4.4 散粮交割玉米出库不完善粒总量允许范围为≤11%。

4.5 卫生检验和植物检疫按国家有关标准和规定执行。

5 检验方法

按照 GB 1353-2009 和 GB/T 20570-2006 执行。

6 附加说明

本标准由大连商品交易所负责解释。

附件 13:

大连商品交易所线型低密度聚乙烯交割质量标准
(F/DCE L001-2007)

1 主题内容与适用范围

1.1 本标准规定了用于大连商品交易所交割的线型低密度聚乙烯质量指标。

1.2 本标准适用于大连商品交易所线型低密度聚乙烯期货合约交割标准品。

2 引用标准

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/T 6678 化工产品采样总则

GB/T 6679 固体化工原料采样通则

GB/T 15182 线型低密度聚乙烯树脂

3 技术要求

3.1 线型低密度聚乙烯为本色、圆柱状或扁圆状颗粒，粒子的尺寸任意方向上应为 2-5mm，不夹杂金属、机械杂质。

3.2 线型低密度聚乙烯质量指标应符合表 1 要求。

表 1： 线型低密度聚乙烯交割质量指标

测试项目		单位	质量要求
颗粒外观	污染粒子	个/Kg ≤	40
	大粒和小粒	g/Kg ≤	10
熔体流动速率	标 称 值	g/10min	2.0
	偏 差	g/10min	±0.5
密 度		g/cm ³	[0.915, 0.923]
拉伸屈服应力		MPa ≥	8.3
拉伸断裂应力		Mpa ≥	12.0
断裂伸长率		% ≥	500

3.2.1 线型低密度聚乙烯密度标称值位于区间[0.915, 0.923], 且产品的密度与标称值的偏差不超过 0.003 g/cm³。

4 试验方法

4.1 取样要求按 GB/T 6678 和 GB/T 6679 执行。

4.2 质量指标检验按 GB/T 15182 执行。

5 标志、包装和贮存

5.1 标志

线型低密度聚乙烯包装袋上应印有该产品的标志。标志中包括：商标、产品名称、生产厂名称、产品标准号、产品牌号、批号及净重。

5.2 包装

使用原生产厂家或者其认可的包装，袋装产品每袋净重 25±0.2Kg。包装材料应保证产品在多次运输、码放、贮存时不污染和泄漏，并能防潮、防尘。

5.3 贮存

线型低密度聚乙烯应存放在通风、干燥、清洁并有良好消防设施的仓库内，贮存时，应远离热源，防止阳光直接照射，禁止在露天堆放。

6 附加说明

本标准由大连商品交易所负责解释。

(以下标准自 L1506 合约开始施行)

大连商品交易所线型低密度聚乙烯交割质量标准

(F/DCE L003-2014)

1 主题内容与适用范围

1.1 本标准规定了用于大连商品交易所交割的线型低密度聚乙烯质量指标。

1.2 本标准适用于大连商品交易所线型低密度聚乙烯期货合约交割标准品。

2 引用标准

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/T 6678 化工产品采样总则

GB/T 6679 固体化工产品采样通则

GB/T 11115 聚乙烯（PE）树脂

GB/T 1033.1 塑料 非泡沫塑料密度的测定 第1部分：浸渍法、液体比重瓶法和滴定法

3 术语和定义

应符合 GB/T 11115 和 GB/T 1033.1 及该两国标引用标准中术语和定义的有关规定。

4 技术要求

4.1 线型低密度聚乙烯为本色颗粒，无杂质，无黑粒。

4.2 线型低密度聚乙烯质量指标应符合表1要求。

表1： 线型低密度聚乙烯交割质量指标

测试项目		单位	质量要求
颗粒外观	色粒	个/Kg ≤	40
	大粒和小粒	g/Kg ≤	10
熔体流动速率	标 称 值	g/10min	2.0
	偏 差	g/10min	±0.5
密 度		g/cm ³	[0.915, 0.923]
拉伸屈服应力		MPa ≥	7.0
拉伸断裂标称应变		% ≥	200

4.2.1 线型低密度聚乙烯密度位于区间[0.915, 0.923]，且产品的密度与标称值的偏差不超过 0.003 g/cm³。

5 试验方法

5.1 取样要求按 GB/T 6678 和 GB/T 6679 执行。

5.2 质量指标（除密度外）检验按 GB/T 11115 执行。

5.3 密度测定按 GB/T 1033.1 执行，采用浸渍法。

6 标志、包装和贮存

6.1 标志

线型低密度聚乙烯包装袋上应印有该产品的标志。标志中包括：商标、生产厂家名称、产品标准号、产品牌号、批号及净重、产品名称（线型低密度聚乙烯、

线型低密度聚乙烯树脂、聚乙烯、聚乙烯树脂、LLDPE、Linear Low Density Polyethylene 等)。

6.2 包装

使用原生产厂家或者其认可的包装，袋装产品每袋净重 25 ± 0.2 Kg。包装材料应保证产品在多次运输、码放、贮存时不污染和泄漏，并能防潮、防尘。

6.3 贮存

线型低密度聚乙烯应存放在通风、干燥、清洁并有良好消防设施的仓库内，贮存时，应远离热源，防止阳光直接照射，禁止在露天堆放。

7 附加说明

本标准由大连商品交易所负责解释。

附件 16:

大连商品交易所焦炭交割质量标准

(F/DCE J001—2011)

1 主题内容与适用范围

1.1 本标准规定了用于大连商品交易所交割的焦炭质量要求、试验方法、检验规则和运输要求等。

1.2 本标准规定的焦炭是指以炼焦煤为主要原料,以高温干馏等方法得到的用于高炉炼铁的冶金焦炭。

1.3 本标准适用于大连商品交易所焦炭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/T 1996 冶金焦炭

GB/T 1997 焦炭试样的采取和制备

GB/T 2001 焦炭工业分析测定方法

GB/T 2005 冶金焦炭的焦末含量及筛分组成的测定方法

GB/T 2006 冶金焦炭机械强度的测定方法

GB/T 2286 焦炭全硫含量的测定方法

GB/T 4000 焦炭反应性及反应后强度试验方法

GB/T 8170 数值修约规则

GB/T 9977 焦化产品术语

3 术语和定义

GB/T 9977 确立的术语和定义适用于本标准。

4 质量要求

4.1 标准品质量要求

指标	质量标准 (%)
灰分 A_d	≤ 12.5
硫分 $S_{t,d}$	≤ 0.65
抗碎强度 M_{40}	≥ 82
耐磨强度 M_{10}	≤ 7.5

反应性 CRI	≤ 28	
反应后强度 CSR	≥ 62	
挥发分 V_{daf}	≤ 1.5	
焦末 ($<25\text{mm}$) 含量	入库 ≤ 5.0	出库 ≤ 7.0
粒度 ($\geq 25\text{mm}$)	入库 ≥ 95.0	出库 ≥ 93.0

4.2 替代品质差异与升贴水

指标	允许范围 (%)	升贴水 (元/吨)
灰分 A_d	>12.5 且 ≤ 13.0	每增加 0.1%, 扣价 3
	>13.0 且 ≤ 13.5	每增加 0.1%, 扣价 5
	>13.5 且 ≤ 14.0	每增加 0.1%, 扣价 10
硫分 $S_{t,d}$	>0.65 且 ≤ 0.70	每增加 0.01%, 扣价 3
	>0.70 且 ≤ 0.75	每增加 0.01%, 扣价 5
	>0.75 且 ≤ 0.80	每增加 0.01%, 扣价 10
反应后强度 CSR	≥ 55 且 <62	出现任一项扣价 50; 出现多项不累扣
反应性 CRI	>28 且 ≤ 32	
抗碎强度 M_{40}	≥ 78 且 <82	
耐磨强度 M_{10}	>7.5 且 ≤ 8.5	

4.3 水分 M_t 要求 $\leq 5.0\%$ 。水分含量大于 5.0% 的, 按超过部分四舍五入至小数点后一位扣重 (例如, 实测水分为 6.32%, 扣重 1.3%)。

4.4 出库时, 焦末含量或粒度不符合标准品质要求的出库标准的, 对超过焦末含量标准或不足粒度标准的部分四舍五入至小数点后一位, 指定交割仓库应当按照出库完成前一交易日最近月份焦炭合约结算价计算补偿金额 (例如, 焦末含量出库标准为不超过 7%, 实测为 8.23%, 四舍五入至小数点后一位, 补偿金额为对应货物货款的 1.2%)。

5 试验方法、检验规则

5.1 试样的采取和制备按照 GB/T 1997 的规定执行。

5.2 焦末含量、粒度的测定按照 GB/T 2005 的规定执行。

5.3 水分、灰分、挥发分的测定按照 GB/T 2001 的规定执行。

5.4 全硫含量的测定按照 GB/T 2286 的规定执行。

5.5 抗碎强度 M_{40} 和耐磨强度 M_{10} 的测定按照 GB/T 1996 的规定执行。

5.6 反应性和反应后强度的测定按照 GB/T 4000 的规定执行。

5.7 数值修约按照 GB/T 8170 的规定执行。

6 运输要求

焦炭应当用洁净的火车车厢、汽车车厢、轮船船舱或其它运输工具装运。

7 附加说明

本标准由大连商品交易所负责解释。

附件 18:

大连商品交易所焦煤交割质量标准

(F/DCE JM001-2013)

1 主题内容与适用范围

1.1 本标准规定了用于大连商品交易所交割的焦煤质量要求、试验方法、检验规则和运输要求等。

1.2 本标准规定的焦煤是指经过洗煤厂洗选,质量指标满足生产焦炭要求的焦煤,产地不限。

1.3 本标准适用于大连商品交易所焦煤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/T 5751 中国煤炭分类

GB/T 212 煤的工业分析方法

GB/T 214 煤中全硫的测定方法

GB/T 479 烟煤胶质层指数测定方法

GB/T 5447 烟煤粘结指数测定方法

GB/T 6948 煤的镜质体反射率显微镜测定方法

GB/T 15591 商品煤反射率分布图的判别方法

GB/T 397 炼焦用煤技术条件

GB/T 3715 煤质及煤分析有关术语

GB 475 商品煤样人工采取方法

Q/CY-MKZY-006-2012 炼焦煤炼焦试验方法 40KG 试验焦炉法

3 术语和定义

GB/T 3715 确立的术语和定义适用于本标准。

4 质量要求

4.1 标准品质量要求

指标	允许范围	
灰分 (A_d) , %	≥ 10.0 且 ≤ 11.5	
硫分 ($S_{t,d}$) , %	≥ 1.10 且 ≤ 1.40	
挥发分 (V_{daf}) , %	≥ 16.0 且 ≤ 28.0	
粘结指数 (G)	入库 ≥ 75	出库 > 65
胶质层最大厚度 (Y) , mm	≤ 25.0	

4.2 替代品质量差异与升贴水

指标	允许范围	升贴水 (元/吨)
灰分 (A_d)	$\geq 9.0\%$ 且 $< 10.0\%$	每降低 0.1%, 升价 2
	$< 9.0\%$	以 9.0% 计价
硫分 ($S_{t,d}$)	$\geq 0.80\%$ 且 $< 1.10\%$	每降低 0.01%, 升价 1
	$< 0.80\%$	以 0.80% 计价
胶质层最大厚度 (Y)	$> 25.0\text{mm}$	0

4.3 试验焦炉生成焦炭反应后强度 (CSR) $> 50\%$ 。

4.4 镜质体随机反射率标准差 (S) ≤ 0.13 。

4.5 水分 $M_t \leq 8.0\%$ 。水分含量大于 8.0% 的, 按超过部分四舍五入至小数点后一位扣重 (例如, 实测水分为 9.32%, 扣重 1.3%)。

5 试验方法和检验规则

5.1 试样的采取和制备按照 GB 475 的规定执行;

5.2 水分、灰分、挥发分的测定按照 GB/T 212 的规定执行;

5.3 硫分的测定按照 GB/T 214 的规定执行；

5.4 粘结指数的测定按照 GB/T 5447 的规定执行；

5.5 胶质层最大厚度的测定按照 GB/T 479 的规定执行；

5.6 镜质体随机反射率的测定按照 GB/T 6948 的规定执行；

5.7 镜质体随机反射率标准差的判别按照 GB/T 15591 的规定执行；

5.8 试验焦炉实验生成焦炭反应后强度的测定按照 Q/CY-MKZY-006-2012 的规定执行。

6 运输要求

焦煤应当用洁净的火车车厢、汽车车厢、轮船船舱或其它运输工具装运。

7 附加说明

本标准由大连商品交易所负责解释。

附件 20:

铁矿石交收商品品质、数量确认书

大连商品交易所:

买方_____愿意接受卖方_____提交的
出具的关于
_____（船名）的铁矿石的检验结果。其中，铁含量
（Fe%）_____, 二氧化硅含量_____%，三氧化二铝含
量_____%，硫含量_____%，磷含量_____%，水分含
量_____%。粒度符合大连商品交易所铁矿石期货交割标
准。交收实际重量为_____湿吨。交收完成后双方确认
期货交割责任已履行完毕，不再对交收商品提出品质、数量
等方面提出争议。

买方章: _____

卖方章: _____

年 月 日

年 月 日

附件 21:

大连商品交易所铁矿石交割质量标准

(F/DCE I001-2013)

1 主题内容与适用范围

1.1 本标准规定了用于大连商品交易所交割的铁矿石质量要求、试验方法、检验规则和运输要求等。

1.2 本标准规定的铁矿石是指天然开采的铁矿石经过破碎、选矿等工序之后,形成的用于生产铁矿石烧结矿、球团矿等人造块矿的粉矿和精矿。

1.3 本标准适用于大连商品交易所铁矿石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/T 10322.1-2000 铁矿石取样和制样方法

GB/T 6730.5-2007 铁矿石全铁含量的测定

GB/T 6730.62-2005 铁矿石钙、硅、镁、钛、磷、锰、铝和钡含量的测定

GB/T 6730.61-2005 铁矿石碳和硫含量的测定

GB/T 6730.54-2004 铁矿石铅含量的测定

GB/T 6730.53-2004 铁矿石锌含量的测定

GB/T 6730.36-1986 原子吸收分光光度法测定铜量

GB/T 6730.45-2006 铁矿石砷含量的测定

GB/T 6730.69-2010 铁矿石氟和氯含量的测定

GB/T 6730.49-1986 原子吸收分光光度法测定钠和钾量

GB/T 6730.22-1986 二安替吡啉甲烷光度法测定钛量

GB/T 10322.7-2004 铁矿石粒度分布的筛分测定

GB/T 10322.5-2000 铁矿石交货批水分含量的测定

GB/T 20565 确立的术语和定义适用于本标准

3 术语和定义

GB/T 20565 确立的术语和定义适用于本标准。

4 质量要求

4.1 标准品质量要求

指标	质量标准
铁 (Fe)	$\geq 62.0\%$
二氧化硅 (SiO_2)	$\leq 4.0\%$
三氧化二铝 (Al_2O_3)	$\leq 2.5\%$
磷 (P)	$\leq 0.07\%$
硫 (S)	$\leq 0.05\%$
微量元素	铅 (Pb) $\leq 0.10\%$ 锌 (Zn) $\leq 0.10\%$ 铜 (Cu) $\leq 0.20\%$ 砷 (As) $\leq 0.07\%$ 二氧化钛 (TiO_2) $\leq 0.80\%$ 氟+氯 $\leq 0.20\%$ 氧化钾 (K_2O) + 氧化钠 (Na_2O) $\leq 0.30\%$
粒度	至少 90% 在 10 毫米以下, 且最多 40% 在 0.15 毫米以下

4.2 替代品质量差异与升贴水

指标	允许范围	升贴水 (元/吨)
铁 (Fe)	$\geq 60.0\%$ 且 $< 62.0\%$	每降低 0.1%, 扣价 1.5
	$> 62.0\%$ 且 $\leq 65.0\%$	每升高 0.1%, 升价 1.0
	$> 65.0\%$	以 65.0% 计价
二氧化硅 (SiO_2) + 三氧化二铝 (Al_2O_3)	$\leq 10.0\%$	在二氧化硅 $> 4.0\%$ 时, 二氧化硅每升高 0.1%, 扣价 1.0; 在三氧化二铝 $> 2.5\%$ 时, 三氧化二铝每升高 0.1%, 扣价 1.0;
磷 (P)	$> 0.07\%$ 且 $\leq 0.10\%$	每升高 0.01%, 扣价 1.0;
	$> 0.10\%$ 且 $\leq 0.15\%$	每升高 0.01%, 扣价 3.0;
硫 (S)	$\leq 0.20\%$	$> 0.05\%$ 且 $\leq 0.20\%$ 时, 每升高 0.01%, 扣价 1.0
粒度	至少 70% 在 0.075 毫米以下	0

4.3 铁矿石采用干基计价, 水分是扣重指标。实物交收时, 实测水分按四舍五入至小数点后一位扣重 (例如, 实测水分为 6.32%, 扣重 6.3%)。

5 试验方法、检验规则

5.1 试样的采取和制备按照 GB/T10322.1-2000 的规定执行；

5.2 铁含量的测定按照 GB/T6730.5-2007 的规定执行；

5.3 二氧化硅、三氧化二铝、磷含量的测定按照 GB/T6730.62-2005 的规定执行；

5.4 硫含量的测定按照 GB/T6730.61-2005 的规定执行；

5.5 铅含量的测定按照 GB/T 6730.54-2004 的规定执行；

5.6 锌含量的测定按照 GB/T 6730.53-2004 的规定执行；

5.7 铜含量的测定按照 GB/T 6730.36-1986 的规定执行；

5.8 砷含量的测定按照 GB/T 6730.45-2006 的规定执行；

5.9 氟含量的测定按照 GB/T 6730.69-2010 的规定执行；

5.10 氯含量的测定按照 GB/T 6730.69-2010 的规定执行；

5.11 氧化钾含量的测定按照 GB/T 6730.49-1986 的规定执行；

5.12 氧化钠含量的测定按照 GB/T 6730.49-1986 的规定执行；

5.13 二氧化钛含量的测定按照 GB/T 6730.22-1986 的规定执行；

5.14 粒度的测定按照 GB/T10322.7-2004 的规定执行；

5.15 水分的测定按照 GB/T10322.5-2000 的规定执行。

6 运输要求

铁矿石产品用洁净的火车车厢、汽车车厢、轮船船舱或其它运输工具装运。

7 附加说明

7.1 本标准由大连商品交易所负责解释。

附件 23:

大连商品交易所鸡蛋交割质量标准

(F/DCE JD001-2013)

1 主题内容与适用范围

1.1 本标准规定了用于大连商品交易所交割的鸡蛋质量要求、试验方法、检验规则和包装、运输要求等。

1.2 本标准适用于大连商品交易所鸡蛋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 2748 鲜蛋卫生标准

SB/T 10277 鲜鸡蛋

NY/T 1758 鲜蛋等级规格

GB/T 6543 运输包装用单瓦楞纸箱和双瓦楞纸箱

BB/T 0015 纸浆模塑蛋托盘

3 术语和定义

3.1 鲜鸡蛋：鸡生产的，未经加工的蛋。

3.2 硌窝：指鲜蛋受震动或碰撞后使局部蛋壳破裂凹陷，而内蛋壳膜未破，蛋白未外流。

3.3 流清：指蛋壳受外力而破碎，蛋白已流出。

3.4 裂纹：指蛋壳受外力形成长条裂纹，内蛋壳膜未破，蛋白未流出。

3.5 箱装：把鸡蛋有序排列在蛋托上整箱包装。

3.6 蛋重等级：根据 1 枚鸡蛋的重量将鸡蛋蛋重分为五个等级：

蛋重等级	重量范围（单位：克）
XXL	≥ 68 且 < 78
XL	≥ 60 且 < 68
L	≥ 53 且 < 60
M	≥ 48 且 < 53
S	≥ 43 且 < 48

4 质量要求

4.1 标准品质量要求

指标	允许范围	
感官要求	抽样样品中，蛋壳不完整、硌窝、流清、裂纹长度大于 2cm 或不清洁面积超过总面积 1/8 的鸡蛋不超过 5%	
蛋重等级	80%以上的鸡蛋处于同一蛋重等级	
哈夫单位	入库 ≥ 72	出库 ≥ 60

4.2 替代品质量差异与升贴水

指标	允许范围	升贴水（元/500 千克）
蛋重等级	不满足标准品蛋重等级要求的交割品	扣价 200

4.3 卫生符合 GB 2748 中理化指标和食品添加剂的规定。

5 试验方法、检验规则

5.1 每 10 箱抽取 1 箱（不足 10 箱部分按 10 箱计），所抽箱中每箱取 3 枚蛋，抽样方法按照 SB/T 10277 执行。

5.2 蛋重的测定按照 SB/T 10277 中单枚蛋重的规定执行。

5.3 哈夫单位的测定按照 NY/T 1758 的规定执行。

5.4 感官检验按照 SB/T 10277 的规定执行。

6 包装及运输要求

6.1 使用符合 BB/T 0015 和 GB/T 6543 规定的蛋托和纸箱，并按照 SB/T 10277 的规定执行。

6.2 运输要求按照 GB 2748 的规定执行。

7 附加说明

本标准由大连商品交易所负责解释。

附件 25:

大连商品交易所纤维板交割质量标准

(F/DCE FB001-2013)

1 主题内容与适用范围

1.1 本标准规定了用于大连商品交易所交割的纤维板质量要求、试验方法、检验规则和包装、运输要求等。

1.2 本标准适用于大连商品交易所纤维板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/T 11718 中密度纤维板

GB 18580 室内装饰装修材料人造板及其制品中甲醛释放限量

3 术语和定义

应符合 GB/T 11718、GB 18580 中术语和定义的有关规定。

4 质量要求

4.1 表面应砂光，外观质量符合 GB/T 11718 优等品的要求。

4.2 幅面尺寸：

	单位：mm	升贴水(单位：元/张)
宽度	1220	—
长度	2440	—
厚度	标准品：15	0
	替代品：18	6

4.3 尺寸偏差、密度及偏差和含水率符合 GB/T 11718 中的要求。

4.4 物理力学性能符合 GB/T 11718 中家具型中密度纤维板的要求。

4.5 甲醛释放限量：

甲醛释放 限量标志	执行标准	试验方法	限量值	升贴水 (单位：元/张)
E ₁	GB/T 11718	穿孔法	≤8 mg/100g	—
E ₂	GB 18580	穿孔萃取法	≤30 mg/100g	-30

5 抽样、测量与检验和判定规则按照 GB/T 11718 的相关要求执行，其中理化性能抽样按照已验收合格的产品总体实施质量监督的要求进行。

6 标志、包装、运输和贮存按照 GB/T11718 的要求执行。

7 附加说明

本标准由大连商品交易所负责解释。

附件 27:

大连商品交易所胶合板交割质量标准

(F/DCE BB001-2013)

1 主题内容与适用范围

1.1 用于大连商品交易所胶合板期货合约交割的商品为实心、胶拼、双面砂光、室内普通用途的五层细木工板。

1.2 本标准规定了用于大连商品交易所交割的胶合板质量要求、试验方法、检验规则和包装、运输要求等。

1.3 本标准适用于大连商品交易所胶合板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/T 5849 细木工板

GB 18580 室内装饰装修材料人造板及其制品中甲醛释放限量

3 术语和定义

应符合 GB/T 5849、GB 18580 中术语和定义的有关规定。

4 质量要求

4.1 不区分面板树种。外观质量与翘曲度满足 GB/T 5849 一等品的要求

4.2 规格尺寸：

	单位：mm	升贴水（单位：元/张）
宽度	1220	—
长度	2440	—
厚度	标准品：15	0
	替代品：18	15

4.3 材料、尺寸偏差与板芯质量符合 GB/T 5849 中的要求

4.4 物理力学性能符合 GB/T 5849 的要求，其中胶合强度不做检验要求。

4.5 甲醛释放量：

甲醛释放 限量标志	执行标准	试验方法	限量值	升贴水 (单位: 元/张)
E ₁	GB 18580	干燥器法	≤1.5 mg/L	-
E ₂			≤5 mg/L	-30

5 抽样规则与检验方法按照 GB/T 5849 的要求执行。

6 标志、标签、包装和贮运按照 GB/T 5849 的要求执行。

7 附加说明

本标准由大连商品交易所负责解释

附件 29:

大连商品交易所聚丙烯交割质量标准

(F/DCE PP001-2014)

1 主题内容与适用范围

1.1 本标准规定了用于大连商品交易所交割的聚丙烯质量指标。

1.2 本标准适用于大连商品交易所聚丙烯期货合约交割标准品。

2 引用标准

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/T 6678 化工产品采样总则

GB/T 6679 固体化工产品采样通则

GB/T 12670 聚丙烯（PP）树脂

3 术语和定义

应符合 GB/T 12670 及其引用标准中术语和定义的有关规定。

4 技术要求

4.1 聚丙烯为本色颗粒，无杂质。

4.2 聚丙烯质量指标应符合表 1 要求。

表 1： 聚丙烯交割质量指标

测试项目		单位	质量要求
颗粒外观	黑粒	个/kg	0
	色粒	个/kg	≤5
	大粒和小粒	g/kg	≤100
熔体质量流动速率（MFR）		g/10min	≥2.5 且 ≤4.0
等规指数		%	>95.5
灰分（质量分数）		%	≤0.03
拉伸性能	拉伸屈服应力	MPa	>29.0

	拉伸断裂应力	MPa	>15
	拉伸断裂标称应变	%	>150

4.2.1 聚丙烯熔体质量流动速率 (MFR) 应大于等于 2.5，且小于等于 4.0 g/10min，产品的 MFR 与标称值的偏差不超过标称值的 30%。

5 试验方法

5.1 取样要求按 GB/T 6678 和 GB/T 6679 执行。

5.2 质量指标检验按 GB/T 12670 执行。

6 标志、包装和贮存

6.1 标志

聚丙烯外包装袋上应有明显的标志。标志内容包括：商标、生产厂名称、标准号、产品名称、牌号、生产日期、批号和净含量等。

6.2 包装

使用原生产厂家或者其认可的包装，袋装产品每袋净重 25 ± 0.2 Kg。包装材料应保证产品在多次运输、码放、贮存时不污染和泄漏，并能防潮、防尘。

6.3 贮存

聚丙烯应存放在通风、干燥、清洁并有良好消防设施的仓库内，贮存时，应远离热源，防止阳光直接照射，禁止在露天堆放。

7 附加说明

本标准由大连商品交易所负责解释。

附件 31:

大连商品交易所玉米淀粉交割质量标准**(F/DCE CS001-2014)****1 主题内容与适用范围**

1.1 本标准规定了用于大连商品交易所交割的玉米淀粉定义、质量要求、试验方法、检验与判定规则、包装和贮存等要求。

1.2 本标准适用于大连商品交易所玉米淀粉期货合约交割标准品。

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，引用文件最新版本适用于本标准。

GB/T 8885 食用玉米淀粉

GB/T 191 包装储运图示标志

3 术语和定义

玉米淀粉：以国产玉米为原料，在中国境内生产的淀粉。

4 质量要求

标准品质量应同时满足表 1、表 2 和表 3 要求。

表 1 感官要求

项目	质量要求
外观	白色或微带浅黄色阴影的粉末，具有光泽；
气味	具有玉米淀粉固有的特殊气味，无异味。

表 2 理化指标

项目	质量要求
----	------

水分/（%）	≤14.0
酸度（干基）/（°T）	≤1.80
灰分（干基）/（%）	≤0.15
蛋白质（干基）/（%）	≤0.45
斑点/（个/cm ² ）	≤0.7
脂肪（干基）/（%）	≤0.15
细度/（%）	≥99.0
白度/（%）	≥87.0

表 3 卫生指标

项目	质量要求
二氧化硫/（mg/kg）	≤30.0
砷（以 As 计）/（mg/kg）	≤0.5
铅（以 Pb 计）/（mg/kg）	≤1.0

5 检验与判定规则

5.1 同一生产厂家、同一包装规格的产品组为一批。

5.2 抽样数量按照 GB/T 8885 中抽样方案规定，再向上取最近整数后执行，检验方法按照 GB/T 8885 中相关规定执行，有版本更新的，适用新版本相应条款。

5.3 本标准 4 质量要求中任何一个项目不合格，该批次产品为不合格。

6 包装、标签、标志要求

6.1 采用全新的双层或覆膜袋装，包装材料应干燥、清洁、牢固，符合食品包装材料的卫生要求。

6.2 每袋净重应为 40 ± 0.5 千克或 830 ± 5 千克。

6.3 包装袋应注明产品名称、净含量、生产者名称、地址和联系方式、生产日期、食品生产许可证编号等内容，标志应符合 GB/T191 的要求。

7 贮存要求

产品贮存在阴凉、干燥、通风无污染的环境下，不应露天存放。

8 附加说明

本标准由大连商品交易所负责解释。

附件 33:

质量承诺书

大连商品交易所、***（指定交割仓库名称）：

兹承诺***（仓单注册申请人名称）于*年*月*日起在***（指定交割仓库名称）储存的，我方生产的下表所列商标、牌号、批号的产品质量标准符合***（期货交割标准名称）要求，该产品出现任何质量问题，我方愿承担相应的责任。

商标	牌号	批号	数量（吨）

企业名称（加盖公章）：

日 期：

大连商品交易所会员管理办法

(2015 年 8 月 10 日)

第一章 总 则

第一条 为加强会员的自律管理,保障会员的合法权益,规范会员在大连商品交易所(以下简称交易所)的业务活动,根据《期货交易所管理办法》、《期货公司管理办法》、《大连商品交易所章程》和《大连商品交易所交易规则》,制定本办法。

第二条 会员是指根据期货交易有关法律、法规及交易所章程的有关规定,经交易所审核批准,在交易所进行期货交易活动的企业法人。

第三条 本办法适用于会员及其从业人员。

第二章 会员资格

第四条 交易所会员按业务范围分为期货公司会员和非期货公司会员。

第五条 申请成为交易所会员必须具备下列条件:

- (一) 中华人民共和国境内注册登记的企业法人;
- (二) 承认并遵守交易所的章程和业务规则;
- (三) 申请期货公司会员的,须拥有 3000 万元(含 3000 万元)以上的注册资本;申请非期货公司会员的,须拥有 500 万元(含 500 万元)以上的注册资本;
- (四) 具有良好的信誉和经营历史,近三年内无严重违法记录或被期货交易所除名的记录;
- (五) 具有健全的组织机构和财务管理制度及完善的期货业务管理制度;
- (六) 具有取得期货从业资格的人员、固定的经营场所和必要设施;
- (七) 申请期货公司会员的,须持有中国证监会核发的《期货经纪业务许可证》;
- (八) 中国证监会和交易所规定的其他条件。

第六条 申请成为会员须向交易所提交下列文件和资料:

- (一) 经法定代表人签字的申请书;
- (二) 工商行政管理部门核发的《企业法人营业执照》;
- (三) 经会计师事务所或审计师事务所审计的最近两年的年度会计报告;
- (四) 住所(经营场所)使用证明;
- (五) 交易所认为需要提供的其他文件。

第七条 申请成为期货公司会员的，除提供前条规定的资料外，还需提供：

- （一）中国证监会核发的《期货经纪业务许可证》；
- （二）公司章程和期货经纪业务规则；
- （三）期货经营机构的设置情况、企业法定代表人和期货业务主要负责人简历、期货从业人员名册；
- （四）主要交易设施和信息设施的使用权证明。

第八条 申请交易所会员资格，须向交易所提交书面申请书。申请书主要包括以下内容：

- （一）申请交易所会员资格的目的和理由；
- （二）书面承诺遵守交易所章程和各项规定；
- （三）组织机构、经营机构的设置情况；
- （四）交易所要求申请者须说明的其他情况。

第九条 交易所收到符合要求的入会申请材料后，应于 30 个工作日内提出处理意见，提交会员资格审查委员会初审。

经会员资格审查委员会初审通过，并报理事会批准后，交易所对符合会员条件的申请单位发出入会通知书。

第十条 申请单位自收到交易所入会通知书之日起 30 个工作日内办理如下事项：

- （一）缴纳会员资格费 50 万元；
- （二）期货公司会员交纳年会费 2 万元，非期货公司会员交纳年会费 1 万元；
- （三）期货公司会员以自有资金汇入结算准备金 200 万元，非期货公司会员汇入结算准备金 50 万元；
- （四）在交易所指定的期货保证金存管银行开设专用资金账户；
- （五）办理有关人员和印鉴的授权手续；
- （六）其他必须办理的事项。

逾期未办的，视为自动放弃入会资格。

第十一条 申请单位办理完入会手续后，即正式取得会员资格。交易所颁发会员证书，并报告中国证监会。

第十二条 正式取得交易所会员资格后，会员拥有一个场内交易席位。会员因业务发展需要增加交易席位，须向交易所提出申请，由交易所审核批准。增加的交易席位使用期最少为一年，使用费按年收取，每年 2 万元。

会员可以按一定程序申请远程交易席位。使用远程交易席位须严格遵守交易所的有关规定。

第十三条 会员不得将席位全部或者部分以出租或者承包等形式交由其他机构和个人使用。

第十四条 会员享有章程规定的权利，履行章程规定的义务。

第三章 会员资格转让

第十五条 经批准，会员资格可以转让。禁止私下转让会员资格。

第十六条 会员进行会员资格转让的，转让双方应提前向交易所提交会员资格转让申请文件，申请文件包括：

（一）转让方向交易所提交《大连商品交易所会员资格转让申请》；

（二）受让方向交易所提交《大连商品交易所会员管理办法》第六、七条规定的会员资格申请文件。

第十七条 交易所在接到上述会员资格转让申请文件后，提交理事会会员资格审查委员会对受让方进行资格审查。经审查合格的，报理事会批准。理事会批准后，交易所向申请双方发出同意该项会员转让的书面通知。

第十八条 转让双方在接到交易所同意该项会员资格转让的通知后，应签订《会员资格转让协议书》，报交易所备案。

第十九条 转让方在接到交易所同意其会员资格转让的通知后，必须在 30 个工作日内办理完毕下列事项：

- （一）了结期货合约持仓；
- （二）结清与交易所的全部债权债务；
- （三）退还各种票据和交易所颁发的各种证件；
- （四）办理专用资金账户的销户手续；
- （五）退还交易所提供的各种交易设备；
- （六）按规定应当办理的其他事项。

第二十条 转让方办理完上述事项后，交易所在 5 个工作日内向受让方发出书面的入会通知书，受让方按照本办法第十条的有关规定办理相关事项。

逾期未办的，视为放弃受让会员资格。

第二十一条 受让方办理完有关入会事项后，交易所将转让方的会员资格变更到受让方

名下，并颁发会员证书。

第二十二条 会员存在以下情况之一的，交易所不予受理会员资格转让的申请：

- （一）由于经纪纠纷、违法或犯罪接受国家有关部门立案调查处理期间；
- （二）涉嫌违规，被交易所立案调查期间；
- （三）因违法、违规被交易所处以通报批评、暂停期货业务处罚不满三个月的；
- （四）取得交易所会员资格未满一年的；
- （五）已被交易所取消会员资格的；
- （六）与交易所发生债务纠纷尚未了结的。

第二十三条 交易所会员因诉讼纠纷等原因被法院等司法机关和其他有权的行政执法机关裁定转让会员资格并要求交易所协助执行时，交易所对相关会员进行会员资格的强制转让。

第二十四条 交易所在接到法院等司法机关和其他有权的行政执法机关下发的有关转让会员资格的协助执行通知书之日起，10 个工作日内，下发暂停相关会员的开仓交易并限期了结现有期货合约持仓的通知。

第二十五条 期货公司会员的客户持仓可通过平仓、交割及移仓等方式了结持仓；非期货公司会员可通过平仓、交割等方式了结持仓。会员持仓须在自通知下发之日起 60 个工作日内了结。逾期未了结持仓，交易所将于到期日下一个交易日，对该会员实施强制平仓。

第二十六条 该会员持仓了结后，应结清与交易所的全部债权与债务。若该会员不到交易所办理有关手续，交易所所有权按有关规定对其资金进行扣划以结清其与交易所的债务。

第二十七条 该会员与交易所的全部债权债务结清后，经交易所批准，将会员资格转让给符合交易所会员条件的受让方。如果该会员没有其他可用资金或其他可用资金不足以用于结清与交易所的债务，交易所可先批准对该会员的会员资格进行转让，然后用会员资格转让费清偿与交易所的债务，清偿后若有余额再划转到有关机关指定账户。

第二十八条 受让方应向交易所提交会员资格申请书，经交易所会员资格审查委员会按会员条件审查合格并报理事会批准后，交易所批准转让，由受让方受让会员资格。

第二十九条 受让方须在交易所批准转让后 30 个工作日内将会员资格转让费交至交易所并办理完第十条所述事项。逾期未办的，视为放弃受让会员资格。

第三十条 受让方办理完上述事项后，交易所将会员资格变更到受让方名下，并颁发会员证书，完成转让。

第三十一条 交易所收到受让方交来的会员资格转让费后,在 3 个工作日内,将会员资格转让费或第二十七条所述余额划转到有关机关指定账户。

第三十二条 交易所将办理强制转让的文件归档保存。办理强制转让的文件包括:有关方面强制转让会员资格的裁定、受让方提交的会员资格申请书及交易所批准转让的文件。

第四章 会员的变更

第三十三条 兼并会员的法人或与会员合并后新设立的法人若要承继会员资格,必须向交易所提出申请,经交易所理事会审查批准后,方可承继会员资格。

兼并会员的法人或与会员合并后新设立的法人,有优先取得会员资格的权利。

第三十四条 会员存在下列情况之一的,经理事会批准,可以取消其会员资格:

- (一) 被中国证监会吊销期货经纪业务许可证或被宣布为“市场禁止进入者”的;
- (二) 将席位全部或者部分以出租或者承包等形式交由其他机构和个人使用的;
- (三) 资金、人员和设备严重不足,管理混乱,经整顿无效的;
- (四) 拒绝执行会员大会或理事会决议的;
- (五) 无正当理由连续三个月不做交易的;
- (六) 其他违反国家法律、法规、规章和严重违反交易所章程及有关规定的。

第三十五条 会员申请放弃会员资格,应当经理事会批准。

第三十六条 会员被取消会员资格或放弃会员资格后,必须在 30 个工作日内办理完毕下列事项:

- (一) 通过平仓、移仓等方式了结各期货合约持仓;
- (二) 结清与交易所的全部债权与债务;
- (三) 退还各种票据和交易所颁发的各种证件;
- (四) 办理专用资金账户的销户手续;
- (五) 退还交易所提供的各种交易设备;
- (六) 按规定应当办理的其他事项。

逾期末了结持仓,交易所将于到期日下一个交易日对该会员实施强制平仓;未结清与交易所的债务的,交易所将在清退会员资格费前从会员资格费中扣除,会员资格费不足以结清与交易所债务的,交易所保留继续追索的权利;其他未办事项由交易所按有关规定办理。

第三十七条 会员资格发生变化,交易所应当报告中国证监会。

第三十八条 会员有下列情况之一的,应在 10 个工作日内向交易所书面报告:

- (一) 法定代表人变更；
- (二) 注册资本总额或股权结构变更；
- (三) 名称、住所、经营范围及联系方式变更；
- (四) 分支机构的设立、合并、关闭；
- (五) 经营状况发生重大变化；
- (六) 发生 50 万元以上诉讼案件或经纪纠纷；
- (七) 停止期货业务；
- (八) 取得其他交易所会员资格；
- (九) 因违法、违规受到期货市场监管部门、行政执法部门、司法机关或其他交易所处罚。

第五章 监督管理

第三十九条 会员及其从业人员必须遵守国家有关法律、法规、政策和交易所章程、规则、办法等各项业务规定，接受交易所的管理和监督。

第四十条 交易所每年对会员遵守期货交易所业务规则的情况进行抽样或者全面检查。交易所行使监管职权时，可以按照期货交易所章程和交易规则及其细则规定的权限和程序对会员进行调查取证，会员应当配合。

第四十一条 会员有下列情况之一的，交易所要求其限期整改：

- (一) 财务管理不善，长期亏损，经营状况不佳或清偿能力明显下降；
- (二) 年度审验中发现重大问题。

会员未能在限期内整改的，交易所有权暂停其期货交易或经理事会批准取消其会员资格。

第四十二条 除《期货交易管理条例》第二十六条规定的情形外，期货公司会员不得接纳有下列情况之一者为客户：

- (一) 无民事行为能力或者限制民事行为能力的自然人；
- (二) 中国证监会及其派出机构、期货交易所、期货保证金安全存管机构、中国期货业协会和期货公司的工作人员及其配偶；
- (三) 中国证监会及交易所规定的其他情况。

第四十三条 客户委托他人作为其交易指令下达人或资金调拨人的，必须由客户提供本人亲自签名或法定代表人签字并加盖公章的书面授权委托书。

没有授权委托书或书面授权不明的，期货公司会员不得允许他人代客户从事交易活动。

第四十四条 期货公司会员接受客户委托从事交易时，应事先对客户的身分、资信及交易资格核查确认。

客户交易资金来源与客户名称不相符的，客户应当提供交易资金合法使用权的证明。

第四十五条 期货公司会员应当在期货交易所指定期货保证金存管银行开立保证金账户专门存放保证金，与自有资金分户存放，严禁挪用客户保证金。

客户办理出入金手续时，期货公司会员应当要求客户或其合法资金调拨人在财务凭证上签字或盖章。

期货公司会员不得将收取的客户保证金用于自身经营活动或冲抵自身债务；不得允许他人擅自使用客户保证金或擅自用客户保证金为他人经营活动提供担保。

第四十六条 期货公司会员应当及时、准确执行客户交易指令。委托交易成交后，期货公司会员应及时通知客户。未经客户委托，不得擅自代客户进行期货交易。

第四十七条 期货公司为客户提供网上委托服务的，应当建立网上交易风险管理制度，并对客户进行网上交易风险的特别提示。

第四十八条 期货公司会员应完善客户下达交易指令和交易结算资料的确认手续。

第四十九条 期货公司会员为控制交易风险，需要对客户持仓实施强行平仓的，应当遵守双方合同规定的标准和条件，并以合同约定的方式通知客户。不得允许客户透支交易。

第五十条 期货公司会员不得以任何方式欺诈客户。

第五十一条 会员应维护交易所的声誉，协助交易所处理各种突发或异常事件。期货公司会员应做好客户的解释工作。

第五十二条 会员应按照交易所的要求参加交易所组织的各项活动和交易所召开的各种会议。因故确实无法参加的，应事先报交易所同意。

第五十三条 会员从业人员必须符合中国证监会关于期货从业人员资格的有关规定。

第五十四条 会员从业人员在交易所内从事交易、交割、结算业务的，须经其会员授权。会员从业人员在同一时期内，只能受聘于一家会员，不得在其他会员处兼职。

会员从业人员在交易所从事的业务活动均由该会员承担全部责任。

第五十五条 会员资格转让、被取消会员资格或放弃会员资格的，该会员对其从业人员的授权自动失效。

第六章 附则

第五十六条 会员发生违规、违约行为的，按照《大连商品交易所违规处理办法》及其他有关规定执行。

第五十七条 本办法解释权属于大连商品交易所。

第五十八条 本办法自公布之日起实施。

大连商品交易所套期保值管理办法

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。套期保值持仓额度分为一般月份（自合约上市之日起至交割月份前第一个月第九个交易日）套期保值持仓额度和临近交割月份（交割月份前第一个月第十个交易日至交割月份）套期保值持仓额度。

第三条 会员、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。

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，可以在相关品种上进行套期保值交易。

第八条 非期货公司会员和客户套期保值持仓与投机持仓合计不得超过交易所规定的投机持仓限额。

非期货公司会员和客户可以申请增加套期保值持仓额度。

第九条 申请增加套期保值持仓额度的客户应当向其开户的期货公司会员申报，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；申请增加套期保值持仓额度的非期货公司会员直接向交易所办理申报手续。

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 申请增加临近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。

申请增加临近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临近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。

对增加临近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，对应期货合约的持仓状况、可供交割品的数量以及期现价格是否背离等因素，确定其临近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临近交割月份时，交易所将按其一般

月份套期保值持仓数量与该品种临近交割月份投机持仓限额中的较低标准,转化为临近交割月份套期保值持仓增加额度。

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。对增加临近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、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一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。

大连商品交易所套利交易管理办法

第一章 总则

第一条 为规范套利交易业务管理，促进期货市场规范发展，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 本办法所称套利交易按照品种的不同，分为跨期套利和跨品种套利。跨期套利是指同一品种不同合约间的套利交易。跨品种套利是指不同品种合约间的套利交易。

按照合约月份的不同，套利交易可分为一般月份套利交易（自合约上市之日起至交割月份前一个月第九个交易日）和临近交割月份套利交易（交割月份前一个月第十个交易日至交割月份）。

第三条 交易所应及时公布适用于套利交易的品种、合约和组合方式。

第四条 会员、客户在大连商品交易所（以下简称交易所）从事套利交易业务，应当遵守本办法。

第二章 套利持仓

第五条 非期货公司会员和客户套利持仓与投机持仓合计不得超过交易所规定的投机持仓限额。非期货公司会员和客户可以申请增加套利持仓额度。已获得套期保值交易资格的客户不得申请相关品种的套利持仓增加额度。

第六条 申请增加套利持仓额度的客户应当向其开户的期货公司会员申报，由期货公司会员进行审核后，按本办法向交易所办理申报手续；申请增加套利持仓额度的非期货公司会员直接向交易所办理申报手续。

第七条 申请增加一般月份套利持仓额度的非期货公司会员或客户，应当提交下列材料：

（一）增加套利持仓额度申请表，主要包括申请人基本信息、申请品种、数量，套利交易策略及交易所要求的其他信息；

（二）交易所要求的其他材料。

非期货公司会员或客户获批一般月份套利持仓增加额度适用于申请品种的所有一般月份合约。

第八条 申请增加临近交割月份套利持仓额度的非期货公司会员或客户，应当向交易所提交下列材料：

(一) 增加套利持仓额度申请表, 主要包括申请人基本信息、申请品种、合约、数量, 套利交易策略及交易所要求的其他信息;

(二) 申请合约价差偏离情况分析;

(三) 交易所要求的其他材料。

非期货公司会员或客户获批临近交割月份套利持仓增加额度仅适用于申请合约。

第九条 申请增加临近交割月份套利持仓额度的截止日为套利持仓中近月合约交割月份前一个月的最后交易日, 逾期交易所不再受理该合约临近交割月份套利持仓额度的申请。

第十条 交易所对增加一般月份套利持仓额度的申请, 按资信情况、历史交易状况、套利持仓使用情况等进行审核, 确定其一般月份套利持仓增加额度。

交易所对增加临近交割月份套利持仓额度的申请, 按资信情况、历史交易状况、合约持仓状况、可供交割品数量、申请合约价差是否背离等情况进行审核, 确定其临近交割月份套利持仓增加额度。

第十一条 对增加一般月份套利持仓额度的申请, 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。对增加临近交割月份套利持仓额度的申请, 交易所在收到完整的申请材料后, 于套利持仓近月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。

第十二条 非期货公司会员和客户需要调整套利持仓额度时, 应当及时向交易所提出变更申请。

第十三条 交易所可以根据市场情况对非期货公司会员和客户套利持仓增加额度进行调整。

第三章 套利交易保证金、盈亏和手续费

第十四条 交易所应当制定套利交易保证金的收取标准, 并向市场公布。交易所可以根据市场情况调整套利交易保证金标准。

第十五条 交易期间, 以交易所规定的套利交易指令建立的持仓按前一个交易日结算时的标准收取套利交易保证金, 保证金不足的按照《大连商品交易所结算细则》等规则规定执行。

第十六条 结算时, 交易所对同一交易编码下的所有持仓按照先跨期、后跨品种的原则, 根据合约距离交割月份由近到远的顺序进行组合, 收取套利交易保证金。

第十七条 套利持仓平仓时, 先返还套利持仓交易保证金, 再收取未平仓合约交易保证金。

第十八条 套利交易的持仓盈亏和平仓盈亏的计算根据《大连商品交易所结算细则》相关规定执行。

第十九条 交易所可以对套利交易的手续费采取优惠措施。

第四章 监督管理

第二十条 交易所对会员和客户的资信情况及期货市场交易行为可随时进行监督和调查，会员和客户应予协助和配合。

第二十一条 非期货公司会员和客户套利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一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 非期货公司会员和客户利用套利交易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、调整或者取消其套利持仓增加额度、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增加套利持仓额度和交易时，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利持仓额度的申请、调整或者取消已批准的套利持仓增加额度、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 本办法未作规定的，按照本所相关业务规则执行。

第二十五条 本办法解释权属于大连商品交易所。

第二十六条 本办法自公布之日起实施。

大连商品交易所违规处理办法

第一章 总 则

第一条 为加强期货市场管理,规范期货交易行为,保障期货市场参与者的合法权益,根据《大连商品交易所章程》、《大连商品交易所交易规则》的有关规定,制定本办法。

第二条 本办法所称违规行为是指会员、客户、指定交割仓库及期货市场相关参与者违反大连商品交易所(以下简称交易所)章程、交易规则及其他有关规定的行为。

第三条 交易所根据公平、公正的原则,以事实为依据,对违规行为进行调查、认定和处罚。违规行为构成犯罪的,移交司法机关,依法追究刑事责任。

第四条 会员、客户、指定交割仓库及期货市场相关参与者的违规行为已受到中国证监会处罚的,交易所在决定处罚时,可以免除或减轻处罚。

第五条 从事交易所期货交易相关业务活动适用本办法。

第二章 稽 查

第六条 稽查是指交易所根据交易所的各项规章制度,对会员、客户、指定交割仓库及期货市场相关参与者的业务活动进行监督和检查。

稽查包括常规检查和立案调查。

第七条 交易所履行监管职责时,可行使下列职权:

- (一) 查阅、复制与期货交易有关的信息、资料;
- (二) 对会员、客户、指定交割仓库等单位 and 人员进行调查、取证;
- (三) 要求会员、客户、指定交割仓库等被调查者申报、陈述、解释、说明有关情况;
- (四) 查询会员的期货保证金账户;
- (五) 检查会员的交易、结算及财务等电脑系统;
- (六) 制止、纠正、处理违规行为;
- (七) 交易所履行监管职责所必须的其他职权。

第八条 会员、客户、指定交割仓库及期货市场相关参与者应自觉接受交易所的监督。

第九条 交易所设立投诉、举报电话。投诉、举报人应身份真实、明确;投诉、举报人不愿公开其身份的,交易所为其保密。

第十条 对常规检查工作中发现的、投诉举报的、期货监管部门和司法机关等单位移交的或其他途径获得的线索进行审查后,认为有违规行为发生的,交易所应予以立案调查。

第十一条 对已立案的期货违规案件,交易所应指定专人负责调查。调查取证应当由两名以上调查人员参加,并出示本人工作证或交易所的证明文件。

第十二条 调查人员认为自己与本案有利害关系或者其他可能影响案件公正处理的,应当申请回避。

被调查人员认为调查人员与本案有关、可能影响公正办案的,有权申请有关人员回避。

交易所认为调查人员应该回避的,指令其回避。

调查人员的回避由交易所稽查部门负责人决定。稽查部门负责人的回避由交易所总经理决定。

第十三条 证据包括书证、物证、调查笔录、鉴定结论、视听材料、电子记录等能够证明案

件真实情况的一切材料。

证据应当调查核实才能作为定案的根据。

第十四条 调查笔录核对无误后, 被调查人和调查人员应当在笔录上签名。

书证、物证的提取应当制作提取笔录, 注明提取的时间和地点, 并由被调查人签名。被调查人无法签名的, 由见证人签名。

视听资料、电子记录的收集应当注明收集或制作的时间、地点、方式、使用的设备及保存的条件, 并由被调查人或见证人签名。

鉴定结论必须由中国证监会或交易所认定的有权鉴定单位做出, 并由鉴定单位和鉴定人盖章签字。

第十五条 调查人员在常规检查和立案调查过程中应严格遵守保密制度, 不得滥用职权。对违反规定的, 交易所根据不同情节给予相应的处分。

第十六条 会员、客户和指定交割仓库涉嫌重大违规, 经交易所立案调查的, 在确认违规行为之前, 为防止违规行为后果进一步扩大, 交易所可对其采取下列限制性措施:

- (一) 限期说明情况;
- (二) 暂停登录新的客户编码;
- (三) 暂停出金;
- (四) 限制指定交割仓库的交割业务;
- (五) 降低持仓限量或标准仓单持有限量;
- (六) 调高保证金比例;
- (七) 暂停开仓交易;
- (八) 限期平仓。

采取前款(五)至(八)项措施须经交易所理事会决定。

第三章 违规处理

第十七条 有多种违规行为的, 分别定性, 数罚并用。多次违规的, 从重或加重处罚。

第十八条 期货公司会员具有下列违反经纪业务资格管理规定行为之一的, 责令改正, 没收违规所得; 根据情节轻重给予警告、通报批评、强行平仓、暂停开仓交易 1 至 6 个月、取消会员资格的处罚; 没有违规所得或者违规所得 5 万元以下的, 可并处 5 至 25 万元的罚款; 违规所得 5 万元以上的, 可并处违规所得一倍以上五倍以下的罚款:

- (一) 以欺骗手段获取从事期货经纪业务资格的;
- (二) 擅自设立从事期货经纪业务分支机构的;
- (三) 聘用未取得期货从业人员资格和未经交易所培训合格的人员从事经纪业务的;
- (四) 其他违反中国证监会及交易所对交易所会员经纪业务资格管理规定的行为。

第十九条 期货公司会员具有下列违反经纪业务管理规定行为之一的, 责令改正, 没收违规所得; 情节较轻的, 给予警告、通报批评, 可并处 1 至 10 万元的罚款; 情节严重的, 强行平仓、暂停开仓交易 1 至 6 个月、取消会员资格、宣布为“市场禁止进入者”; 没有违规所得或违规所得 10 万元以下的, 可并处 10 至 50 万元的罚款; 违规所得 10 万元以上的, 可并处违规所得一倍以上五倍以下的罚款:

- (一) 为未履行开户手续或未按规定履行开户手续的客户进行期货交易的;
- (二) 违反交易编码管理制度的;
- (三) 未按规定履行审核义务, 为不符合开户条件的客户办理开户手续的;
- (四) 未如实向客户说明期货交易的风险或不签署风险声明书的;
- (五) 向客户作获利保证或与客户私下约定分享赢利或共担风险损失的;
- (六) 利用客户帐户名义为自己或他人交易的;

(七) 未按客户的委托事项进行交易, 故意阻止、延误或改变客户下单指令, 诱导、强制客户按自己的意志进行交易的;

(八) 场外交易、私下对冲的;

(九) 未将自有资金与客户资金分户存放的;

(十) 无正当理由拖延客户出金的;

(十一) 允许客户在保证金不足时开仓交易的;

(十二) 挪用或擅自允许他人挪用客户资金或套用不同帐户资金的;

(十三) 故意制造和散布虚假的或容易使人误解的信息进行误导的;

(十四) 泄露客户委托事项或其他交易秘密的;

(十五) 出市代表接受本单位以外的其他单位和个人的委托指令进行交易的;

(十六) 未按规定向客户提供有关成交结果、资金结算报表的;

(十七) 其他违反中国证监会和交易所对经纪业务管理规定的行为。

交易所可给予责任人暂停从事交易所期货业务 1 个月以内的处罚, 情节严重的, 给予责任人暂停从事交易所期货业务 1 至 6 个月或取消其从事交易所期货业务资格的处罚。

第二十条 会员有下列行为之一的, 责令改正, 给予警告、通报批评、暂停开仓交易 1 至 6 个月的处罚; 情节严重的, 取消会员资格:

(一) 会员法定代表人、经营范围、注册地和分支机构等变更后未履行报告义务的;

(二) 未按规定的期限要求向交易所报送财务报表等有关材料的;

(三) 未按大户报告制度向交易所履行申报义务, 或作虚假报告、隐瞒不报的;

(四) 未协助交易所对其涉嫌违规或者违规的客户采取限制性措施的;

(五) 未按交易所规定及时缴纳年会费等有关费用的;

(六) 不按规定保管有关交易、结算、财务、会计等资料的;

(七) 伪造、涂改、买卖各种凭证或审批文件的;

(八) 非期货公司会员从事业务或期货公司会员从事自营业务的;

(九) 假借期货交易之名从事非法活动的。

第二十一条 会员存在下列情况之一的, 取消会员资格:

(一) 被中国证监会吊销期货经纪业务许可证或被中国证监会宣布为“市场禁止进入者”的;

(二) 私下转让会员席位, 将席位委托给他人管理或承包给他人经营的;

(三) 资金、人员和设备严重不足, 管理混乱, 经整顿无效的;

(四) 拒不执行会员大会或理事会决议的;

(五) 无正当理由连续三个月不做交易的;

(六) 其他违反国家法律、法规、规章和严重违反交易所章程及有关规定的。

第二十二条 会员无正当理由未在规定期限内执行强行平仓的, 给予警告、通报批评、暂停开仓交易 1 个月以内处罚, 可并处 5 万元以下的罚款。

第二十三条 会员具有下列违反交易所结算管理规定行为之一的, 责令改正, 可给予警告; 情节严重的, 给予通报批评、暂停开仓交易 1 个月以内的处罚, 可并处 1 至 20 万元的罚款。

(一) 会员未按时足额缴纳保证金的;

(二) 在结算报告书、交易月报表和其他结算文件资料中作不真实记载的;

(三) 对客户保证金未进行分帐管理的;

(四) 未对客户实行每日结算的;

(五) 伪造、变造交易记录、会计报表、帐册的。

第二十四条 交易所对会员(客户)在套期保值申报过程中协助提供或出具虚假材料的以及违反交易所其他规定的, 除取消其套期保值申请资格外, 可并处不超过其持有的虚假套期保值持仓总金额 5% 的罚款, 并视情节轻重, 给予警告、通报批评、强行平仓、没收违规所得、取消会员

资格、宣布为“市场禁止进入者”的处罚。

第二十五条 会员在实物交割环节上蓄意违约,影响或试图影响实物交割的正常进行,牟取非法利益的,交易所对违约会员可给予警告、通报批评、暂停开仓交易 1 至 6 个月的处罚,有违约所得的,没收违约所得,并可处违约部分合约价值 10%至 30%的罚款。

第二十六条 会员或客户违反交易所持仓管理规定的,给予强行平仓、警告、通报批评的处罚。

第二十七条 会员具有下列违反交易所信息和计算机通讯等设备管理规定行为之一的,责令改正,赔偿经济损失。情节较轻的,给予警告、暂停开仓交易 1 个月以内的处罚,可并处 1 至 5 万元的罚款;情节严重的,给予暂停开仓交易 1 至 6 个月、取消会员资格的处罚,可并处 5 至 20 万元的罚款:

- (一) 未经交易所许可,擅自发布交易所信息的;
- (二) 擅自动用其他会员席位上的计算机或通讯设备的;
- (三) 通过交易席位非法窃取其他会员的成交、结算资金等商业秘密或破坏交易系统的。

交易所可给予责任人暂停从事交易所期货业务 1 个月以内的处罚;情节严重的,给予责任人暂停从事交易所期货业务 1 至 6 个月或取消其从事交易所期货业务资格的处罚。

第二十八条 会员从事标准仓单交易时,违反交易所规定的,交易所将对其处以警告、通报批评、罚款 1 至 10 万元、暂停其从事标准仓单交易的处罚,情节严重的将取消其会员资格。

第二十九条 期货市场参与者具有下列违反交易管理规定行为之一的,责令改正,没收违规所得。情节较轻的,给予警告、强行平仓、暂停开仓交易 1 个月以内的处罚;没有违规所得或者违规所得 5 万元以下的,可并处 5 至 20 万元的罚款;违规所得 5 万元以上的,可并处违规所得一倍以上三倍以下的罚款;情节严重的,给予通报批评、强行平仓、暂停开仓交易 1 至 6 个月、取消会员资格、宣布为“市场禁止进入者”的处罚;没有违规所得或者违规所得 10 万元以下的,可并处 10 至 100 万元的罚款;违规所得 10 万元以上的,可并处违规所得三倍以上五倍以下的罚款:

- (一) 通过合谋,集中资金,统一指令,联手买卖,操纵市场价格的;
- (二) 利用移仓、分仓、对敲等手段,规避交易所的持仓限制,超量持仓,控制或企图控制市场价格,影响市场秩序的;
- (三) 利用对敲、自成交等手段,影响市场价格、转移资金或者牟取不当利益的;
- (四) 不以成交为目的或明知申报的指令不能成交,仍恶意或连续输入交易指令企图影响期货价格,扰乱市场秩序或转移资金的;
- (五) 为制造虚假的市场行情而进行连续买卖、自我买卖或蓄意串通,按事先约定的方式或价格进行交易或互为买卖,制造市场假象,影响或企图影响市场价格或持仓量的;
- (六) 利用内幕信息或国家机密进行期货交易或泄露内幕信息影响期货交易的;
- (七) 以垄断、囤积标的物和不当集中持仓量的方式,控制交易所大量指定交割仓库标准仓单,企图或实际严重影响期货市场行情或交割的;
- (八) 以操纵市场为目的,用直接或间接的方法操纵或扰乱交易秩序,妨碍或有损于公正交易,有损于国家利益和社会公众利益的;
- (九) 以非善意的期转现行为,影响市场秩序的;
- (十) 未按要求使用交易所标准仓单管理系统,影响系统正常运作的;
- (十一) 未遵守交易所风险警示制度有关要求的;
- (十二) 开具空头支票、虚开增值税发票及其他伪造票证的;
- (十三) 其他违反中国证监会和交易所有关交易管理规定的行为。

第三十条 出市代表具有下列行为之一的,给予警告处罚;情节严重的,给予暂停出市交易 1 个月以内或取消出市代表资格的处罚,可并处 1 千元至 1 万元的罚款:

- (一) 违反交易所有关交易大厅管理规定的;

- (二) 未按规定程序操作, 给交易系统造成损害的;
- (三) 随意拆卸、搬动交易大厅内各种设备或私接电话和其他设备的;
- (四) 采取虚假、欺骗和不正当手段骗取出市代表资格的;
- (五) 伪造、涂改、借用出市代表证件的;

具有本条第(二)、(三)项行为之一造成损害的, 由其委派会员承担赔偿责任。

第三十一条 结算交割员具有下列行为之一的, 给予警告处罚; 情节严重的, 给予暂停结算交割员资格1个月以内或取消结算交割员资格的处罚, 可并处1千元至1万元的罚款:

- (一) 采取虚假、欺骗和不正当手段骗取结算交割员资格的;
- (二) 伪造、涂改、借用结算交割员证件的。

第三十二条 指定交割仓库有下列行为之一的, 责令改正, 没收违规所得。情节较轻的, 给予警告、通报批评, 可并处1至10万元的罚款; 情节严重的, 暂停交割业务、取消其交割仓库资格、宣布为“市场禁止进入者”, 没有违规所得或违规所得10万元以下的, 可并处10至50万元的罚款; 违规所得10万元以上的, 可并处违规所得一倍以上五倍以下的罚款:

- (一) 违反国家有关规定参与期货交易的;
- (二) 出具虚假仓单的;
- (三) 盗卖交割商品的;
- (四) 泄露与期货有关不宜公开的仓储信息或散布虚假信息误导市场的;
- (五) 与会员或客户联手, 影响或企图影响期货市场价格的;
- (六) 标准仓单所示商品中有牌号、商标、规格、质量等混杂的;
- (七) 交割商品与单证不符的;
- (八) 交割商品没有或缺少规定证明文件的;
- (九) 交割商品的捆数、块数、包装要求和交易所规定不符的;
- (十) 未完成规定的检验项目而开具仓单的;
- (十一) 错收错发的;
- (十二) 因保管不当, 引起储存商品变质、灭失的;
- (十三) 在搬运、装卸、堆码等作业过程中造成包装和商品损坏的;
- (十四) 商品交割中滥行收费的;
- (十五) 蓄意刁难, 造成卖方或买方违约的;
- (十六) 违反期货交割业务规则, 限制、故意拖延交割商品的入库、出库的;
- (十七) 拒绝、阻挠交易所依法监督检查的;
- (十八) 其他违反中国证监会和交易所规定的行为。

第三十三条 会员或客户以各种手段扰乱交易管理秩序的, 给予警告、通报批评、暂停开仓交易1个月以内的处罚, 对直接责任人员给予暂停从事本交易所期货业务1个月以内的处罚; 情节严重的, 给予通报批评、暂停开仓交易1至6个月、取消会员资格、宣布为“市场禁止进入者”, 对直接责任人暂停从事本交易所期货业务1至6个月、宣布为“市场禁止进入者”的处罚。

第三十四条 被交易所宣布为“市场禁止进入者”的, 自宣布生效之日起20个交易日内清理原有持仓, 了结交易业务, 结清债权债务。

被中国证监会或其他期货交易所宣布为“市场禁止进入者”的, 在市场禁止进入期限内不得从事本交易所期货业务。

第三十五条 会员或客户拒绝、阻挠交易所依法对其交易行为、经纪行为进行监督检查的, 责令改正, 给予通报批评、暂停开仓交易1个月以内的处罚, 可并处1至20万元的罚款。

第三十六条 交易所工作人员违反有关规定的, 按国家法律、法规和交易所人事管理制度及有关廉政规定处理。

第四章 裁决与执行

第三十七条 交易所作出取消会员资格、宣布为“市场禁止进入者”的处罚应当由交易所理事会决定。

第三十八条 交易所对违规行为核查后, 事实清楚、证据确凿的, 依照交易所章程、交易规则及本办法规定予以裁决。

第三十九条 交易所作出裁决应制作处理决定书。

处理决定书主要包括以下内容:

- (一) 当事人的姓名或者名称、住所;
- (二) 违规事实和证据;
- (三) 处罚种类和依据;
- (四) 处罚的履行方式和期限;
- (五) 不服处罚决定申请复议途径和期限;
- (六) 作出处理决定的日期。

第四十条 交易所应将处理决定书送达当事人。当事人为会员的, 处理决定书送至交易席位视为送达; 当事人为非会员的, 可邮寄送达。邮件寄出后, 市内 3 日、市外 7 日视为送达。处理决定书同时分送有关协助执行部门。

按照中国证监会的规定需要抄报违规处理情况的, 同时抄报中国证监会。

第四十一条 交易所作出的处理决定书自送达之日起生效。

当事人对处理决定书不服的, 可于决定书生效之日起 10 日内向交易所书面申请复议一次, 复议期间不停止决定的执行。

第四十二条 交易所应于收到复议申请书之日起一个月内作出复议决定, 复议决定为终局决定。

第四十三条 经交易所作出处理决定承担履行义务的会员拒绝履行义务的, 由交易所强制执行。

第四十四条 违规处理决定中, 具有罚没款项的, 当事人应在处理决定书生效之日起 5 日内将罚没款项如数缴纳至交易所指定帐户。逾期不付罚没款项的, 交易所从会员专用资金帐户中划付。对会员工作人员的罚没款项, 由会员代缴。

会员应当配合执行交易所对客户处罚, 划拨客户在该会员处的资金。

第四十五条 违规处理决定中, 具有罚没款项的, 受处罚的指定交割仓库应在处理决定书生效之日起 5 日内将罚没款项缴纳至交易所指定帐户; 对指定交割仓库工作人员的罚没款项, 由指定交割仓库代缴。逾期不缴的, 交易所从该指定交割仓库风险抵押金中划转。

第五章 纠纷调解

第四十六条 会员、客户、指定交割仓库之间发生的期货交易纠纷可自行协商解决, 也可提请交易所调解。

第四十七条 交易所的调解机构是交易所理事会下设的调解委员会。

第四十八条 调解应在事实清楚、责任明确的基础上依据国家有关期货交易的法律、法规和交易所的规章制度进行。

第四十九条 当事人向调解委员会提出调解申请, 应当从其知道或应当知道其合法权益被侵害之日起 30 日内提出。

第五十条 当事人申请调解应当符合下列条件:

- (一) 有调解申请书;
- (二) 有具体的事实、理由和请求;

(三) 属于调解委员会的受理范围。

第五十一条 当事人向调解委员会申请调解，必须提交书面申请和有关材料。

调解申请书应当写明以下事项：

(一) 当事人的姓名、性别、年龄、职业、工作单位和住所或单位名称、住所和法定代表人或者负责人的姓名、职务；

(二) 请求调解的事实、理由及要求；

(三) 有关证据。

第五十二条 当事人根据有关规定负有举证的责任。调解委员会认为必要时，可调查收集证据。

第五十三条 调解委员会调解纠纷，应当在查明事实，分清是非和自愿的基础上调解，促使当事人相互谅解，达成协议。

第五十四条 经调解达成的协议应记录在案，并制作调解书，由双方当事人签字，调解员署名，加盖调解委员会印章后生效。

第五十五条 调解书应当写明以下内容：

(一) 双方当事人的名称、住所、法定代表人或者负责人的姓名及职务；

(二) 争议的事项和请求；

(三) 协议结果。

第五十六条 调解委员会应当在受理调解后 30 天内结案；到期未结案的，调解委员会应当向当事人说明理由。双方当事人要求继续调解的，调解委员会应继续调解。有一方要求终止调解的，应当终止调解。

第五十七条 调解不成的，当事人可以依法提请仲裁机构仲裁或向人民法院起诉。

第六章 附 则

第五十八条 本办法解释权属于大连商品交易所。

第五十九条 本办法所称“以上”、“以下”均含本数。

第六十条 本办法自公布之日起实施。

大连商品交易所指定交割仓库管理办法

(自 2014 年 12 月 19 日起施行)

第一章 总 则

第一条 为加强大连商品交易所（以下简称交易所）指定交割仓库的管理，规范交割行为，保证交割正常进行，根据《中华人民共和国合同法》和《大连商品交易所交易规则》的有关规定，制定本办法。

第二条 指定交割仓库是指经交易所审定注册的，为期货合约履行实物交割的指定交割地点。

第三条 交易所依据本办法对指定交割仓库进行管理，指定交割仓库及其有关工作人员必须遵守本办法。

第二章 申请和审批

第四条 申请指定交割仓库必须具备以下条件：

- （一）具有工商行政管理部门颁发的营业执照；
- （二）净资产和注册资本须达到交易所规定的数额；
- （三）财务状况良好，具有较强的抗风险能力；
- （四）具有良好的商业信誉,完善的仓储管理规章制度; 近三年内无严重违法违规行为记录和被取消指定交割仓库资格的记录；
- （五）承认交易所的交易规则、交割细则等；
- （六）仓库主要管理人员应当具有仓储管理经验；
- （七）堆场、库房有一定规模,有储存交易所上市商品的条件、设备完好、齐全、计量符合规定要求以及良好的交通运输条件；
- （八）有严格、完善的商品检化验制度、商品出入库制度、库存商品管理制度等；
- （九）交易所要求的其他条件。

第五条 申请成为指定交割仓库，须提供下列材料：

- （一）申请书；
- （二）工商行政管理部门颁发的营业执照复印件；
- （三）注册会计师事务所出具的近两年审计报告原件或加盖会计师事务所印章的复印件；

（四）申请单位仓库土地使用证复印件及相关文件；

（五）申请单位上级主管部门或董事会出具的同意申请指定交割仓库的批准文件及有关单位出具的担保函；

（六）仓库管理制度及简介；

（七）交易所要求提供的其他文件。

第六条 指定交割仓库的审批程序：

（一）交易所根据前条所列材料进行初审；

（二）交易所根据初审结果派员对申请单位进行实地调查和评估；

（三）指定交割仓库需根据本办法，制定相应的操作规程或细则，经交易所审定后方可开展有关期货合约的实物交割业务；

（四）交易所根据实地调查和评估结果择优选定物流企业或生产加工企业，并与之签订《指定交割仓库协议书》。

第七条 指定交割仓库经交易所核定批准后须办理以下事宜：

（一）指定交割仓库签发标准仓单所需各种印章须到交易所备案；

（二）期货交割业务指定专人授权书及专人签字须到交易所备案；

（三）缴纳风险抵押金；

（四）指定交割仓库期货管理人员接受交易所的交割业务培训；

（五）交易所规定的其他事宜。

第八条 指定交割仓库申请放弃指定交割仓库资格，应向交易所递交《放弃指定交割仓库资格申请书》，并经交易所审核批准。

第九条 指定交割仓库放弃或被取消资格的，应办理以下事项：

（一）交割商品全部出库或者全部变成现货，或者按交易所认可的其他方式处理；

（二）结清与交易所的债权债务；

（三）按交易所规定清退风险抵押金。

第十条 指定交割仓库资格的确认、放弃或取消，交易所应及时通告会员及指定交割仓库，并报中国证监会备案。

第三章 权利和义务

第十一条 指定交割仓库的权利：

（一）按交易所规定签发标准仓单；

（二）按交易所审定的收费项目、标准和方法收取有关费用；

(三) 对交易所制定的有关实物交割的规定享有建议权;

(四) 交易所交割细则和《指定交割仓库协议书》规定的其他权利。

第十二条 指定交割仓库的义务:

(一) 遵守交易所的交割细则和其它有关规定, 接受交易所的监管, 及时向交易所提供有关情况;

(二) 根据期货合约规定的标准, 对用于期货交割的商品进行验收入库;

(三) 按规定保管好库内的商品, 确保商品安全;

(四) 按标准仓单要求提供商品, 积极协助货主安排交割商品的运输;

(五) 保守与期货交易有关的商业秘密;

(六) 参加交易所组织的年审;

(七) 缴纳风险抵押金;

(八) 变更法定代表人、注册资本、股东或股本结构、仓储场地等事项, 应及时向交易所报告;

(九) 每年四月底之前, 向交易所提交经审计的上年年度财务报告等年审材料;

(十) 出现法律纠纷时, 在三个工作日内应向交易所报告;

(十一) 对外出具有关货物所有权证明函件时, 应在证明函件落款日期的前三个工作日内向交易所报告;

(十二) 交易所交割细则和《指定交割仓库协议书》规定的其他义务。

第四章 日常业务

第十三条 指定交割仓库的日常业务分为三个阶段: 商品入库、商品保管和商品出库。

第十四条 指定交割仓库应保证期货交割商品优先办理入、出库。

第十五条 经交割预报的商品在入库过程中, 指定交割仓库应及时进行抽样检验或者验收, 并将入库数量、检验结果及时录入计算机。

第十六条 指定交割仓库对期货交割业务进行计算机管理, 期货帐目及有关单据须按交易所规定的统一格式进行处理, 并定期发送至交易所。

第十七条 指定交割仓库对检验后的样品应设专门地点存放, 以备查验。

第十八条 期货货物须合理堆放。

第十九条 指定交割仓库储存黄大豆 1 号、黄大豆 2 号、玉米时, 应对保管的期货商品进行定期检测, 检测内容包括: 水分、温度、虫情、鼠情等, 并做好记录以备查验。

第二十条 指定交割仓库储存黄大豆 1 号、黄大豆 2 号、玉米时, 对水分较大或水分不均的

期货商品，指定交割仓库应及时采取相应的保管措施，确保商品质量。

第二十一条 指定交割仓库储存黄大豆 1 号、黄大豆 2 号、玉米时，在高温季节（5 月 1 日～10 月 31 日），各指定交割仓库必须对露天保管的商品采取加盖顶席、苇席兜底的保管措施。

第二十二条 指定交割仓库储存黄大豆 1 号、黄大豆 2 号、玉米时，在高温季节应及时对期货商品进行熏蒸。

第二十三条 指定交割仓库储存黄大豆 1 号、黄大豆 2 号、玉米时，应定期灭鼠，减少期货商品损耗。

第二十四条 指定交割仓库在贮存线型低密度聚乙烯、聚氯乙烯、纤维板、胶合板、聚丙烯、玉米淀粉时，应远离火种和热源，禁止阳光直接照射，禁止露天堆放。

第二十五条 指定交割仓库在贮存线型低密度聚乙烯、聚氯乙烯、纤维板、胶合板、聚丙烯、玉米淀粉时，应配备托盘，防止垛位底部受潮。

第二十六条 指定交割仓库在贮存线型低密度聚乙烯、聚氯乙烯、聚丙烯时，应与氧化剂、酸碱类物品分开存放。

第二十七条 指定交割仓库在贮存线型低密度聚乙烯、聚氯乙烯、纤维板、胶合板、聚丙烯时，应将不同生产厂家、不同牌号商品分开存放。

第二十八条 线型低密度聚乙烯、聚氯乙烯、纤维板、胶合板、聚丙烯、玉米淀粉指定交割仓库应保持库房通风、干燥、清洁，消防设施良好。纤维板、胶合板指定交割仓库应定期对库房做防治白蚁工作。

第二十九条 指定交割仓库在贮存鸡蛋、玉米淀粉时，应与中药等有气味的物品分开存放。

第三十条 指定交割仓库在贮存鸡蛋时，应将不同客户、不同批次的鸡蛋分开存放。

第三十一条 指定交割仓库在贮存玉米淀粉时，应将不同生产厂家、不同包装规格商品分开存放。

第三十二条 指定交割仓库必须积极配合货主发运商品，不得故意拖延。

第三十三条 指定交割仓库应及时将出库商品的进度、垛位及发运方向等情况反馈到交易所。

第五章 监督管理

第三十四条 指定交割仓库必须对库存交割商品投保财产险。

第三十五条 指定交割仓库必须对期货交割商品单独设帐管理。

第三十六条 指定交割仓库必须确定一名负责人主管期货交割业务，指定专人负责交割商品的管理和办理标准仓单业务。

第三十七条 为保证和提高交易所指定交割仓库为会员、客户的服务质量，切实改进仓库管

理水平，交易所对指定交割仓库实行仓库自查、交易所抽查和年审制度。

自查制度。各指定交割仓库根据本办法、交割细则、标准仓单管理办法和仓库的实际情况，每月选择一项或几项工作内容进行检查，并将检查结果送交易所。

交易所抽查制度。交易所根据掌握的情况或会员、客户的反映，随时对各指定交割仓库的一项或多项工作进行抽查，并做好详细记录，以检查指定交割仓库在日常工作中对交易所的各项规定的执行情况。

年审制度。交易所每一年度对指定交割仓库的工作做一次年度检查和评比。交易所将根据审核评比结果，调整交割仓库的配货量和交割限量。对确不符合指定交割仓库要求又不能做改进的仓库，交易所将取消其指定交割仓库资格。

交易所审查的内容包括仓储设施、库容库貌、业务能力、业务实绩、帐目管理、会员满意程度以及交易所认为必要的其它内容。

第三十八条 交易所所有权根据市场情况调整指定交割仓库的交割限量。

第三十九条 指定交割仓库应向交易所缴纳风险抵押金作为仓库履行义务的保证。若未发生经济赔偿的，交易所将其利息返还给仓库，利息按中国人民银行公布的同期银行活期存款利率计算；若发生经济赔偿的，交易所首先用其所缴纳的风险抵押金赔偿，抵押金不足以赔偿的，交易所所有权向指定交割仓库追索。

风险抵押金的具体数额和缴纳方式在指定交割仓库的协议书上明确。

第六章 附则

第四十条 本办法第十九条、第二十一条、第二十二条、第二十三条不适用于焦炭指定交割仓库。

第四十一条 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。

第四十二条 本办法解释权属于大连商品交易所。

第四十三条 本办法自公布之日起实施。

大连商品交易所焦炭套期保值管理办法

(经大连商品交易所第二届理事会第十八次会议审议批准,自2011年4月15日起施行)

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 期货套期保值持仓额度分为一般月份(自合约上市之日起至交割月份前第二月的最后一个交易日)套期保值持仓额度(以下简称“一般月份套期保值持仓额度”)和临近交割月份(交割月份前一个月和交割月份)套期保值持仓额度(以下简称“临近交割月份套期保值持仓额度”)。

第三条 会员、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 一般月份套期保值持仓额度的申请与审批

第四条 一般月份套期保值持仓额度实行审批制。一般月份套期保值持仓额度分为一般月份买入套期保值额度和一般月份卖出套期保值额度。

第五条 申请一般月份套期保值持仓额度的客户应当向其开户的期货公司会员申报,由期货公司会员进行审核后,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。

第六条 申请一般月份套期保值持仓额度的客户和非期货公司会员应当具备与套期保值交易品种相关的生产经营资格。

第七条 申请一般月份套期保值持仓额度的会员或客户,应当填写《大连商品交易所一般月份套期保值持仓额度申请(审批)表》,并向交易所提交下列证明材料:

- (一)企业营业执照副本复印件;
- (二)当年和上一年的现货经营业绩;
- (三)企业套期保值交易方案(主要内容包括风险来源分析、确定保值目标、明确交割或平仓的数量);
- (四)交易所要求的其他证明材料。

第八条 一般月份套期保值持仓额度的申请应当在套期保值合约交割月份前第二月的第一个交易日之前提出,逾期交易所不再受理该合约一般月份套期保值持仓额度的申请。会员或客户可以一次申请多个合约的一般月份套期保值持仓额度。

第九条 交易所对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额度。一般月份套期保值持仓额度不超过其所提供的套期保值证明材料中所申报的数量。

全年各合约月份一般月份套期保值持仓额度累计不超过其当年生产能力、当年生产计划或上一年度该商品经营数量。

第十条 交易所自收到一般月份套期保值持仓额度申请后,在5个交易日内进行审核,并按下列情况分别处理:

- (一) 对符合条件的，书面通知其准予办理；
- (二) 对不符合条件的，书面通知其不予办理；
- (三) 对相关证明材料不足的，告知申请人补充证明材料。

第三章 临近交割月份套期保值持仓额度的申请与审批

第十一条 临近交割月份套期保值持仓额度实行审批制。临近交割月份套期保值持仓额度分为临近交割月份买入套期保值额度和临近交割月份卖出套期保值额度。

第十二条 申请临近交割月份套期保值持仓额度的客户应当向其开户的期货公司会员申报，由期货公司会员进行审核后，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。

第十三条 申请临近交割月份套期保值持仓额度的会员或客户，应当填写《大连商品交易所临近交割月份套期保值持仓额度申请（审批）表》，并向交易所提交以下证明材料：

(一) 生产企业应当提交的证明材料：

上一年度生产计划书、本次保值头寸所对应的现货仓单或拥有实物的其他凭证（购销合同或发票）、位列行业主管部门公告的符合《焦化行业准入条件》企业名单的证明材料。

(二) 加工企业应当提交的证明材料：

上一年度生产计划书、卖出套期保值需提供本次保值头寸所对应的现货仓单或拥有实物的其他凭证（购销合同或发票），买入套期保值需提供本次保值头寸所对应的购销计划（合同）的证明材料。

(三) 贸易及其他企业应当提交的证明材料：

卖出套期保值需提供本次保值头寸所对应的现货仓单或拥有实物的其他凭证（购销合同或发票），买入套期保值需提供本次保值头寸所对应的购销计划（合同）的证明材料。

(四) 除上述证明材料外，交易所在认为有必要的情况下还可以要求会员或客户提供其他证明材料。

第十四条 临近交割月份套期保值持仓额度的申请应当在套期保值合约交割月份前第二月的第一个交易日至倒数第十个交易日之间提出，逾期交易所不再受理该交割月份的套期保值申请。

需要申请临近交割月份套期保值持仓额度且尚未申请一般月份套期保值持仓额度的会员或客户，应当补充提交**第七条**规定的证明材料。

第十五条 对临近交割月份套期保值持仓额度的申请，交易所将按照会员或客户的交易部位和数量、现货经营状况，对应期货合约的持仓状况、可供交割品在交易所库存、以及期现价格是否背离等，确定其临近交割月份套期保值持仓额度。临近交割月份套期保值持仓额度不超过其所提供的相关套期保值证明材料中所申报的数量。

全年各合约月份临近交割月份套期保值持仓额度累计不超过其当年生产能力、当年生产计划或上一年度该商品经营数量。

第十六条 交易所收到临近交割月份套期保值持仓额度申请后，在交割月份前一个月的第一个交易日之前进行审批，并按下列情况分别处理：

- (一) 对符合条件的，书面通知其准予办理；
- (二) 对不符合条件的，书面通知其不予办理；
- (三) 对相关证明材料不足的，告知申请人补充证明材料。

第十七条 未在规定时间内申请临近交割月份套期保值持仓额度或申请临近交割月份套期保值持仓额度未获批准的会员或客户，其一般月份套期保值持仓在进入合约交割月份前一个月和交割月份时，将按照期货品种限仓制度规定的额度执行，并按此额度标准转化为临近交割月份套期保值持仓。

申请临近交割月份套期保值持仓额度并获批准的会员或客户，其一般月份套期保值持仓在进

入合约交割月份前一个月时，将按照批准的临近交割月份套期保值持仓额度执行，并按此额度标准转化为临近交割月份套期保值持仓。

第四章 套期保值交易

第十八条 临近交割月份套期保值持仓额度获得审批的会员或客户，应当在套期保值合约交割月份前一个月最后一个交易日收市前，按批准的交易方向和额度建仓。在规定期限内未建仓的，视为自动放弃临近交割月份套期保值持仓额度。

第十九条 临近交割月份套期保值持仓额度不得重复使用。

第二十条 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。

第五章 套期保值监督管理

第二十一条 交易所对会员或客户提供的有关生产经营状况、资信情况及期货、现货市场交易行为可随时进行监督和调查，会员及相关客户应予协助和配合。

交易所可以要求获批套期保值持仓额度的会员或客户报告现货、期货交易情况。

第二十二条 交易所对会员或客户获批套期保值持仓额度的使用情况进行监督管理。

第二十三条 会员或客户在获得套期保值持仓额度期间，企业情况发生重大变化时，应及时向交易所报告。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会员或客户套期保值持仓额度进行调整。

第二十四条 会员或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书面变更申请。

第二十五条 交易所对套期保值交易的持仓量单独计算，不受持仓限额的限制。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。

第二十六条 会员或客户套期保值持仓超过获批套期保值持仓额度的，应当在下一交易日第一节交易结束前自行调整；逾期末进行调整或调整后仍不符合要求的，交易所可以强行平仓。

第二十七条 获批套期保值持仓额度的会员或客户在套期保值额度内频繁进行开平仓交易的，或者利用获批的套期保值持仓额度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额度，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。

第二十八条 会员或客户在进行套期保值持仓额度申请和交易时，有欺诈或违反交易所规定行为的，交易所可以不受理其套期保值持仓额度申请、调整或者取消已批准的套期保值持仓额度，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。

第六章 附 则

第二十九条 本办法解释权属于大连商品交易所。

第三十条 本办法自公布之日起实施。

大连商品交易所期货合约文本

玉米期货合约

交易品种	黄玉米
交易单位	10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, 3, 5, 7, 9, 11月
交易时间	每周一至周五上午9:00~11:30, 下午13:30~15:00
最后交易日	合约月份第十个交易日
最后交割日	最后交易日后第二个交易日
交割等级	大连商品交易所玉米交割质量标准 (FC/DCE D001-2009)（具体内容见附件）
交割地点	大连商品交易所玉米指定交割仓库
最低交易保证金	合约价值的5%
交易手续费	不超过3元/手
交割方式	实物交割
交易代码	C
上市交易所	大连商品交易所

附件：

大连商品交易所玉米交割质量标准 (FC/DCE D001-2009)

1 范围

本标准规定了用于大连商品交易所交割的黄玉米质量指标、分级标准及检验方法。

本标准适用于大连商品交易所玉米期货合约交割标准品和替代品。

2 引用标准

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 1353-2009 玉米

GB/T 20570-2006 玉米储存品质判定规则

3 定义

本标准采用的定义按 GB 1353-2009 和 GB/T 20570-2006 解释。

4 质量指标

4.1 玉米期货合约交割标准品品质技术要求：

容重/（g/L）	杂质含量 （%）	水分含量 （%）	不完善粒含量（%）		色泽、气味
			总量	其中：生霉粒	
≥650	≤1.0	≤14.0	≤8.0	≤2.0	正常

4.2 玉米期货合约质量差异扣价：

项目	标准品质量要求	替代品质量要求	替代品扣价（元/吨）
容重/（g/L）	≥650	≥620且<650	-20
水分含量/（%）	≤14.0	>14.0且<14.5	0
生霉粒（%）	≤2.0	>2.0且≤4.0	-25

4.3 玉米储存品质技术要求：入库指标，宜存；出库指标，宜存或轻度不宜存。

4.4 散粮交割玉米出库不完善粒总量允许范围为≤11%。

4.5 卫生检验和植物检疫按国家有关标准和规定执行。

5 检验方法

按照 GB 1353-2009 和 GB/T 20570-2006 执行。

6 附加说明

本标准由大连商品交易所负责解释。

黄大豆 1 号期货合约

（自 A1103 合约施行）

交易品种	黄大豆1号
交易单位	10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%
合约交割月份	1, 3, 5, 7, 9, 11
交易时间	每周一至周五上午9:00~11:30, 下午13:30~15:00
最后交易日	合约月份第十个交易日
最后交割日	最后交易日后七日(遇法定节假日顺延)
交割等级	大连商品交易所黄大豆1号交割质量标准 (FA/DCE D001-2009) (具体内容见附件)
交割地点	大连商品交易所指定交割仓库
交易保证金	合约价值的5%
交易手续费	不超过4元/手
交割方式	实物交割
交易代码	A
上市交易所	大连商品交易所

附件:

大连商品交易所黄大豆 1 号交割质量标准 (FA/DCE D001-2009)

1 范围

本标准规定了用于大连商品交易所黄大豆 1 号期货合约的交割质量指标、分级标准及检验方法。

本标准适用于大连商品交易所黄大豆 1 号期货合约交割标准品和替代品。

本标准所称黄大豆为种皮为黄色、淡黄色，脐为黄褐、淡褐、深褐、黑色或其它颜色。

2 引用标准

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 1352-2009 大豆

国粮发〔2000〕143 号 《粮油储存品质判定规则》（试行）

3 术语和定义

本标准采用的术语和定义按 GB 1352-2009 和国粮发〔2000〕143 号解释。

4 质量要求和卫生要求

4.1 黄大豆 1 号交割标准品品质技术要求:

完整粒率 (%)	种皮	损伤粒率(%)		杂质含量 (%)	水分含量 (%)	色泽、气 味
		合计	其中:热损 粒			
≥85.0	黄色、淡黄色混 有异色粒限度为 5.0%	≤ 3.0	≤0.5	≤1.0	≤13.0	正常

4.2 黄大豆 1 号期货合约质量差异升扣价:

项目	质量标准(%)	允许范围(%)	质量差异(%) (高+;低-)	升扣价(元/ 吨)	备 注
完整粒率	≥85.0	≥95.0	-----	30	-----
		≥90.0且<95.0		10	
		≥80.0且<85.0		0	
		≥75.0且<80.0		-30	
损 伤 粒 率	合 计	≤3.0	-----	0	-----
		≤5.0		-30	
	其中: 热损 粒	≤0.5		0	
水分含量	≤13.0	11、1、3合约月 份<15.0	-1.0	+20	1. 升水升至水分含 量12.0% 2. 低于或高于标准 不足1.0%不计算升 扣价
		5、7、9合约月 份≤13.5	+1.0	-55	
杂质含量	≤1.0	<2.0	-0.5	+10	低于或高于标准不 足0.5% 不计算升 扣价
			+0.5	-30	

- 4. 3 转基因大豆不得以标准品或替代品交割。
 - 4. 4 卫生标准和动植物检疫项目按 GB1352-2009 执行。
 - 4. 5 储存品质技术要求:入库指标, 宜存; 出库指标, 宜存或不宜存
- 5 检验方法及规则
- 按照 GB 1352-2009 和国粮发[2000] 143 号执行。
- 6 附加说明
- 本标准由大连商品交易所负责解释。

黄大豆 2 号期货合约

交易品种	黄大豆2号
交易单位	10 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, 3, 5, 7, 9, 11 月
交易时间	每周一至周五上午9:00~11:30, 下午13:30~15:00
最后交易日	合约月份第10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	符合《大连商品交易所黄大豆2号交割质量标准（FB/DCE D001-2009）》（具体内容见附件）
交割地点	大连商品交易所指定交割仓库
最低交易保证金	合约价值的5%
交易手续费	不超过4元/手
交割方式	实物交割
交易代码	B
上市交易所	大连商品交易所

附件:

大连商品交易所黄大豆 2 号交割质量标准 (FB/DCE D001-2009)

1 范围

本标准规定了用于大连商品交易所黄大豆 2 号期货合约的交割质量指标、分级标准及检验方法。

本标准适用于大连商品交易所黄大豆 2 号期货合约交割标准品和替代品。

本标准所称黄大豆为种皮为黄色、淡黄色，脐为黄褐、淡褐、深褐色、黑色等。

2 引用标准

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。

SN/T 0798-1999 进出口粮油、饲料检验 检验名词术语

SN/T 0799-1999 进出口粮油、饲料检验 检验一般规则

SN/T 0800.1-1999 进出口粮油、饲料检验 抽样和制样方法

SN/T 0803.1-1999 进出口油料 粗脂肪检验方法

SN/T 0803.9-1999 进出口油料 粗蛋白质检验方法

SN/T 0803.7-1999 进出口油料 水分及挥发物检验方法

SN/T 0803.6-1999 进出口油料 杂质检验方法

SN/T 0803.2-1999 进出口油料 不完善粒检验方法

国粮发 [2000]143 号 《粮油储存品质判定规则》（试行）

3 定义

本标准采用下列定义。

3.1 粗脂肪：按 SN/T 0798-1999 关于粗脂肪的解释执行。

3.2 粗蛋白：按 SN/T 0798-1999 关于粗蛋白的解释执行。

3.3 水分及挥发物：按 SN/T 0798-1999 关于水分及挥发物的解释执行。

3.4 杂质：按 SN/T 0798-1999 关于杂质的解释执行。

3.5 破碎粒、损伤粒、热损粒：按 SN/T 0798-1999 关于破碎粒、损伤粒、热损粒的解释执行。

3.6 色泽气味：按 SN/T 0798-1999 关于色泽气味的解释执行。

3.7 储存品质控制指标：按国粮发[2000]143 号《粮油储存品质判定规则》（试行）关于储存品质

控制指标的解释执行。

4 质量指标

4.1 黄大豆 2 号期货合约交割标准品品质技术要求：

粗脂肪 (湿基) %	粗蛋白 (湿基) %	水分及挥发物 %	杂质%	破碎粒%	损伤粒%		色泽 气味
					总量	其中：热损粒%	
≥18.5	≥34.5	≤13.5	≤2.0	≤20.0	≤3.0	≤0.5	正常

4.2 黄大豆 2 号期货合约质量差异升扣价：

项 目		质量标准%	允许范围%	升扣价（元/吨）
粗脂肪（湿基）		≥18.5	≥16.5且<18.5	-120
粗蛋白（湿基）		≥34.5	≥33.5且<34.5	-50
水分及挥发物		≤13.5	11、1、3月合约交割的国	-50
损伤粒	总量	≤3.0	≤8.0	-30
	其中：热损粒	≤0.5	≤5.0	

4.3 大豆储存品质控制指标：入库指标，宜存；出库指标：宜存或不宜存。

4.4 散粮交割大豆出库破碎粒总量允许范围为≤25%。

4.5 卫生检验和动植物检疫按照国家有关标准和规定执行。

5 检验方法

5.1 检验的一般规则按 SN/T 0799-1999 执行。

5.2 抽样和制样方法按 SN/T 0800.1-1999 执行。

5.3 粗脂肪检验按 SN/T 0803.3-1999 执行。

5.4 粗蛋白检验按 SN/T 0803.9-1999 执行。

5.5 水分及挥发物检验按 SN/T 0803.7-1999 执行。

5.6 杂质检验按 SN/T 0803.6-1999 执行。

5.7 破碎粒、损伤粒、热损粒检验按 SN/T 0803.2-1999 执行。

5.8 色泽气味检验按 SN/T 0798-1999 和 SN/T 0800.1-1999 执行。

5.9 储存品质控制指标检验按国粮发[2000]143 号《粮油储存品质判定规则》（试行）执行。

6 附加说明：本标准由大连商品交易所负责解释。

豆粕期货合约

交易品种	豆粕
交易单位	10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	1，3，5，7，8，9，11，12月
交易时间	每周一至周五9:00~11:30，13:30~15:00
最后交易日	合约月份第10个交易日
最后交割日	最后交易日后第4个交易日
交割等级	大连商品交易所豆粕交割质量标准
交割地点	大连商品交易所指定交割仓库
最低交易保证金	合约价值的5%
交易手续费	不超过3元/手
交割方式	实物交割
交易代码	M
上市交易所	大连商品交易所

附件：

大连商品交易所豆粕交割质量标准

F/DCE D001-2006

DCE QUALITY SPECIFICATION OF THE DELIVERY SOYBEAN MEAL

- 1 主题内容与适用范围
 - 1.1 本标准规定了用于大连商品交易所交割的豆粕的质量要求、试验方法、检验规则、标签、包装、运输和贮存。
 - 1.2 大连商品交易所豆粕期货合约中所规定的豆粕是指以大豆为原料，以预压-浸提或浸提法取油后所得饲料用大豆粕，产地不限。
 - 1.3 本标准适用于大连商品交易所豆粕期货合约交割标准品。
- 2 规范性引用文件

应符合 GB/T 19541—2004 中规范性引用文件的有关规定。
- 3 术语和定义

应符合 GB/T 19541—2004 中术语和定义的有关规定。
- 4 要求
 - 4.1 感官性状：本品呈浅黄褐色或浅黄色不规则的碎片状、粉状或粒状，无发酵、霉变、非挤压性结块、虫蛀及异味异臭。
 - 4.2 夹杂物：应符合 GB/T 19541—2004 中夹杂物的有关规定。
 - 4.3 标准品的质量指标：

项 目	取 值
水分（%）	≤13.0
粗蛋白质（%）	≥43.0
粗纤维（%）	≤7.0
粗灰分（%）	≤7.0
尿素酶活性(以氨态氮计)[mg/(min·g)]	≤0.3
注：粗蛋白质、粗纤维、粗灰分三项指标均以87%干物质为基础计算。	
 - 4.4 卫生标准：应符合 GB/T 19541—2004 中卫生标准的有关规定。
- 5 试验方法、检验规则、标签、包装、运输和贮存

包装按《大连商品交易所交割细则》的规定执行，其它应符合 GB/T 19541—2004 中试验方法、检验规则、标签、运输和贮存的有关规定。
- 6 附加说明
 - 6.1 本标准由大连商品交易所负责解释。
 - 6.2 本标准自 2007 年 3 月合约开始实施。

豆油期货合约

交易品种	大豆原油
交易单位	10 吨/手
报价单位	元（人民币）/吨
最小变动价位	2 元/吨
涨跌停板幅度	上一交易日结算价的4%
合约月份	1, 3, 5, 7, 8, 9, 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
最后交易日	合约月份第10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	大连商品交易所豆油交割质量标准
交割地点	大连商品交易所指定交割仓库
最低交易保证金	合约价值的5%
交易手续费	不超过6元/手
交割方式	实物交割
交易代码	Y
上市交易所	大连商品交易所

附件:

大连商品交易所豆油交割质量标准

1. 主题内容与适用范围

1.1 本标准规定了用于大连商品交易所交割的豆油质量指标与分级标准。

1.2 大连商品交易所豆油期货合约中所规定的大豆原油是指以大豆为原料加工的不能供人类直接食用的大豆油，产地不限。

1.3 本标准适用于大连商品交易所豆油期货合约交割标准品。

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 1535 大豆油

SN/T 0798 进出口粮油、饲料检验 检验名词术语

GB 5537 植物油脂检验 磷脂测定法

3. 术语和定义

3.1 含磷量：符合 SN/T 0798 中的相关规定。

3.2 其他术语和定义：符合 GB1535 中的相关规定。

4. 质量要求

4.1 特征指标：符合 GB1535 中的相关规定。

4.2 质量等级指标：

项 目	质量指标
气味、滋味	具有大豆原油固有的气味、滋味，无异味
水分及挥发物(%) ≤	0.20
不溶性杂质(%) ≤	0.20
酸值(mg KOH/g) ≤	3.0
过氧化值 (mmol/kg) ≤	7.5
溶剂残留量(mg/kg) ≤	100
含磷量(mg/kg) ≤	200

4.3 卫生指标：按 GB 1535 中的规定执行。

4.4 其他：按 GB 1535 中的规定执行。

5. 检验方法、检验规则、标签

5.1 含磷量检验 按 GB 5537 执行。

5.2 其他：按 GB 1535 中的规定执行。

6. 附加说明

本标准由大连商品交易所负责解释。

棕榈油期货合约

交易品种	棕榈油
交易单位	10吨/手
报价单位	元（人民币）/吨
最小变动价位	2 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
最后交易日	合约月份第10个交易日
最后交割日	最后交易日后第2个交易日
交割等级	大连商品交易所棕榈油交割质量标准
交割地点	大连商品交易所棕榈油指定交割仓库
最低交易保证金	合约价值的5%
交易手续费	不超过6元/手
交割方式	实物交割
交易代码	P
上市交易所	大连商品交易所

附件 1:

大连商品交易所棕榈油交割质量标准 (F/DCE P001-2007)

1 主题内容与适用范围

1.1 本标准规定了用于大连商品交易所交割的棕榈油质量指标。

1.2 本标准适用于大连商品交易所棕榈油期货合约交割标准品。

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/T 15680-1995 食用棕榈油

GB 8873-88 油脂工业名词术语

3 术语和定义

3.1 符合 GB/T 15680-1995 食用棕榈油

3.2 符合 GB 8873-88 油脂工业名词术语

4 质量要求

4.1 特征指标

项 目	质量指标
折光指数 (40℃)	1.458-1.460
比重 (40℃/25℃水)	0.902-0.909
碘值 (gI/100g) ≥	56
皂化值 (mgKOH/g)	188-207
不皂化物 (%) ≤	1.0

4.2 质量指标

项 目	质量指标	
熔点 (℃) ≤	24	
酸值 (mgKOH/g) ≤	入库: 0.18	出库: 0.20
过氧化值 (meq/kg) ≤	入库: 5	出库: 10
色泽(罗维朋比色槽133.4mm) ≤	入库: 黄30; 红3.0	出库: 黄35; 红3.5
气味、滋味	具有棕榈油固有的气味、滋味，无异味	
透明度	40℃澄清、透明	
水分及挥发物 (%) ≤	0.05	
杂质 (%) ≤	0.05	

4.3 卫生指标: 按 GB/T 15680-1995 规定执行。

5 检验方法、检验规则、标签按 GB/T 15680-1995 规定执行。

6 贮存和运输

6.1 贮存

应贮存在低温、干燥、清洁及避光的地方。不得与有害、有毒物品一同存放。

6.2 运输

运输中应注意安全，防止日晒、雨淋、渗漏、污染和标签脱落。散装运输要有专车，保持车辆清洁、卫生。

7 附加说明

本标准由大连商品交易所负责解释。

根据大商所发[2012]27号通知文件，自棕榈油 P1303 合约起，执行以下交割质量标准：

大连商品交易所棕榈油交割质量标准

(F/DCE P002-2011)

1 主题内容与适用范围

1.1 本标准规定了用于大连商品交易所交割的棕榈油质量指标。

1.2 本标准适用于大连商品交易所棕榈油期货合约交割标准品。

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 15680-2009 棕榈油

GB 3102.3-93 力学的量和单位

化工标准名词术语

3 术语和定义

3.1 符合 GB 15680-2009 棕榈油

3.2 符合 GB 3102.3-93 力学的量和单位

3.3 符合化工标准名词术语

4 质量要求

4.1 特征指标

项 目		特征指标
折光指数 (40℃)		1.458-1.460
相对密度 (比重) (40℃/20℃水)		0.899-0.920
碘值 (g/100g) ≥		56
皂化值 (以氢氧化钾计) (mg/g)		194-202
不皂化物【g/kg (%)】≤		13 (1.3)
脂 肪 酸 组 成	癩酸 C10:0 (%)	ND
	月桂酸 C12:0 (%)	0.1-0.5
	豆蔻酸 C14:0 (%)	0.5-1.5
	棕榈酸 C16:0 (%)	38.0-43.5
	棕榈一烯酸 C16:1 (%)	ND-0.6
	十七烷酸 C17:0 (%)	ND-0.2
	十七碳一烯酸 C17:1 (%)	ND-0.1
	硬脂酸 C18:0 (%)	3.5-5.0
	油酸 C18:1 (%)	39.8-46.0
	亚油酸 C18:2 (%)	10.0-13.5
	亚麻酸 C18:3 (%)	ND-0.6
	花生酸 C20:0 (%)	ND-0.6
	花生一烯酸 C20:1 (%)	ND-0.4

	山嵛酸 C22:0 (%)	ND-0.2
注：ND 表示未检出，定义为 $\leq 0.05\%$		

4.2 质量指标

项 目	质量指标	
熔点 ($^{\circ}\text{C}$) $\leq$	24	
酸值 (以氢氧化钾计) (mg/g) $\leq$	入库: 0.20	出库: 0.23
过氧化值 $[\text{mmol/kg} (\text{meq/kg})] \leq$	入库: 2.5 (5)	出库: 5 (10)
色泽 (罗维朋比色槽133.4mm) $\leq$	入库: 黄30;	出库: 黄35;
气味、滋味	具有棕榈油固有的气味、滋味, 无异味	
透明度	40 $^{\circ}\text{C}$ 澄清、透明	
水分及挥发物 (%) $\leq$	0.05	
不溶性杂质 (杂质) (%) $\leq$	0.05	

4.3 棕榈油期货合约质量替代品和升贴水:

在酸值检验项目中, 入库时仅 $0.20 (\text{mg/g}) < \text{酸值} \leq 0.23 (\text{mg/g})$ 或者出库时仅 $0.23 (\text{mg/g}) < \text{酸值} \leq 0.25 (\text{mg/g})$, 其他指标符合基准交割品质量要求的棕榈油, 可以替代交割, 贴水为 15 元/吨。

入库或出库时, 若酸值 $> 0.20 (\text{mg/g})$, 则均以原油标示。

4.4 卫生指标: 按 GB15680-2009 规定执行。

4.5 真实性要求: 按 GB 15680-2009 规定执行。

5 检验方法、检验规则按 GB 15680-2009 规定执行。

6 贮存和运输

6.1 贮存

应贮存在低温、干燥、清洁及避光的地方。不得与有害、有毒物品一同存放。

6.2 运输

运输中应注意安全, 防止日晒、雨淋、渗漏、污染和标签脱落。散装运输要有专车, 保持车辆清洁、卫生。

7 附加说明

本标准由大连商品交易所负责解释。

线型低密度聚乙烯期货合约

交易品种	线型低密度聚乙烯
交易单位	5吨/手
报价单位	元（人民币）/吨
最小变动价位	5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
最后交易日	合约月份第10个交易日
最后交割日	最后交易日后第2个交易日
交割等级	大连商品交易所线型低密度聚乙烯交割质量标准
交割地点	大连商品交易所线型低密度聚乙烯指定交割仓库
最低交易保证金	合约价值的5% （当前暂为6%）
交易手续费	不超过8元/手 （当前暂为4元/手）
交割方式	实物交割
交易代码	L
上市交易所	大连商品交易所

附件：

大连商品交易所线型低密度聚乙烯交割质量标准 (F/DCE L001-2007)

1 主题内容与适用范围

1.1 本标准规定了用于大连商品交易所交割的线型低密度聚乙烯质量指标。

1.2 本标准适用于大连商品交易所线型低密度聚乙烯期货合约交割标准品。

2 引用标准

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/T 6678 化工产品采样总则

GB/T 6679 固体化工原料采样通则

GB/T 15182 线型低密度聚乙烯树脂

3 技术要求

3.1 线型低密度聚乙烯为本色、圆柱状或扁圆状颗粒，粒子的尺寸任意方向上应为 2-5mm，不夹杂金属、机械杂质。

3.2 线型低密度聚乙烯质量指标应符合表 1 要求。

表 1： 线型低密度聚乙烯交割质量指标

测试项目		单位	质量要求
颗粒外观	污染粒子	个/K σ $\leq$	40
	大粒和小粒	σ /K σ $\leq$	10
熔体流动速率	标称值	σ /10min	2.0
	偏差	σ /10min	± 0.5
密度		σ /cm ³	[0.915, 0.923]
拉伸屈服应力		MPa $\geq$	8.3
拉伸断裂应力		Mpa $\geq$	12.0
断裂伸长率		% $\geq$	500

3.2.1 线型低密度聚乙烯密度标称值位于区间[0.915, 0.923]，且产品的密度与标称值的偏差不超过 0.003g/cm³。

4 试验方法

4.1 取样要求按 GB/T 6678 和 GB/T 6679 执行。

4.2 质量指标检验按 GB/T 15182 执行。

5 标志、包装和贮存

5.1 标志

线型低密度聚乙烯包装袋上应印有该产品的标志。标志中包括：商标、产品名称、生产厂名称、产品标准号、产品牌号、批号及净重。

5.2 包装

使用原生产厂家或者其认可的包装，袋装产品每袋净重 25Kg。包装材料应保证产品在多次运输、码放、贮存时不污染和泄漏，并能防潮、防尘。

5.3 贮存

线型低密度聚乙烯应存放在通风、干燥、清洁并有良好消防设施的仓库内，贮存时，应远离热源，防止阳光直接照射，禁止在露天堆放。

6 附加说明

本标准由大连商品交易所负责解释。

聚氯乙烯期货合约

交易品种	聚氯乙烯
交易单位	5吨/手
报价单位	元（人民币）/吨
最小变动价位	5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
最后交易日	合约月份第10个交易日
最后交割日	最后交易日后第2个交易日
交割等级	质量标准符合《悬浮法通用型聚氯乙烯树脂（GB/T 5761-2006）》规定的SG5型一等品和优等品
交割地点	大连商品交易所指定交割仓库
最低交易保证金	合约价值的5% （当前暂为6%）
交易手续费	不超过6元/手 （当前暂为4元/手）
交割方式	实物交割
交易代码	V
上市交易所	大连商品交易所

附件：

聚氯乙烯交割标准

聚氯乙烯标准品为质量标准符合国家标准《悬浮法通用型聚氯乙烯树脂（GB/T 5761-2006）》的 SG5 型一等品。优等品作为替代品允许交割，优等品和一等品之间不设等级升贴水。

交易所推荐厂家推荐品牌的聚氯乙烯，货主能够提供《大连商品交易所黄大豆 1 号、黄大豆 2 号、玉米、线型低密度聚乙烯、聚氯乙烯标准仓单管理办法》规定材料，经交割仓库审核同意后，可免于质量检验。推荐厂家推荐牌号的企业资格与名录由交易所确定并公布。

聚氯乙烯指定交割仓库分为基准交割仓库和非基准交割仓库，分别设在广东省、上海市、浙江省、江苏省等地，交易所可视情况对指定交割仓库进行调整。指定交割仓库名录和升贴水由交易所确定并公布。

聚氯乙烯交割品要求使用原生产厂家或者其认可的包装，包装袋上应标明商标、产品名称、产品标准号、净质量、生产厂名称及地址，并标识产品型号。

包装材料为内衬塑料薄膜袋的牛皮纸袋、聚丙烯编制袋或牛皮纸与聚丙烯编制物复合袋，应保证产品在正常贮运中包装不破损，产品不被污染，不泄漏。每袋净重 $25 \pm 0.2\text{kg}$ ，每吨 40 袋，无溢短。

聚氯乙烯包装物价格包含在聚氯乙烯合约价格中。

焦炭期货合约

交易品种	冶金焦炭
交易单位	100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
最后交易日	合约月份第10个交易日
最后交割日	最后交易日后第2个交易日
交割等级	大连商品交易所焦炭交割质量标准
交割地点	大连商品交易所焦炭指定交割仓库
最低交易保证金	合约价值的5%（当前暂为6%）
交割方式	实物交割
交易代码	J
上市交易所	大连商品交易所

附件：

大连商品交易所焦炭交割质量标准

(F/DCE J001—2011)

1 主题内容与适用范围

1.1 本标准规定了用于大连商品交易所交割的焦炭质量要求、试验方法、检验规则和运输要求等。

1.2 本标准规定的焦炭是指以炼焦煤为主要原料，以高温干馏等方法得到的用于高炉炼铁的冶金焦炭。

1.3 本标准适用于大连商品交易所焦炭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/T 1996 冶金焦炭

GB/T 1997 焦炭试样的采取和制备

GB/T 2001 焦炭工业分析测定方法

GB/T 2005 冶金焦炭的焦末含量及筛分组成的测定方法

GB/T 2006 冶金焦炭机械强度的测定方法

GB/T 2286 焦炭全硫含量的测定方法

GB/T 4000 焦炭反应性及反应后强度试验方法

GB/T 8170 数值修约规则

GB/T 9977 焦化产品术语

3 术语和定义

GB/T 9977 确立的术语和定义适用于本标准。

4 质量要求

4.1 标准品质量要求

指标	质量标准（%）	
灰分 A_d	≤ 12.5	
硫分 $S_{t,d}$	≤ 0.65	
抗碎强度 M_{40}	≥ 82	
耐磨强度 M_{10}	≤ 7.5	
反应性 CRI	≤ 28	
反应后强度 CSR	≥ 62	
挥发分 V_{daf}	≤ 1.5	
焦末（ $<25\text{mm}$ ）含量	入库 ≤ 5.0	出库 ≤ 7.0
粒度（ $\geq 25\text{mm}$ ）	入库 ≥ 95.0	出库 ≥ 93.0

4.2 替代品质量差异与升贴水

指标	允许范围（%）	升贴水（元/吨）
灰分 A_d	>12.5 且 ≤ 13.0	每增加0.1%，扣价3
	>13.0 且 ≤ 13.5	每增加0.1%，扣价5
	>13.5 且 ≤ 14.0	每增加0.1%，扣价10
硫分 $S_{t,d}$	>0.65 且 ≤ 0.70	每增加0.01%，扣价3
	>0.70 且 ≤ 0.75	每增加0.01%，扣价5
	>0.75 且 ≤ 0.80	每增加0.01%，扣价10
反应后强度 CSR	≥ 55 且 < 62	出现任一项扣价50； 出现多项不累扣
反应性 CRI	> 28 且 ≤ 32	
抗碎强度 M_{40}	≥ 78 且 < 82	
耐磨强度 M_{10}	> 7.5 且 ≤ 8.5	

4.3 水分 M_t 要求 $\leq 5.0\%$ 。水分含量大于 5.0%的，按超过部分四舍五入至小数点后一位扣重（例如，实测水分为 6.32%，扣重 1.3%）。

4.4 出库时，焦末含量或粒度不符合标准品质量要求的出库标准的，对超过焦末含量标准或不足粒度标准的部分四舍五入至小数点后一位，指定交割仓库应当按照出库完成前一交易日最近月份焦炭合约结算价计算补偿金额（例如，焦末含量出库标准为不超过 7%，实测为 8.23%，四舍五入至小数点后一位，补偿金额为对应货物货款的 1.2%）。

5 试验方法、检验规则

5.1 试样的采取和制备按照 GB/T 1997 的规定执行。

5.2 焦末含量、粒度的测定按照 GB/T 2005 的规定执行。

5.3 水分、灰分、挥发分的测定按照 GB/T 2001 的规定执行。

5.4 全硫含量的测定按照 GB/T 2286 的规定执行。

5.5 抗碎强度 M_{40} 和耐磨强度 M_{10} 的测定按照 GB/T 1996 的规定执行。

5.6 反应性和反应后强度的测定按照 GB/T 4000 的规定执行。

5.7 数值修约按照 GB/T 8170 的规定执行。

6 运输要求

焦炭应当用洁净的火车车厢、汽车车厢、轮船船舱或其它运输工具装运。

7 附加说明

本标准由大连商品交易所负责解释。

大连商品交易所铁矿石期货合约

交易品种	铁矿石
交易单位	100 吨/手
报价单位	元（人民币）/吨
最小变动单位	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
最后交易日	合约月份第 10 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	大连商品交易所铁矿石交割质量标准
交割地点	大连商品交易所铁矿石指定交割仓库及指定交割地点
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	I
上市交易所	大连商品交易所

附件:

大连商品交易所鸡蛋期货合约

交易品种	鲜鸡蛋
交易单位	5 吨/手
报价单位	元（人民币）/500 千克
最小变动价位	1 元/500 千克
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, 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
最后交易日	合约月份第 10 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	大连商品交易所鸡蛋交割质量标准
交割地点	大连商品交易所鸡蛋指定交割仓库
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	JD
上市交易所	大连商品交易所

附件 23:

大连商品交易所鸡蛋交割质量标准

(F/DCE JD001-2013)

1 主题内容与适用范围

1.1 本标准规定了用于大连商品交易所交割的鸡蛋质量要求、试验方法、检验规则和包装、运输要求等。

1.2 本标准适用于大连商品交易所鸡蛋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 2748 鲜蛋卫生标准

SB/T 10277 鲜鸡蛋

NY/T 1758 鲜蛋等级规格

GB/T 6543 运输包装用单瓦楞纸箱和双瓦楞纸箱

BB/T 0015 纸浆模塑蛋托盘

3 术语和定义

3.1 鲜鸡蛋：鸡生产的，未经加工的蛋。

3.2 硌窝：指鲜蛋受震动或碰撞后使局部蛋壳破裂凹陷，而内蛋壳膜未破，蛋白未外流。

3.3 流清：指蛋壳受外力而破碎，蛋白已流出。

3.4 裂纹：指蛋壳受外力形成长条裂纹，内蛋壳膜未破，蛋白未流出。

3.5 箱装：把鸡蛋有序排列在蛋托上整箱包装。

3.6 蛋重等级：根据 1 枚鸡蛋的重量将鸡蛋蛋重分为五个等级：

蛋重等级	重量范围（单位：克）
XXL	≥ 68 且 < 78
XL	≥ 60 且 < 68
L	≥ 53 且 < 60
M	≥ 48 且 < 53
S	≥ 43 且 < 48

4 质量要求

4.1 标准品质量要求

指标	允许范围	
感官要求	抽样样品中，蛋壳不完整、硌窝、流清、裂纹长度大于 2cm 或不清洁面积超过总面积 1/8 的鸡蛋不超过 5%	
蛋重等级	80%以上的鸡蛋处于同一蛋重等级	
哈夫单位	入库 ≥ 72	出库 ≥ 60

4.2 替代品质量差异与升贴水

指标	允许范围	升贴水（元/500 千克）
蛋重等级	不满足标准品蛋重等级要求的交割品	扣价 200

4.3 卫生符合 GB 2748 中理化指标和食品添加剂的规定。

5 试验方法、检验规则

5.1 每 10 箱抽取 1 箱（不足 10 箱部分按 10 箱计），所抽箱中每箱取 3 枚蛋，抽样方法按照 SB/T 10277 执行。

5.2 蛋重的测定按照 SB/T 10277 中单枚蛋重的规定执行。

5.3 哈夫单位的测定按照 NY/T 1758 的规定执行。

5.4 感官检验按照 SB/T 10277 的规定执行。

6 包装及运输要求

6.1 使用符合 BB/T 0015 和 GB/T 6543 规定的蛋托和纸箱，并按照 SB/T 10277 的规定执行。

6.2 运输要求按照 GB 2748 的规定执行。

7 附加说明

本标准由大连商品交易所负责解释。

大连商品交易所纤维板期货合约

交易品种	中密度纤维板
交易单位	500 张/手
报价单位	元（人民币）/张
最小变动单位	0.05 元/张
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
最后交易日	合约月份第 10 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	大连商品交易所纤维板交割质量标准
交割地点	大连商品交易所纤维板指定交割仓库
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	FB
上市交易所	大连商品交易所

大连商品交易所纤维板交割质量标准

(F/DCE FB001-2013)

1 主题内容与适用范围

1.1 本标准规定了用于大连商品交易所交割的纤维板质量要求、试验方法、检验规则和包装、运输要求等。

1.2 本标准适用于大连商品交易所纤维板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/T 11718 中密度纤维板

GB 18580 室内装饰装修材料人造板及其制品中甲醛释放限量

3 术语和定义

应符合 GB/T 11718、GB 18580 中术语和定义的有关规定。

4 质量要求

4.1 表面应砂光，外观质量符合 GB/T 11718 优等品的要求。

4.2 幅面尺寸：

	单位：mm	升贴水(单位：元/张)
宽度	1220	—
长度	2440	—
厚度	标准品：15	0
	替代品：18	6

4.3 尺寸偏差、密度及偏差和含水率符合 GB/T 11718 中的要求。

4.4 物理力学性能符合 GB/T 11718 中家具型中密度纤维板的要求。

4.5 甲醛释放限量:

甲醛释放限量标志	执行标准	试验方法	限量值	升贴水 (单位: 元/张)
E ₁	GB/T 11718	穿孔法	≤ 8 mg/100g	—
E ₂	GB 18580	穿孔萃取法	≤ 30 mg/100g	-30

5 抽样、测量与检验和判定规则按照 GB/T 11718 的相关要求执行, 其中理化性能抽样按照已验收合格的产品总体实施质量监督的要求进行。

6 标志、包装、运输和贮存按照 GB/T11718 的要求执行。

7 附加说明

本标准由大连商品交易所负责解释。

大连商品交易所纤维板指定交割仓库名录

序号	交割仓库名称	存货地点	地址	邮编	联系人	联系电话	交割专区	基准库/非基准库	与基准库升贴水（元/张）
1	广东国储物流股份有限公司		广州市萝岗区开发大道 1330 号	510730	邓丽娟	020-32288125 020-32288125（F） 13580531500	广州国储库区	基准库	0
2	中国物资储运广州公司		广东省东莞市麻涌镇新基村新基工业区	523141	陈日玲	020--82299020 020--82290581（F） 13826216834	中储广州库区	基准库	0
3	广东广物木材产业有限公司	广州库	广州市黄埔大道东 838 号广东鱼珠国际木材市场	510710	林慕钧	020—82490358 020—82490307（F） 15800008111	广物木材广州库区	基准库	0
4		佛山库	广东省佛山市南海区九江镇 325 国道段大转湾鱼珠国际木材夹板市场	528203	何泽凯	0757-81862137, 0757-81867128（F） 18988632622	广物木材佛山库区	基准库	0
5	中储发展股份有限公司	新港库	天津市滨海新区塘沽新港四号路北	300461	刘振婷	022-59815152, 022-59815042(F), 13821256116	中储新港库区	非基准库	5
6		南仓库	天津市北辰区南仓道	300400	孟小冬	022-58986699, 022-58986805（F）, 18920287007	中储南仓库区	非基准库	5

7	天津全程物流配送有限公司		天津市东丽区华粮道 2298 号	300300	马文涛	022-84828862, 022-84828553 (F) 15620035893	天津全程库区	非基准库	5
					刘欣	022-84828366, 022-84828553 (F), 15822972951			
8	镇江惠龙长江港务有限公司		镇江市金桥大道 88 号	212000	胡文娟	0511-85938558, 13852940132, 0511-85588959 (F)	镇江惠龙港 库区	非基准库	5
					陈文	0511-85938557, 15052911987, 0511-85588960 (F)			
9	江苏武进港务有限公司		江苏省常州市武进区奔牛镇 奔牛港	213131	胡小明	0519-68850505, 13706111983, 0519-67898300 (F)	江苏武进港 库区	非基准库	5
10	浙江省国际贸易集团物流有限公司	嘉兴库	浙江省嘉兴市塘汇镇铁路东 站内	314003	金方云	0571-85779792, 0571-85779652 (F), 13805726904	浙江国贸嘉兴 库区	非基准库	5
					沈敏强	0571-85778718, 0571-85779652 (F), 13958019189			
11		钱江库	浙江省海宁市连杭经济开发 区启潮路 28 号	314422	金方云	0571-85779792, 0571-85779652 (F), 13805726904	浙江国贸钱江 库区	非基准库	5
					沈敏强	0571-85778718, 0571-85779652 (F), 13958019189			

大连商品交易所胶合板期货合约

交易品种	细木工板
交易单位	500 张/手
报价单位	元（人民币）/张
最小变动单位	0.05 元/张
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
最后交易日	合约月份第 10 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	大连商品交易所胶合板交割质量标准
交割地点	大连商品交易所胶合板指定交割仓库
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	BB
上市交易所	大连商品交易所

大连商品交易所胶合板交割质量标准

(F/DCE BB001-2013)

1 主题内容与适用范围

1.1 用于大连商品交易所胶合板期货合约交割的商品为实心、胶拼、双面砂光、室内普通用途的五层细木工板。

1.2 本标准规定了用于大连商品交易所交割的胶合板质量要求、试验方法、检验规则和包装、运输要求等。

1.3 本标准适用于大连商品交易所胶合板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/T 5849 细木工板

GB 18580 室内装饰装修材料人造板及其制品中甲醛释放限量

3 术语和定义

应符合 GB/T 5849、GB 18580 中术语和定义的有关规定。

4 质量要求

4.1 不区分面板树种。外观质量与翘曲度满足 GB/T 5849 一等品的要求

4.2 规格尺寸:

	单位: mm	升贴水 (单位: 元/张)
--	--------	---------------

宽度	1220	—
长度	2440	—
厚度	标准品：15	0
	替代品：18	15

4.3 材料、尺寸偏差与板芯质量符合 GB/T 5849 中的要求

4.4 物理力学性能符合 GB/T 5849 的要求，其中胶合强度不做检验要求。

4.5 甲醛释放量：

甲醛释放限量标志	执行标准	试验方法	限量值	升贴水 (单位：元/张)
E ₁	GB 18580	干燥器法	≤ 1.5 mg/L	—
E ₂			≤ 5 mg/L	-30

5 抽样规则与检验方法按照 GB/T 5849 的要求执行。

6 标志、标签、包装和贮运按照 GB/T 5849 的要求执行。

7 附加说明

本标准由大连商品交易所负责解释。

大连商品交易所胶合板指定交割仓库名录

序号	交割仓库名称	存货地点	地址	邮编	联系人	联系电话	交割专区	基准库/非基准库	与基准库升贴水(元/张)
1	镇江惠龙长江港务有限公司		镇江市金桥大道 88 号	212000	胡文娟	0511-85938558 0511-85588959(F) 13852940132	镇江惠龙港库区	基准库	0
					陈文	0511-85938557 0511-85588960(F) 15052911987			
2	江苏武进港务有限公司		江苏省常州市武进区奔牛镇奔牛港	213131	胡小明	0519-68850505 0519-67898300(F) 13706111983	江苏武进港库区	基准库	0
3	浙江省国际贸易集团物流有限公司	嘉兴库	浙江省嘉兴市塘汇镇铁路站内	314003	金方云	0571-85779792 0571-85779652(F) 13805726904	浙江国贸嘉兴库区	基准库	0
					沈敏强	0571-85778718 0571-85779652(F) 13958019189			
4		钱江库	浙江省海宁市连杭经济开发区启潮路 28 号	314422	金方云	0571-85779792 0571-85779652(F) 13805726904	浙江国贸钱江库区	基准库	0
					沈敏强	0571-85778718			

						0571-85779652 (F) 13958019189			
5	天津全程物流配送有限公司		天津市东丽区华粮道 2298 号	300300	马文涛 刘欣	022-84828862 022-84828553 (F) 15620035893 022-84828366 022-84828553 (F) 15822972951	天津全程库区	非基准库	-10
6	中储发展股份有限公司	南仓库	天津市北辰区南仓道	300400	孟小冬	022-58986699 022-58986805 (F) 18920287007	中储南仓库区	非基准库	-10
7		新港库	天津市滨海新区塘沽新港四号路北	300461	刘振婷	022-59815152 022-59815042 (F) 13821256116	中储新港库区	非基准库	-10
8		廊坊库	廊坊市光明东道 25 号	065000	张俊如	0316-2316226 0316-2316226 (F) 13231638750	中储廊坊库区	非基准库	-20
9	立晨物流股份有限公司		临沂经济开发区杭州路 21 号	276023	卢衍岭	0539-6012272 0539-6012316 (F) 18805390851	立晨物流库区	非基准库	-20
10	广东国储物流股份有限公司		广州市萝岗区开发大道 1330 号	510730	邓丽娟	020-32288125 020-32288125 (F) 13580531500	广州国储库区	非基准库	-20
11	中国物资储运广州公司		广东省东莞市麻涌镇新基村新基工业区	523141	陈日玲	020--82299020 020--82290581 (F) 13826216834	中储广州库区	非基准库	-20

12	广东广物木材产业 有限公司	广州库	广州市黄埔大道东 838 号 广东鱼珠国际木材市场	510710	林慕钧	020—82490358 020—82490307(F) 15800008111	广物木材广 州库区	非基准库	-20
13		佛山库	广东省佛山市南海区九江 镇 325 国道段大转湾鱼珠 国际木材夹板市场	528203	何泽凯	0757-81862137 0757-81867128(F) 18988632622	广物木材佛 山库区	非基准库	-20

大连商品交易所风险管理办法

(2016 年 8 月 22 日修订)

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、客户必须遵守本办法。

第二章 保证金制度

第四条 交易所实行保证金制度。黄大豆 1 号、黄大豆 2 号、豆粕、豆油、棕榈油、玉米、线型低密度聚乙烯、聚氯乙烯、焦炭、焦煤、铁矿石、鸡蛋、纤维板、胶合板、聚丙烯、玉米淀粉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 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。

第八条 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。

第九条 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

第十一条 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。

第十二条 黄大豆 1 号、黄大豆 2 号、豆粕、豆油、棕榈油、玉米、线型低密度聚乙烯、聚氯乙烯、焦炭、焦煤、铁矿石、鸡蛋、纤维板、胶合板、聚丙烯、玉米淀粉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。

第十三条 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。

第十四条 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。

第十五条 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。

第十六条 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。

第十七条 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。

第十八条 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:

$$\text{客户该合约单位净持仓盈亏} = \frac{\text{客户该合约持仓盈亏总和}}{\text{客户该合约净持仓量} \times \text{交易单位}}$$

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)。

(八) 由上述减仓造成的经济损失由会员及其客户承担。

第十九条 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。

第二十一条 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合约的限仓数额;
- (二) 某一月份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, 进入交割月份的合约限仓数额从严控制;
- (三) 套期保值交易头寸实行审批制, 其持仓不受限制。

第二十二条 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。

第二十三条 非期货公司会员和客户采取不同的限仓要求:

焦炭、焦煤、鸡蛋以外品种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九个交易日）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。在合约进入交割月份前一个月第十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。焦炭、焦煤、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。

第二十四条 除鸡蛋品种外，各品种合约一般月份（合约上市至交割月份前一个月第九个交易日）非期货公司会员和客户持仓限额为：（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 $\leq 200,000$	40,000	20,000
	单边持仓 $> 200,000$	单边持仓 $\times 20\%$	单边持仓 $\times 10\%$
黄大豆 2 号	单边持仓 $\leq 100,000$	20,000	10,000
	单边持仓 $> 100,000$	单边持仓 $\times 20\%$	单边持仓 $\times 10\%$
豆粕	单边持仓 $\leq 200,000$	40,000	20,000
	单边持仓 $> 200,000$	单边持仓 $\times 20\%$	单边持仓 $\times 10\%$
玉米	单边持仓 $\leq 200,000$	40,000	20,000
	单边持仓 $> 200,000$	单边持仓 $\times 20\%$	单边持仓 $\times 10\%$
豆油	单边持仓 $\leq 100,000$	20,000	10,000
	单边持仓 $> 100,000$	单边持仓 $\times 20\%$	单边持仓 $\times 10\%$
棕榈油	单边持仓 $\leq 50,000$	10,000	5,000
	单边持仓 $> 50,000$	单边持仓 $\times 20\%$	单边持仓 $\times 10\%$
线型低密度 聚乙烯	单边持仓 $\leq 100,000$	20,000	10,000
	单边持仓 $> 100,000$	单边持仓 $\times 20\%$	单边持仓 $\times 10\%$
聚氯乙烯	单边持仓 $\leq 200,000$	40,000	20,000
	单边持仓 $> 200,000$	单边持仓 $\times 20\%$	单边持仓 $\times 10\%$
焦炭	单边持仓 $\leq 50,000$	2,400	2,400

	单边持仓 > 50,000		
焦煤	单边持仓 ≤ 80,000	5,000	5,000
	单边持仓 > 80,000		
铁矿石	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%
纤维板	单边持仓 ≤ 160,000	16000	16000
	单边持仓 > 160,000	单边持仓 × 10%	单边持仓 × 10%
胶合板	单边持仓 ≤ 60,000	6000	6000
	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%

除鸡蛋品种外,各品种合约自交割月份前一个月第十个交易日至交割月期间非期货公司会员和客户持仓限额为:(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个交易日起	10,000	5,000
	交割月份	5,000	2,500
豆粕	交割月前一个月第十个交易日起	10,000	5,000
	交割月份	5,000	2,500
豆油	交割月前一个月第十	4,000	2,000

	个交易日起		
	交割月份	2,000	1,000
棕榈油	交割月前一个月第十个交易日起	2,000	1,000
	交割月份	1,000	500
玉米	交割月前一个月第十个交易日起	20,000	10,000
	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个交易日起	4,000	2,000
	交割月份	2,000	1,000
聚氯乙烯	交割月前一个月第十个交易日起	10,000	5,000
	交割月份	5,000	2,500
焦炭	交割月前一个月第十个交易日起	900	900
	交割月份	300	300
焦煤	交割月前一个月第十个交易日起	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个交易日起	400	400
	交割月份	100	100

胶合板	交割月前一个月第十个交易日起	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个交易日起	4,500	4,500
	交割月份	1,500	1,500

鸡蛋合约非期货公司会员和客户持仓限额为：（单位：手）

交易时间段	非期货公司会员	客户
合约上市起	300	300
交割月前一个月第一个交易日起	100	100
交割月前一个月第十个交易日起	30	30
交割月份	5	5

第二十五条 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。

第五章 交易限额制度

第二十六条 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。

套期保值交易的开仓数量不受本条前款限制。

第二十七条 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

第二十八条 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。交易所可根据市场风险状况，调整改变持仓报告水平。

第二十九条 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。

第三十一条 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。

第三十二条 期货公司会员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，然后转交交易所。期货公司会员应保证客户所提供的材料的真实性。

第三十三条 交易所将不定期地对会员或客户提供的材料进行核查。

第三十四条 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

第三十五条 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。

第三十六条 当会员、客户出现下列情形之一时，交易所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。

第三十七条 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和第一节交易时间内；对未开设夜盘交易的品种，其时限为第一节交易时间内。若时限内会员未执行完毕，则由交易所强制执行。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。

（一）由会员单位执行的强行平仓头寸的确定

1. 属第三十六条第（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. 属第三十六条第（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. 属第三十六条第（一）项的强行平仓，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

其客户需要强行平仓的头寸由交易所按先投机、后套期保值的原则；并按上一交易日闭市后合约总持仓量由大到小顺序，先选择持仓量大的合约作为强行平仓的合约。

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. 属第三十六条第（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. 属第三十六条第（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。

若会员同时满足第三十六条第（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。

第三十八条 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。

第三十九条 强行平仓的价格通过市场交易形成。

第四十条 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。

第四十一条 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。

第四十二条 除第三十六条第（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。

本办法第三十六条第（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细则》平仓盈亏有关规定计算。

第八章 异常情况处理

第四十三条 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；

第四十四条 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。

第四十五条 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。

对棕榈油合约采取终止交易紧急措施的，应当经中国证监会批准。

第四十六条 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。

第四十七条 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。

第四十八条 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

第四十九条 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。

第五十条 出现下列情形之一的，交易所可以要求会员或客户报告情况，或约见指定的会员高管人员或客户谈话提醒风险：

- （一）期货价格出现异常变动；
- （二）会员或客户交易行为异常；
- （三）会员或客户持仓变化较大；
- （四）会员资金变化较大；
- （五）会员或客户涉嫌违规；
- （六）会员或客户被投诉；
- （七）会员涉及司法调查或诉讼案件；
- （八）交易所认定的其他情形。

交易所要求会员或客户报告情况的，会员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，会员或客户应当按照交易所要求的时间、地点和方式认真履行。如果使用电话提醒方式，应保留电话录音；如果当面谈话，应保存谈话记录。

第五十一条 发生下列情形之一的，交易所可以向全体或部分会员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）会员或客户涉嫌违规；
- （四）会员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

第五十二条 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。

第五十三条 本办法解释权属于大连商品交易所。

第五十四条 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

步骤	分配条件	分配数	分配比例	分配对象	结果
1	单位净持仓盈利 6% 以上的投机持仓 $\geq$ 申报平仓数量	申报平仓数量	申报平仓数量 / 单位净持仓盈利 6% 以上的投机持仓	单位净持仓盈利 6% 的投机客户	分配完毕
2	单位净持仓盈利 6% 以上的投机持仓 $<$ 申报平仓数量	单位净持仓盈利 6% 以上的投机持仓数量	单位净持仓盈利 6% 以上的投机持仓 / 申报平仓数量	申报平仓客户	有剩余再按步骤 3, 4 分配
3	单位净持仓盈利 3% 以上的投机持仓 $\geq$ 剩余申报平仓数量 1	剩余申报平仓数量 1	剩余申报平仓数量 1 / 单位净持仓盈利 3% 以上的投机持仓	单位净持仓盈利 3% 的投机客户	分配完毕
4	单位净持仓盈利 3% 以上的投机持仓 $<$ 剩余申报平仓数量 1	单位净持仓盈利 3% 以上的投机持仓数量	单位净持仓盈利 3% 以上的投机持仓 / 剩余申报平仓数量 1	剩余申报平仓客户	有剩余再按步骤 5, 6 分配
5	单位净持仓盈利大于零的投机持仓 $\geq$ 剩余申报平仓数量 2	剩余申报平仓数量 2	剩余申报平仓数量 2 / 单位净持仓盈利大于零的投机持仓	单位净持仓盈利的投机客户	分配完毕
6	单位净持仓盈利大于零的投机持仓 $<$ 剩余申报平仓数量 2	单位净持仓盈利大于零的投机持仓数量	单位净持仓盈利大于零的投机持仓 / 剩余申报平仓数量 2	剩余申报平仓客户	有剩余再按步骤 7, 8 分配
7	单位净持仓盈利 7% 的保值持仓数量 $\geq$ 剩余申报平仓数量 3	剩余申报平仓数量 3	剩余申报平仓数量 3 / 单位净持仓盈利 7% 的保值持仓数量	净持仓盈利 7% 的保值客户	分配完毕
8	单位净持仓盈利 7% 的保值持仓数量 $<$ 剩余申报平仓数量 3	单位净持仓盈利 7% 的保值持仓数量	单位净持仓盈利 7% 的保值持仓数量 / 剩余申报平仓数量 3	剩余申报平仓客户	有剩余不再分配

- 注：1. 剩余申报平仓数量 1=申报平仓数量-单位净持仓盈利 6%以上的投机持仓数量；
 2. 剩余申报平仓数量 2=剩余申报平仓数量 1-单位净持仓盈利 3%以上的投机持仓数量；
 3. 剩余申报平仓数量 3=剩余申报平仓数量 2-单位净持仓盈利大于零的投机持仓数量；
 4. 投机持仓数量和保值持仓数量是指在平仓范围内盈利客户的持仓数量。

附件 2:

大连商品交易所非期货公司会员大户报告表

会员名称: 会员编号: 年 月 日

合约 代码	买持 仓量	卖持仓量	持仓 性质	建仓 时间	持仓占用 保证金	可动用 资金	预报交 割数量	申请交 割数量	持仓意向
合计									
资金 来源 说明									
会员 单位 意见	会员单位盖章: 负责人签字: 年 月 日								
交易 所 意见	交易所盖章: 负责人签字: 年 月 日								

附件 3:

大连商品交易所客户大户报告表

会员名称: 会员编号: 年 月 日

客户名称	客户编码	合约代码	买持仓量	卖持仓量	建仓时间	持仓性质	持仓占用保证金	可动用资金	预报交割数量	申请交割数量	持仓意向
合计											
资金来源说明											
会员单位意见	会员单位盖章: 负责人签字: 年 月 日										
交易所意见	交易所盖章: 负责人签字: 年 月 日										

关于发布施行《大连商品交易所异常交易管理办法（试行）》的通知

大商所发〔2010〕219号

各会员单位：

为规范期货交易行为，保护期货交易当事人的合法权益，维护市场正常秩序，根据《大连商品交易所交易规则》等业务规则，我所制定了《大连商品交易所异常交易管理办法（试行）》，经理事会审议批准，现予发布，自2010年11月22日起施行。

特此通知。

附件：大连商品交易所异常交易管理办法（试行）

大连商品交易所
二〇一〇年十一月十五日

附件

大连商品交易所异常交易管理办法（试行）

第一条 为规范期货交易行为，保护期货交易当事人的合法权益，维护市场正常秩序，根据《大连商品交易所交易规则》、《大连商品交易所会员管理办法》、《大连商品交易所风险管理办法》和《大连商品交易所违规处理办法》等规定，制定本办法。

第二条 交易所对期货交易进行监控，发现期货交易出现异常情形的，有权对相关期货公司会员、非期货公司会员和客户采取相应监管措施或者纪律处分措施。

第三条 期货公司会员应当切实履行客户交易行为管理职责，及时发现、及时报告、及时制止客户的异常交易行为，不得纵容、诱导、怂恿、支持客户进行异常交易。

第四条 非期货公司会员和客户参与期货交易应当遵守法律、法规和交易所业务规则的规定，接受交易所监管，自觉规范交易行为。客户还应接受期货公司会员对其交易行为的合法合规性管理。

第五条 期货交易出现以下情形之一的，为异常交易行为：

（一）以自己为交易对象，多次进行自买自卖；

- (二) 交易所认定的实际控制关系账户组内发生的多次互为对手方的交易;
- (三) 频繁报撤单行为;
- (四) 大额报撤单行为;
- (五) 交易所认定的实际控制关系账户组合并持仓超过交易所持仓限额规定;
- (六) 通过计算机程序自动批量下单、快速下单影响交易所系统安全或者正常交易秩序;
- (七) 交易所认定的其他情形。

第六条 期货公司会员应当密切关注客户的交易行为,积极防范客户在交易中可能出现的异常交易行为,引导客户理性、合规参与期货交易。

期货公司会员发现客户在期货交易过程中出现本办法**第五条**所列异常交易行为之一的,应当及时予以提醒、劝阻和制止,并及时向交易所报告。

第七条 客户出现本办法**第五条**所列异常交易行为之一,经劝阻、制止无效的,期货公司会员可以采取提高交易保证金、限制开仓、强行平仓等措施。

第八条 非期货公司会员或客户出现本办法**第五条**所列异常交易行为之一的,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、列入重点监管名单等措施;情节严重的,交易所可以根据《大连商品交易所违规处理办法》等相关规则的规定采取强行平仓、限制开仓等监管措施;涉嫌违反法律、法规、规章的,交易所可以提请中国证监会进行立案调查。

第九条 交易所对存在异常交易行为的客户采取有关监管措施或者做出相关书面决定的,通过客户所在期货公司会员向客户发出。期货公司会员应当及时与相关客户取得联系,告知交易所的相关监管信息和书面决定,保留有关证据,并采取有效措施,规范客户交易行为。

第十条 期货公司会员具有下列情形之一的,交易所可以责令其整改,并按照《大连商品交易所违规处理办法》等相关规则的规定,采取相应监管措施或者纪律处分措施,可同时向中国证监会提请分类监管扣分。

- (一) 未及时、准确地向客户传达、送达交易所有关监管信息或者书面决定;
- (二) 未采取有效措施制止客户异常交易行为;
- (三) 未按照交易所要求尽责对涉嫌违法违规行为协助调查或者存在故意拖延、隐瞒和遗漏等行为;
- (四) 纵容、诱导、怂恿、支持客户进行异常交易;
- (五) 交易所认定的其他情形。

第十一条 异常交易行为的认定标准及处理程序，由交易所另行通知。

第十二条 本办法由交易所负责解释。

第十三条 本办法自 2010 年 11 月 22 日起实施。

大连商品交易所指定存管银行管理办法

第一章 总则

第一条 为规范银行业金融机构从事大连商品交易所(以下简称交易所)期货保证金存管业务,确保期货保证金存管安全和期货交易的平稳运行,根据相关法律法规、监管机构有关规定及交易所规则,制定本办法。

第二条 交易所根据审慎原则和市场发展需要指定期货保证金存管银行(以下简称存管银行),并按照本办法规定,切实履行对存管银行的审核、监督等工作要求。

第三条 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,应当遵守本办法及交易所其他相关规定,并接受交易所自律监管。

第二章 资格申请

第四条 银行业金融机构(以下简称申请银行)申请从事交易所期货保证金存管业务资格,应当具备下列条件:

- (一) 中华人民共和国境内设立的全国性商业银行法人;
- (二) 注册资本达到100亿元人民币,总资产在15000亿元人民币以上,资本净额在1000亿元人民币以上,最近3个会计年度连续盈利;
- (三) 分支机构在600个以上,且在期货交易所所在地设有可以办理期货保证金存管业务和资金结算相关业务的分支机构;
- (四) 符合中国银行业监督管理机构对银行业金融机构资本充足率、流动性、资产负债比例等的规定;
- (五) 具有良好的公司治理、风险管理体系和内部控制制度;
- (六) 设有专门机构或部门负责期货保证金存管业务;
- (七) 具有健全的期货保证金管理制度,制定与期货保证金存管业务相关的内部管理制度、操作流程以及技术和通讯系统故障等异常情况下的应急处理预案;
- (八) 具有开展期货保证金存管业务和配合期货保证金安全存管监控所需的设施和技术水平,最近3年高效稳定的异地资金划拨系统,覆盖全国范围的行内实时汇划系统,以及服务良好的全

国集中式银期转账系统；

（九）交易所指定的期货保证金存管分支机构中，取得期货从业资格人员不得少于3名，其中交易所结算专柜人员在取得期货从业资格，交易所结算专柜管理人员必须取得期货从业资格且应具备5年以上银行业金融机构从业经验；

（十）最近3年内无重大违法违规行为，未发生过重大事故及未收到过监管机构的重大行政处罚；

（十一）无严重影响资信状况的未决诉讼和未清偿债务；

（十二）结合交易所上市品种及会员、客户特点，在促进期货市场功能发挥、创新业务合作方面具有可行的期货创新服务方案；

（十三）交易所认定的其他条件。

与交易所上市品种密切相关的政策性银行，申请从事交易所期货保证金存管业务资格的，不适用本条第一款第（一）至（三）项规定。

申请从事与符合规定条件的境外机构有关的保证金存管业务的银行，具体条件由交易所另行规定。

第五条 申请银行应当向交易所提交以下预审材料：

- （一）《期货保证金存管业务资格申请表》、申请报告、可行性报告及业务计划书；
- （二）分支机构、营业网点以及开展期货保证金存管业务所需设施的情况说明；
- （三）期货保证金存管制度、内部管理制度以及相关的应急处理预案；
- （四）期货保证金存管业务部门的岗位设置和职责规定，以及部门负责人和业务人员名单、履历；
- （五）遵守期货保证金安全存管监控有关规定的承诺书；
- （六）最新年检的《企业法人营业执照》复印件；
- （七）《金融业务许可证》复印件；
- （八）最近3年的审计报告及内部控制评价报告；
- （九）企业法人的授权书及经办人员的身份证明文件；
- （十）交易所要求提供的其他文件。

第六条 申请银行通过交易所资格预审后，应当完成开展期货保证金存管业务相关筹备工作，包括系统准备、制定并实施期货创新服务方案、交易所指定的期货保证金存管分支机构筹建等，

并向交易所提交以下材料：

- （一）由中国期货保证金监控中心（以下简称监控中心）出具的申请银行通过期货保证金存管业务相关数据报送测试的书面证明材料；
- （二）与期货公司（或其他期货市场参与者）进行全国集中式银期转账系统测试情况；
- （三）交易所指定的期货保证金存管分支机构营业执照复印件及设立情况说明，包括：分支机构的营业场所、设施、岗位设置和职责规定，以及分支机构负责人和业务人员名单、履历；
- （四）期货创新服务方案及实施情况说明；
- （五）交易所要求提供的其他文件。

第七条 交易所批准的存管银行，应当于交易所批准之日起3个工作日内向银行业监督管理机构报告。

第八条 存管银行在开展期货保证金存管业务前，应当与交易所签订协议，明确双方的权利和义务。

第三章 业务要求

第九条 存管银行应当为从事其期货保证金存管业务的客户提供安全、准确、及时地期货保证金存管、划转服务。

第十条 交易所指定的期货保证金存管分支机构应当设置在交易所指定的距离范围内，分支机构内应当设置交易所结算专柜。

第十一条 存管银行应当根据交易所交易和结算时间的变化，相应调整业务办理时间，以满足期货保证金存管业务的需要。

第十二条 交易所与会员之间期货业务资金往来通过交易所专用结算账户和会员专用资金账户办理。

存管银行应当根据交易所申请，为交易所办理开立、变更、注销专用结算账户业务。

存管银行应当根据交易所签发的通知书，为交易所会员办理开立、变更、注销专用资金账户业务。

第十三条 存管银行应当按照与交易所协商确定的存款利率向交易所支付专用结算账户利息。

第十四条 存管银行应当依法拒绝任何其他单位或个人对交易所专用结算账户内资金的冻结、扣划，确保交易所存放的期货保证金安全。

第十五条 如有其他单位拟对会员专用资金账户采取冻结等影响保证金存管业务的措施时，存管银行应当及时通知交易所。

第十六条 存管银行不得协助期货公司在保证金账户上设定担保。

第十七条 存管银行应当采取有效措施，减少资金的流动性风险；未经交易所书面同意，不得限制交易所会员出入金；为测试保证金存款的安全性，交易所可以随时对存管银行的保证金进行跨行调拨。

当交易所的资金结算出现流动性需求时，经交易所申请，存管银行应当予以相应的资金配合，协助化解交易所风险。

第十八条 存管银行应当按照期货保证金安全存管的有关规定，通过转账方式办理期货保证金存取业务，对期货保证金实行封闭运行。

第十九条 存管银行应当按以下规定办理收款业务：

当有款项划入交易所专用结算账户时，存管银行应当在资金到账后立即记入交易所账户，并实时通知交易所。

第二十条 存管银行应当按以下规定办理划款业务：

(一) 存管银行应当按照交易所提供的票据或指令办理划款业务；

(二) 对于本行系统内账户的资金划拨，存管银行应当保证在收到交易所划款票据或指令后实时将资金汇划至交易所指定的资金账户；

(三) 对于跨行的资金划拨，存管银行应当保证在收到交易所划款票据或指令后及时划出款项。

第二十一条 存管银行应当按以下规定与交易所进行账务核对：

(一) 每日期货结算终了后进行对账，并根据交易所的需要及时对账；

(二) 在存管银行营业时间内，交易所可以随时查询专用结算账户余额及变动情况，存管银行应当实时回送查询结果；

(三) 存管银行应当将交易所进账单、收付款明细清单等业务凭证在业务发生后当日送到交易所；

(四) 存管银行应当按交易所的要求及时提供专用结算账户对账单。

第二十二条 存管银行应当向交易所提供交易所会员专用资金账户的余额及变动情况，实时回送查询结果。

第二十三条 存管银行应当按照期货保证金安全存管监控的有关规定，通过网络专线在规定的时间内向监控中心报送在该行开设的全部期货保证金账户前一交易日的账户余额、变动明细等相关信息。

第二十四条 存管银行应当保证交易所对专用结算账户资金的及时、准确、安全调度，并应当对期货保证金动态作研究分析，做好相应资金头寸的管理和调度工作。

第二十五条 存管银行应当保证交易所指定营业网点的业务稳定和人员稳定，定期组织业务人员培训，积极参加交易所组织的培训，保证业务人员熟练掌握期货保证金存管业务流程及交易所关于期货保证金存管业务的规则、要求。

第四章 技术要求

第二十六条 存管银行应当按照《大连商品交易所电子出入金系统银行接口规范》完成电子出入金系统的开发建设，系统上线须通过交易所的功能测试、性能测试和稳定性测试，并提供测试通过报告。

第二十七条 存管银行应当使用不同运营商的专线分别接入交易所主、备数据中心，同时需申请单独的专线接入交易所测试中心，数据链路带宽均不低于2Mbps。电子出入金系统的主机、网络等设备应当具有热备份能力。

第二十八条 交易所与存管银行之间的数据交换应当采用国家密码管理委员会认证的数字证书进行加密和签名，双方均承认信息是真实有效且不可否认的。存管银行应当对电子出入金系统的密钥严格管理，定期更新，不得泄露。

第二十九条 存管银行应当将电子出入金系统纳入技术系统的统一运维管理流程，对电子出入金系统、网络链路和软硬件平台进行实时监控和预警，发现问题应当参照《大连商品交易所电子出入金系统应急处理预案》，及时与交易所沟通协调。

第三十条 存管银行电子出入金系统的安全管理和数据管理应该满足行业相关规定，对期货结算业务产生的电子数据实行日常备份，并定期进行备份数据的可恢复性检查，作为重要凭证永久保存。

第三十一条 存管银行电子出入金系统进行变更应当提前5个工作日通知交易所，以便及时协调配合。存管银行应当积极配合参与交易所组织的应急演练和联合测试。

第三十二条 存管银行应当按照《大连商品交易所电子出入金系统应急处理预案》要求做好应急准备，定期进行应急演练工作，设立7*24小时的技术应急联系人，应急联系人信息发生变更

应当及时向交易所进行报备。

第五章 应急处理

第三十三条 存管银行应当建立期货保证金存管业务应急预案，做到职责明确、措施到位、反应快速、处置及时。

第三十四条 交易所或存管银行任何一方发生可能影响期货保证金存管业务的业务操作失误或技术系统故障时，发现方应当立即通知对方，共同采取补救措施。

第三十五条 存管银行发现电子出入金系统发生故障的，应当立即通知交易所，并积极配合对各自系统进行检查，以确定原因、排除故障、明确责任。如有必要，可以立即启动应急措施。

第三十六条 存管银行在其发生影响期货保证金存管业务运行稳定和安全的条件下，应当立即启动应急预案，尽快恢复正常运行，并将相关情况报告交易所和监控中心。

第六章 监督管理

第三十七条 存管银行保证金存管部门岗位设置、职责规定、部门负责人、业务联系人等发生变更时，应当于3个工作日内书面报告交易所和监控中心。

第三十八条 存管银行实施系统升级改造或实施其他可能影响期货保证金存管业务的措施前，应当提前5个工作日书面通知交易所、监控中心和交易所相关会员，做好信息披露和系统测试工作，并制定针对性应急预案。

第三十九条 存管银行在出现影响该行资信状况的重大业务风险或损失时，应当于3个工作日内向交易所和监控中心报告，并提交该业务风险或损失对该行保证金存管业务的影响分析及应对措施。

第四十条 存管银行应当在每一年度结束后1个月内，向交易所和监控中心提交其上年度期货保证金存管业务总结报告。总结报告的内容包括但不限于：该存管银行上年度保证金存管业务经营情况、服务情况、技术运行情况、风险管理情况、操作失误及技术故障情况、有关法律、法规、规章、政策以及期货市场自律规则执行情况等。

第四十一条 交易所依据本办法规定对存管银行资格进行年度检查，或根据需要进行不定期检查，存管银行应当予以配合。存管银行应当向交易所提交以下年度检查材料：

(一)上一年度财务报表审计报告及内部控制评价报告；

(二)指定期货保证金存管分支机构中取得期货从业资格的人员名单、证书复印件以及结算专柜人员履历；

(三)交易所认定的其他资料。

第四十二条 交易所对存管银行的期货保证金存管业务进行年度考评, 综合考核其开展期货保证金存管业务的安全性、准确性、时效性和流动性。考核内容涉及存管银行资格条件、系统运维、人员配置、业务运营、风险控制和期货创新服务等方面。考评方式为存管银行自查、交易所会员评分和日常运营情况等相结合。

第四十三条 交易所在安排各存管银行的保证金存管业务量以及进行风险评估和管理时, 参考考评结果。

第七章 违规处理

第四十四条 存管银行出现下列情况之一的, 责令改正, 并根据情节轻重, 采取警告、通报批评、暂停新增会员的存管业务等措施:

- (一) 出现本办法第三十六条至第四十条所列情形, 存管银行未按照要求履行相关义务的;
- (二) 发生影响或可能影响期货保证金存管业务的情况时, 存管银行未采取有效措施或措施不力, 影响期货市场稳健运行, 损害交易所会员、客户合法权益的;
- (三) 未能按照监控中心相关要求报送期货保证金安全存管业务数据的;
- (四) 违反期货保证金存管业务协议或者交易所业务规则的;
- (五) 存管银行发生可能影响期货保证金存管业务的操作失误或技术系统故障时, 未立即通知交易所的, 或未及时采取有效措施处理的;
- (六) 不符合银行业监督管理机构关于资本充足率、流动性、资产负债比例等指标要求的;
- (七) 不配合交易所对存管银行期货保证金存管业务进行检查, 不按要求提交上年度期货保证金存管业务总结报告或其他要求提供的材料的;
- (八) 无故拖延或限制会员资金调拨的;
- (九) 交易所会员普遍反映存管银行服务质量不高, 银期转账系统不稳定的;
- (十) 交易所认定的其他情况。

第四十五条 存管银行出现下列情况之一的, 交易所可以暂停其期货保证金存管业务:

- (一) 未能采取有效措施, 导致交易所专用结算账户内的资金被冻结或扣划的;
- (二) 违反规定, 在期货公司保证金账户上设定担保的;
- (三) 最近一个会计年度发生亏损的;
- (四) 交易所认定的其他情况。

第四十六条 对于暂停期货保证金存管业务的存管银行，交易所认为其整改后重新具备正常开展期货保证金存管业务能力的，可以恢复其业务资格。

第四十七条 存管银行出现下列情况之一的，交易所可以取消其存管银行资格：

- (一) 申请终止其存管银行资格的；
- (二) 被依法撤销、解散或宣告破产的；
- (三) 被收购或兼并且丧失法人地位的；
- (四) 不再满足期货保证金存管业务资格条件的；
- (五) 最近3个会计年度连续发生亏损的；
- (六) 最近一个年度考评结果不合格的；
- (七) 向交易所提供虚假材料信息的；
- (八) 交易所认为该存管银行存在重大风险隐患的；
- (九) 交易所认定的其他情况。

第四十八条 交易所决定取消存管银行期货保证金存管业务资格时，应当提前10个工作日向该存管银行发出通知，报告中国证监会，并在交易所网站上公告。

存管银行资格取消不影响其与交易所已经存在的法律关系，交易所依法与该存管银行了结相关业务关系。

第四十九条 被交易所取消存管银行资格的银行业金融机构，自取消之日起3年内不得再次申请交易所期货保证金存管业务资格。

第八章 附则

第五十条 对在与交易所进行期货保证金存管业务的过程中，存管银行接触到的与交易所有关的任何非公开信息，除依法向有权机关披露外，存管银行均应严守秘密，保证其及其相关业务人员不以任何方式向任何第三人披露。

第五十一条 本办法实施前已开展期货保证金存管业务的存管银行，无需重新申请资格，但应当遵守本办法的其他规定。

第五十二条 本办法由交易所负责解释和修订。

第五十三条 本办法自 2013 年 8 月 14 日起实施。

附件 1:

大连商品交易所期货保证金存管业务资格申请表

.....		
申请人基本财 务状况及其他 情况	上一年度期末	总资产:
		净资产:
		资本净额:
		

《大连商品交易所异常交易管理办法（试行）》有关监管标准及处理程序

为加强对期货市场异常交易行为的监管，发挥期货公司会员对客户交易行为的管理作用，现对《大连商品交易所异常交易管理办法（试行）》第五条关于异常交易行为的监管标准及处理程序规定如下：

一、自成交行为、频繁报撤单行为、大额报撤单行为的监管标准及处理程序

（一）监管标准

1. 客户或非期货公司会员单日在某一合约上的自成交次数达到5次（含5次）以上的，构成“以自己为交易对象，多次进行自买自卖”的异常交易行为。交易所认定的实际控制关系账户之间发生成交的，按照自成交行为进行处理。

2. 客户或非期货公司会员单日在某一合约上的撤单次数达到500次（含500次）以上的，构成“频繁报撤单”的异常交易行为。

3. 客户或非期货公司会员单日在某一合约上的撤单次数达到400次（含400次）以上的，且单笔撤单的撤单量超过合约最大下单手数的80%，构成“大额报撤单”的异常交易行为。

4. 客户或非期货公司会员单日在多个合约上自成交、频繁报撤单或大额报撤单达到交易所处理标准的，按照一次认定。

在统计客户和非期货公司会员自成交、频繁报撤单和大额报撤单次数时，市价指令、止损（盈）指令、套利指令、附加立即全部成交否则自动撤销（FOK）和立即成交剩余指令自动撤销（FAK）指令属性形成的撤单和自成交不计入在内。

（二）处理程序

1. 客户出现自成交、频繁报撤单、大额报撤单行为的处理流程

（1）客户自成交、频繁报撤单、大额报撤单行为第一次达到交易所处理标准的，交易所于当日对客户所在会员的首席风险官进行电话提示。

（2）客户自成交、频繁报撤单、大额报撤单行为第二次达到交易所处理标准的，交易所将

该客户列入重点监管名单，同时向客户所在期货公司会员通报。

(3) 客户自成交、频繁报撤单、大额报撤单行为第三次达到交易所处理标准的，交易所于当日闭市后对客户采取限制开仓的监管措施，限制开仓的时间不低于1个月。

2. 非期货公司会员出现自成交、频繁报撤单、大额报撤单行为的处理流程

非期货公司会员参与交易，出现自成交、频繁报撤单、大额报撤单行为，第一次达到处理标准的，交易所对该会员的指定联系人进行电话提示；第二次达到处理标准的，交易所约见会员的高级管理人员谈话；第三次达到处理标准的，交易所对该会员采取限制开仓的监管措施，限制开仓的时间不低于3个月。

二、实际控制关系账户合并持仓超限行为的监管标准及处理程序

(一) 监管标准

实际控制关系账户的监管标准适用《关于〈大连商品交易所异常交易管理办法（试行）〉有关实际控制关系账户监管标准的通知》。

一组实际关系账户单日在多个合约上合并持仓超限达到交易所处理标准的，按照一次认定。

(二) 处理程序

1. 完全由客户构成的实际控制关系账户合并持仓超限的处理流程

(1) 一组客户已被交易所认定为实际控制关系账户，且发生合并持仓超限行为，交易所于当日闭市后通知所在会员首席风险官，要求客户自行平仓；如客户次日第一节前未自行平仓的，交易所对客户进行强行平仓，直至合并持仓不高于交易所规定的持仓限额，同时于强行平仓当日闭市后对已认定的该组实际控制关系客户采取限制开仓的监管措施，限制开仓的时间不低于1个月。

(2) 一组实际控制关系账户出现合并持仓超限的，交易所除按前款要求进行处理外，第一次出现的，交易所将该组实际控制关系账户列入重点监管名单；第二次出现的，交易所于次日对该组实际控制关系账户采取限制开仓的监管措施，限制开仓的时间不低于10个交易日；第三次出现的，交易所于次日对该组实际控制关系账户采取限制开仓的监管措施，限制开仓的时间不低于6个月。

2. 一组实际控制关系账户当日结算时在某合约发生合并持仓超限行为，但其在该合约的持仓未超过上一交易日结算时交易所持仓限额，此种情形可豁免本款(二)1(2)的监管措施。当日已进行强行平仓的一组实际控制关系账户在同一合约同一持仓方向继续发生合并持仓超限行为的，

若该组实际控制关系账户当日未在该合约同方向增仓的，可豁免本款（二）1(2)的监管措施。

3. 包含非期货公司会员的实际控制关系账户组超仓的，按照本款（二）1、2条进行处理。

4. 实际控制关系账户组强行平仓处理，应遵循交易所强行平仓的其他相关规定。

三、出现异常交易行为，对客户所在期货公司会员的处理流程

（一）处理流程

客户达到交易所处理标准的交易行为发生在同一会员的，交易所将该会员进行电话提示。发生在不同会员的，交易所根据异常交易行为类别，分别选择自成交行为、频繁报撤单行为、大额报撤单行为发生次数最多的会员进行电话提示；对于实际控制关系账户合并持仓超限行为，交易所选择账户组内客户持仓分布最大的会员进行电话提示。

会员应当及时将交易所提示转达客户，并对客户进行教育、引导、劝阻及制止。

（二）监管措施

1. 对于未按照交易所要求对客户尽到通知、教育、引导、劝阻及制止义务的会员，交易所可根据情节的严重程度采取提示、约见谈话、下发监管警示函等监管措施。

2. 由于会员未尽到相关义务，交易所已向同一会员下发二次监管警示函的，第三次应向该会员下发监管意见函，并提请分类监管扣分。

交易所将根据市场情况及相关监管要求调整并公布相关异常交易行为的监管标准及处理程序。

关于有关实际控制关系账户监管标准的通知

大商所发〔2011〕48号

各会员单位：

为加强对期货市场实际控制关系账户的监管，强化市场基础性制度建设，维护市场平稳健康运行，现将《大连商品交易所异常交易管理办法（试行）》关于实际控制关系账户的监管标准通知如下：

一、实际控制关系账户的认定标准

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。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。

二、实际控制关系账户的报备工作要求

（一）具有实际控制关系账户（实际控制他人期货账户或被他人实际控制）的开户人应通过期货公司会员主动申报相关信息，并填写《实际控制关系账户申报表》（附件 1）。

（二）具有实际控制关系账户的开户人在实际控制关系发生变更时，应在 5 个工作日内通过

期货公司会员向交易所主动申报相关信息的变更情况。

（三）交易所对日常监控中发现的具有疑似实际控制关系且尚未申报的账户，将向开户人进行书面询问。

如相关开户人承认存在实际控制关系，应按照正常流程进行申报。

如相关开户人否认存在实际控制关系，应提供相关材料，并签署《合规声明及承诺书》（附件2）。交易所将对相关说明材料进行审核，对于事实清楚、理由充分，确不属于实际控制关系的，交易所将对相关账户进行正常管理；对于事实、理由不充分的，交易所将相关账户列入重点监控名单。

（四）非期货公司会员在申报情况及提供材料时，应直接向交易所上报。

（五）对于具有实际控制关系账户但不如实申报相关信息、隐瞒事实真相、故意回避等不协助报备工作的开户人，交易所将根据情节轻重，采取谈话提醒、书面警示、限制相关业务等措施。

（六）期货公司会员应当切实履行客户交易行为管理职责，积极配合相关开户人做好实际控制关系账户报备工作，及时发现、及时报告、及时制止相关开户人的失信行为。

我所将根据市场情况及相关监管要求调整并公布实际控制关系账户监管标准。

特此通知。

附件：1. 实际控制关系账户申报表

2. 合规声明及承诺书

大连商品交易所
二〇一一年三月十四日

附件 1
实际控制关系账户申报表（K-1 表）

第一部分：申报人信息				
个人客户 填写信息	*姓名		*交易编码	
	*身份证号码		联系电话	
	开户会员名称			
单位客户 填写信息	*名称		*交易编码	
	*组织机构代码		联系电话	
	开户会员名称			
	客户类型	A. 生产企业 ☐ B. 加工企业 ☐ C. 贸易公司 ☐ D. 投资公司 ☐ E. 其他（请详细说明）_____		
	主营业务			
	是否参与过套期保值交易？ 是 ☐ 否 ☐			

第二部分：实际控制关系账户信息					
实际控制关系账户相关信息	1、是否实际控制其他主体（个人客户或单位客户）的期货交易？是 ☐ 否 ☐ 如果是，请根据所控主体的性质填写所控客户的以下相关信息：				
	所控主体为个人客户时：	*姓名		*交易编码	
		*身份证号码		联系电话	
		开户会员名称			
		实际控制关系描述	(请简要描述报告主体与所控主体之间的实际控制关系)		
	所控主体为单位客户时：	*名称		*交易编码	
		*组织机构代码		联系电话	
		开户会员名称			
		主营业务			
		实际控制关系描述	(请简要描述报告主体与所控主体之间的实际控制关系)		
		是否参与过套期保值交易？ 是 ☐ 否 ☐			
	2、是否被其他主体（个人或单位）实际控制期货交易？是 ☐ 否 ☐ 如果是，请根据控制主体的性质填写控制客户的以下相关信息：				
	控制主体为个人客户时：	*姓名		联系电话	
		*身份证号码			
		实际控制关系描述	(请简要描述报告主体与控制主体之间的实际控制关系)		
		是否参与过期货交易？ 是 ☐ 否 ☐ 如果是，请继续填写以下内容：			
		开户会员名称		交易编码	
	控制主体为单位客户时：	*名称		联系电话	
		*组织机构代码			
		主营业务			
实际控制关系描述		(请简要描述报告主体与控制主体之间的实际控制关系)			
是否参与过期货交易？ 是 ☐ 否 ☐ 如果是，请继续填写以下内容：					
开户会员名称			交易编码		
是否参与过套期保值交易？ 是 ☐ 否 ☐					

第三部分：申报人承诺

1. 本人承诺所申报内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏，并对其真实性、准确性、完整性承担个别和连带的法律责任。
2. 本人承诺当所申报内容发生变更时，及时履行变更申报义务。
3. 本人知悉并承诺遵守交易所关于存在实际控制关系账户的有关规则及要求，合法合规参与期货交易，自愿承担相应的法律责任并接受交易所的处理措施。

注：1. 标注“*”的选项为必填项；其他选项可根据实际情况填写。

2. 如报告主体与1个以上的其他主体存在实际控制关系，则须填写相应数量的《实际控制关系账户申报表》进行申报，但第一部分内容只填写一次即可。

申报人： (签字)

年 月 日

附件 2:

合规声明及承诺书

大连商品交易所:

本人声明: 本人与_____账户之间不存在因代理、投资、亲属、交叉任职、协议以及其他安排等因素而对_____账户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_____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:

关于实际控制关系账户投机持仓合并计算相关规则的通知

大商所发〔2011〕96号

为加强对实际控制关系账户的监管，维护市场运行秩序，现将实际控制关系账户投机持仓合并计算和强行平仓规则通知如下：

一、实际控制关系账户投机持仓合并计算规则

1. 实际控制关系账户投机持仓合并计算，套期保值持仓不合并计算。
2. 全部由客户构成的实际控制关系账户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；包含非期货公司会员的实际控制关系账户合并计算的投机持仓量，不得超过单个非期货公司会员的投机持仓限额。

二、由交易所执行的强行平仓规则

1. 实际控制关系账户合并计算的投机持仓量超出其限仓规定的，交易所将于下一交易日按有关规定执行强行平仓。
2. 若实际控制关系账户合并计算的投机持仓超仓，交易所按上一个交易日结算时实际控制关系账户中客户或者非期货公司会员持仓量由大到小的顺序强行平仓。
3. 若客户或者非期货公司会员投机持仓超仓，同时其实际控制关系账户合并计算的投机持仓超仓，交易所先对超仓的客户或者非期货公司会员投机持仓强行平仓，再对其实际控制关系账户投机持仓强行平仓。

三、上述规则自2011年5月16日起施行。

特此通知。

大连商品交易所

二〇一一年五月四日

大连商品交易所标准仓单管理办法

(2016年10月11日)

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、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、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，《大连商品交易所保税交割实施细则》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、充抵等，鸡蛋标准仓单不允许转让和充抵。

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、充抵、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 标准仓单充抵按照《大连商品交易所结算细则》有关规定执行。

第三章 标准仓单的生成

第一节 仓库标准仓单

第九条 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。

第十条 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。未办理交割预报的入库商品不得用于交割。

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。

第十一条 会员办理交割预报时，应当交纳交割预报定金。各品种交割预报定金见《大连商品交易所交割细则》相关规定。

第十二条 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。

对于黄大豆 2 号品种，未能办理以期货交割为目的的《中华人民共和国进境动植物检疫许可证》导致无法入库的，交割预报定金予以返还。

第十三条 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。

黄大豆 2 号品种因为未能办理以期货交割为目的的《中华人民共和国进境动植物检疫许可证》导致无法入库的，会员凭指定交割仓库所在地的直属出入境检验检疫局出具的证明通过电子仓单系统办理返还交割预报定金。

第十四条 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。

第十五条 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《大连商品交易所交割细则》相关规定。入库过程中，包装不符合《大连商品交易所交割细则》相关规定的，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。

第十六条 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

第十七条 豆粕、豆油、棕榈油、焦炭、焦煤、铁矿石、鸡蛋、胶合板、玉米淀粉可以注册厂库标准仓单。

第十八条 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。

第十九条 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

第二十一条 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，鸡蛋标准仓单不允许交易和转让。

第二十二条 标准仓单进行实物交割的，按照《大连商品交易所交割细则》和《大连商品交易所保税交割实施细则》相关规定办理。

第二十三条 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。

第二十四条 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。

第五章 标准仓单的注销

第一节 仓库标准仓单

第二十五条 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。

第二十六条 标准仓单持有人注销标准仓单，应当通过会员办理。

第二十七条 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，《大连商品交易所保税交割实施细则》有规定的，按照相关规定执行。

第二十八条 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。

第二十九条 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。鸡蛋标准仓单相应的期货商品转为现货后，不允许再次生成标准仓单。

第三十条 标准仓单应当在交易所规定的期限内进行注销，各品种标准仓单注销期限见《大连商品交易所交割细则》相关规定。

第二节 厂库标准仓单

第三十一条 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。

第三十二条 标准仓单持有人注销标准仓单，应当通过会员办理。

第三十三条 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。

第三十四条 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。

第三十五条 商品重量与数量以厂库核对为准。

第三十六条 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。

第三十七条 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。

第三十八条 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。

第三十九条 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。

第四十一条 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。

其中，胶合板、铁矿石以外品种的滞纳金标准为 2 元/吨·天；胶合板滞纳金标准为 0.1 元/张·天；铁矿石滞纳金标准在标准仓单注销日后（不含注销日）第 19 个自然日（含当日）以内为 0.1 元/吨·天，超过该期间为 0.5 元/吨·天。

第四十二条 对于鸡蛋、胶合板以外的品种，货主应当在《大连商品交易所交割细则》规定的提货期限内到厂库提货。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 19 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。

对于鸡蛋品种，货主应当在《大连商品交易所交割细则》规定的提货期限内到厂库提货。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 19 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发货时间和发货速度的责任，但不再按期货标准承担有关商品质量的责任。

对于胶合板品种，货主应当在《大连商品交易所交割细则》规定的提货期限内到厂库提货。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 22 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。

其中，胶合板、铁矿石以外品种的滞纳金标准为 2 元/吨·天，胶合板滞纳金标准为 0.1 元/张·天，铁矿石滞纳金标准在标准仓单注销日后（不含注销日）第 19 个自然日（含当日）以内为 0.1 元/吨·天，超过该期间为 0.5 元/吨·天。

第四十三条 对于胶合板以外的品种，货主在标准仓单注销日后（不含注销日）的 19 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。

对于胶合板品种，货主在标准仓单注销日后（不含注销日）的 22 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。

胶合板、铁矿石以外品种的滞纳金金额=2 元/吨·天×全部的商品数量×19 天

胶合板滞纳金金额=0.1 元/张·天×全部的商品数量×22 天

铁矿石滞纳金金额=0.1 元/吨·天×全部的商品数量×19 天

第四十四条 厂库未按规定的时间发货速度发货，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%

第四十五条 厂库未按时完成所有商品的发货，在按第四十四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%

第四十六条 当厂库发生第四十四条、第四十五条中的违约行为时，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。

第四十七条 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。

第四十八条 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。

第四十九条 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。

第五十一条 标准仓单应当在交易所规定的期限内进行注销，各品种标准仓单注销期限见《大连商品交易所交割细则》相关规定。

第六章 争议与处理

第五十二条 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。

第五十三条 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、胶合板、玉米淀粉品种，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；对于鸡蛋品种，货主对鸡蛋质量有异议的，应当在发货日当天提出，并向交易所书面说明需要复检的质量指标，交易所按照《大连商品交易所交割细则》相关规定进行复检。

第五十四条 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、黄大豆 2 号、玉米、线型低密度聚乙烯、聚氯乙烯、纤维板、胶合板、聚丙烯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。

当货主就免检入库的线型低密度聚乙烯、聚氯乙烯、聚丙烯的质量存在异议时，可以在标准仓单注销之日起 10 个工作日内向交易所提出争议检验申请。由交易所指定争议检验机构，争议检验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。

第五十五条 黄大豆 1 号、黄大豆 2 号、玉米、豆粕、豆油、棕榈油、焦炭、焦煤、铁矿石、鸡蛋、玉米淀粉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。

线型低密度聚乙烯、聚氯乙烯、纤维板、胶合板、聚丙烯入库时的复检费用由提出争议者负担。出库时的复检费用由提货方先行垫付，复检结果与交割质量标准相符的，由此产生的一切费用和损失由提货方负担；不相符的，该费用和损失由指定交割仓库负担；聚氯乙烯复检结果与交割质量标准虽相符，但非卖方承诺交割品牌的，指定交割仓库应当在 200 元/吨范围内向买方先行承担赔偿责任，并有权向卖方或其他责任人追偿，生产厂家应当予以配合。

免检入库的线型低密度聚乙烯、聚氯乙烯、聚丙烯争议检验费用由提货方先行垫付，争议检验结果与交割质量标准相符的，由此产生的费用由提货方负担；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，或虽相符但非卖方承诺交割品牌的，除买方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提货方换货，逾期未完成换货的，按照每日 2 元/吨的标准向提货方支付赔偿金，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，应当向买方赔偿所有损失。生产厂家向买方先行承担上述责任后，有权向卖方或其他责任人追偿。

第五十六条 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

第五十七条 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。

第五十八条 本办法解释权属于大连商品交易所。

第五十九条 本办法自公布之日起实施。

聚氯乙烯交割注册品牌管理办法

(2015年7月13日修订)

第一章 总则

第一条 为了规范交割注册品牌的管理,根据《大连商品交易所交割细则》及有关规定,制定本办法。

第二条 交割注册品牌是指经交易所注册的、可用于交割的指定生产企业的指定品牌。

符合条件的交割注册品牌可以申请成为免检注册品牌,免检注册品牌在注册仓单时可以免于质量检验。

第三条 交割注册品牌的申请、暂停、取消及日常管理等按照本办法进行,交易所、会员、客户、指定质检机构以及相关生产企业等应当遵守本管理办法。

第二章 申请与审批

第四条 申请聚氯乙烯交割注册品牌的企业,应当满足以下条件:

- (一) 从事聚氯乙烯生产的企业法人;
- (二) 聚氯乙烯产品的品牌拥有国家有关部门颁发的商标注册证;
- (三) 信誉良好,产品市场接受度较高;
- (四) 聚氯乙烯产品质量标准符合期货交割质量标准;
- (五) 有健全的质量管理体系和管理制度;
- (六) 聚氯乙烯产品投产3年以上;
- (七) 企业上一年度开工率及产能达到交易所规定水平1;
- (八) 交易所要求的其他条件。

第五条 申请聚氯乙烯免检注册品牌的企业,应当满足以下条件:

- (一) 满足交割注册品牌的申请条件;
- (二) 申请企业为上市公司;
- (三) 聚氯乙烯产品投产5年以上;
- (四) 产能达到交易所规定水平2;
- (五) 交易所规定的其他条件。

第六条 申请交割注册品牌的企业应当提供以下材料:

- (一) 《大连商品交易所聚氯乙烯交割注册品牌资格申请表》（见附件 1）；
- (二) 承诺书（见附件 3）
- (三) 企业营业执照（副本）、税务登记证（副本）及组织机构代码证（副本）的复印件；
- (四) 商标注册证复印件；
- (五) 反映申请品牌产品外观、标识和包装情况的实物彩照，同时应注明包装方式、材料及规格、商标及标识所在部位；
- (六) 商品质量管理体系相关材料，包括企业质量控制制度和执行标准等质量管理文件、质量检验项目列表、主要检验设备及质量管理体系通过认证的证明材料等；
- (七) 立项批复、环保验收合格文件的复印件；
- (八) 由交易所指定或认可的国内五家以上用户的近期商品使用报告，商品使用报告包括用户的企业介绍、行业地位、主要产品、生产工艺、产品规格、产品技术指标、符合标准等；
- (九) 1 家以上会员单位出具的交割注册商品推荐书。
- (十) 交易所要求的其他材料。

第七条 申请免检注册品牌的企业，应当提供以下材料：

- (一) 《大连商品交易所聚氯乙烯免检注册品牌资格申请表》（见附件 2）；
- (二) 承诺书（见附件 4）；
- (三) 企业最近一个月内产品的质量指标出厂检验报告；
- (四) 免检注册品牌产品交割的内部控制流程，包括产品流向的追溯机制；
- (五) 直接申请免检注册品牌的企业，还应当提交第六条所列（三）至（九）项内容；
- (六) 交易所要求的其他材料。

第八条 交易所对申请企业提供的书面材料进行预审。

第九条 预审合格后，交易所指定质检机构及相关人员到申请企业实地考察，了解企业质量管理体系的认证及执行情况、商品的内在质量及商品外观、包装、计量以及工艺流程等情况。指定质检机构应当做好详细的检查记录，并提供完整的质检报告。

交易所根据实际情况，对提供使用意见的用户，进行实地生产和商品考察。

第十条 交易所应当根据申请企业的申请材料、实地考察以及交易所了解的其他情况等，在收到申请企业完整的申请材料之日起 45 个工作日内，做出是否批准交割注册品牌的决定。

第十一条 成为交割注册品牌后，申请企业应当按照交易所规定缴纳商品注册费 3 与风

险抵押金。

第三章 监督管理

第十二条 交易所可以根据市场情况对交割注册品牌商品的质量情况进行检查，对其市场满意度情况进行市场调查，生产企业应当予以配合。检查及调查结果可以作为确定该品牌能否继续成为交割注册品牌、免检注册品牌的依据。

质量检查费用由生产企业承担。

第十三条 取得交割注册品牌资格的生产企业发生下列事项之一的，应当在 5 个工作日内向交易所提交书面报告：

- （一）企业分立、合并、更名、变更公司组织形式；
- （二）企业 5%以上股权发生变更或者企业实际控制人发生变化；
- （三）交割注册品牌产品的商标、包装规格、包装标志等发生变化；
- （四）企业生产经营发生重大变化；
- （五）交易所规定的其他情形。

第十四条 交割注册品牌发生下列情形的，交易所可以暂停其交割注册品牌、免检注册品牌资格：

- （一）质量检查结果无法达到交易所要求的；
- （二）企业未按规定向交易所通报生产、经营方面的重大变动的；
- （三）发生质量纠纷，企业未能积极配合解决的；
- （四）交易所认定的其他情况。

发生上述情形时，交易所可以责令相关企业限期整改，经整改后符合交易所要求的，交易所可以恢复其交割注册品牌、免检注册品牌资格。

第十五条 交割注册品牌发生下列情形的，交易所可以取消其交割注册品牌、免检注册品牌资格：

- （一）企业分立、合并、更名、变更组织形式的；
- （二）商品注册商标发生转让的；
- （三）整改后仍无法达到交易所要求的
- （四）生产企业发生重大亏损，可能影响其持续经营的；
- （五）生产企业解散、破产的；
- （六）其他违反交易所规定的情形。

第十六条 指定交割仓库按照《大连商品交易所黄大豆 1 号、黄大豆 2 号、玉米、线型低密度聚乙烯、聚氯乙烯标准仓单管理办法》第四十二条规定对注册仓单的商品货物来源进行核对时，生产企业应当积极配合。

第十七条 交易所可以根据市场情况调整交割注册品牌、免检注册品牌、相关生产企业以及品牌升贴水，并及时向社会公布相关信息。

第四章 附 则

第十八条 本办法所称“以上”、“工作日内”，包括本数。

第十九条 本办法解释权属于大连商品交易所。

第二十条 本办法自发布之日起施行。

注：

- 1 开工率水平暂定为不低于行业平均水平，产能暂定为不低于 15 万吨。
- 2 暂定为不低于 25 万吨。
- 3 暂定为 5 万元。

附件 1:

大连商品交易所聚氯乙烯交割注册品牌 资格申请表

单位名称			
单位地址			
邮 编		法定代表人	
联 系 人		联系电话（手机）	
传 真		电子信箱	
产品名称及型号		执行标准	
投产日期		产能	
近三年产量		注册资本	
股权结构			
近两年净资产情况			
声明:我公司保证所填写内容的真实、准确、完整,如有错误或遗漏,我公司愿意承担由此产生的一切责任。 法人代表签字: 盖 章 年 月 日			
董事会审批意见: 盖 章 年 月 日			

企 业 简 介

注：企业简介包括：地理位置、历史沿革、公司制度、股东情况、主要产品、产量、采用的工艺路线、产品质量、行业地位、企业优势、未来有无扩产计划或发展规划等，可另行加页。

产 品 概 况

产品名称	聚氯乙烯	注册商标	
执行标准		投产日期	
产能（万吨/年）		去年产量（万吨/年）	
今年(1 至 月) 实际产量（万 吨）		SG5 型料产量（万吨/年）	
		_____型产量（万吨/年）	
		_____型产量（万吨/年）	
		_____型产量（万吨/年）	
市场分销量(吨)		销售区域及比例	
产品采用的生产工艺：			
商品的包装及规格：产品标识（提供产品标牌的数码及彩色照片）			
商标注册号： 商标图案： 有效期：			
注：若有多个商标，请说明区分方法			

附件 2:

大连商品交易所聚氯乙烯免检注册品牌 资格申请表

单位名称			
单位地址			
邮 编		法定代表人	
联 系 人		联系电话（手机）	
传 真		电子信箱	
产品名称及型号		执行标准	
投产日期		产能	
近五年产量		注册资本	
股权结构			
近三年净资产情况			
声明:我公司保证所填写内容的真实、准确、完整,如有错误或遗漏,我公司愿意承担由此产生的一切责任。 法人代表签字: 盖 章 年 月 日			
董事会审批意见: 盖 章 年 月 日			

企 业 简 介

注：企业简介包括：地理位置、历史沿革、公司制度、股东情况、主要产品、产量、采用的工艺路线、产品质量、行业地位、企业优势、未来有无扩产计划或发展规划等，可另行加页。

产 品 概 况

产品名称	聚氯乙烯	注册商标	
执行标准		投产日期	
产能（万吨/年）		去年产量（万吨/年）	
今年(1 至 月) 实际产量（万 吨）		SG5 型料产量（万吨/年）	
		_____型产量（万吨/年）	
		_____型产量（万吨/年）	
		_____型产量（万吨/年）	
市场分销量(吨)		销售区域及比例	
产品采用的生产工艺：			
商品的包装及规格：产品标识（提供产品标牌的数码及彩色照片）			
商标注册号： 商标图案：		有效期：	
注：若有多个商标，请说明区分方法			

附件 3:

承 诺 书

为使我企业的 牌 （商品）成为或继续成为可以用于大连商品交易所聚氯乙烯期货合约的交割注册品牌商品，我们承诺：

1、严格遵守《大连商品交易所交割细则》、《大连商品交易所聚氯乙烯交割注册品牌管理办法》及交易所其它相关规定。

2、随时接受、配合交易所的质量检查。

3、及时向交易所通报企业有关生产经营活动的变动情况，包括产品生产能力、执行技术标准、商标、外形尺寸以及企业重组、改制等方面的变化。

4、向交易所及指定质量检验机构支付交易所规定的可能发生的费用。

企业签章：

日期：

附件 4:

承 诺 书

为使我企业的 牌 （商品）成为或继续成为可以用于大连商品交易所聚氯乙烯期货合约的免检注册品牌商品，我们承诺：

- 1、严格遵守《大连商品交易所交割细则》、《大连商品交易所聚氯乙烯交割注册品牌管理办法》及交易所其它相关规定。
- 2、随时接受、配合交易所的质量检查。
- 3、及时向交易所通报企业有关生产经营活动的变动情况，包括产品生产能力、执行技术标准、商标、外形尺寸以及企业重组、改制等方面的变化。
- 4、向交易所及指定质量检验机构支付交易所规定的风险抵押金及其它可能发生的费用。
- 5、积极配合交易所处理交割过程中发生的交割商品质量纠纷。我企业生产的免检注册品牌商品出现任何质量问题，我企业愿承担相应的责任。

企业签章：

日期：

大连商品交易所保税交割实施细则

(2016年2月5日)

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）期货保税交割业务的正常进行，规范交割行为，根据《大连商品交易所交易规则》等相关规定，制定本实施细则。

第二条 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。

第三条 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。

第四条 保税标准仓单是指由交易所统一制定的，交易所指定保税交割仓库在完成入库保税商品验收、确认合格后提交标准仓单注册申请，经交易所注册的实物提货凭证。保税标准仓单经交易所注册后生效。

第五条 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。

第六条 交易所期货保税交割业务按照本实施细则进行，交易所、会员、客户及保税交割仓库应当遵守本实施细则。

第二章 线型低密度聚乙烯的保税交割

第一节 保税标准仓单的生成

第七条 保税标准仓单的生成流程按照交易所标准仓单的有关规定执行。

第八条 保税交割仓库申请注册的标准仓单应当明确对应货物为保税状态或完税状态，并对不同状态的货物分别管理。

第二节 保税标准仓单的流通

第九条 保税标准仓单可用于一次性交割和期转现交割。

第十条 经交易所批准，保税标准仓单可以作为保证金使用。

保税标准仓单作为保证金的，交易所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结算价扣除税费后的价格为基准计算价值。

保税仓单作为保证金的基准价格= $\frac{[(\text{申请日前一交易日该品种最近交割月份期货合约的结算价}-\text{相关费用})/(1+\text{进口增值税税率})-\text{消费税}]/(1+\text{进口关税税率})}{1}$;

除本条前三款规定外，保税标准仓单作为保证金使用的其他具体流程按照《大连商品交易所结算细则》标准仓单相关规定办理。

本条第三款所指的“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，其他品种保税仓单作为保证金的基准价格计算公式由交易所另行规定。

第三节 保税标准仓单期货转现货

第十一条 保税标准仓单期货转现货（以下简称保税期转现）是指持有同一交割月份合约的交易双方协商一致并向交易所提出申请，获得交易所批准后，按照交易所规定的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。

保税期转现只允许保税标准仓单期转现。

第十二条 会员应当在交易日 11:30 前向交易所提出保税期转现申请，交易所在申请的当日予以审批。

批准日 11:30 前，卖方会员应将相应数量的保税标准仓单交到交易所，买方会员应将按照协议价格计算的全额交割货款划入交易所帐户。

第十三条 保税期转现的保税标准仓单交收和货款支付由交易所负责办理，手续费按照《大连商品交易所结算细则》和《大连商品交易所交割细则》等相关规定收取。

第十四条 保税期转现批准日结算时，交易所将交易双方的相应持仓按照协议价进行结算处理，产生的盈亏计入当日平仓盈亏。

第十五条 保税期转现批准日闭市后，交易所将卖方会员提交的标准仓单交付买方会员，并向买方开具报关所需的保税交割结算单，保税交割结算单包括仓库名称、实际数量以及保税期转现交割结算价等内容，将保税期转现交割货款的 80% 付给卖方会员，余款在卖方会员提交了增值税普通发票后结清。

保税期转现交割结算价 = $\left[\left(\text{保税期转现前一日最近交割月份合约结算价} - \text{相关费用} \right) / \left(1 + \text{进口增值税税率} \right) - \text{消费税} \right] / \left(1 + \text{进口关税税率} \right)$ 。

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，其他品种的保税期转现交割结算价计算公式由交易所另行规定。

保税期转现交割结算价作为海关征收进口关税及进口增值税的计价基准。

第十六条 保税期转现申请的批准日后 7 个交易日内，卖方会员应向买方会员提交增值税普通发票。

第十七条 保税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保税期转现有关信息予以公布。

第四节 保税交割结算

第十八条 保税交割结算按照《大连商品交易所交割细则》第五章规定的交割流程进行，并以交割结算价作为交割货款的计算依据。

第十九条 配对结果确定后，买方会员应当在配对日后 1 个交易日内，按照税务机关的规定将开具增值税专用发票的具体事项，包括购货单位名称、地址、纳税人登记号、金额等信息通知卖方会员。

交易所向卖方开具报关所需的保税交割结算单，保税交割结算单包括仓库名称、实际数量以及保税交割结算价等内容。

卖方应以保税交割结算单上注明的保税交割结算价作为成交价格向海关申报，及时完成报关手续，并在最后交割日后 7 个交易日内将增值税专用发票交付买方。

保税交割结算价 = $\left[\left(\text{交割结算价} - \text{相关费用} \right) / \left(1 + \text{进口增值税税率} \right) - \text{消费税} \right] / \left(1 + \text{进口关税税率} \right)$ 。

本条第四款所指的“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。

第二十条 遇国家税收政策调整的，交易所可对保税交割结算价的计算公式进行调整，并及时公布。

第二十一条 交易所在合约最后交易日，公布该合约保税交割结算价。

第五节 保税标准仓单的注销

第二十二条 保税标准仓单注销是指保税标准仓单合法持有人向交易所申请提货（出关、出境）或转为一般现货提单，并办理保税标准仓单退出流通手续的过程。

第二十三条 保税标准仓单持有人注销保税标准仓单，应当通过会员办理。

第二十四条 货主提货时，应当向保税交割仓库提供提货人身份证、货主授权委托书，同时与保税交割仓库结清自保税标准仓单注销日次日至提货日的有关费用。

保税交割仓库应当向货主开具保税仓单清单。

第二十五条 保税标准仓单持有人需要对保税商品办理报关进口的，按照海关的相关规定办理。报关商品与数量应当与所持有的保税交割结算单、保税仓单清单保持一致。

第三章 铁矿石的保税交割

第一节 保税标准仓单的生成

第二十六条 保税标准仓单的生成流程按照交易所标准仓单的有关规定执行。

第二十七条 保税交割仓库申请注册的标准仓单应当明确对应货物为保税状态或完税状态，并对不同状态的货物分别管理。

第二节 保税标准仓单的流通

第二十八条 铁矿石保税标准仓单可用于期转现交割、一次性交割、交易及转让。

第二十九条 铁矿石保税标准仓单的期转现交割和一次性交割，除本章第三节、第四节规定外，按照《大连商品交易所交割细则》、《大连商品交易所结算细则》标准仓单有关规定办理。

保税标准仓单交易的具体流程由交易所另行规定。

第三十条 保税标准仓单转让应当通过会员在交易所办理过户手续，同时结清有关费用；交易所依据双方成交价，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。《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、交割方式等内容，交割方式中应当标注“转让”。

注销的保税标准仓单是由转让而取得的，交易所不为其开具《保税交割结算单》（报关专用），海关依据现有相关规定办理手续。

未通过交易所办理过户手续而转让的保税标准仓单，交易所不为其开具《保税交割结算单》（税务专用、记账专用、报关专用）等相关单证。

第三节 保税期转现

第三十一条 保税期转现的保税标准仓单交收和货款支付由交易所负责办理，手续费按照《大连商品交易所结算细则》和《大连商品交易所交割细则》等相关规定收取。

第三十二条 保税期转现批准日结算时，交易所按照申请日前一日最近交割月份合约结算价对买卖双方的相应持仓进行平仓，结算盈亏；按照申请日前一日最近交割月份合约结算价扣除税费后形成的价格划转货款，并以该价格作为交易所为保税期转现开具《保税交割结算单》的依据。每个交易日结束后，交易所将当日执行的保税期转现有关信息予以公布。

第三十三条 保税期转现批准日闭市后，交易所将保税期转现货款的 80%付给卖方会员，余款在卖方会员提交了其他形式的发票或者交易所认可的其他单据后结清。

保税期转现货款=申请日前一日最近交割月份合约结算价扣除税费后形成的价格×申请期转现保税标准仓单数量

第三十四条 保税期转现批准日闭市后，交易所将卖方会员提交的标准仓单交付买方会员，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）。

《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、交割方式等内容，交割方式中应当标注“期转现”。

第四节 保税标准仓单一次性交割

第三十五条 最后交易日后第一个交易日闭市前，卖方会员应当将其交割月份合约持仓相对应的全部标准仓单（含保税标准仓单）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交割品种与标准仓单（含保税标准仓单）数量信息。

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。最后交易日后第二个交易日闭市后，交易所按照《大连商品交易所交割细则》第四十八条对标准仓单（含保税标准仓单）和买方客户进行配对。

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。

保税标准仓单货款=保税交割结算价×保税标准仓单数量；

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)；

保税交割结算价由交易所在合约最后交易日公布。

本条第五款所指的“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。

第三十六条 最后交割日闭市后，交易所将保税标准仓单货款的 80%付给卖方会员，并按照保税交割结算价给卖方开具《保税交割结算单》（税务专用、记账专用），给买方开具《保税标准仓单持有凭证》和《保税交割结算单》（记账专用）。《保税交割结算单》中除了价格信息外，还应当包括仓库名称、实际数量、交割时间、交割方式等内容，交割方式中应当标注“一次性交割”。余款在卖方会员提交了其他形式的发票或者交易所认可的其他单据后结清。

第三十七条 遇国家税收政策调整的，交易所可以对保税交割结算价的计算公式进行调整，并及时公布。

第五节 铁矿石保税标准仓单作为保证金使用与所外质押

第三十八条 经交易所批准，保税标准仓单可以作为保证金使用。

保税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结算价扣除税费后的价格为基准计算价值。

保税仓单作为保证金的基准价格=[(申请日前一交易日该品种最近交割月份期货合约的结算价-相关费用)/(1+进口增值税税率)-消费税]/(1+进口关税税率)；

除本条前三款规定外，保税标准仓单作为保证金使用的其他具体流程按照《大连商品交易所结

算细则》标准仓单相关规定办理。

本条第三款所指的“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，其他品种保税仓单作为保证金的基准价格计算公式由交易所另行规定。

第三十九条 保税标准仓单所外质押具体流程按照当地海关铁矿石保税交割业务监管办法和交易所相关规定办理。

第六节 保税标准仓单的注销

第四十条 保税标准仓单的注销业务流程和基本要求,除本节规定外,按照《大连商品交易所标准仓单管理办法》办理。

第四十一条 保税标准仓单持有人需要对保税商品办理报关进口或转运出境的,办理保税标准仓单注销手续时,应当向交易所说明,然后按照当地海关的相关规定办理进口报关或转运出境手续。

货主办理提货手续后,保税交割仓库向货主开具保税标准仓单清单,交易所凭保税标准仓单清单向货主开具《保税交割结算单》(报关专用),同时将《保税交割结算单》相关信息通过电子仓单系统发送给相应海关。信息一经发送,即视为送达。

货主应当在《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)向海关办理进口报关手续,报关商品、数量、价格等基本信息应当与其所持有的《保税交割结算单》、保税标准仓单清单保持一致。

注销的保税标准仓单是由交易、转让等非期货交割方式而取得的,交易所不为其开具《保税交割结算单》(报关专用)。

第四十二条 货主办理报关进口时,按照以下原则向海关申报,供海关审定铁矿石完税价格,并按照海关相关规定缴纳税款:

采用一次性交割的: 申报价=保税交割结算价+保税升贴水;

采用期转现交割的: 申报价=申请日前一日最近交割月份合约结算价扣除税费后形成的价格+保税升贴水;

采用提货单交割的: 申报价=保税交割结算价+保税升贴水;

保税升贴水=升贴水/(1+进口增值税税率)/(1+进口关税税率)。

本条第五款升贴水的计算按照交易所相关规定执行。

注销的保税标准仓单是由交易、转让等非期货交割方式而取得的,货主办理报关进口时,海关按照现行保税货物内销有关规定审定完税价格。

第四章 附则

第四十三条 本实施细则的解释权属于交易所。

第四十四条 本实施细则未做明确规定的，按照交易所其他有关规定执行。

第四十五条 本实施细则自公布之日起实施。

（注：铁矿石保税交割制度自 I1606 合约开始施行）