

大连商品交易所细则（期货）

交易品种	黄玉米	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（PVC）	焦炭	焦煤	铁矿石	鸡蛋	纤维板	胶合板	聚丙烯	玉米淀粉	乙二醇	粳米	苯乙烯	液化石油气	生猪	
交易代码	C	A	B	M	Y	P	L	V	J	JM	I	JD	FB	BB	PP	CS	EG	RR	EB	PG	LH	
交易单位	10吨/手				5吨/手			100吨/手	60吨/手	100吨/手	5吨/手	10立方米/手	500张/手	5吨/手	10吨/手	10吨/手	10吨/手	5吨/手	20吨/手	16吨/手		
报价单位	元（人民币）/吨										元（人民币）/500千克	元（人民币）/立方米	元（人民币）/张	元（人民币）/吨	元（人民币）/吨	元（人民币）/吨	元（人民币）/吨	元（人民币）/吨	元（人民币）/吨	元（人民币）/吨	元（人民币）/吨	
最小变动价位	1元/吨				2元/吨		5元/吨		0.5元/吨		1元/500千克	0.5元/立方米	0.05元/张	1元/吨	1元/吨	1元/吨	1元/吨	1元/吨	1元/吨	1元/吨	1元/吨	5元/吨
最后交易日	合约月份第10个交易日										合约月份倒数第四个交易日	合约月份第10个交易日				合约月份倒数第4个交易日	合约月份第10个交易日	合约月份倒数第4个交易日				
注意事项	<p>个人客户持仓和焦炭、焦煤、铁矿石、黄大豆2号非交割单位整数倍持仓不得交割，不具备苯乙烯或液化石油气生产、经营或使用资质的单位客户不得参与相应品种交割。</p> <p>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。</p> <p>对焦炭、焦煤、铁矿石、黄大豆2号、苯乙烯、液化石油气以外品种合约，最后交易日收市后，个人客户交割月份合约的持仓仍未能平仓的，首先由会员代为履约，会员仍未能履约的，则按照《大连商品交易所交割细则》中交割违约的有关规定进行处理。</p> <p>对焦炭、焦煤、铁矿石、黄大豆2号、苯乙烯、液化石油气合约，最后交易日收市后，个人客户交割月份合约的持仓和非交割单位整数倍持仓仍未能平仓的，由交易所按照“不允许交割持仓优先，含有时间最短持仓的交割单位整数倍持仓优先”原则，选择对手方持仓对冲平仓，平仓价格为该合约交割结算价，并对客户持有的不允许交割持仓部分处以按交割结算价计算合约价值20%的罚款，该款项支付给对方。若对冲双方均为持有不允许交割持仓的客户，交易所对双方分别处以按交割结算价计算合约价值20%的罚款，不再支付给对方。</p> <p>黄大豆1号、黄大豆2号、豆粕、豆油、玉米、玉米淀粉、焦煤、焦炭、乙二醇、粳米、苯乙烯、纤维板、液化石油气、生猪、铁矿石（适用于i2205及以后合约）合约适用滚动交割。滚动交割是指在交割月第一个交易日至最后交易日的前一个交易日期间，由持有标准仓单（已冻结的除外）和交割月单向卖持仓的卖方客户主动提出（纤维板除外），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。</p>																					
交易限额	<p>非期货公司会员或者客户在铁矿石期货各月份合约上单日开仓量不得超过2,000手。该单日开仓量是指非期货公司会员或者客户当日在铁矿石期货单个合约上的买开仓数量与卖开仓数量之和。</p> <p>非期货公司会员或者客户在生猪期货合约单日开仓量不得超过500手，其中单日开仓量是指非期货公司会员或者客户当日在所有月份合约上的买开仓数量与卖开仓数量之和。</p>																					
连续三日涨跌停后交易所风控措施	<p>若某合约在D3交易日出现同方向单边市（即连续三天涨跌停板），则若D3交易日是该合约的最后交易日，则该合约直接进入交割；若D4交易日是该合约的最后交易日，则D4交易日按照D3交易日的涨跌停板和保证金水平继续交易。除以上两种情况之外，交易所可在D3交易日收市后决定并公告，对该合约采取以下措施中的一种或多种：</p> <p>（一）单边或双边、同比例或不同比例、部分会员或全部会员提高交易保证金；</p> <p>（二）调整涨跌停板幅度；</p> <p>（三）暂停部分会员或全部会员开新仓</p> <p>（四）限制出金</p> <p>（五）限期平仓</p> <p>（六）强行平仓</p> <p>（七）在D3交易日收市后强制减仓</p>																					
合约临近交割月时交易所保证金收取标准																						
交易品种	黄玉米	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（PVC）	焦炭	焦煤	铁矿石	鸡蛋	纤维板	胶合板	聚丙烯	玉米淀粉	乙二醇	粳米	苯乙烯	石油液化气	生猪	
交易代码	C	A	B	M	Y	P	L	V	J	JM	I	JD	FB	BB	PP	CS	EG	RR	EB	PG	LH	
交割月份前一个月第十五个交易日	10%	10%	10%	10%	10%	10%	10%	10%	10%	10%	10%	10%	10%	10%	10%	10%	10%	10%	10%	10%	10%	
交割月份第一个交易日	20%	20%	20%	20%	20%	20%	20%	20%	20%	20%	20%	20%	20%	20%	20%	20%	20%	20%	20%	20%	20%	
期货合约持仓量变化时的交易所保证金收取标准（N代表某一期期货合约的单边持仓量）																						
交易品种	乙二醇																					
合约代码	EG																					

执行时间	交割月前一个月第一个交易日至该月第十四个交易日	交割月前一个月第十五个交易日至该月最后一个交易日
某日的上一交易日结算时单边持仓量	N>12万手	N>8万手
交易保证金	10%	20%

大连商品交易所非期货公司会员和客户投机持仓的限仓额度规定（具有实际控制关系的客户和非期货公司会员的持仓合并计算） 单位：手

品种	一般月份（合约上市至交割月前一个月第十四个交易日）			品种	交割月前一个月第十五个交易日起		品种	交割月份		品种	一般规定				特别规定			
	期货合约月份单边持仓量	一般月份最大单边持仓占市场单边持仓比例或绝对限仓量			非期货公司会员	客户		非期货公司会员	客户（个人客户持仓限额为0手）		时间段	合约单边持仓量	非期货公司会员	客户	时间段	合约单边持仓量	非期货公司会员	客户
	(N)	非期货公司会员	客户															
黄大豆1号	N≤15万	30000	15000	黄大豆1号	5,000	2,500	黄大豆1号	2,000	1,000	乙二醇	合约上市至交割月份前一个月第十四个交易日	单边持仓量≤80,000	8,000		交割月份前一个月第一个交易日至该月第十四个交易日	单边持仓量>120,000	3000（维持该标准，直至该月第十四个交易日）	
	N>15万	20%	10%	黄大豆2号	4,500	4,500	黄大豆2号	1,500	1,500			单边持仓量>80,000	单边持仓量×10%					
黄大豆2号	N≤20万	20,000	20,000	豆粕	15,000	7,500	豆粕	5,000	2,500		交割月份前一个月第十五个交易日至该月最后一个交易日	-	3000		交割月份前一个月第十五个交易日至该月最后一个交易日	单边持仓量>80,000	1000（维持该标准，直至该月最后一个交易日）	
	N>20万	10%	10%	豆油	6,000	3,000	豆油	2,000	1,000			-	1000					-
豆粕	N≤40万	80,000	40,000	棕榈油	3,000	1,500	棕榈油	1,000	500	鸡蛋	所有月份合约	交易时间段		非期货公司会员/境外特殊非经纪参与者	客户			
	N>40万	20%	10%	玉米	30,000	15,000	玉米	10,000	5,000			合约上市起				1,200	1,200	
玉米	N≤40万	80,000	40,000	线型低密度聚乙烯	6,000	3,000	线型低密度聚乙烯	2,000	1,000			交割月前一个月第一个交易日起				400	400	
	N>40万	20%	10%	聚氯乙烯	10,000	5,000	聚氯乙烯	5,000	2,500			交割月前一个月第十个交易日起				120	120	
豆油	N≤20万	40,000	20,000	焦炭	900	900	焦炭	300	300	生猪	非7月合约	交割月份（个人客户持仓限额为0）		20	20			
	N>20万	20%	10%	焦煤	1,500	1,500	焦煤	500	500			合约上市起		500	500			
棕榈油	N≤10万	20,000	10,000	铁矿石（适用于i2204及之前月份合约）	6,000	6,000	铁矿石（适用于i2204及之前月份合约）	2,000	2,000			交割月前一个月第一个交易日起		125	125			
	N>10万	20%	10%	纤维板	800	800	纤维板	200	200			交割月前一个月第十个交易日起		30	30			
线型低密度聚乙烯	N≤10万	20,000	10,000	胶合板	80	80	胶合板	20	20	7月合约	交割月份（个人客户持仓限额为0）		10	10				
	N>10万	20%	10%	聚丙烯	5,000	5,000	聚丙烯	2,500	2,500		合约上市起		200	200				
聚氯乙烯	N≤20万	40,000	20,000	玉米淀粉	4,500	4,500	玉米淀粉	1,500	1,500		交割月前一个月第一个交易日起		50	50				
	N>20万	20%	10%	粳米	2,000	2,000	粳米	1,000	1,000		交割月前一个月第十个交易日起		10	10				
焦炭	N≤5万	5,000	5,000	苯乙烯	2,000	2,000	苯乙烯	1,000	1,000	铁矿石（适用于i2205及之后月份合约）	所有月份合约	交割月份（个人客户持仓限额为0）		5	5			
	N>5万	10%	10%	液化石油气	1000	1,000	液化石油气	500	500			合约上市起		15,000	15,000			
焦煤	N≤8万	8,000	8,000						交割月前一个月第一个交易日起			10,000	10,000					
	N>8万	10%	10%						交割月前一个月第十个交易日起			6,000	6,000					
铁矿石（适用于i2204及之前月份合约）	N≤40万	40,000	40,000							交割月份		2,000	2,000					

1440*24*1000 份合约)	N>40万	10%	10%
纤维板	N≤30万	30,000	30,000
	N>30万	10%	10%
胶合板	N≤6万	6,000	6,000
	N>6万	10%	10%
聚丙烯	N≤20万	20,000	20,000
	N>20万	10%	10%
玉米淀粉	N≤15万	15,000	15,000
	N>15万	10%	10%
粳米	N≤20万	20,000	20,000
	N>20万	10%	10%
苯乙烯	N≤12万	12,000	12,000
	N>12万	10%	10%
液化石油气	N≤8万	8,000	8,000
	N>8万	10%	10%

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

以上表格中内容更新于2021年5月20日，实际执行的涨跌停板、交易所保证金、限仓标准等内容以交易所公布为准，如交易所针对以上表中的内容有所调整，请投资者及时查阅大连商品交易所网站公告；公司保证金标准以招商期货公布为准。投资者可通过招商期货官方网站交易提示查看各合约保证金标准及涨跌停板幅度。