

附件

## 大连商品交易所交割细则修正案

第四十二条 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，~~在购和竞卖交割违约处理在最后交割日滚动交割的交收日后集中~~进行。

### 第二十四章 交割违约

第一百六十四条 ~~在计算买方交割违约合约数量时，违约部分应预留合约价值20%的违约金和赔偿金。~~

买、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（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）。

第一百六十五条 发生交割违约后，交易所于~~违约发生当日~~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。

~~守约方须在下一交易日11:00以前将终止交割或继续交割的选择意向书面递交交易所。逾期未递交选择意向的，交易所按终止交割处理。终止交割后，交易所交割担保责任了结。~~

~~第一百六十六条 鸡蛋以外的品种，构成交割违约的，由违约方支付违约部分合约价值 5%20% 的违约金给守约方，买卖双方终止交割。同时按以下办法处理：~~

~~（一）卖方违约的，买方可作如下的一项选择~~

~~1. 终止交割：交易所退还买方货款；~~

~~2. 继续交割：交易所在最后交割日后的三个交易日内发布标准仓单征购公告，并在最后交割日后的第 7 个交易日组织征购。征购成功，交易所支付给买方标准仓单；征购失败，卖方支付给买方违约部分合约价值 15% 的赔偿金，交易所退还买方交割货款后终止交割。卖方承担因征购产生的一切经济损失和费用。~~

~~（二）买方违约的，卖方可作如下的一项选择~~

~~1. 终止交割：交易所退还卖方标准仓单；~~

~~2. 继续交割：交易所在最后交割日后的三个交易日内发布标准仓单竞卖公告，并在最后交割日后的第七个交易日组织竞卖。竞卖成功，交易所支付给卖方交割货款；竞卖失败，买方支付给卖方违约部分合约价值 15% 的赔偿金，交易所退还卖方标准仓单后终止交割。买方承担因竞卖产生的一切经济损失和费用。~~

~~第一百六十七条 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。~~

~~第一百六十七条 鸡蛋品种，构成交割违约的，按以下办法处理：~~

~~（一）卖方违约的，卖方支付给买方违约部分合约价值 20% 的赔偿金，交易所退还买方交割货款后终止交割；~~

~~（二）买方违约的，买方支付给卖方违约部分合约价值 20% 的赔偿金，交易所退还卖方保证金后终止交割。~~

~~第一百六十八条 征购价格不高于交割结算价的 125%，竞卖价格不低于交割结算价的 75%。~~

## ~~第二十五章 标准仓单征购、竞卖~~

~~第一百七十二条 标准仓单征购、竞卖是指发生交割违约后，在守约方选择继续交割的情况下，交易所公开买入、卖出标准仓单的行为。~~

~~第一百七十三条 标准仓单征购、竞卖由交易所委托具备资格的机构统一组织进行。客户参与标准仓单征购、竞卖须由会员代理，并以会员名义进行。~~

~~个人客户不允许参与标准仓单征购、竞卖。~~

~~第一百七十四条 在最后交割日后的三个交易日内，交易所向全体会员和社会发布标准仓单征购、竞卖公告。~~

~~第一百七十五条 在最后交割日后的第七个交易日，交易所组织标准仓单征购、竞卖。~~

~~第一百七十六条 标准仓单征购、竞卖的报价是指对应期货合约的交割标准品在基准交割仓库交货的含增值税和包装物款项的价格。~~

~~第一百七十七条 参加标准仓单征购（竞卖）的会员在其可流通的标准仓单被冻结或将货币资金存入交易所后取得参加征购（竞卖）的资格，并在征购、竞卖完成后按成交价结算货款。~~

~~征购（竞卖）仓单数量为：~~

~~可卖出仓单量（手）=被冻结仓单数量（手）~~

~~可买入仓单量（手）=预交货款（元）/交割结算价（元/吨）/交易单位（吨/手）。~~

~~第一百七十八条 标准仓单征购、竞卖按照“价格优先，数量优先”的原则进行。~~

~~第一百七十九条 征购起始价格为交割结算价的125%，竞卖起始价格为交割结算价的75%。~~

~~在交易中，会员根据当前价格申报买入（卖出）的数量。如果当前价格申报买入（卖出）的数量大于等于竞卖（征购）数量，则竞卖（征购）价格按照最小变动价位顺次提高（降低）。~~

~~会员在最新价格的申报不得撤销，除非是会员在最新价格的申报量大于其在次新价格的申报量，否则次新价格的申报不得撤销；最新和次新价格以外的其余价位的申报自动撤销。~~

~~第一百八十条 最近一笔申报之后，如无人进行新的申报，则主持人可以宣布征购（竞卖）结束，并按照价格优先和相同价格按申报数量由大到小的顺序确定成交，如果数量相同则按时间先后顺序分配。~~

~~第一百八十一条 征购（竞卖）部分成功是指在起始征购（竞卖）中，申报数量小于征购（竞卖）数量。此时取全部申报为成交申报并在结束后将实际征购（竞卖）获得的仓单数量（货币资金）按对应违约方的违约数量占总的卖方（买方）违约数量的比例向对应守约方分配。~~

~~第一百八十二条 征购（竞卖）结束后，交易所将征购（竞卖）结果和配对结果予以公布；交易所并以成交价格对参与征购（竞卖）的卖方（买方）的货款进行结算（含包装物款项），并开具《标准仓单持有凭证》。~~

~~第一百八十三条 征购（竞卖）结束后，如果征购（竞卖）价格低于（高于）交割结算价，则以成交价对守约方进行结算，增值税专用发票由双方直接开具。~~

~~如果征购（竞卖）价格高于（低于）交割结算价，则以交割结算价对守约方进行结算，成交价与交割结算价之间的差额从违约方帐户中支付。增值税专用发票以违约方为中间票据出具人分别开具。~~

~~第一百八十四条 征购（竞卖）结束后，如征购（竞卖）部分成功，交易所对未成功部分合约按交割结算价计算合约价值的15%违约金从违约方帐户划入~~

~~守约方帐户。如果同一违约方对应多个守约方，则对违约方的未成功部分合约按对应守约方的配对数量平均分配。~~

~~第一百八十五条 征购（竞卖）结束后，增值税专用发票应在五个交易日内开给对应客户。会员迟交或未提交增值税专用发票的，参照《大连商品交易所结算细则》有关规定处理。~~

~~第一百八十六条 交易所向违约方收取 5 元/吨的征购（竞卖）费用。~~

~~由征购（竞卖）产生的其他费用由违约方承担。~~

~~第一百八十七条 未成交会员（客户）持相关凭证在征购、竞卖结束后到交易所办理资金清退和标准仓单解冻手续。~~

~~第一百八十八条 征购、竞卖结果由交易所予以公开发布。~~

注：阴影部分为新增内容，双划线部分为删除内容。出现条款增删的，其他条款顺序依次顺延。