

关于 2020 年清明节假期调整相关品种期货合约涨跌停板幅度和交易保 证金水平的通知

大商所发〔2020〕143 号

各会员单位：

根据《大连商品交易所风险管理办法》规定，经研究决定，我所将在 2020 年清明节休市前后对各品种期货合约涨跌停板幅度和交易保证金水平作如下调整：

自 2020 年 4 月 2 日（星期四）结算时起，铁矿石品种期货合约涨跌停板幅度和交易保证金水平分别调整为 8%和 10%；黄大豆 1 号、黄大豆 2 号、豆粕、豆油、棕榈油、聚乙烯、聚丙烯和聚氯乙烯品种期货合约涨跌停板幅度和交易保证金水平分别调整为 7%和 8%；玉米、玉米淀粉、粳米品种期货合约涨跌停板幅度和交易保证金水平分别调整为 5%和 6%。焦炭、焦煤、鸡蛋、乙二醇、苯乙烯、液化石油气、纤维板和胶合板品种期货合约的涨跌停板幅度和交易保证金水平维持不变。

2020 年 4 月 7 日（星期二）恢复交易后，在各品种持仓量最大的期货合约未出现涨跌停板单边无连续报价的第一个交易日结算时起，作如下调整：

铁矿石品种期货合约涨跌停板幅度和投机交易保证金水平分别恢复至 7%和 8%；黄大豆 1 号、黄大豆 2 号、豆粕、豆油、棕榈油、玉米、玉米淀粉、粳米、焦炭、焦煤、鸡蛋、乙二醇、苯乙烯、聚乙烯、聚丙烯、聚氯乙烯、液化石油气、纤维板和胶合板品种期货合约的涨跌停板幅度和投机交易保证金水平维持不变。铁矿石、焦炭、焦煤、黄大豆 1 号、黄大豆 2 号、豆粕、豆油、棕榈油、玉米、玉米淀粉、粳米、鸡蛋、聚乙烯、聚丙烯、聚氯乙烯、乙二醇、苯乙烯和液化石油气等 18 个品种期货合约的套期保值交易保证金水平调整为与涨跌停板幅度相同。纤维板和胶合板品种期货合约的涨跌停板幅度和交易保证金水平维持不变。

如遇上述涨跌停板幅度、交易保证金水平与现行执行的涨跌停板幅度、交易保证金水平不同时，则按两者中幅度大、水平高的执行。

表：清明节前后相关品种风险参数调整安排

品种	现行标准		长假标准 (4.2 结算时-4.7 日)		长假后标准		
	涨跌停板幅 度	交易保证金水 平	涨跌停板幅 度	交易保证金水 平	涨跌停板幅 度	交易保证金水 平	
						投机	保值
铁矿石	7%	8%	8%	10%	7%	8%	7%
焦炭	7%	8%	7%	8%	7%	8%	7%
焦煤	7%	8%	7%	8%	7%	8%	7%
黄大豆 1 号	5%	6%	7%	8%	7%	8%	7%
黄大豆 2 号	5%	6%	7%	8%	7%	8%	7%
豆粕	5%	6%	7%	8%	7%	8%	7%
豆油	5%	6%	7%	8%	7%	8%	7%
棕榈油	6%	7%	7%	8%	7%	8%	7%
玉米	4%	5%	5%	6%	5%	6%	5%
玉米淀粉	4%	5%	5%	6%	5%	6%	5%
粳米	4%	5%	5%	6%	5%	6%	5%

鸡蛋	6%	7%	6%	7%	6%	7%	6%
聚乙烯	6%	7%	7%	8%	7%	8%	7%
聚丙烯	6%	7%	7%	8%	7%	8%	7%
聚氯乙烯	5%	6%	7%	8%	7%	8%	7%
乙二醇	9%	11%	9%	11%	9%	11%	9%
苯乙烯	9%	11%	9%	11%	9%	11%	9%
液化石油 气	7%	8%	7%	8%	7%	8%	7%
纤维板	5%	10%	5%	10%	5%	10%	10%
胶合板	5%	20%	5%	20%	5%	20%	20%

2020年清明假期将至，且近期市场波动较大，请各会员单位做好对客户风险提示工作，加强市场风险防范，确保市场平稳运行。

特此通知。

大连商品交易所

2020年3月31日