

关于 2020 年劳动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〕173 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 年劳动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做如下调整：

自 2020 年 4 月 29 日（星期三）结算时起，铁矿石、焦炭、焦煤和聚氯乙烯品种期货合约涨跌停板幅度调整为 8%，套期保值交易和投机交易保证金水平分别调整为 8%和 9%；聚乙烯品种期货合约涨跌停板幅度调整为 9%，套期保值交易和投机交易保证金水平分别调整为 9%和 11%；液化石油气品种期货合约涨跌停板幅度调整为 10%，套期保值交易和投机交易保证金水平分别调整为 10%和 11%；苯乙烯期货品种合约涨跌停板幅度调整为 11%，套期保值交易和投机交易保证金水平分别调整为 11%和 12%；豆油和棕榈油品种期货合约涨跌停板幅度调整为 9%，套期保值交易和投机交易保证金水平分别调整为 9%和 10%；胶合板品种期货合约套期保值交易和投机交易保证金水平均调整为 40%，涨跌停板幅度维持不变；黄大豆 1 号、黄大豆 2 号、豆粕、玉米、玉米淀粉、粳米、鸡蛋、聚丙烯、乙二醇和纤维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 5 月 6 日（星期三）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，做如下调整：

豆油和棕榈油品种期货合约涨跌停板幅度恢复至 7%，套期保值交易和投机交易保证金水平分别恢复至 7%和 8%；铁矿石、焦炭、焦煤、聚乙烯、聚氯乙烯、液化石油气、苯乙烯和胶合板维持假期期间涨跌停板幅度和交易保证金水平不变，不恢复至节前标准；黄大豆

1号、黄大豆2号、豆粕、玉米、玉米淀粉、粳米、鸡蛋、聚丙烯、乙二醇和纤维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：劳动节前后相关品种风险参数调整安排

品种	现行标准			长假期间标准			长假后标准		
	涨跌停板	交易保证金		涨跌停板	交易保证金		涨跌停板	交易保证金	
		投机	保值		投机	保值		投机	保值
铁矿石	7%	8%	7%	8%	9%	8%	8%	9%	8%
焦炭	7%	8%	7%	8%	9%	8%	8%	9%	8%
焦煤	7%	8%	7%	8%	9%	8%	8%	9%	8%
黄大豆1号	7%	8%	7%	7%	8%	7%	7%	8%	7%
黄大豆2号	7%	8%	7%	7%	8%	7%	7%	8%	7%
豆粕	7%	8%	7%	7%	8%	7%	7%	8%	7%
豆油	7%	8%	7%	9%	10%	9%	7%	8%	7%
棕榈油	7%	8%	7%	9%	10%	9%	7%	8%	7%
玉米	5%	6%	5%	5%	6%	5%	5%	6%	5%
玉米淀粉	5%	6%	5%	5%	6%	5%	5%	6%	5%
粳米	5%	6%	5%	5%	6%	5%	5%	6%	5%
鸡蛋	6%	7%	6%	6%	7%	6%	6%	7%	6%
聚乙烯	7%	8%	7%	9%	11%	9%	9%	11%	9%

聚丙烯	9%	11%	9%	9%	11%	9%	9%	11%	9%
聚氯乙烯	7%	8%	7%	8%	9%	8%	8%	9%	8%
乙二醇	9%	11%	9%	9%	11%	9%	9%	11%	9%
苯乙烯	9%	11%	9%	11%	12%	11%	11%	12%	11%
液化石油气	7%	8%	7%	10%	11%	10%	10%	11%	10%
纤维板	5%	10%	10%	5%	10%	10%	5%	10%	10%
胶合板	5%	20%	20%	5%	40%	40%	5%	40%	40%

2020年劳动节假期将至，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4月24日