

关于低硫燃料油期货上市交易有关事项的通知

上能发〔2020〕114号

各有关单位：

中国证监会已批准上海国际能源交易中心（以下简称能源中心）上市交易低硫燃料油期货。根据能源中心相关规则，现将有关事项通知如下：

一、上市时间

低硫燃料油期货自2020年6月22日（周一）起上市交易，当日8:55-9:00集合竞价，9:00开市。

二、交易时间

每周一至周五，09:00-10:15、10:30-11:30和13:30-15:00，连续交易时间，每周一至周五21:00-23:00。法定节假日前第一个工作日（不包含周六和周日）的连续交易时间段不进行交易。

三、挂牌合约

LU2101、LU2102、LU2103、LU2104、LU2105、LU2106。

LU2101的最后交易日为2020年12月24日（周四），交割期为12月25日（周五）、28日（周一）、29日（周二）、30日（周三）和31日（周四）。

四、挂牌基准价

由能源中心在上市前一交易日公布。

五、交易保证金和涨跌停板

交易保证金为合约价值的 15%；涨跌停板幅度为±13%，首日涨跌停板幅度为其 2 倍。

境外特殊非经纪参与者、境外客户可以使用外汇资金作为保证金。以外汇资金作为保证金的，以中国外汇交易中心公布的当日人民币汇率中间价作为其市值核定的基准价，目前能源中心规定可用于作为保证金的外汇币种为美元，折扣率为 0.95。

当日闭市前外汇资金的市值先按照前一交易日中国外汇交易中心公布的当日人民币汇率中间价核算。每日结算时按上述规定的方法重新确定外汇资金作为保证金使用的基准价并调整折后金额。

六、持仓公布

当某一合约收盘后的持仓量达到 5 万手（单边）时，能源中心将公布该月份合约前 20 名期货公司会员、境外特殊经纪参与者的成交量、买持仓量、卖持仓量。

七、交易手续费

人民币 2 元/手，平今仓交易不免收交易手续费。

请各有关单位做好低硫燃料油期货上市的各项准备工作，加强风险防范，确保市场平稳运行。

特此通知。

上海国际能源交易中心

2020年6月10日