

# 关于 2021 年元旦节假日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〕640 号

各会员单位：

根据《大连商品交易所风险管理办法》，经研究决定，我所将在 2021 年元旦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 12 月 30 日（星期三）结算时起，铁矿石品种期货合约投机交易保证金水平由 11%调整为 12%（I2105 合约维持 15%标准不变），涨跌停板幅度和套期保值交易保证金水平维持 10%不变；焦炭和焦煤品种期货合约涨跌停板幅度由 8%调整为 10%，套期保值和投机交易保证金水平分别由 8%和 9%调整为 10%和 11%；黄大豆 1 号品种期货合约投机交易保证金水平由 10%调整为 12%，涨跌停板幅度和套期保值交易保证金水平维持 8%不变；棕榈油品种期货

合约投机交易保证金水平由 9%调整为 10%，涨跌停板幅度和套期保值交易保证金水平维持 8% 不变；玉米品种期货合约涨跌停板幅度和投机交易保证金水平分别由 6%和 8%调整为 7%和 9%，套期保值交易保证金水平维持 7%不变；鸡蛋品种期货合约涨跌停板幅度由 6%调整为 8%，套期保值和投机交易保证金水平分别由 6%和 7%调整为 8%和 9%；其他品种期货合约涨跌停板幅度和交易保证金水平维持不变。

2021 年 1 月 4 日（星期一）恢复交易后，铁矿石、焦炭、焦煤、黄大豆 1 号、棕榈油、玉米和鸡蛋品种期货合约涨跌停板幅度和交易保证金水平维持假期期间标准不变；其他品种期货合约涨跌停板幅度和交易保证金水平维持不变。

表：我所元旦节调整前后各品种期货合约风控参数对比

品种	现行标准			另
	涨跌停板	交易保证金		
		投机	保值	
铁矿石	<b>10%</b>	<b>11%</b>	<b>10%</b>	
焦炭	<b>8%</b>	<b>9%</b>	<b>8%</b>	
焦煤	<b>8%</b>	<b>9%</b>	<b>8%</b>	
黄大豆 1 号	<b>8%</b>	<b>10%</b>	<b>8%</b>	
黄大豆 2 号	8%	9%	8%	
豆粕	7%	8%	7%	
豆油	7%	8%	7%	
棕榈油	<b>8%</b>	<b>9%</b>	<b>8%</b>	
玉米	<b>6%</b>	<b>8%</b>	<b>7%</b>	
玉米淀粉	6%	7%	6%	
粳米	5%	6%	5%	
鸡蛋	<b>6%</b>	<b>7%</b>	<b>6%</b>	
聚乙烯	9%	11%	9%	
聚丙烯	9%	11%	9%	
聚氯乙烯	8%	9%	8%	
乙二醇	9%	11%	9%	
苯乙烯	11%	12%	11%	
液化石油气	10%	11%	10%	

纤维板	5%	10%	10%	
胶合板	5%	40%	40%	

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。

2021 年元旦节假期将至，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 12 月 28 日