

附件 5

## 大连商品交易所风险管理办法 (修改对照表征求意见稿)

(注：阴影部分为新增内容，双划线部分为删除内容，“……”(省略号)含义为该条款未修改的其他内容)

| 原条文                                                                                          | 修改后条文                                                                                                                        |
|----------------------------------------------------------------------------------------------|------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
| <p>第五条 除线型低密度聚乙烯、聚氯乙烯、聚丙烯以外品种期货合约，自进入交割月份前一个月第十五个交易日起，交易所将分时间段逐步提高该合约的交易保证金标准。</p> <p>……</p> | <p>第五条 除线型低密度聚乙烯、聚氯乙烯、聚丙烯以外品种期货合约，自进入交割月份前一个月第十五个交易日起，交易所将分时间段逐步提高该合约的交易保证金标准。</p> <p>……</p> <p>本办法所称交割月份为实物交割期货合约的合约月份。</p> |
| <p>第二十九条 各品种期货合约持仓限额如下：</p> <p>(一)除铁矿石、鸡蛋、生猪以外的品种</p> <p>1.除铁矿石、鸡蛋、生</p>                     | <p>第二十九条 各品种期货合约持仓限额如下：</p> <p>(一)除铁矿石、鸡蛋、生猪、线型低密度聚乙烯、聚氯乙烯、聚丙烯以外的品种</p>                                                      |

猪品种外,各品种期货合约一般月份(合约上市至交割月份前一个月第十四个交易日)非期货公司会员、境外特殊非经纪参与者和客户持仓限额见下表:(单位:手)

| 品种       | 合约单边持仓量        | 非期货公司会员/境外特殊非经纪参与者 | 期货公司会员/境外特殊非经纪参与者 | 客户         |
|----------|----------------|--------------------|-------------------|------------|
| ...      | .....          | .....              | .....             | .....      |
| 线型低密度聚乙烯 | 单边持仓量 ≤200,000 | 20,000             | 20,000            | 20,000     |
| 线型低密度聚乙烯 | 单边持仓量 >200,000 | 单边持仓量 ×10%         | 单边持仓量 ×10%        | 单边持仓量 ×10% |

1.除~~铁矿石、鸡蛋、生猪品种~~外,各品种期货合约一般月份(合约上市至交割月份前一个月第十四个交易日)非期货公司会员、境外特殊非经纪参与者和客户持仓限额见下表:(单位:手)

| 品种                  | 合约单边持仓量                      | 非期货公司会员/境外特殊非经纪参与者    | 客户                    |
|---------------------|------------------------------|-----------------------|-----------------------|
| .....               | .....                        | .....                 | .....                 |
| <del>线型低密度聚乙烯</del> | <del>单边持仓量 ≤200,000</del>    | <del>20,000</del>     | <del>20,000</del>     |
| <del>线型低密度聚乙烯</del> | <del>单边持仓量 &gt;200,000</del> | <del>单边持仓量 ×10%</del> | <del>单边持仓量 ×10%</del> |
| <del>聚氯乙烯</del>     | <del>单边持仓量 ≤200,000</del>    | <del>20,000</del>     | <del>20,000</del>     |
| <del>聚氯乙烯</del>     | <del>单边持仓量 &gt;200,000</del> | <del>单边持仓量 ×10%</del> | <del>单边持仓量 ×10%</del> |
| .....               | .....                        | .....                 | .....                 |

|      |                   |            |            |
|------|-------------------|------------|------------|
| 聚氯乙烯 | 单边持仓量<br>≤200,000 | 20,000     | 20,000     |
|      | 单边持仓量 > 200,000   | 单边持仓量 ×10% | 单边持仓量 ×10% |
| ...  | .....             | .....      | .....      |
| 聚丙烯  | 单边持仓量<br>≤200,000 | 20,000     | 20,000     |
|      | 单边持仓量 > 200,000   | 单边持仓量 ×10% | 单边持仓量 ×10% |
| ...  | .....             | .....      | .....      |

2.除铁矿石、鸡蛋、生猪品种外,各品种期货合约自交割月份前一个月第十五个交易日至交割月期间非期货公司会员、境外特殊非经纪参与者和客户持仓

|                |                               |                       |                       |
|----------------|-------------------------------|-----------------------|-----------------------|
| <del>聚丙烯</del> | <del>单边持仓量<br/>≤200,000</del> | <del>20,000</del>     | <del>20,000</del>     |
|                | <del>单边持仓量 &gt; 200,000</del> | <del>单边持仓量 ×10%</del> | <del>单边持仓量 ×10%</del> |
| .....          | .....                         | .....                 | .....                 |

2.除铁矿石、鸡蛋、生猪品种外,各品种期货合约自交割月份前一个月第十五个交易日至交割月期间非期货公司会员、境外特殊非经纪参与者和客户持仓限额见下表,交割月份个人客户持仓限额为 0:  
(单位:手)

| 品种                  | 时间段                       | 非期货公司会员/境外特殊非经纪参与者 | 客户               |
|---------------------|---------------------------|--------------------|------------------|
| .....               | .....                     | .....              | .....            |
| <del>线型低密度聚乙烯</del> | <del>交割月前一个月第十五个交易日</del> | <del>5,000</del>   | <del>5,000</del> |
|                     | 交割月份                      | 2,500              | 2,500            |

限额见下表，交割月份个人客户持仓限额为 0：（单位：手）

| 品种       | 时间段             | 非期货公司会员/境外特殊非经纪参与者 | 客户    |
|----------|-----------------|--------------------|-------|
| .....    | .....           | .....              | ..... |
| 线型低密度聚乙烯 | 交割月前一个月第十五个交易日起 | 5,000              | 5,000 |
|          | 交割月份            | 2,500              | 2,500 |
| 聚氯乙烯     | 交割月前一个月第十五个交易日起 | 5,000              | 5,000 |
|          | 交割月份            | 2,500              | 2,500 |
| .....    | .....           | .....              | ..... |
| 聚丙烯      | 交割月前一个          | 5,000              | 5,000 |

|                 |                            |                  |                  |
|-----------------|----------------------------|------------------|------------------|
| <del>聚氯乙烯</del> | <del>交割月前一个月第十五个交易日起</del> | <del>5,000</del> | <del>5,000</del> |
|                 | <del>交割月份</del>            | <del>2,500</del> | <del>2,500</del> |
| .....           | .....                      | .....            | .....            |
| <del>聚丙烯</del>  | <del>交割月前一个月第十五个交易日起</del> | <del>5,000</del> | <del>5,000</del> |
|                 | <del>交割月份</del>            | <del>2,500</del> | <del>2,500</del> |
| .....           | .....                      | .....            | .....            |

（二）铁矿石、鸡蛋、生猪品种

~~铁矿石、鸡蛋、生猪期货合约~~  
非期货公司会员、境外特殊非经纪参与者和客户持仓限额见下表，交割月份个人客户持仓限额为 0：（单位：手）

.....

（三）线型低密度聚乙烯、聚氯乙烯、聚丙烯品种

非期货公司会员和客户持仓限额见下表，交割月份个人客户持仓

|       |           |       |       |
|-------|-----------|-------|-------|
|       | 月第十五个交易日起 |       |       |
|       | 交割月份      | 2,500 | 2,500 |
| ..... | .....     | ..... | ..... |

(二) 铁矿石、鸡蛋、生猪品种

铁矿石、鸡蛋、生猪期货合约非期货公司会员、境外特殊非经纪参与者和客户持仓限额见下表,交割月份个人客户持仓限额为 0:  
(单位:手)

.....

限额为 0: (单位:手)

| 时间<br>段                                                                                          | 单边持<br>仓量                 | 线型低密度<br>聚乙烯、聚<br>氯乙烯、聚<br>丙烯期货合<br>约 |                      | 线型低密<br>度聚乙烯、<br>聚氯乙烯、<br>聚丙烯月<br>均价期货<br>合约 |                      |
|--------------------------------------------------------------------------------------------------|---------------------------|---------------------------------------|----------------------|----------------------------------------------|----------------------|
|                                                                                                  |                           | 非期<br>货公<br>司会<br>员                   | 客<br>户               | 非期<br>货公<br>司会<br>员                          | 客<br>户               |
| 合<br>约<br>上<br>市<br>至<br>合<br>约<br>月<br>份<br>前<br>一<br>个<br>月<br>第<br>十<br>四<br>个<br>交<br>易<br>日 | 单边持<br>仓量<br>≤200,00<br>0 | 16,00<br>0                            | 16,00<br>0           | 4,00<br>0                                    | 4,00<br>0            |
|                                                                                                  | 单边持<br>仓量 ><br>200,000    | 单边<br>持仓<br>量<br>×8%                  | 单边<br>持仓<br>量<br>×8% | 单边<br>持仓<br>量<br>×2%                         | 单边<br>持仓<br>量<br>×2% |
| 合<br>约<br>月                                                                                      | ——                        | 4,000                                 | 4,000                | 1,00<br>0                                    | 1,00<br>0            |

|  |                   |  |  |  |  |  |
|--|-------------------|--|--|--|--|--|
|  | 份前一个月第十五个交易日起交割月份 |  |  |  |  |  |
|  |                   |  |  |  |  |  |
|  |                   |  |  |  |  |  |
|  |                   |  |  |  |  |  |
|  |                   |  |  |  |  |  |
|  |                   |  |  |  |  |  |
|  |                   |  |  |  |  |  |
|  |                   |  |  |  |  |  |
|  |                   |  |  |  |  |  |
|  |                   |  |  |  |  |  |
|  |                   |  |  |  |  |  |
|  |                   |  |  |  |  |  |
|  |                   |  |  |  |  |  |
|  |                   |  |  |  |  |  |
|  |                   |  |  |  |  |  |
|  |                   |  |  |  |  |  |
|  |                   |  |  |  |  |  |
|  |                   |  |  |  |  |  |
|  |                   |  |  |  |  |  |
|  |                   |  |  |  |  |  |
|  |                   |  |  |  |  |  |
|  |                   |  |  |  |  |  |
|  |                   |  |  |  |  |  |
|  |                   |  |  |  |  |  |
|  |                   |  |  |  |  |  |
|  |                   |  |  |  |  |  |
|  |                   |  |  |  |  |  |
|  |                   |  |  |  |  |  |
|  |                   |  |  |  |  |  |
|  |                   |  |  |  |  |  |
|  |                   |  |  |  |  |  |
|  |                   |  |  |  |  |  |
|  |                   |  |  |  |  |  |
|  |                   |  |  |  |  |  |
|  |                   |  |  |  |  |  |
|  |                   |  |  |  |  |  |
|  |                   |  |  |  |  |  |
|  |                   |  |  |  |  |  |
|  |                   |  |  |  |  |  |
|  |                   |  |  |  |  |  |
|  |                   |  |  |  |  |  |
|  |                   |  |  |  |  |  |
|  |                   |  |  |  |  |  |
|  |                   |  |  |  |  |  |
|  |                   |  |  |  |  |  |
|  |                   |  |  |  |  |  |
|  |                   |  |  |  |  |  |
|  |                   |  |  |  |  |  |
|  |                   |  |  |  |  |  |
|  |                   |  |  |  |  |  |
|  |                   |  |  |  |  |  |
|  |                   |  |  |  |  |  |
|  |                   |  |  |  |  |  |
|  |                   |  |  |  |  |  |
|  |                   |  |  |  |  |  |
|  |                   |  |  |  |  |  |
|  |                   |  |  |  |  |  |
|  |                   |  |  |  |  |  |
|  |                   |  |  |  |  |  |
|  |                   |  |  |  |  |  |
|  |                   |  |  |  |  |  |
|  |                   |  |  |  |  |  |
|  |                   |  |  |  |  |  |
|  |                   |  |  |  |  |  |
|  |                   |  |  |  |  |  |
|  |                   |  |  |  |  |  |
|  |                   |  |  |  |  |  |
|  |                   |  |  |  |  |  |
|  |                   |  |  |  |  |  |
|  |                   |  |  |  |  |  |
|  |                   |  |  |  |  |  |