

附件 10

相关规则修改对照表

一、《大连商品交易所交易管理办法》
修改对照表

（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
第三十一条 交易所应当及时发布以下与交易有关的信息： …… （十一）结算价。结算价是指某一期货合约当日交易期间成交价格按成交量的加权平均价。无成交合约当日结算价按照《大连商品交易所结算管理办法》相关规定确定。结算价是进行当日未平仓合约盈亏结算和确定下一交易日涨跌停板幅度的依据。	第三十一条 交易所应当及时发布以下与交易有关的信息： …… （十一）结算价。结算价是指某一期货合约当日交易期间成交价格按成交量的加权平均价。无成交合约当日结算价按照《大连商品交易所结算管理办法》相关规定确定。结算价是进行当日未平仓合约盈亏

.....	结算和确定下一交易日涨跌停板幅度的依据。结算价按照《大连商品交易所结算管理办法》等有关规定确定。 												
第三十四条 交易指令的种类: (五) 套利交易指令: 交易所对指定合约提供套利交易指令, 交易所计算机撮合系统收到指令后将指令内各成分合约按规定比例同时成交。套利交易指令分为同品种跨期套利和跨品种套利交易指令, 各指令具体内容如下: <table><tr><th>名 称</th><th>交易方式 (从买方角度)</th><th>报价方式</th></tr><tr><td>同品种跨期套利交易指</td><td>买入近月份合约, 卖出同等数量远月份合约。</td><td>买(卖)套利价格 = 近月合约买(卖)申报价格 -</td></tr></table>	名 称	交易方式 (从买方角度)	报价方式	同品种跨期套利交易指	买入近月份合约, 卖出同等数量远月份合约。	买(卖)套利价格 = 近月合约买(卖)申报价格 -	第三十四条 交易指令的种类: (五) 套利交易指令: 交易所对指定合约提供套利交易指令, 交易所计算机撮合系统收到指令后将指令内各成分合约按规定比例同时成交。套利交易指令分为同品种跨期套利和、跨品种套利和不同交割方式套利交易指令, 各指令具体内容如下: <table><tr><th>名 称</th><th>交易方式 (从买方角度)</th><th>报价方式</th></tr><tr><td>同品种跨期套利交</td><td>买入近月份合约, 卖出同等数量远月</td><td>买(卖)套利价格 = 近月合约买(卖)申</td></tr></table>	名 称	交易方式 (从买方角度)	报价方式	同品种跨期套利交	买入近月份合约, 卖出同等数量远月	买(卖)套利价格 = 近月合约买(卖)申
名 称	交易方式 (从买方角度)	报价方式											
同品种跨期套利交易指	买入近月份合约, 卖出同等数量远月份合约。	买(卖)套利价格 = 近月合约买(卖)申报价格 -											
名 称	交易方式 (从买方角度)	报价方式											
同品种跨期套利交	买入近月份合约, 卖出同等数量远月	买(卖)套利价格 = 近月合约买(卖)申											

令		远月合约 卖(买)申 报价格	易指 令	份合约。	报价格 - 远月合约 卖(买)申 报价格
.....					
.....			不同 交割 方式 套利 交易 指令	买入实物 交割合 约, 卖出 同等数量 现金交割 合约。	买(卖)套 利价 格 = 实物 交割合约 买(卖)申 报价 格 - 现金 交割合约 卖(买)申 报价格
					

二、《大连商品交易所风险管理办法》 修改对照表

（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
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。 ……	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。 …… 本办法所称交割月份为实物交割期货合约的合约月份。
第二十九条 各品种期货合约持仓限额如下： （一）除铁矿石、鸡蛋、生猪以外的品种	第二十九条 各品种期货合约持仓限额如下： （一）除铁矿石、鸡蛋、生猪、线型低密度聚乙烯、聚氯乙烯、聚

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	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 $\leq 200,000$	20,000	20,000	20,000
...	单边持仓量 $> 200,000$	单边持仓量	单边持仓量	单边持仓量

丙烯以外的品种

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
.....			
线型低密度聚乙烯	单边持仓量 $\leq 200,000$	20,000	20,000
...	单边持仓量 $> 200,000$	单边持仓量 $\times 10\%$	单边持仓量 $\times 10\%$
聚氯乙	单边持仓量 $\leq 200,000$	20,000	20,000
烯	单边持仓量 $> 200,000$	单边持仓量 $\times 10\%$	单边持仓量 $\times 10\%$

烯		×10%	×10%
聚氯 乙烯	单 边 持 仓 量 ≤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 ≤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

.....			
聚丙 烯	单 边 持 仓 量 ≤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	5,000	5,000

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

	易日起		
	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	交割月前一个月第十五个交易日起	5,000	5,000
	交割月份	2,500	2,500
.....			

（二）铁矿石、鸡蛋、生猪品种

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

	月第十 五个交 易日起			额见下表，交割月份个人客户持仓					
	交割月 份	2,500	2,500	限额为 0：（单位：手）					
.....				时 间 段	单 边 持 仓 量	线型低密度 聚乙烯、聚 氯乙烯、聚 丙烯期货合 约		线型低密 度聚乙烯、 聚氯乙烯、 聚丙烯月 均价期货 合约	
						非期 货公 司会 员	客 户	非期 货公 司会 员	客 户
(二) 铁矿石、鸡蛋、 生猪品种				合 约 上 市 至 合 约 月 份 前 一 个 月 第 十 四 个 交 易 日	单 边 持 仓 量 ≤200,00 0	16,00 0	16,00 0	4,00 0	4,00 0
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）					单 边 持 仓 量 ＞ 200,000	单 边 持 仓 量 ×8%	单 边 持 仓 量 ×8%	单 边 持 仓 量 ×2%	单 边 持 仓 量 ×2%
.....					合	——	4,000	4,000	1,00

	约月份前一个月第十五个交易日				0	0
	交割月份	_____	2,500	2,500	_____	_____
	第五十七条 相关品种期货业务细则对保证金和涨跌停板另有规定的，适用其规定。					

三、《大连商品交易所结算管理办法》 修改对照表

（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，出现条款增删的，其他条款顺序依次顺延。）

原条文	修改后条文
第三十四条 …… 标准仓单交到交易所后，与其所示数量相同的最近交割月份卖持仓交易保证金在结算时不再收取。黄大豆2号、鸡蛋等品种期货业务细则另有规定的，适用其规定。	第三十四条 …… 标准仓单交到交易所后，与其所示数量相同的实物交割期货合约的最近交割月份卖持仓交易保证金在结算时不再收取。黄大豆2号、鸡蛋等品种期货业务细则另有规定的，适用其规定。
第四十条 期货合约当日结算价是指某一期货合约当日成交价格按照成交量的加权平均价。当日无成交价格的，其合约的当日结算价按照下列方	第四十条 期货合约当日结算价是指某一期货合约当日成交价格按照成交量的加权平均价。当日无成交价格的，其合约的当日结算价按照下列方

法确定： 新上市合约连续三个交易日无成交，交易所可另行调整结算价。 交易所进行合约、规则调整的，对于当前无持仓且连续三个交易日无成交的已挂牌合约，交易所可另行调整结算价。	法确定： 新上市合约连续三个交易日无成交，交易所可另行调整结算价。 线型低密度聚乙烯、聚氯乙烯、聚丙烯月均价期货合约的当日结算价按照其期货业务细则有关规定确定。 交易所进行合约、规则调整的，对于当前无持仓且连续三个交易日无成交的已挂牌合约，交易所可另行调整结算价。
第四十三条 资产作为保证金的实际可用金额具体计算方法见本办法第六章的有关规定。	第四十三条 资产作为保证金的实际可用金额具体计算方法见本办法第六章的有关规定。
第四十七条 实有货币资金指实有人民币资金和外汇资金价值按照折扣比率折算后的人民币金额之和，外汇资金的折算方法见本	第四十七条 实有货币资金指实有人民币资金和外汇资金价值按照折扣比率折算后的人民币金额之和，外汇资金的折算方法见本

办法第六章的规定。	办法第 六 七章的规定。
	第五章 现金交割结算 第六十九条 期货合约采取现金交割的，交割日结算时，交易所以交割结算价为基础，划付持仓双方的盈亏，了结到期未平仓合约。
	第七十条 会员进行现金交割，应按规定向交易所交纳交割手续费，具体标准由交易所另行公布。 交割手续费从会员的结算准备金中扣划。
	第七十一条 期货合约采取现金交割的，其交割结算价按照品种期货业务细则有关规定执行。
第七十三条 具有第七十二条第一项情形的，境外特殊参与者、移入和移出委托结算的会员应当在协议期满前 10 个	第七十 三 六条 具有第七十二 三 五条第一项情形的，境外特殊参与者、移入和移出委托结算的会员应当在协议期满前

交易日内，向交易所提交下列材料办理委托结算关系变更手续： 	10 个交易日内，向交易所提交下列材料办理委托结算关系变更手续：
第七十四条 具有第七十二条第（二）、（三）项情形的，境外特殊参与者、移入和移出委托结算的会员除提交第七十三条规定的材料外，还应当提交解除原委托结算关系的协议。交易所收到完整材料后，在 10 个交易日内对申请材料进行审核。审核通过的，交易所通知变更委托结算关系的约定结算日。	第七十四四七条 具有第七十二二五条第（二）、（三）项情形的，境外特殊参与者、移入和移出委托结算的会员除提交第七十三六条规定的材料外，还应当提交解除原委托结算关系的协议。交易所收到完整材料后，在 10 个交易日内对申请材料进行审核。审核通过的，交易所通知变更委托结算关系的约定结算日。
第七十八条 作为保证金的资产的市值按以下方法计算： （一）标准仓单作为保证金的，每日结算时，交易所以该标准仓单对应品种最近交割	第七十八八十一一条 作为保证金的资产的市值按以下方法计算： （一）标准仓单作为保证金的，每日结算时，交易所以该标准仓单对应品种实物交割

月份期货合约的当日结算价为基准价计算其市值。当日闭市前，先以该标准仓单对应品种最近交割月份期货合约的前一交易日结算价为基准价计算其市值。 	期货合约的最近交割月份期货合约的当日结算价为基准价计算其市值。当日闭市前，先以该标准仓单对应品种实物交割期货合约的最近交割月份期货合约的前一交易日结算价为基准价计算其市值。
--	--

四、《大连商品交易所交割管理办法》 修改对照表

（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
第一条 为保证大连商品交易所（以下简称交易所）期货交割业务的正常进行，规范实物交割行为，根据《大连商品交易所交易规则》，制定本办法。	第一条 为保证大连商品交易所（以下简称交易所）期货交割业务的正常进行，规范实物交割期货交割行为，根据《大连商品交易所交易规则》，制定本办法。
第二条 交易所上市的商品期货合约采用实物交割方式。实物交割是指交易双方按照合约和规则的规定通过该期货合约所载商品所有权的转移，了结未平仓合约的过程。	第二条 交易所上市的商品期货合约可以采用实物交割或者现金交割方式。 实物交割是指交易双方按照合约和规则的规定通过该期货合约所载商品所有权的转移，了结未平仓合约的过程。 现金交割是指交易所以交

	割结算价为基础，划付持仓双方的盈亏，了结到期未平仓合约的过程。
第三条 实物交割应当由会员办理，并以会员名义在交易所进行。 会员的客户、委托会员结算的境外特殊参与者、委托会员交易结算的境外中介机构应当通过会员在交易所办理实物交割。 境外特殊经纪参与者、境外中介机构的客户，应当分别通过该境外特殊经纪参与者、境外中介机构办理实物交割。	第三条 实物期货交割应当由会员办理，并以会员名义在交易所进行。 会员的客户、委托会员结算的境外特殊参与者、委托会员交易结算的境外中介机构应当通过会员在交易所办理实物期货交割。 境外特殊经纪参与者、境外中介机构的客户，应当分别通过该境外特殊经纪参与者、境外中介机构办理实物期货交割。
第六条 以下持仓不得交割： 	第六条 以下持仓不得进行实物交割：
第七条 交易所上市的商品期货合约的交割业务按本办法进行，交易所、会员、境外	第七条 交易所上市的商品期货合约的交割业务按本办法进行，实物交割业务按照本

特殊参与者、境外中介机构、客户、指定交割仓库、指定车板交割场所、指定质量检验机构等交割业务参与者应当遵守本办法。	办法执行，现金交割业务按照《大连商品交易所结算管理办法》有关规定执行。 交易所、会员、境外特殊参与者、境外中介机构、客户、指定交割仓库、指定车板交割场所、指定质量检验机构等交割业务参与者应当遵守本办法。
第五十二条 交易所在夜盘交易小节不办理交割及标准仓单、非标准仓单等相关业务。	第五十二条 交易所在夜盘交易小节不办理实物交割及标准仓单、非标准仓单等相关业务。

五、《大连商品交易所套利交易管理办法》 修改对照表

（注：阴影部分为新增内容。）

原条文	修改后条文
第二条 按照合约月份的不同，套利交易可分为一般月份套利交易(自合约上市之日起至交割月份前第一个月最后一个交易日)和交割月份套利交易。	第二条 按照合约月份的不同，套利交易可分为一般月份套利交易(自合约上市之日起至交割月份前第一个月最后一个交易日)和交割月份套利交易。 线型低密度聚乙烯、聚氯乙烯、聚丙烯月均价期货合约套利业务按照一般月份套利交易有关规定执行。 本办法所称交割月份为实物交割期货合约的合约月份。

六、《大连商品交易所套期保值管理办法》 修改对照表

（注：阴影部分为新增内容。）

原条文	修改后条文
第二条 套期保值实行资格认定和额度管理制度。按照合约月份的不同，套期保值持仓额度分为一般月份套期保值持仓额度(自合约上市之日起至交割月份前一个月最后一个交易日)和交割月份套期保值持仓额度。	第二条 套期保值实行资格认定和额度管理制度。按照合约月份的不同，套期保值持仓额度分为一般月份套期保值持仓额度(自合约上市之日起至交割月份前一个月最后一个交易日)和交割月份套期保值持仓额度。 线型低密度聚乙烯、聚氯乙烯、聚丙烯月均价期货合约套期保值管理按照一般月份有关规定执行。 本办法所称交割月份为实物交割期货合约的合约月份。