

附件 3

大连商品交易所豆油期货业务细则

第一章 总则

第一条 为规范大连商品交易所（以下简称交易所）豆油期货合约交易行为，根据《大连商品交易所交易规则》和《大连商品交易所豆油期货合约》，制定本细则。

第二条 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、指定质量检验机构、指定期货保证金存管银行及期货市场其他参与者应当遵守本细则。

第三条 本细则未规定的，按照交易所相关业务规则的规定执行。

第二章 合约主要条款和相关参数

第四条 豆油期货合约交割标准品的质量标准详见附件 1《大连商品交易所豆油交割质量标准(F/DCE Y002-2020)》。

第五条 豆油期货合约采用实物交割。

第六条 豆油指定交割仓库分为基准交割仓库和非基准交割仓库(详见附件 2《大连商品交易所豆油指定交割仓库名录》)。

豆油指定交割仓库的升贴水可以采用固定升贴水或者动态升贴水。动态升贴水按照附件 3《大连商品交易所豆油动态升贴水标准》执行。固定升贴水或动态升贴水由交易所确定并公布。交易所可视情况对豆油指定交割仓库及升贴水进行调整。

第七条 豆油期货合约的合约月份为 1、3、5、7、8、9、11、12 月。

第八条 豆油期货合约的交易单位为 10 吨/手。

第九条 豆油期货合约的报价单位为元（人民币）/吨。

第十条 豆油期货合约的最小变动价位为 1 元/吨。

第十一条 豆油期货合约的交易指令每次最大下单数量为 1000 手。

第十二条 豆油期货合约的交易保证金标准、涨跌停板幅度和持仓限额，按照《大连商品交易所风险管理办法》相关规定执行。

第十三条 豆油期货合约的最后交易日为合约月份第 10 个交易日。

第十四条 豆油期货合约的最后交割日为最后交易日后第 3 个交易日。

第十五条 豆油期货合约的交易代码为 Y。

第三章 交割与结算

第一节 一般规定

第十六条 豆油期货合约适用期转现交割、滚动交割和一次性交割，具体流程见《大连商品交易所交易管理办法》《大连商品交易所交割管理办法》和《大连商品交易所结算管理办法》相关规定。

滚动交割和一次性交割只允许采用标准仓单交割。

第十七条 以标准仓单申请期转现的，交易双方除按照《大连商品交易所交易管理办法》规定提交期转现相关信息和材料外，还应当提交合法有效的能够接收或者开具增值税发票的资质证明。

参与滚动交割和一次性交割的，客户应当通过会员在交割日14:30前向交易所提交合法有效的能够接收或者开具增值税发票的资质证明。未在规定时间内提交的，视为不具备接收或者开具增值税发票的资质，并按照《大连商品交易所交割管理办法》相关规定处理。

第十八条 豆油标准仓单分为仓库标准仓单和厂库标准仓单。

第十九条 豆油交割开具增值税专用发票。

第二十条 豆油交割手续费、取样及检验费、仓储及损耗费（包括储存费、保管损耗）等费用由交易所另行规定并公布。

第二节 标准仓单交割

第二十一条 标准仓单生成、流通、注销等相关业务，本细则未规定的，适用《大连商品交易所标准仓单管理办法》相关规定。

第二十二条 会员办理交割预报时，应当按30元/吨向交易所交纳交割预报定金。

第二十三条 办理完交割预报的货主在发货前，应当将车船号、品种、数量、到货时间等通知指定交割仓库，指定交割仓库应当合理安排接收商品入库。

第二十四条 豆油收发重量以指定交割仓库检重为准，检重时汽运以地磅计量为准，火车运输以火车罐打尺计量为准，船运以储油罐打尺计量为准。

第二十五条 指定交割仓库按照交易所有关规定对入库的豆油进行检验。检验结果为合格的，指定交割仓库将有关检验报告报交易所。交易所或者交易所委托质量检验机构对入库商品进行核查，确认无误后方为入库商品检验合格。

第二十六条 指定交割仓库按照交易所有关规定对入库的豆油进行检验时，应当以一个油池、一个油罐、一个车槽为一个检验单位。

第二十七条 豆油标准仓单在每年的3、7、11月份最后1个交易日之前应当进行标准仓单注销。

第二十八条 对于有精炼能力的仓库，豆油仓库标准仓单注销后，货主提出精炼要求的，仓库有义务代为进行大豆原油的精炼，精炼产品、精炼损耗和精炼费用由仓库和货主协商确定。

对于有精炼能力的厂库，豆油厂库标准仓单注销后，如果货主提出精炼要求，厂库有义务向其提供符合要求的精炼豆油，精炼产品、精炼损耗和精炼费用由厂库和货主协商确定。在这

种情况下，发货时间和发货速度不需按交易所有关规定办理。厂库和货主应当进行书面确认并妥善保存，以备核查。

第二十九条 豆油从仓库出库时，持有《提货通知单》或者提货密码的货主应当在实际提货日3个自然日前与指定交割仓库联系有关出库事宜，并在标准仓单注销日后10个工作日内（含当日）到指定交割仓库提货。

第三十条 货主对仓库出库商品质量有异议的，首先与仓库协商解决。协商不成的，货主应当在标准仓单注销之日起10个工作日内且货物未出库的情况下，以书面形式向交易所提出复检申请。复检申请应当说明仓库名称和需要复检的商品储罐号、数量、质量指标等，留存联系方式，并加盖货主公章。未在规定时间内以规定方式提出申请的，视为货主对出库商品质量无异议。交易所委托指定质量检验机构进行复检，复检结果为解决争议的依据。复检费用由货主先行垫付。复检结果与交割质量标准相符的，由此产生的相关费用（检验费和差旅费等）和损失由货主负担；不相符的，由此产生的相关费用（检验费和差旅费等）和损失由仓库负担。

第三十一条 豆油从厂库出库时，货主应当在标准仓单注销日后（不含注销日）的4个自然日内（含当日）到厂库提货。厂库应当在标准仓单注销日后（不含注销日）的4个自然日内（含当日）开始发货。

豆油出库时，厂库应当在货主的监督下进行抽样，经双方确认后将样品封存，并将样品保留至发货日后的 30 个自然日。

货主对厂库出库商品质量有异议的，首先与厂库协商解决。协商不成的，货主应当在发货日起 10 个工作日内以书面形式向交易所提出复检申请。交易所委托指定质量检验机构对封存的样品进行复检，并以该样品检验结果作为解决争议的依据。本款未规定的，参照适用本细则第三十条有关规定。

第三十二条 厂库以不高于日发货速度向货主发货时，货主因运输能力等原因无法按时提货，货主应当向厂库支付滞纳金。滞纳金按照如下方法确定：

（一）从开始提货之日（含当日）起，每日按照截至当日应提而未提的商品数量乘以相应的滞纳金标准计算出当日滞纳金金额；

（二）直至完成提货之日（不含当日），在加总每日滞纳金金额的基础上，计算出货主应当向厂库支付的滞纳金总额。

滞纳金标准为 2 元/吨·天。

第三十三条 在提货期限届满之日后（不含当日）且在标准仓单注销日后（不含注销日）的 19 个自然日内（含当日）到厂库提货的，货主应当向厂库支付滞纳金，厂库仍应按照期货标准承担有关的商品质量、发货时间和发货速度的责任，直至发完全部期货商品。

滞纳金按照如下方法确定：

(一) 从提货期限届满之日(含当日)起, 每日按照截至当日应提而未提的商品数量乘以相应的滞纳金标准计算出当日滞纳金金额;

(二) 直至完成提货之日(不含当日), 在加总每日滞纳金金额的基础上, 计算出货主应当向厂库支付的滞纳金总额。

滞纳金标准为 2 元/吨·天。

第三十四条 在标准仓单注销日后(不含注销日)的 19 个自然日后(不含当日)到厂库提货的, 货主应当以下述公式的计算方法向厂库支付滞纳金, 同时厂库将不再按照期货标准承担有关的商品质量、发货时间和发货速度的责任。

滞纳金金额=2 元/吨·天×全部的商品数量×19 天

第三十五条 厂库未按规定日发货速度发货, 但按时完成了所有商品的发货, 厂库应当向货主支付赔偿金。

赔偿金金额=该商品最近已交割月份一次性交割结算价×按日出库速度应发而未发的商品数量×5%

第三十六条 厂库未按时完成所有商品的发货, 在按本细则第三十五条规定进行赔偿的基础上, 同时还应当向货主支付赔偿金, 赔偿金金额=该商品最近已交割月份一次性交割结算价×按商品总量应发而未发的商品数量×5%; 并按照以下程序进行处理:

(一) 交易所向货主提供其它厂库或其它地点的相同质量和数量的现货商品，并承担调整交货地点和延期发货产生的全部费用。

(二) 交易所无法提供上述商品时，向货主退还货款并支付赔偿金。

退还货款和赔偿金的金额=该商品最近已交割月份一次性交割结算价×按商品总量应发而未发的商品数量×120%

第三十七条 当厂库发生本细则第三十五条、第三十六条中的违约行为时，首先由厂库向货主支付赔偿金。厂库未支付的或者支付数额不足的，交易所按照《大连商品交易所标准仓单管理办法》相关规定处理。

第四章 附则

第三十八条 违反本细则规定的，交易所按照《大连商品交易所违规处理办法》和其他业务规则的有关规定处理。

第三十九条 本细则解释权属于大连商品交易所。

第四十条 本细则自 2019 年 7 月 1 日起实施。

附件:1.大连商品交易所豆油交割质量标准(F/DCE Y002-2020) (略)

2.大连商品交易所豆油指定交割仓库名录 (略)

3.大连商品交易所豆油动态升贴水标准 (略)