大连商品交易所结算细则

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）的期货结算行为，保护交易当事人的合法权益和社会公众利益，防范和化解期货市场风险，根据《大连商品交易所交易规则》，制定本细则。

　　第二条 结算是指根据交易结果和交易所有关规定对会员交易保证金、盈亏、手续费、交割货款及其它有关款项进行计算、划拨的业务活动。

　　第三条 交易所结算实行保证金制度、当日无负债结算制度和风险准备金制度等。

　　第四条 交易所实行全员结算制度，交易所只对会员进行结算，期货公司会员对客户进行结算。

　　第五条 本细则适用于交易所内的一切结算活动，交易所及其工作人员、交易所会员及其工作人员、客户和交易所指定期货保证金存管银行（以下简称存管银行）必须遵守本细则。

　　第二章 结算机构及其职责

　　第六条 交易所负责期货交易的统一结算、保证金管理、风险准备金管理及结算风险的防范。

　　第七条 交易所结算业务的主要职责：

　　（一）编制会员的结算账表；

　　（二）办理资金往来汇划业务；

　　（三）统计、登记和报告交易结算情况；

　　（四）处理会员交易中的账款纠纷；

　　（五）办理交割结算业务；

　　（六）控制结算风险，保证期货合约的履行；

　　（七）按规定管理保证金、风险准备金。

　　第八条 所有在交易所交易系统中成交的合约必须通过交易所进行统一结算。

　　第九条 交易所依据交易所规则对会员的结算资料、财务报表及相关的凭证和账册进行检查时，会员应当予以配合。

　　第十条 会员必须设立结算部门。期货公司会员结算部门负责会员与交易所、会员与客户之间的结算工作；非期货公司会员结算部门负责会员与交易所之间的结算工作。

　　结算部门应妥善保管结算资料、财务报表及相关凭证、账册，以备查询和核实。

　　第十一条 交易所应保证结算资料、财务报表及相关凭证、账册的完整与安全，保存期限应不少于20年。

　　第十二条 结算交割员是经会员单位授权，代表会员办理结算和交割业务的人员。每一会员须指派两名以上(含两名)结算交割员。

　　结算交割员应符合中国证券监督管理委员会(以下简称中国证监会)关于期货从业人员资格的有关规定,经交易所培训合格,取得《大连商品交易所结算交割员培训合格证书》,并经所属会员的法人授权后取得《大连商品交易所结算交割员证》(以下简称《结算交割员证》)。

　　第十三条 结算交割员的业务职责：

　　（一）办理会员出入金业务；

　　（二）获取交易所提供的结算数据，并及时进行核对；

　　（三）办理有价证券的充抵保证金手续；

　　（四）办理实物交割手续；

　　（五）办理其它结算、交割业务。

　　第十四条 结算交割员在交易所办理结算与交割业务时，必须出示《结算交割员证》，否则交易所有权不予办理。

　　第十五条 《结算交割员证》仅限本人使用，不得伪造、涂改、借用，会员在其结算交割员发生变动时，应及时到交易所办理相关手续。

　　第十六条 会员应加强对结算交割员的管理，严格操作规范，特别要防止因密码被盗造成泄密。

　　第十七条 存管银行是指交易所指定的，协助交易所办理期货交易结算业务的银行。

　　交易所有权对存管银行的期货结算业务进行监督。

　　第十八条 存管银行须符合以下条件：

　　（一）是全国性的商业银行，资金雄厚，信誉良好；

　　（二）在全国各主要城市设有分支机构和营业网点；

　　（三）有先进、快速的异地资金划拨手段；

　　（四）有完善的保证金管理制度；

　　（五）有懂得期货知识、风险防范意识强的专业技术人员；

　　（六）交易所认为必须具备的其他条件。

　　符合以上条件，并经交易所同意成为存管银行后，存管银行与交易所应签订相应协议，明确双方的权利和义务，以规范相关业务行为。

　　第十九条 存管银行的权利：

　　（一）开设交易所专用结算账户和会员专用资金账户；

　　（二）吸收交易所和会员的存款；

　　（三）了解会员在交易所的资信情况。

　　第二十条 存管银行的义务：

　　（一）向交易所提供会员专用资金账户的资金情况；

　　（二）根据交易所提供的票据或指令优先划转会员的资金，并及时将资金划转结果和相关账户变动信息反馈给交易所；

　　（三）协助交易所核查会员资金的来源和去向；

　　（四）向交易所及时通报本所标准仓单的质押情况及会员在资金结算方面的不良行为和风险；

　　（五）在交易所出现重大风险时，必须协助交易所化解风险；

　　（六）根据中国证监会或交易所的要求，对会员专用资金账户中的资金实行必要的监管措施；

　　（七）保守交易所和会员的商业秘密；

　　（八）接受交易所对其期货业务进行监督。

　　第二十一条 交易所在各存管银行开设专用结算账户,用于存放会员保证金及相关款项。

　　第二十二条 会员须在存管银行开设专用资金账户，用于存放保证金及相关款项。

　　第二十三条 会员应在其专用资金账户开户及变更前到结算部申请，经交易所同意，方可办理。

　　第二十四条 交易所与会员之间期货业务资金的往来结算通过交易所专用结算账户和会员专用资金账户办理。

　　第二十五条 交易所对会员存入交易所专用结算账户的保证金实行分账管理，为每一会员设立明细账户，按日序时登记核算每一会员出入金、盈亏、交易保证金、手续费等。

　　第二十六条 期货公司会员对客户存入会员专用资金账户的保证金实行分账管理，为每一客户设立明细账户，按日序时登记核算每一客户出入金、盈亏、交易保证金、手续费等。

　　第二十七条 会员在开设专用资金账户时,须向交易所提交《印鉴授权书》等相关资料。

　　第二十八条 《印鉴授权书》中被授权的公章、财务章、法定代表人章或其授权人章为会员的有效印鉴，会员应对使用以上印鉴所产生的一切后果承担责任。

　　第二十九条 会员更名或转让必须向交易所重新提交《印鉴授权书》，并办理相关专用资金账户的变更手续。

　　第三十条 交易所有权在不通知会员的情况下通过存管银行从会员的专用资金账户中收取各项应收款项,并且有权随时查询该账户的资金情况。

　　第三章 日常结算

　　第三十一条 交易所实行保证金制度。会员应按规定向交易所交纳一定的资金，用于结算和保证履约。

　　保证金分为结算准备金和交易保证金。

　　经交易所同意，会员可用标准仓单、可流通的国债和中国证监会认定的其他有价证券充抵保证金。

　　第三十二条 结算准备金是指会员为了交易结算在交易所专用结算账户中预先准备的资金，是未被合约占用的保证金。结算准备金的最低余额由交易所决定。

　　第三十三条　期货公司会员结算准备金最低余额为200万元，以期货公司会员自有资金足额缴纳；非期货公司会员结算准备金最低余额为50万元。会员必须在下一个交易日开市前补足至结算准备金最低余额。未补足的，若结算准备金余额大于零而低于结算准备金最低余额，禁止开新仓；若结算准备金余额小于零，则交易所将按有关规定对该会员强行平仓。

　　第三十四条 交易所根据会员当日结算准备金余额中的货币资金部分，以不低于中国人民银行公布的同期银行活期存款利率计算利息，交易所对具体执行利率进行公示并在每年的3 月、6月、9月和12月下旬将利息支付给会员。

　　第三十五条 交易保证金是指会员在交易所专用结算账户中确保合约履行的资金，是已被合约占用的保证金。当买卖双方成交后,交易所按持仓合约价值的一定比率收取交易保证金。

　　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，鸡蛋品种除外。

　　第三十六条 各品种合约的交易保证金收取标准按交易所保证金制度有关规定执行。

　　第三十七条 期货公司会员代理客户交易，向客户收取的保证金属于客户所有，必须存放于会员专用资金账户，以备随时交付保证金及有关费用。

　　期货公司会员除按照中国证监会的规定为客户向交易所交存保证金、进行交易结算外，严禁将保证金挪作他用。

　　第三十八条 期货公司会员向客户收取的交易保证金不得低于交易所向会员收取的交易保证金。

　　第三十九条 交易所根据会员当日成交合约数量或者成交合约金额收取交易手续费，收取标准由交易所另行规定。

　　第四十条 交易所实行当日无负债结算制度。

　　当日无负债结算制度是指每日交易结束后，交易所按当日结算价结算所有合约的盈亏、交易保证金及手续费等费用，对应收应付的款项实行净额一次划转，相应增加或减少会员的结算准备金。

　　第四十一条 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：

　　(一)若合约当日有买、卖双方委托报价的，以最高买报价、最低卖报价与该合约上一交易日的结算价三者居中的一个价格作为合约的当日结算价；

　　(二)若合约出现涨（跌）停板单边无连续报价的，以该停板价格作为合约的当日结算价；

　　(三)若合约当日无委托报价，或者有买或卖单方委托报价但未出现涨(跌)停板单边无连续报价的，以当日距无成交合约最近的前一有成交合约作为基准合约计算当日无成交合约结算价：

　　1.若基准合约当日结算价的涨跌幅度（%）小于等于当日无成交合约当日的涨跌停板，则当日无成交合约结算价＝该合约上一交易日的结算价×（1±基准合约结算价的涨跌幅度）。

　　2.若基准合约当日结算价的涨跌幅度（%）大于当日无成交合约当日的涨跌停板，则当日无成交合约结算价＝该合约上一交易日的结算价×（1±该合约的当日涨跌停板幅度）。

　　3.若无法找到基准合约，则当日无成交合约结算价＝上一交易日该合约的结算价；新合约上市第一日若无法找到基准合约，则当日无成交合约结算价=挂盘基准价。

　　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。。

　　第四十二条 期货合约均以当日结算价作为计算当日盈亏的依据。具体计算公式如下：

　　当日盈亏 = 平仓盈亏 + 持仓盈亏

　　平仓盈亏 = 平历史仓盈亏 + 平当日仓盈亏

　　平历史仓盈亏 = Σ [( 卖出平仓价－上一交易日结算价 ) ×卖出平仓量]+ Σ [( 上一交易日结算价－买入平仓价 ) ×买入平仓量]

　　平当日仓盈亏 = Σ [( 当日卖出平仓价－当日买入开仓价 ) ×卖出平仓量]+ Σ [( 当日卖出开仓价－当日买入平仓价 ) ×买入平仓量]

　　持仓盈亏 = 历史持仓盈亏 + 当日开仓持仓盈亏

　　历史持仓盈亏 = Σ [( 上一日结算价－当日结算价 ) ×卖出历史持仓量]+ Σ [( 当日结算价－上一日结算价 ) ×买入历史持仓量]

　　当日开仓持仓盈亏 = Σ [( 卖出开仓价－当日结算价 ) ×卖出开仓量]+ Σ [( 当日结算价－买入开仓价 ) ×买入开仓量]

　　第四十三条 当日结算时的交易保证金超过昨日结算时的交易保证金部分从会员结算准备金中扣划，当日结算时的交易保证金低于昨日结算时的交易保证金部分划入会员结算准备金。当日盈利划入会员结算准备金，当日亏损从会员结算准备金中扣划。

　　手续费等各项费用从会员结算准备金中扣划。

　　第四十四条 结算准备金余额的具体计算公式如下：

　　当日结算准备金余额=上一交易日结算准备金余额+上一交易日交易保证金－当日交易保证金+当日实际可用充抵金额-上一交易日实际可用充抵金额+当日盈亏+入金－出金－手续费等

　　实际可用充抵金额的具体计算方法见本细则第五章的有关规定。

　　第四十五条 结算完毕后，会员的结算准备金低于最低余额时，该结算结果即视为交易所向会员发出的追加保证金通知。

　　第四十六条 交易所本着准确、快捷的原则为会员办理出入金业务。正常情况下，会员在每个交易日闭市之前提出的书面、电子等方式入金申请,交易所将于当日闭市前完成会员入金业务，会员在每个交易日闭市之后提出的书面入金申请,交易所将于下一交易日开市前完成会员入金业务；会员应在每个交易日15:10之前提出书面、电子等方式出金申请,经交易所审核后,于当日15:10后集中办理会员出金划转。特殊情况下，交易所办理出入金业务时间顺延。

　　夜盘交易小节，交易所不受理出金申请、不办理出金业务。

　　第四十七条 会员出金必须符合交易所规定。会员的出金标准为：

　　（一）当实际可用充抵金额大于等于交易保证金的80%时

　　可出金额=货币资金-交易保证金×20%-结算准备金最低余额

　　（二）当实际可用充抵金额小于交易保证金的80%时

　　可出金额=货币资金-（交易保证金-实际可用充抵金额）-结算准备金最低余额

　　交易所可根据市场风险状况对会员出金标准做适当调整。

　　第四十八条 有下列情况之一的会员和客户，交易所可限制会员出金：

　　（一）涉嫌重大违规，经交易所立案调查的；

　　（二）因投诉、举报、交易纠纷等被司法部门、交易所或其他有关部门正式立案调查，且正处在调查期间；

　　（三）交易所认为必要的其他情况。

　　第四十九条 当日交易结束后，交易所对每一会员的盈亏、交易手续费、交易保证金等款项进行结算。交易所采用发放结算单据或电子传输等方式向会员提供当日结算数据，包括：《大连商品交易所会员当日成交合约表》、《大连商品交易所会员当日平仓盈亏表》、《大连商品交易所会员当日持仓表》和《大连商品交易所会员资金结算表》等。

　　第五十条 遇特殊情况造成交易所不能按时提供结算数据，交易所将另行通知提供结算数据的时间。

　　第五十一条 会员每日应及时地取得交易所提供的结算数据，做好核对工作，并将之妥善保存，该数据至少保存20年，但对有关期货交易有争议的，应当保存至该争议消除时为止。

　　第五十二条 会员如对结算数据有异议,应不迟于下一交易日开市前三十分钟以书面形式通知交易所。遇特殊情况，会员可在下一交易日开市后二小时内以书面形式通知交易所。如在规定时间内会员没有对结算数据提出异议,则视作会员已认可结算数据的正确性。

　　第五十三条 交易所将在每月的第一个交易日向会员提供上月的《大连商品交易所资金结算核对单(代收据)》(加盖结算专用章),作为会员核查交易账簿记录的依据。

　　第五十四条 发生下列情形之一的，经交易所批准，可进行移仓：

　　（一）期货公司会员发生合并、分立、破产；

　　（二）期货公司会员因故不能从事期货经纪业务；

　　（三）交易所认可的其他移仓情况。

   发生（一）、（二）项规定的情形，期货公司会员应当按照国家法律、法规和其他规定予以公告，并将有关公告提交交易所。

　　期货公司会员发生合并时，由期货公司会员提出移仓申请，申请材料中应当包括移入和移出仓位、期货公司会员同意移仓的申请书以及客户持仓的详细清单。发生其他情形时，由期货公司会员和客户共同提出移仓申请，申请材料中应当包括移入和移出仓位、期货公司会员同意移仓的申请书、客户同意移仓的申请书以及客户持仓的详细清单。

　　第五十五条 移仓申请经批准后,交易所将与期货公司会员约定一周内的某一交易日为客户移仓结算日。

　　第五十六条 交易所将在约定日期的当日结算完成后，为期货公司会员实施客户移仓,并提供客户移仓前和移仓后的持仓清单由期货公司会员确认。

　　第五十七条 移仓内容仅包括客户的持仓及相应的交易保证金,不包括当日的盈亏、交易手续费、结算准备金等其他款项。

　　第五十八条 期货公司会员应仔细核对移仓前后客户的移仓情况,一经确认,不得更改。

　　第五十九条 会员当日结算准备金余额低于零或者持有有价证券充抵保证金的，不得办理移仓。

　　第四章 实物交割结算

　　第六十条 会员进行实物交割,应按规定向交易所交纳交割手续费。具体标准在交割细则中载明。

　　交割手续费从会员的结算准备金中扣划。

　　第六十一条 交割结算价根据不同交割方式确定。滚动交割的交割结算价采用该期货合约滚动交割配对日的当日结算价；一次性交割的交割结算价采用该期货合约自交割月第一个交易日起至最后交易日所有成交价格的加权平均价。期转现结算价采用买卖双方协议价格。提货单交割的交割结算价采用该期货合约提货单交割配对日的当日结算价。

　　第六十二条 交割款项按交割结算价结算。

　　第六十三条 在交割期内，买方会员未能如数解付货款，卖方会员未能如数交付标准仓单或提货单的，构成交割违约。

　　第六十四条 交割增值税专用（普通）发票由交割的卖方客户向相对应的买方客户开具，客户开具的增值税专用（普通）发票由双方会员转交、领取并协助核实，交易所根据双方会员确认结果结清相应的余款。

　　鸡蛋品种开具增值税普通发票。

　　第六十五条 卖方会员未在规定时间提交增值税专用（普通）发票的，自应交而未交增值税专用（普通）发票次日起，交易所向卖方会员按货款金额每日0.5‰的比例收取滞纳金，补偿给买方会员；超过30个自然日，卖方会员仍未提交增值税专用（普通）发票的，视作不交增值税专用（普通）发票，交易所按国家税收政策规定计算的增值税税额收取赔偿金，与滞纳金一并补偿给买方会员。上述款项从该会员在交易所预留的交割货款金额中扣除，剩余货款属于卖方会员。买卖双方另有约定的，遵其约定。

　　第六十六条 一次性交割的结算业务按以下规定办理：

   (一) 最后交易日闭市后，买方会员交割月份买持仓的交易保证金转为交割预付款，卖方会员交割月份卖持仓的交易保证金转为交割保证金；鸡蛋以外的品种，卖方会员将标准仓单交到交易所后，交易所清退卖方会员交割保证金；鸡蛋品种，标准仓单交到交易所后，不清退卖方会员交割保证金；

   (二)最后交易日结算时，交易所对会员该交割月份持仓按交割结算价进行结算处理，产生的盈亏计入当日平仓盈亏；

   (三)最后交易日结算时，交易所从会员的结算准备金中扣划交割手续费；

   (四)最后交易日后第1个交易日闭市前，卖方会员应当将与其交割月份卖持仓相对应的全部标准仓单交到交易所；

   (五)最后交割日闭市前，买方会员应当将与其交割月份买持仓相对应的货款与交割预付款的差额部分划入交易所的专用结算账户；

　　(六)在规定时间内，卖方会员未能如数交付标准仓单，买方会员未能如数解付货款的，构成交割违约；

　　(七)最后交割日闭市后，交易所将卖方会员提交的标准仓单交付给买方会员。对于鸡蛋以外的品种，交易所将货款的80%付给卖方会员，余款在卖方会员提交了增值税专用发票后结清。对于鸡蛋品种，买方客户对鸡蛋质量无异议的，在最后交割日后第4个交易日闭市后，交易所清退卖方会员交割保证金，将货款的80％付给卖方会员，余款在卖方会员提交了增值税普通发票后结清；若买方客户对鸡蛋质量有异议或发生疫情的，按照《大连商品交易所交割细则》相关规定处理。

   (八)配对日后1个交易日内，买方会员应按税务机关的规定将开具增值税专用（普通）发票的具体事项，包括购货单位名称、购货单位地址、纳税人登记号、金额等信息通知卖方会员；

　　(九)鸡蛋以外的品种，配对日后7个交易日内，卖方会员应当将提交增值税专用发票交付买方会员；鸡蛋品种，交易所支付80%货款后7个交易日内，卖方会员应当将实际交割货物相应的增值税普通发票交付买方会员。

　　第六十七条 滚动交割的结算业务按以下规定办理。

　　(一) 配对日闭市后，买方会员配对买持仓的交易保证金转为交割预付款；

　　(二) 配对日结算时，交易所对会员该交割月份持仓按交割结算价进行结算处理，产生的盈亏计入当日平仓盈亏；

　　(三)配对日结算时，交易所从会员的结算准备金中扣划交割手续费；

　　(四)交收日闭市前，买方会员须将与其交割买持仓相对应的货款与交割预付款的差额部分划入交易所的专用结算账户；

　　(五)交收日闭市时，买方会员未能如数解付货款的，构成交割违约；

　　(六)交收日闭市后，交易所将卖方会员提交的标准仓单交付买方会员，将货款的80%付给卖方会员，余款在卖方会员提交了增值税专用发票后结清；

　　(七)配对日后1个交易日内，买方会员应按税务机关的规定将开具增值税专用发票的具体事项，如购货单位名称、购货单位地址、纳税人登记号、金额等信息通知卖方会员；

　　(八)配对日后7个交易日内，卖方会员向买方会员提交增值税专用发票。

　　第六十八条 期转现的结算业务按以下规定办理。

　　(一)标准仓单期转现的仓单交收和货款支付由交易所负责办理；

　　(二)非标准仓单期转现的货物交收和货款支付由交易双方自行协商确定，交易所对此不承担保证责任；

　　(三)期转现批准日结算时，交易所将交易双方的期转现持仓按协议价格进行结算处理，产生的盈亏计入当日平仓盈亏；

　　(四)期转现批准日结算时，交易所从会员结算准备金中扣划期转现手续费，

　　标准仓单的期转现手续费按该品种交割手续费标准收取，非标准仓单的期转现手续费按该品种交易手续费标准收取；

　　(五)标准仓单期转现批准日11:30前，买方会员将全额货款划入交易所的专用结算账户，卖方会员将相应数量的标准仓单交到交易所。

　　(六)标准仓单期转现批准日闭市后，交易所将卖方会员提交的标准仓单交付买方会员，将货款的80%付给卖方会员，余款在卖方会员提交了增值税专用发票后结清；

　　(七)标准仓单期转现批准日后7个交易日内，卖方会员应向买方会员提交增值税专用发票。

　　第六十九条 提货单交割的结算业务按以下规定办理。

　　(一) 配对日闭市后，买方会员配对买持仓的交易保证金转为交割预付款；卖方会员配对卖持仓的交易保证金转为交割保证金；

　　(二) 配对日结算时，交易所对会员申请交割的持仓按交割结算价进行结算处理，产生的盈亏计入当日平仓盈亏；

　　(三) 配对日结算时，交易所从会员的结算准备金中扣划交割手续费；

　　(四) 通知日后第3个自然日（第3个自然日不是交易日的，顺延至下一个交易日）闭市前，买方会员的交割预付款和卖方会员的交割保证金应按配对合约价值20%补足。闭市后，交易所从相应会员的结算准备金中划转。

　　最后通知日后第3个自然日（第3个自然日不是交易日的，顺延至下一个交易日）闭市前，参与提货单交割的所有买方会员的交割预付款和所有卖方会员的交割保证金应按配对合约价值20%补足。闭市后，交易所从相应会员的结算准备金中划转。

　　(五) 交收日闭市前，买方会员须将交割买持仓相对应的货款（包括溢短款和升贴水）与交割预付款的差额部分划入交易所的专用结算账户；

　　(六) 交收日闭市后，交易所释放卖方会员交割保证金，并将全额货款的80%划转给卖方会员，余款在卖方会员提交了增值税专用发票后结清；

　　(七) 交收日，买方会员应按税务机关的规定将开具增值税专用发票的具体事项，如购货单位名称、购货单位地址、纳税人登记号、金额等信息通知卖方会员；

　　(八) 交收日后7个交易日内，卖方会员向买方会员提交增值税专用发票。

　　第五章 有价证券充抵保证金

　　第七十条 经交易所批准，以下有价证券可以充抵保证金：

　　(一) 除鸡蛋品种外的标准仓单；

　　(二) 可流通的国债；

　　(三) 中国证监会认定的其他有价证券。

　　以前款规定的有价证券充抵保证金的，充抵的期限不得超过该有价证券的有效期限，并且每次充抵保证金的金额不得低于10万元。

　　第七十一条 标准仓单充抵保证金的，交易所以充抵日前一交易日该标准仓单对应品种最近交割月份期货合约的结算价为基准计算价值。

　　国债充抵保证金的，交易所以充抵日前一交易日该国债在上海证券交易所、深圳证券交易所较低的收盘价为基准计算价值。

　　当充抵保证金的有价证券的市值涨跌幅度超过10%（含本数）时，交易所可以对该笔有价证券基准价值作相应调整。

　　第七十二条 有价证券充抵保证金的金额不得高于以下标准中的较低值：

　　(一) 有价证券基准计算价值的80％；

　　(二) 会员在期货交易所专用结算账户中的实有货币资金的4倍。

　　交易所在每日结算时根据以上原则自动调整会员有价证券的充抵金额。

　　第七十三条 期货交易的相关亏损、费用、货款和税金等款项，应当以货币资金支付，不得以有价证券充抵的金额支付。

　　第七十四条 客户以有价证券充抵保证金的，会员应当将收到的有价证券提交交易所。

　　第七十五条 有价证券的充抵手续：

　　（一）申请：

　　会员办理有价证券充抵业务时，须向交易所提出申请，经办人须提交单位法定代表人签发的《有价证券充抵专项授权书》。会员以客户的有价证券办理充抵业务时，应同时提交经客户签章的《客户专项授权书》。

　　（二）验证交存：

　　 办理标准仓单充抵的会员须在充抵申请获交易所批准后办理标准仓单交存手续；其他有价证券的验证交存由交易所另行规定。

　　（三）签订协议：

　　核算有价证券充抵金额后，会员与交易所签定《大连商品交易所有价证券充抵交易保证金协议书》。

　　（四）会员也可以通过电子方式办理充抵业务。

　　第七十六条 有价证券每次充抵最长期限为6个月。期满再次充抵的，应当重新办理手续。

　　第七十七条 出现下列情况之一的，交易所可以终止充抵协议并取消充抵额度：

　　（一）办理充抵的会员提取和运用资金出现较大风险并有可能危及交易所合法权益的；

　　（二）由于其他原因需要停止充抵的。

　　第七十八条 协议期内，会员可申请提前解除充抵，但应当在弥补应交保证金之后，方可解除充抵协议，取回充抵的有价证券。

　　第七十九条 协议期满，有价证券所充抵的保证金已被清偿时，会员方可终止充抵协议，取回充抵的有价证券。

　　充抵期满，当会员以有价证券充抵的保证金不能清偿时，交易所有权按本细则和充抵协议的有关规定依法将充抵的有价证券兑现或变现，用于清偿其充抵的保证金和相关债务。清偿后有余额的，将余额部分退还会员；兑现或变现金额不足以清偿其充抵的保证金和相关债务的，交易所有权向会员追索。

　　第八十条 办理有价证券充抵保证金的，会员应当交纳充抵手续费，同时承担该有价证券在充抵期内发生的其他费用，如标准仓单对应的仓储费，以及需兑现或变现时发生的费用。充抵手续费标准由交易所确定。

　　第八十一条 当会员不履行或不能完全履行交易保证金债务时，交易所有权将该有价证券变现，从所得的款项中优先受偿交易保证金债务和相关交易债务。

　　第八十二条 夜盘交易小节，交易所不受理有价证券充抵和解除充抵的业务申请、不办理相关业务。

　　第六章 风险与责任

　　第八十三条 会员对其在交易所成交的合约负有承担风险的责任。

　　第八十四条 风险防范实行两级负责制。交易所防范会员的风险，会员防范客户的风险。

　　第八十五条 会员不能履行合约责任时，交易所有权对其采取下列保障措施：

　　（一） 动用会员的结算准备金；

　　（二） 暂停开仓交易；

　　（三） 按规定强行平仓，直至用平仓后释放的保证金能够履约为止；

　　（四） 将充抵的有价证券变现，用变现所得履约赔偿。

　　第八十六条 如采取前条措施后会员仍欠资金，交易所将按以下步骤履约赔偿：

　　（一）取消该会员资格，用该会员的会员资格费抵偿；

　　（二）动用风险准备金进行履约赔偿；

　　（三）动用交易所的自有资产进行履约赔偿;

　　（四）通过法律程序,继续对该会员追偿。

　　第八十七条 交易所实行风险准备金制度。风险准备金是指由交易所设立，用于为维护期货市场正常运转提供财务担保和弥补因交易所不可预见风险带来的亏损的资金。

　　第八十八条 风险准备金的来源：

　　（一）交易所按向会员收取手续费收入20%的比例，从管理费用中提取；

　　（二）符合国家财政政策规定的其他收入。

　　第八十九条 风险准备金必须按规定存储、管理。

　　第九十条 风险准备金的动用必须按规定的程序进行，按规定的用途使用，并报中国证监会备案。

　　第七章 附则

　　第九十一条 本细则中所称时间均为北京时间，除本细则有明确的规定外，“日”均指交易日。

　　第九十二条 违反本细则规定的，交易所按《大连商品交易所违规处理办法》的有关规定处理。

　　第九十三条 本细则解释权属于大连商品交易所。

　　第九十四条 本细则自公布之日起实施。