

第三节 大连商品交易所风险管理办法

第一章 总则

第一条 为了加强期货交易风险管理,维护期货交易各方的合法权益,保证大连商品交易所(以下简称交易所)期货交易正常的进行,根据《大连商品交易所交易规则》,制定本办法。

第二条 交易所风险管理实行保证金制度、涨跌停板制度、限仓制度、大户报告制度、强行平仓制度和风险警示制度。

第三条 交易所、会员、客户必须遵守本办法。

第二章 保证金制度

第四条 交易所实行保证金制度。黄大豆1号、黄大豆2号、豆粕、豆油、棕榈油、玉米、线型低密度聚乙烯、聚氯乙烯期货合约的最低交易保证金为合约价值的5%。

新开仓交易保证金按前一交易日结算时交易保证金收取。

交易所可以根据市场情况调整各合约交易保证金标准。

第五条 自黄大豆1号、黄大豆2号、豆粕、豆油、棕榈油、玉米、线型低密度聚乙烯、聚氯乙烯合约进入交割月份前一个月第一个交易日起,交易所将分时间段逐步提高该合约的交易保证金。合约在某一交易时间段的交易保证金标准自该交易时间段起始日前一交易日结算时起执行。

黄大豆1号、黄大豆2号、豆粕、豆油、棕榈油、玉米、线型低密度聚乙烯、聚氯乙烯合约临近交割期时交易保证金收取标准为:

交易时间段	交易保证金(元/手)
交割月份前一个月第一个交易日	合约价值的10%
交割月份前一个月第六个交易日	合约价值的15%
交割月份前一个月第十个交易日	合约价值的20%
交割月份前一个月第十六个交易日	合约价值的25%
交割月份第一个交易日	合约价值的30%

第六条 随着合约持仓量的增大，交易所将逐步提高该合约交易保证金比例。

黄大豆1号、豆粕、聚氯乙烯合约持仓量变化时交易保证金收取标准为：

合约月份双边持仓总量 (N)	交易保证金 (元/手)
$N \leq 100$ 万手	合约价值的 5%
$100 \text{ 万手} < N \leq 150$ 万手	合约价值的 8%
$150 \text{ 万手} < N \leq 200$ 万手	合约价值的 9%
$200 \text{ 万手} < N$	合约价值的 10%

黄大豆2号、豆油合约持仓量变化时交易保证金收取标准为：

合约月份双边持仓总量 (N)	交易保证金 (元/手)
$N \leq 50$ 万手	合约价值的 5%
$50 \text{ 万手} < N \leq 60$ 万手	合约价值的 8%
$60 \text{ 万手} < N \leq 70$ 万手	合约价值的 9%
$70 \text{ 万手} < N$	合约价值的 10%

玉米合约持仓量变化时交易保证金收取标准为：

合约月份双边持仓总量 (N)	交易保证金 (元/手)
$N \leq 150$ 万手	合约价值的 5%
$150 \text{ 万手} < N \leq 200$ 万手	合约价值的 8%
$200 \text{ 万手} < N \leq 250$ 万手	合约价值的 9%
$250 \text{ 万手} < N$	合约价值的 10%

棕榈油、线型低密度聚乙烯合约持仓量变化时交易保证金收取标准为：

合约月份双边持仓总量 (N)	交易保证金 (元/手)
$N \leq 25$ 万手	合约价值的 5%
$25 \text{ 万手} < N \leq 30$ 万手	合约价值的 8%
$30 \text{ 万手} < N \leq 35$ 万手	合约价值的 9%
$35 \text{ 万手} < N$	合约价值的 10%

第七条 当某期货合约出现涨跌停板的情况，则该期货合约的交易保证金按本办法第三章的有关规定执行。

第八条 当某期货合约连续三个交易日按结算价计算的涨（跌）幅之和达到合约规定的最大涨跌幅的 2 倍，连续四个交易日按结算价计算的涨（跌）幅之和达到合约规定的最大涨跌幅的 2.5 倍，连续五个交易日按结算价计算的涨（跌）幅之和达到合约规定的最大涨跌幅的 3 倍时，交易所所有权根据市场情况，采取单

边或双边、同比例或不同比例、部分会员或全部会员提高交易保证金的措施。提高交易保证金的幅度不高于合约规定交易保证金的 1 倍。

交易所采取上述措施须事先报告中国证监会。

第九条 如遇法定节假日休市时间较长，交易所可以根据市场情况在休市前调整合约交易保证金标准和涨跌停板幅度。

第十条 对同时满足本办法有关调整交易保证金规定的合约，其交易保证金按照规定交易保证金数值中的较大值收取。

第三章 涨跌停板制度

第十一条 交易所实行价格涨跌停板制度，由交易所制定各期货合约的每日最大价格波动幅度。交易所可以根据市场情况调整各合约涨跌停板幅度。

第十二条 黄大豆 1 号、黄大豆 2 号、豆粕、豆油、棕榈油、玉米、线型低密度聚乙烯、聚氯乙烯合约交割月份以前的月份涨跌停板幅度为上一交易日结算价的 4%，交割月份的涨跌停板幅度为上一交易日结算价的 6%。

新上市期货合约的涨跌停板幅度为合约规定涨跌停板幅度的两倍，如合约有成交则于下一交易日恢复到合约规定的涨跌停板幅度；如合约无成交，则下一交易日继续执行前一交易日涨跌停板幅度。

第十三条 当某期货合约以涨跌停板价格申报时，成交撮合原则实行平仓优先和时间优先的原则。

第十四条 涨(跌)停板单边无连续报价是指某一期货合约在某一交易日收市前 5 分钟内出现只有停板价位的买入(卖出)申报、没有停板价位的卖出(买入)申报, 或者一有卖出(买入)申报就成交、但未打开停板价位的情况。

第十五条 当黄大豆 1 号、黄大豆 2 号、豆粕、豆油、棕榈油、玉米、线型低密度聚乙烯、聚氯乙烯合约在某一交易日(该交易日记为第 N 个交易日)出现涨跌停板单边无连续报价的情况，则当日结算时，该期货合约的交易保证金按合约价值的 6%收取(原交易保证金比例高于 6%的，按原比例收取)，第 N+1 个交易日黄大豆 1 号、黄大豆 2 号、豆粕、豆油、棕榈油、玉米、线型低密度聚乙烯、聚氯乙烯合约的涨跌停板幅度为 4%(原涨跌停板比例高于 4%的，按原比例执行)。

第十六条 若第 N+1 个交易日出现与第 N 个交易日同方向涨跌停板单边无连

续报价的情况，则第 N+1 个交易日结算时起，该黄大豆 1 号、黄大豆 2 号、豆粕、豆油、棕榈油、玉米、线型低密度聚乙烯、聚氯乙烯合约交易保证金按合约价值的 7%收取（原交易保证金比例高于 7%的，按原比例收取）。第 N+2 个交易日该黄大豆 1 号、黄大豆 2 号、豆粕、豆油、棕榈油、玉米、线型低密度聚乙烯、聚氯乙烯合约涨跌停板幅度不变。

第十七条 若某期货合约在某交易日未出现与上一交易日同方向涨跌停板单边无连续报价的情况，则该交易日结算时交易保证金恢复到正常水平，下一交易日该合约的涨跌停板幅度按合约规定执行。

第十八条 若第 N+2 个交易日出现与第 N+1 个交易日同方向涨跌停板单边无连续报价的情况，则在第 N+2 个交易日收市后，交易所将进行强制减仓，如连续同方向涨跌停板系因会员或客户交易行为异常引发，则按第七章规定处理。

第十九条 强制减仓是指交易所将当日以涨跌停板价申报的未成交平仓报单，以当日涨跌停板价与该合约净持仓盈利客户（或非期货公司会员，下同）按持仓比例自动撮合成交。同一客户持有双向头寸，则其净持仓部分的平仓报单参与强制减仓计算，其余平仓报单与其对锁持仓自动对冲。具体强制减仓方法如下：

（一）申报平仓数量的确定：

在第 N +2 个交易日收市后，已在计算机系统中以涨跌停板价申报无法成交的、且客户合约的单位净持仓亏损大于或等于第 N +2 个交易日结算价的 5%（棕榈油合约标准为 4%）的所有持仓。

若客户不愿按上述方法平仓可在收市前撤单，不作为申报的平仓报单。

（二）客户单位净持仓盈亏的确定：

$$\text{客户该合约单位净持仓盈亏} = \frac{\text{客户该合约持仓盈亏总和(元)}}{\text{客户该合约净持仓量(手)} \times \text{交易单位(吨/手)}}$$

客户该合约持仓盈亏总和，是指客户该合约的全部持仓按其实际成交价与当日结算价之差计算的盈亏总和。

（三）净持仓盈利客户平仓范围的确定：

根据上述方法计算的客户单位净持仓盈利大于零的客户的的所有投机持仓以及客户单位净持仓盈利大于或等于第 N +2 个交易日结算价的 7%的保值持仓都列入平仓范围。

（四）平仓数量的分配原则及方法：

1. 平仓数量的分配原则

（1）在平仓范围内按盈利的大小和投机与保值的不同分成四级，逐级进行分配。

首先分配给属平仓范围内单位净持仓盈利大于或等于第 N+2 个交易日结算价的 6%以上的投机持仓（以下简称盈利 6%以上的投机持仓）；

其次分配给单位净持仓盈利大于或等于第 N+2 个交易日结算价的 3%以上而小于 6%的投机持仓（以下简称盈利 3%以上的投机持仓）；

再次分配给单位净持仓盈利小于第 N+2 个交易日结算价的 3%而大于零的投机持仓（以下简称盈利大于零的投机持仓）；

最后分配给单位净持仓盈利大于或等于第 N+2 个交易日结算价的 7%的保值持仓（以下简称盈利 7%保值持仓）。

（2）以上各级分配比例均按申报平仓数量(剩余申报平仓数量)与各级可平仓的盈利持仓数量之比进行分配。

2. 平仓数量的分配方法及步骤：

若单位净持仓盈利 6%以上的投机持仓数量大于或等于申报平仓数量，则根据申报平仓数量与单位净持仓盈利 6%以上的投机持仓数量的比例，将申报平仓数量向单位净持仓盈利 6%以上的投机持仓分配实际平仓数量；

若单位净持仓盈利 6%以上的投机持仓数量小于申报平仓数量，则根据单位净持仓盈利 6%以上的投机持仓数量与申报平仓数量的比例，将单位净持仓盈利 6%以上的投机持仓数量向申报平仓客户分配实际平仓数量。再把剩余的申报平仓数量按上述的分配方法向单位净持仓盈利 3%以上的投机持仓分配；若还有剩余，则再向单位净持仓盈利大于零的投机持仓分配；若还有剩余，则再向单位净持仓盈利 7%的保值持仓分配。若还有剩余则不再分配。

分配平仓数量以“手”为单位，不足一手的按如下方法计算：首先对每个交易编码所分配到的平仓数量的整数部分进行分配，然后按小数部分由大到小的顺序“进位取整”进行分配。

（五）强制减仓的执行

强制减仓于第 N +2 个交易日收市后由交易系统按强制减仓原则自动执行，

强制减仓结果作为第 N +2 个交易日会员的交易结果。

(六) 强制减仓的价格

强制减仓的价格为该合约第 N +2 个交易日的涨(跌)停板价。

(七) 强制减仓当日结算时交易保证金恢复到正常水平, 下一交易日该合约的涨跌停板幅度按合约规定执行。

(八) 由上述减仓造成的经济损失由会员及其客户承担。

第二十条 该合约在采取上述措施后若风险仍未释放, 则交易所宣布为异常情况, 并按有关规定采取风险控制措施。

第四章 限仓制度

第二十一条 交易所实行限仓制度。限仓是指交易所规定会员或客户可以持有的, 按单边计算的某一合约投机头寸的最大数额。

第二十二条 限仓实行以下基本制度:

(一) 根据不同期货品种的具体情况, 分别确定每一品种每一月份合约的限仓数额;

(二) 某一月份合约在其交易过程中的不同阶段, 分别适用不同的限仓数额, 进入交割月份的合约限仓数额从严控制;

(三) 采用限制会员持仓和限制客户持仓相结合的办法, 控制市场风险;

(四) 套期保值交易头寸实行审批制, 其持仓不受限制。

第二十三条 同一客户在不同期货公司会员处开有多个交易编码, 各交易编码上所有持仓头寸的合计数, 不得超出一个客户的限仓数额。

第二十四条 各合约的限仓数额, 按该合约在交易全过程中所处的不同时期, 分别确定。

(一) 在合约上市交易的一般月份(交割月份前一个月以前的月份)期间, 当该合约的市场总持仓量达到一定规模起, 按市场总持仓量的一定比例确定限仓数额; 在该合约的市场总持仓量达到该规模前, 该合约限仓数额以绝对量方式规定。

(二) 在合约进入交割月份前一个月和进入交割月期间, 该合约限仓数额以绝对量方式规定。

第二十五条 当黄大豆 1 号、豆粕、玉米、聚氯乙烯一般月份合约单边持仓大于 20 万手时，期货公司会员该合约持仓限额不得大于单边持仓的 25%，非期货公司会员该合约持仓限额不得大于单边持仓的 20%，客户该合约持仓限额不得大于单边持仓的 10%。

当黄大豆 2 号、豆油、线型低密度聚乙烯一般月份合约单边持仓大于 10 万手时，期货公司会员该合约持仓限额不得大于单边持仓的 25%，非期货公司会员该合约持仓限额不得大于单边持仓的 20%，客户该合约持仓限额不得大于单边持仓的 10%

当棕榈油一般月份合约单边持仓大于 5 万手时，期货公司会员该合约持仓限额不得大于单边持仓的 25%，非期货公司会员该合约持仓限额不得大于单边持仓的 20%，客户该合约持仓限额不得大于单边持仓的 10%。

当黄大豆 1 号、豆粕、玉米、聚氯乙烯一般月份合约单边持仓小于等于 20 万手时，期货公司会员该合约持仓限额为 50,000 手，非期货公司会员该合约持仓限额为 40,000 手，客户该合约持仓限额为 20,000 手。

当黄大豆 2 号、豆油、线型低密度聚乙烯一般月份合约单边持仓小于等于 10 万手时，期货公司会员该合约持仓限额为 25,000 手，非期货公司会员该合约持仓限额为 20,000 手，客户该合约持仓限额为 10,000 手。

当棕榈油一般月份合约单边持仓小于等于 5 万手时，期货公司会员该合约持仓限额为 12,500 手，非期货公司会员该合约持仓限额为 10,000 手，客户该合约持仓限额为 5,000 手。

第二十六条 黄大豆 1 号、黄大豆 2 号、豆粕、聚氯乙烯合约进入交割月份前一个月和进入交割月期间,其持仓限额为:

交易时间段	期货公司会员	非期货公司会员	客户
交割月前一个月第一个交易日起	25,000	20,000	10,000
交割月前一个月第十个交易日起	12,500	10,000	5,000
交割月份	6,250	5,000	2,500

豆油、线型低密度聚乙烯合约进入交割月份前一个月和进入交割月期间,其持仓限额为:
(单位:手)

交易时间段	期货公司会员	非期货公司会员	客户
交割月前一个月第一个交易日起	10,000	8,000	4,000

交割月前一个月第十个交易日起	5,000	4,000	2,000
交割月份	2,500	2,000	1,000

玉米合约进入交割月份前一个月和进入交割月期间,其持仓限额为:
(单位:手)

交易时间段	期货公司会员	非期货公司会员	客户
交割月前一个月第一个交易日起	50,000	40,000	20,000
交割月前一个月第十个交易日起	25,000	20,000	10,000
交割月份	12,500	10,000	5,000

棕榈油合约进入交割月份前一个月和进入交割月期间,其持仓限额为:
(单位:手)

交易时间段	期货公司会员	非期货公司会员	客户
交割月前一个月第一个交易日起	5,000	4,000	2,000
交割月前一个月第十个交易日起	2,500	2,000	1,000
交割月份	1,250	1,000	500

期货合约在某一交易时间段的持仓限额标准自该交易时间段起始日前一交易日结算时起执行。

第二十七条 会员或客户的持仓数量不得超过交易所规定的持仓限额。对超过持仓限额的会员或客户,交易所将于下一交易日按有关规定执行强行平仓。

一个客户在不同期货公司会员处开有多个交易编码,其持仓量合计超出限仓数额的,由交易所指定有关期货公司会员对该客户超额持仓执行强行平仓。

第二十八条 期货公司会员名下全部客户的持仓之和超过该会员的持仓限额的，期货公司会员原则上应按合计数与限仓数之差除以合计数所得比例，由该会员监督其客户减仓；应减仓而未减仓的，由交易所按有关规定执行强行平仓。

第五章 大户报告制

第二十九条 交易所实行大户报告制度。当会员或客户某品种持仓合约的投机头寸达到交易所对其规定的投机头寸持仓限量 80%以上（含本数）时，会员或客户应向交易所报告其资金情况、头寸情况，客户须通过期货公司会员报告。交易所可根据市场风险状况，调整改变持仓报告水平。

第三十条 会员和客户的持仓达到交易所报告界限的，会员和客户应主动于下一交易日 15:00 时前向交易所报告。如需再次报告或补充报告，交易所将通知有关会员。

第三十一条 达到交易所报告界限的期货公司会员应向交易所提供下列材料：

（一）填写完整的《期货公司会员大户报告表》（见附件 2），内容包括会员名称、会员号、合约代码、现有持仓、持仓保证金、可动用资金、持仓客户数量、预报交割数量、申请交割数量；

（二）资金来源说明；

（三）其持仓量前五名客户的名称、交易编码、持仓量、开户资料及当日结算单据；

（四）交易所要求提供的其他材料。

第三十二条 达到交易所报告界限的非期货公司会员应向交易所提供下列材料：

（一）填写完整的《非期货公司会员大户报告表》（见附件 3），内容包括会员名称、会员号、合约代码、现有持仓、持仓性质、持仓保证金、可动用资金、持仓意向、预报交割数量、申请交割数量；

（二）资金来源说明；

（三）交易所要求提供的其他材料。

第三十三条 达到交易所报告界限的客户应提供下列材料：

(一) 填写完整的《客户大户报告表》(见附件 4), 内容包括会员名称、会员号、客户名称和编码、合约代码、现有持仓、持仓性质、持仓保证金、可动用资金、持仓意向、预报交割数量、申请交割数量等;

(二) 资金来源说明;

(三) 开户材料及当日结算单据;

(四) 交易所要求提供的其他材料。

第三十四条 期货公司会员应对达到交易所报告界限的客户所提供的有关材料进行初审, 然后转交交易所。期货公司会员应保证客户所提供的材料的真实性。

第三十五条 交易所将不定期地对会员或客户提供的材料进行核查。

第三十六条 客户在不同期货公司会员处开有多个交易编码, 各交易编码持头寸合计达到报告界限, 由交易所指定并通知有关期货公司会员, 负责报送该客户应报告情况的有关材料。

第六章 强行平仓制度

第三十七条 为控制市场风险, 交易所实行强行平仓制度。强行平仓是指当会员、客户违规时, 交易所对有关持仓实行平仓的一种强制措施。

第三十八条 当会员、客户出现下列情形之一时, 交易所对其持仓进行强行平仓:

(一) 会员结算准备金余额小于零, 并未能在规定时限内补足的;

(二) 持仓量超出其限仓规定的;

(三) 因违规受到交易所强行平仓处罚的;

(四) 根据交易所的紧急措施应予强行平仓的;

(五) 其他应予强行平仓的。

第三十九条 强行平仓的执行原则:

强行平仓先由会员自己执行, 时限除交易所特别规定外, 一律为开市后第一节交易时间内。若时限内会员未执行完毕, 则由交易所强制执行。因结算准备金小于零而被要求强行平仓的, 在保证金补足至最低结算准备金余额前, 禁止相关会员的开仓交易。

(一) 由会员单位执行的强行平仓头寸的确定

1. 属第三十八条第(一)、(二)项的强行平仓, 其需强行平仓头寸由会员单位自行确定, 只要强行平仓结果符合交易所规则即可。

2. 属第三十八条第(三)、(四)、(五)项的强行平仓, 其需强行平仓头寸由交易所确定。

(二) 由交易所执行的强行平仓头寸的确定。

1. 属第三十八条第(一)项的强行平仓, 该会员所有客户按交易保证金等比例平仓原则进行强行平仓:

平仓比例 = 会员应追加交易保证金 / 会员交易保证金总额 × 100% 客户应平仓释放交易保证金 = 该客户交易保证金总额 × 平仓比例 其客户需要强行平仓的头寸由交易所按先投机、后套期保值的原则;

并按上一交易日闭市后合约总持仓量由大到小顺序, 先选择持仓量大的合约作为强行平仓的合约。

若多个会员需要强行平仓的, 按追加保证金由大到小的顺序, 先平需要追加保证金大的会员。

2. 属第三十八条第(二)项的强行平仓: 若系一个会员超仓, 其需强行平仓头寸由交易所按会员超仓数量与会员投机持仓数量的比例确定有关客户的平仓数量; 若系多个会员超仓, 其需强行平仓头寸按会员超仓数量由大到小顺序, 先选择超仓数量大的会员作为强行平仓的对象; 若系客户超仓, 则对该客户的超仓头寸进行强行平仓, 若客户在多个会员处持仓, 则按该客户持仓数量由大到小的顺序选择会员强行平仓。若系会员和客户同时超仓, 则先对超仓的客户进行平仓, 再按会员超仓的方法平仓。

3. 属第三十八条第(三)、(四)、(五)项的强行平仓, 强行平仓头寸由交易所根据涉及的会员和客户具体情况确定。

若会员同时满足第三十八条第(一)、(二)项情况, 交易所先按第(二)项情况确定强行平仓头寸, 再按第(一)项情况确定强行平仓头寸。

第四十条 强行平仓的执行:

(一) 通知。

交易所以“强行平仓通知书”(以下简称通知书)的形式向有关会员下达强

行平仓要求。通知书除交易所特别送达以外，通过会员服务系统随当日结算数据发送，有关会员可以通过会员服务系统获得。

（二）执行及确认。

1. 开市后，有关会员必须首先自行平仓，直至达到平仓要求；

2. 超过会员自行强行平仓时限而未执行完毕的，剩余部份由交易所直接执行强行平仓；

3. 强行平仓执行完毕后，由交易所记录执行结果并存档；

4. 强行平仓结果随当日成交记录发送，有关会员可以通过会员服务系统获得。

第四十一条 强行平仓的价格通过市场交易形成。

第四十二条 如因价格涨跌停板或其他市场原因而无法在当日完成全部强行平仓的，交易所根据结算结果，对该会员或客户做出相应的处理。

第四十三条 由于价格涨跌停板限制或其他市场原因，有关持仓的强行平仓只能延时完成的，因此发生的亏损，仍由直接责任人承担；未能完成平仓的，该持仓持有者须继续对此承担持仓责任或交割义务。

第四十四条 由会员单位执行的强行平仓产生的盈利仍归直接责任人；由交易所执行的强行平仓产生的盈亏相抵后的盈利部分予以罚没；因强行平仓发生的亏损由直接责任人承担。直接责任人是客户的，强行平仓后发生的亏损，由该客户开户所在期货公司会员先行承担后，自行向该客户追索。

第七章 异常情况处理

第四十五条 在期货交易过程中，当出现以下情形之一的，交易所可以宣布进入异常情况，采取紧急措施化解风险：

（一）地震、水灾、火灾等不可抗力或计算机系统故障等不可归责于交易所的原因导致交易无法正常进行；

（二）会员出现结算、交割危机，对市场正在产生或者将产生重大影响；

（三）期货价格出现同方向连续涨跌停板，有根据认为会员或者客户违反交易所交易规则及其实施细则并且对市场正在产生或者即将产生重大影响；

（四）交易所规定的其他情况。

出现前款第（一）项异常情况时，交易所总经理可以采取调整开市收市时间、暂停交易的紧急措施；出现前款第（二）、（三）、（四）项异常情况时，理事会可以决定采取调整开市收市时间、暂停交易、调整涨跌停板幅度、调整交易保证金、暂停开新仓、限期平仓、强行平仓、限制出金等紧急措施；

第四十六条 在棕榈油期货交易过程中，因战争、社会动荡、自然灾害等因素对棕榈油进口正在产生或者即将产生重大影响时，交易所可以宣布进入异常情况，交易所总经理可以采取调整开市收市时间、暂停交易、终止交易的紧急措施。终止交易当天结算时，棕榈油各合约月份全部持仓按照上一交易日结算价进行平仓。

第四十七条 交易所宣布异常情况并决定采取紧急措施前必须报告中国证监会。

对棕榈油合约采取终止交易紧急措施的，应当经中国证监会批准。

第四十八条 交易所宣布进入异常情况并决定暂停交易时，暂停交易的期限不得超过 3 个交易日，但经中国证监会批准延长的除外。

第八章 风险警示制度

第四十九条 交易所实行风险警示制度。当交易所认为必要时，可以分别或同时采取要求报告情况、谈话提醒、发布风险提示函等措施中的一种或多种，以警示和化解风险。

第五十条 出现下列情形之一的，交易所可以要求会员或客户报告情况，或约见指定的会员高管人员或客户谈话提醒风险：

- （一） 期货价格出现异常变动；
- （二） 会员或客户交易行为异常；
- （三） 会员或客户持仓变化较大；
- （四） 会员资金变化较大；
- （五） 会员或客户涉嫌违规；
- （六） 会员或客户被投诉；
- （七） 会员涉及司法调查或诉讼案件；
- （八） 交易所认定的其他情形。

交易所要求会员或客户报告情况的，会员或客户应当按照交易所要求的时间、内容和方式如实报告。

交易所实施谈话提醒的，会员或客户应当按照交易所要求的时间、地点和方式认真履行。如果使用电话提醒方式，应保留电话录音；如果当面谈话，应保存谈话记录。

第五十一条 发生下列情形之一的，交易所可以向全体或部分会员和客户发出风险提示函：

- （一）期货市场交易出现异常变化；
- （二）国内外期货或现货市场发生较大变化；
- （三）会员或客户涉嫌违规；
- （四）会员或客户交易存在较大风险；
- （五）交易所认定的其他异常情形。

第九章 附则

第五十二条 违反本办法规定的，交易所按《大连商品交易所违规处理办法》的有关规定处理。

第五十三条 本办法解释权属于大连商品交易所。

第五十四条 本办法自公布之日起实施。