

关于 2024 年元旦期间保证金调整及风险提示的公告

尊敬的客户：

根据各期货交易所的有关通知，2024 年元旦休市时间为 2023 年 12 月 30 日（星期六）至 2024 年 1 月 1 日（星期一）。另，上海期货交易所、上海国际能源交易中心、大连商品交易所和郑州商品交易所对元旦期间夜盘交易时间安排为，12 月 29 日（星期五）晚上不进行夜盘交易，1 月 2 日（星期二）08:55-09:00 所有期货、期权合约进行集合竞价，1 月 2 日（星期二）当晚恢复夜盘交易。现将元旦前后交易保证金标准和涨跌停板幅度调整等事宜通知如下：

元旦前后交易所将调整相关品种的保证金标准和涨跌停板幅度，因近期集运指数（欧线）和碳酸锂期货价格波动较大，我公司在交易所保证金标准上增加部分调整为 10% 和 8%。我公司和各交易所调整部分品种的保证金标准和涨跌停板幅度的情况如下（更多内容详见各交易所网站相关通知）。

交易所	品种	12 月 27 日结算起			12 月 28 日结算起			1 月 2 日结算起		
		公司保证金比例 (%)		涨跌停板幅度 (%)	公司保证金比例 (%)		涨跌停板幅度 (%)	公司保证金比例 (%)		涨跌停板幅度 (%)
		投机	套保		投机	套保		投机	套保	
大商所	焦炭	26	21	15	26	21	15	26	21	8
	焦煤	26	21	15	26	21	15	26	21	8
	生猪	13	13	6	14	14	7	13	13	6
	液化石油气	13	13	7	14	14	8	13	13	7
能源中心	集运指数（欧线）2404、2406	32	32	20	32	32	20	32	32	20
	集运指数（欧线）2408、2410、2412	30	30	18	30	30	18	30	30	18
	原油	15	14	8	16	15	9	15	14	8
	低硫燃料油	15	14	8	16	15	9	15	14	8
广期所	碳酸锂	22	22	13	24	24	15	22	22	13
	碳酸锂 2401、2402	28	28	13	28	28	15	28	28	13
	工业硅	14	14	7	15	15	8	14	14	7
上期所	氧化铝	14	13	7	15	14	8	14	13	7
	燃料油	15	14	8	16	15	9	15	14	8
	石油沥青	15	14	8	16	15	9	15	14	8
	丁二烯橡胶	17	16	10	18	17	11	17	16	10

2024 年元旦前后各期货交易所调整保证金和涨跌板幅度的情况如下（更多内容详见各期货交易所网站相关通知）：

一、大连商品交易所

1、自 2023 年 12 月 28 日（星期四）结算时起，生猪品种期货合约涨跌停板

幅度调整为 7%，交易保证金水平调整为 9%；液化石油气品种期货合约涨跌停板幅度调整为 8%，交易保证金水平调整为 9%；其他品种期货合约涨跌停板幅度和交易保证金水平维持不变。

对同时满足《大连商品交易所风险管理办法》有关调整涨跌停板幅度和交易保证金规定的合约，其涨跌停板幅度和交易保证金按照规定数值中较大值执行。

2、2024 年 1 月 2 日（星期二）恢复交易后，在各品种持仓量最大的合约未出现涨跌停板单边无连续报价的第一个交易日结算时起，将焦炭、焦煤品种期货合约涨跌停板幅度调整为 8%，交易保证金水平维持不变；生猪和液化石油气品种期货合约涨跌停板幅度和交易保证金水平恢复至节前标准；其他品种期货合约涨跌停板幅度和交易保证金水平维持不变。

二、广州期货交易所

1、自 2023 年 12 月 28 日（星期四）结算时起，工业硅期货合约涨跌停板幅度调整为 8%，交易保证金标准调整为 10%；碳酸锂期货合约涨跌停板幅度调整为 15%，交易保证金标准调整为 16%，其中碳酸锂期货 LC2401、LC2402 合约交易保证金标准维持 20%不变。

如遇上述涨跌停板幅度、交易保证金标准与现行执行的涨跌停板幅度、交易保证金标准不同时，则按两者中幅度大、标准高的执行。

2、2024 年 1 月 2 日（星期二）恢复交易后，在各品种期货持仓量最大的合约未出现涨跌停板单边无连续报价的第一个交易日结算时起，上述品种期货合约涨跌停板幅度和交易保证金标准恢复至调整前水平。

三、上海期货交易所

1、自 2023 年 12 月 28 日（星期四）收盘结算时起，涨跌停板幅度和交易保证金比例调整如下：氧化铝期货合约的涨跌停板幅度调整为 8%，套保交易保证金比例调整为 9%，投机交易保证金比例调整为 10%。燃料油、石油沥青期货合约的涨跌停板幅度调整为 9%，套保交易保证金比例调整为 10%，投机交易保证金比例调整为 11%。丁二烯橡胶期货合约的涨跌停板幅度调整为 11%，套保交易保证金比例调整为 12%，投机交易保证金比例调整为 13%。如遇《上海期货交易所风险控制管理办法》第十二条规定情况，则在上述交易保证金比例、涨跌停板幅度基础上调整。如遇上述涨跌停板幅度、交易保证金比例与执行的涨跌停板幅度、交易保证金比例不同时，则按两者中比例高、幅度大的执行。

2、2024 年 1 月 2 日（星期二）交易后，自第一个未出现单边市的交易日收盘结算时，涨跌停板幅度和交易保证金比例调整如下：所有期货合约的涨跌停板幅度和交易保证金比例恢复至原有水平。

四、能源中心

1、自 2023 年 12 月 28 日（星期四）收盘结算时起，涨跌停板幅度和交易保证金比例调整如下：原油、低硫燃料油期货合约的涨跌停板幅度调整为 9%，套保交易保证金比例调整为 10%，投机交易保证金比例调整为 11%。如遇《上海国际能源交易中心风险控制管理细则》第十六条规定情况，则在上述交易保证金比例、涨跌停板幅度基础上调整。如遇上述涨跌停板幅度、交易保证金比例与执行的涨跌停板幅度、交易保证金比例不同时，则按两者中比例高、幅度大的执行。

2、2024 年 1 月 2 日（星期二）交易后，自第一个未出现单边市的交易日收

盘结算时，涨跌停板幅度和交易保证金比例调整如下：原油、低硫燃料油期货合约的涨跌停板幅度和交易保证金比例恢复至原有水平。

由于近期国内外经济和金融形势复杂多变，影响市场运行的不确定性因素增多，我公司提醒各位客户注意做好风险防范工作，加强持仓风险管理，谨慎运作，理性投资，并请各位客户关注元旦前后各交易所对各品种交易保证金标准和涨跌停板的调整情况。

祝各位客户元旦快乐！

东海期货有限责任公司
2023年12月27日