

大 连 商 品 交 易 所

关于开展线型低密度聚乙烯、聚氯乙烯、 聚丙烯月均价期货仿真交易的通知

各会员单位：

为做好新品种上市和投资者教育工作，大连商品交易所将自 2025 年 9 月 15 日起，在仿真环境开展线型低密度聚乙烯、聚氯乙烯、聚丙烯月均价期货仿真交易，具体参数详见《月均价期货仿真交易参数》。

业务开启前，请会员单位联系柜台系统开发商获取必要的业务升级包，并在仿真环境完成升级。请会员单位及时做好技术和业务准备工作，积极组织客户参与仿真交易。

涉及测试过程中的技术问题，请联系技术服务热线 400-861-8888 转 3。

涉及月均价期货业务问题，请联系期货衍生品部 0411-84808319、0411-84808565。

特此通知。

附件：月均价期货仿真交易参数

大连商品交易所

2025 年 9 月 5 日

附件

月均价期货仿真交易参数

一、月均价期货挂牌合约

首批挂牌合约为 L2511F、L2512F、L2601F、L2602F、L2603F、V2511F、V2512F、V2601F、V2602F、V2603F、PP2511F、PP2512F、PP2601F、PP2602F、PP2603F。

每月最后 1 个交易日闭市后，增挂下一月份的月均价期货合约，如 9 月 30 日闭市后增挂 L2504F、V2504F、PP2504F 合约，依此类推。

二、月均价期货仿真交易参数

（一）线型低密度聚乙烯月均价期货合约仿真交易参数

参数名称	仿真交易参数值
交易代码	L 合约月份 F
交易单位	5 吨/手
报价单位	元（人民币）/吨
最小变动价位	1 元/吨
合约月份	1、2、3、4、5、6、7、8、9、10、11、12 月
交易时间	上午 9:00-11:30,下午 13:30-15:00，以及交易所规定的其他交易时间
最后交易日	合约月份前一个月的最后 1 个交易日
交割日期	同最后交易日
涨跌停板	与对应合约相同，对应合约为相同合

	约月份的线型低密度聚乙烯期货合约
交易保证金	与对应合约相同，对应合约为相同合约月份的线型低密度聚乙烯期货合约
交割方式	现金交割
交易手续费	1 元/手
套期保值交易手续费	0.5 元/手

（二）聚氯乙烯月均价期货合约仿真交易参数

参数名称	仿真交易参数值
交易代码	V 合约月份 F
交易单位	5 吨/手
报价单位	元（人民币）/吨
最小变动价位	1 元/吨
合约月份	1、2、3、4、5、6、7、8、9、10、11、12 月
交易时间	上午 9:00-11:30,下午 13:30-15:00，以及交易所规定的其他交易时间
最后交易日	合约月份前一个月的最后 1 个交易日
交割日期	同最后交易日
涨跌停板	与对应合约相同，对应合约为相同合约月份的聚氯乙烯期货合约
交易保证金	与对应合约相同，对应合约为相同合约月份的聚氯乙烯期货合约
交割方式	现金交割
交易手续费	1 元/手
套期保值交易手续费	0.5 元/手

（三）聚丙烯月均价期货合约仿真交易参数

参数名称	仿真交易参数值
交易代码	PP 合约月份 F
交易单位	5 吨/手
报价单位	元（人民币）/吨
最小变动价位	1 元/吨
合约月份	1、2、3、4、5、6、7、8、9、10、11、12 月
交易时间	上午 9:00-11:30,下午 13:30-15:00, 以及交易所规定的其他交易时间
最后交易日	合约月份前一个月的最后 1 个交易日
交割日期	同最后交易日
涨跌停板	与对应合约相同, 对应合约为相同合约月份的聚丙烯期货合约
交易保证金	与对应合约相同, 对应合约为相同合约月份的聚丙烯期货合约
交割方式	现金交割
交易手续费	1 元/手
套期保值交易手续费	0.5 元/手

（四）月均价期货合约仿真交易持仓限额

时间段	合约单边持仓量	非期货公司会员	客户
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 $\leq 200,000$	4,000	4,000
	单边持仓量 $> 200,000$	单边持仓量 $\times 2\%$	单边持仓量 $\times 2\%$

合约月份前一个月第十五个交易日起	——	1,000	1,000
------------------	----	-------	-------

（五）月均价期货套利交易指令说明

月均价期货支持套利交易指令，具体包括：1.同品种跨期套利（相同月均价期货品种），例如 SP l2511F&l2512F；2.跨品种套利（不同月均价期货品种），例如 SPC l2511F&v2511F；3.不同交割方式套利（实物交割期货合约和月均价期货合约），例如 SP l2511&l2511F。