**附件1**

《上海期货交易所风险控制管理办法》等业务规则修订说明

为积极稳妥地化解市场风险，促进期货市场功能有效发挥，更好地服务实体经济，上期所拟优化连续三板后风险控制、交割仓库风险保证金等，具体涉及《上海期货交易所风险控制管理办法》（以下简称《风控办法（修订草案）》）《上海期货交易所指定交割仓库管理办法》（以下简称《仓库管理办法（修订草案）》）《上海期货交易所指定交割油库管理办法》（以下简称《油库管理办法（修订草案）》）的修订。

一、《风控办法（修订草案）》主要修订内容

1. 《风控办法（修订草案）》规定在出现单边市的情况下，上期所不同品种期货合约在D2、D3交易日涨跌停板幅度和交易保证金比例参数统一调整比例。

2. 《风控办法（修订草案）》规定当某一期货合约连续三个交易日同方向单边市后，除该合约D3、D4交易日是最后交易日的可以在下一交易日直接进入交割的之外，上期所可以对该期货合约采取继续交易或者暂停交易一天的风险控制措施。

3．《风控办法（修订草案）》规定交易所宣布为异常情况的，可以采取调整开市闭市时间、暂停交易、调整涨跌停板幅度、提高保证金标准、限期平仓、强行平仓、限制出金、强制减仓、限制交易等紧急措施。

4.《风控办法（修订草案）》规定交易所宣布为异常情况且采取强制减仓措施的，交易所应当明确强制减仓基准日和采取强制减仓的合约。强制减仓基准日为最近一次出现单边市并应用强制减仓紧急措施的交易日。交易所在采取强制减仓紧急措施时，将强制减仓基准日闭市时以涨跌停板价申报的未成交平仓报单，以强制减仓基准日的涨跌停板价，与该合约净持仓盈利客户（或者非期货公司会员，下同）按持仓比例自动撮合成交。同一客户持有双向头寸，则首先平自己的头寸，再按上述方法平仓。

二、《仓库管理办法》《油库管理办法》主要修订内容

删除指定交割仓库、指定交割油库需要缴纳风险保证金的规定。