附件7

豆油、棕榈油串换试点集团提供的串换价差计算方式

串换现货价差是串出地和串入地两个地点近期现货的价差。

交割月第7个交易日申请成功的串换价差=串换当月第1个交易日至第5个交易日共5个交易日的两地价差算术平均价，计算结果四舍五入，保留到整数位。

最后交割日后的第一天申请成功的串换价差=串换当月第8个交易日至第12个交易日共5个交易日的两地价差算术平均价，计算结果四舍五入，保留到整数位。

第一，串换地点的现货价格由串换库申报价格和第三方网站报价共同组成。

**串换库申报价格：**串换集团需在交割月第1至第5个交易日和最后交割日的前5个交易日，每日向交易所提交相关串换库的一级豆油和24度棕榈油现货成交价格。**第三方网站价格：**为保证价格的公正性，第三方网站价格按照当天某地报价的平均价计算,其中豆油采用一级豆油成交价,棕榈油采用24度棕榈油成交价。如果某串换库在第三方网站上也有报价，则该串换库的网站报价仍然参与网站价格计算。网站价格的平均价作为一个价格采集样本。

第三方网站目前采用天下粮仓网站（http://www.cofeed.com/）、大豆网（http://www.dadou.cn/）、卓创资讯网站（http://agri.sci99.com/）和邦成粮油在线（http://www.epansun.com），随着串换业务的开展，交易所将根据业务需要增加其他第三方报价机构。第三方报价机构详细信息及价格采集标准会以通知形式公布在大连商品交易所网站上。自交易所公布该第三方报价机构信息之日起下一个月的串换业务中，正式采用新公布的第三方报价机构的报价计算现货价格。

第二，串换区域的现货价格计算方式

某串换区域的现货价格=（∑区域内串换库申报价格+∑网站上区域内企业报价平均价）/（区域内串换库数量+第三方网站数量）

第三，两地串换价差计算公式

串换现货价差=串入区域现货价格-串出区域现货价格

第四，串换地点共分为4个区域，包括：

广东地区（东莞、广州、黄埔港）、江浙沪地区（张家港、南通、泰州、镇江、上海）、日照连云港地区、天津河北地区。