

# 交割及仓单业务介绍

## 鲜鸡蛋

### 一、合约、交割标准

交易品种	鲜鸡蛋
交易单位	5 吨/手
报价单位	元（人民币）/500 千克
最小变动价位	1 元/500 千克
涨跌停板幅度	上一交易日结算价的 4%
合约月份	1, 2, 3, 4, 5, 6, 7, 8, 9, 10, 11, 12 月
交易时间	每周一至周五上午 9:00—11:30, 下午 13:30—15:00, 以及交易所规定的其他时间
最后交易日	合约月份倒数第 4 个交易日
最后交割日	最后交易日后第 3 个交易日
交割等级	大连商品交易所鸡蛋交割质量标准 (F/DCE JD003-2020)
交割地点	大连商品交易所鸡蛋指定交割仓库、指定车板交割场所
最低交易保证金	合约价值的 5%
交割方式	实物交割
交易代码	JD
上市交易所	大连商品交易所

### 二、标准仓单的概念

**标准仓单**是指交割仓库完成入库商品验收、确认合格并签发《货物存储证明（保证）书》等后，经交易所注册，可用于证明货主拥有实物或者可予提货的财产凭证。

### 三、入库预报

- 货主向指定交割仓库发货前，应当办理填报《交割预报表》。（交易所在收到《交割预报表》后 3 个工作日之内完成相应的审批工作，并将结果告知。）
- 《交割预报表》获批后，交易所向客户收取入库预报定金，鲜鸡蛋按照 30 元/吨的标准交纳。

### 四、入库及注册

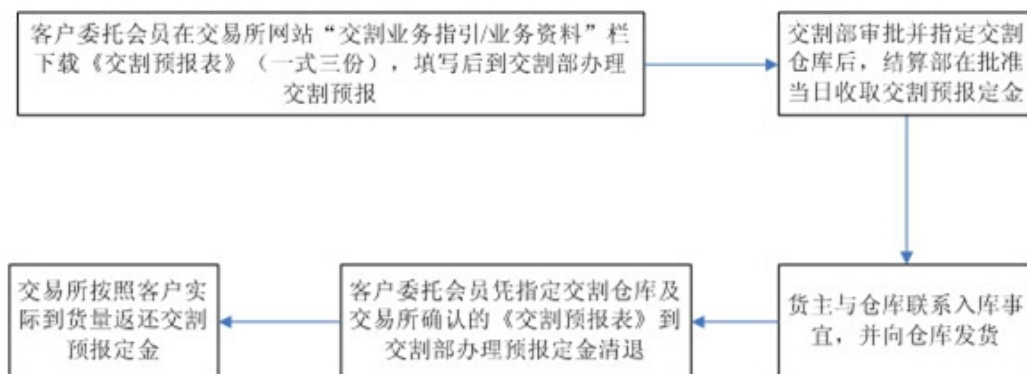
- 办理完鸡蛋的交割预报的货主在入库前 3 个自然日之前，应当将车船号、品种、数量、到货时间等通知指定交割仓库，指定交割仓库凭《交割预报

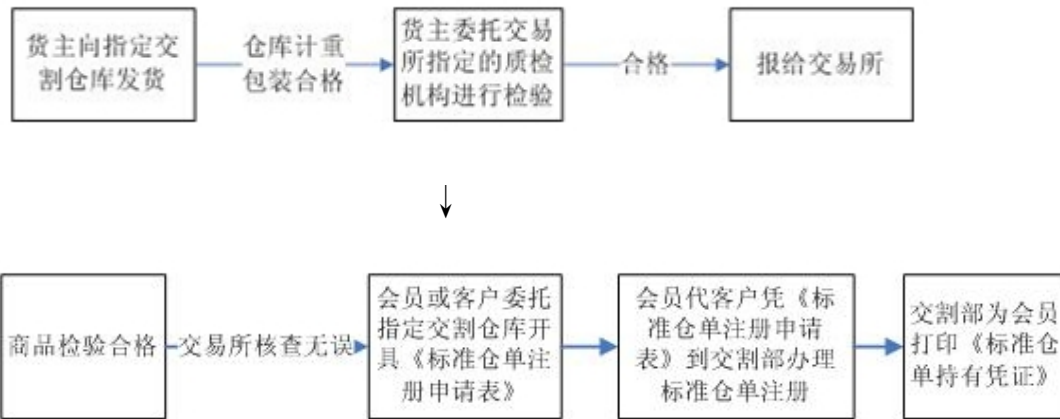
表》合理安排接收商品入库。指定交割仓库应当在收到货主入库通知后，将以上信息通知指定质量检验机构，并在委托质检协议中列明。委托质检协议中还应当明确检验费用、昼夜作业费用、出具检验报告的时间以及因指定质量检验机构未及时到场造成损失的责任承担等内容。检验费用由货主承担，由指定交割仓库负责转交。

- 鸡蛋入库时，货主应当提供防疫证、来自非疫区证明和车辆消毒证原件，并将三证提交指定交割仓库保管。
- 鸡蛋入库最早抽样时间为交割月首个交易日，抽样应当在卸货过程中、恒温库外进行。
- 鸡蛋收发重量以指定交割仓库检重为准。指定交割仓库对指定质量检验机构抽取的每箱鸡蛋进行称重，分别称取其毛重和包装（含纸箱和蛋托）重量，并根据下列公式计算货物重量：  

$$\text{货物重量} = (\text{抽取鸡蛋总毛重} \div \text{抽取箱数} - \text{抽取重量最大三个包装的平均重量}) \times \text{货物箱数}$$
- 鸡蛋应当整箱入库，入库重量与实际交割量差不应超过  $\pm 20$  千克。不足或多余部分，指定交割仓库按照以下方式与货主结算：最后交易日闭市前入库的，按照入库日该交割月份鸡蛋合约前一交易日结算价结算；最后交易日闭市后入库的，按照该交割月份鸡蛋合约交割结算价结算。
- 交易所指定的质量检验机构完成入库鸡蛋质量检验后，应当出具检验报告正本一份，副本三份，并将正本提交指定交割仓库，向交易所和货主分别提交副本一份。
- 指定交割仓库应当按照交易所有关规定对入库鸡蛋的质量等相关材料和凭证进行验收。
- 鸡蛋标准仓单的最早申请注册日为交割月的首个交易日，仓单注册日距检验报告出具日期不应超过 2 个交易日。

## 五、仓单入库及注册释义图





## 六、交割方式

每日选择交割，一次性交割（最后交易日交割）

## 七、鸡蛋的交割单位

5 吨  
 （对应 1 手期货合约）

## 八、鸡蛋仓单的有效期

鸡蛋标准仓单的最早申请注册日为交割月的首个交易日，仓单注册日距检验报告出具日期不应超过 2 个交易日。

对于在最后交易日前一交易日闭市前注册的标准仓单，卖方可以使用其参与每日选择交割，并且应当在仓单注册日或者仓单注册日后第 1 个交易日闭市前申报交割。交割配对成功的，相应标准仓单在交收日闭市后且当日内、交易所将卖方交割的标准仓单过户给对应的配对买方后立即注销。未参与每日选择交割或者申报交割但不符合交割配对条件的，相应标准仓单应当在仓单注册日后第 1 个交易日闭市后且当日内予以注销。

对于在最后交易日前一交易日闭市后注册的标准仓单，卖方可以使用其参与一次性交割，所有标准仓单在最后交割日闭市后且当日内予以注销。

## 九、鸡蛋仓单的标准品质量标准

指标	允许范围
感官要求	每批抽样样品中，蛋壳不完整、硃窝、流清的鸡蛋不超过 3 个；不清洁面积超过总面积 1/8 的鸡蛋不超过 3 个
蛋重等级	每批抽样样品中，9 箱及以上净重为处于同一蛋重等级的小蛋或中蛋，不得检出蛋重等级外的鸡蛋
哈氏单位	≥70（仅限厂库交割和车板交割）

## 十、鸡蛋仓单的升贴水

指标	允许范围	升贴水 (元/500 千克)
感官要求	每批抽样样品中，蛋壳不完整、硃窝、流清的鸡蛋超过 3 个，但未超过 6 个	4 个扣价 100 5 个扣价 200 6 个扣价 400
	每批抽样样品中，不清洁面积超过总面积 1/8 的鸡蛋超过 3 个，但未超过 10 个	每多 1 个扣价 50
蛋重等级	每批抽样样品中，超过 1 箱的净重不处于同一蛋重等级	扣价 200
	每批抽样样品中，9 箱及以上为大蛋，不得检出蛋重等级外的鸡蛋	扣价 150
哈氏单位	仓库入库 ≥70	扣价 200
	仓库出库 ≥60	
	车板交割 ≥60 且 <70	扣价 200

## 十一、交割的概念

期货合约的买卖双方于合约到期时，根据交易所制订的规则和程序，通过期货合约标的物的所有权转移，将到期未平仓合约进行了结的行为。

## 十二、交割结算价

最后交易日交割结算价采用该期货合约自交割月第一个交易日起至最后交易日所有成交价格的加权平均价。

若交割月不足十个交易日,交割结算价采用该期货合约自交割月第一个交易日起至最后交易日所有成交价格的加权平均价。

### 十三、交割的条件

1. 只有企业法人才具备实物交割的权利。自然人客户不允许进行实物交割。
2. 投资者的实物交割须由会员(具有交易席位的期货公司)办理,并以会员名义在交易所进行。
3. 不能交付或者接收增值税专用发票的投资者不允许交割。

### 十四、交割流程(每日选择交割)

<b>每日选择交割执行时间:</b> 交割月第一个交易日至最后交易日的前一交易日。	
<b>每日选择交割结算价:</b> 期货合约每日选择交割配对日的当日结算价。	
步骤	内容
配对日(每日选择交割流程的第一日)	<ol style="list-style-type: none"> <li>1. 11:30 前申报交割,提交仓单,具有车板交割资格的卖方于 11:30 前申报,交易所对上述申请进行审核,并在每个交易日 13:30 后公布通过审核的卖方交割申请。</li> <li>2. 买方申报意向(买方可以根据交易所公布的卖方交割申请申报两个交割意向,包括第一意向和第二意向;如有卖方申报交割,买方无客户申报意向,则交易所按该合约建仓时间最早者优先原则进行配对)。</li> </ol>
交收日(配对日后第 2 个交易日)	<ol style="list-style-type: none"> <li>1. 闭市后仓单过户给买方闭市后仓单过户给买方,交易所将车板交割配对结果通知相应的指定车板交割场所及指定质检机构。</li> <li>2. 闭市前买方补齐与其配对交割月份合约持仓相对应的全额货款,闭市后接收仓单。</li> </ol>
交收日后第 3 个自然日	<ol style="list-style-type: none"> <li>1. 车板交割的卖方 13:30 前将货物运至指定车板交割场所,交易所委托质检机构到场质检。</li> <li>2. 买方 13:30 前到场监收。</li> </ol>
交收日后第 4 个交易日	<ol style="list-style-type: none"> <li>1. 若买方客户对质量无异议,闭市后清退卖方交割保证金,卖方收 80%货款。</li> </ol>
在交易所支付 80%货款后 7 个交易日内	<ol style="list-style-type: none"> <li>1. 卖方开具增值税普通发票,收 20%交割货款。</li> <li>2. 买方收增值税普通发票。</li> </ol>

### 十五、交割流程(一次性交割)

<b>一次性交割执行时间:</b> 合约最后交易日。	
<b>一次性交割的交割结算价:</b> 该期货合约自交割月第一个交易日起至最后交易日所有成交价格的加权平均价。	
步骤	内容
最后交易日	所有未平仓合约的持有者须以交割履约,同一客户号买卖持仓相对应部分的持仓视为自动平仓,不予办理交割,平仓价按一次性交割的交割结算价计算。
标准仓单提交	<ol style="list-style-type: none"> <li>2. 闭市前,卖方会员应当将其交割月份合约持仓相对应</li> </ol>

日 (第一日)	的全部标准仓单交到交易所。 3. 闭市后，交易所公布各交割仓库交割品种与标准仓单数量信息。
配对日 (第二日)	1. 买方填写《一次性交割意向书》并通过会员提交交割申请。 2. 交易所按照配对原则予以配对
交收日 (第三日)	买方按照要求提交开票资料，交易所收盘后扣除货款并向买方开具《标准仓单持有凭证》。

\*关于鸡蛋的增值税发票的流转，需注意：

对于鸡蛋品种，最后交割日后第 4 个交易日闭市前，买方客户对鸡蛋质量无异议的，交易所在闭市后清退卖方交割保证金，将货款的 80%付给卖方会员，余款在卖方会员提交了增值税普通发票后结清。最后交割日后第 4 个交易日闭市前，买方客户对某个交割仓库某批次鸡蛋质量有异议的，可以申请对该批次鸡蛋复检，该交割仓库中与其配对的卖方全部货款暂不支付。最后交割日后第 7 个交易日闭市前，交易所公布争议复检结果，若复检合格，交易所在闭市后清退卖方交割保证金，将该部分货款的 80%付给卖方会员，余款在卖方会员提交了增值税普通发票后结清。若根据《大连商品交易所交割细则》附件 23 鸡蛋交割质量标准中 4.3 的规定，卫生指标复检不合格，在最后交割日后第 12 个交易日闭市前，卖方在原交割仓库或买卖双方协商交割地点更换合格货物，换货时应当委托交易所指定质检机构，对鸡蛋全部交割质量指标检验，并且检验合格，交易所在最后交割日后第 12 个交易日闭市后，清退卖方交割保证金，将该部分货款的 80%付给卖方会员，余款在卖方会员提交了增值税普通发票后结清；卖方不能按时提供合格货物，则交割终止，交易所将卖方该部分鸡蛋合约价值 20%的交割保证金支付给买方，提货通知单对应的该部分货物归还卖方，退还买方货款。若卫生指标合格，仅其他指标存在问题，交易所在最后交割日后第 7 个交易日闭市后，清退卖方交割保证金，将该部分货款的 80%付给卖方会员，余款在卖方会员提交了增值税普通发票后结清，并按照本细则有关规定解决质量争议。

## 十六、车板交割

- 卖方客户申请在其他车板交割场所交割的，应当事先取得车板交割资格。
- 除买卖双方协商自行办理外，买卖双方应当在交收日后第 2 个自然日（即车板交货日）进行货物交收。

- 车板交割时，卖方应当在指定车板交割场所将货物装载至买方车板。若因买方原因无法在 13:30 开始向买方车板装载货物，卖方可以将货物存放在指定车板交割场所的指定地点。货物装载至买方车板或者存放在指定车板交割场所的指定地点时，视为完成交付，实现货权转移。由此产生的装卸费，由卖方承担；之后发生的一切费用（含装卸费、保管费等）由买方承担。
- 交易所委托质量检验机构到场对鸡蛋进行质量检验。鸡蛋抽样应当在卸货过程中进行。检验鸡蛋所产生的损耗由卖方承担。
- 交易所指定的质量检验机构完成鸡蛋质量检验后，应当向交易所出具检验报告。
- 车板交割发生的装卸费、保管费实行最高限价，交易所将根据市场情况进行不定期核定和公布。

## 十七、仓单注销及出库

- 期货的标准仓单之所以被叫做标准仓单，其中一个主要的原因就是在交易所指定的交割仓库中监管、保存，不能离开交割仓库，如果客户需要提货，必须将货物的监管和标准仓单形式取消，并结清相关费用，我们将这一系列操作叫做标准仓单的注销。
- 标准仓单注销是指标准仓单合法持有人到交易所办理标准仓单退出流通手续的过程。标准仓单持有人注销标准仓单，须通过会员提交标准仓单注销申请及相应的《标准仓单持有凭证》。
- 标准仓单注销申请包括：会员名称、会员号、客户名称、客户码、注销品种、数量。交易所注销相应的标准仓单，结清有关费用，并开具《提货通知单》。鸡蛋出库时，货主在实际提货日 3 天前，凭《提货通知单》与指定交割仓库联系有关出库事宜。
- 货主应当在《提货通知单》开具后 3 个交易日内到指定交割仓库办理提货手续。逾期未办的，按现货提货单处理，凭现货提货单提取的商品，指定交割仓库不保证全部商品质量符合期货标准。
- 货主提货时，须向指定交割仓库提供提货人身份证、提货人所在单位证明，同时与仓库结清自标准仓单注销日次日至提货日的有关费用。

- 鸡蛋标准仓单相应的期货商品转为现货后，不允许再次生成标准仓单。

## 十八、期货转现货

是指持有同一交割月份合约的多空双方之间达成现货买卖协议后，变期货部位为现货部位的交易。

达成期转现协议的双方（必须是法人客户）共同向交易所提出申请，获得交易所批准后，分别将各自持仓按双方达成的平仓价格由交易所代为平仓（现货的买方在期货市场应当持有多头部位，现货的卖方在期货市场应当持有空头部位）。同时双方按达成的现货买卖协议进行与期货合约标的物种类相同、数量相当的现货交换。

- 期转现的价格由两个部分构成——平仓价格、转让价格；
- 平仓价格一般取前一日该品种最近合约的结算价；
- 转让价格=平仓价格±协议升贴水；
- 其中平仓价格的高低无关紧要，因为对买方来说，平仓价格高，盘面得益但转让价格同时增加，对于卖方来说一样；
- 期转现的期限为该合约上市之日起至交割月份前一个月倒数第三个交易日（含当日）。在期限日期的每个交易日的 11:30 之前向交易所提交期转现申请。（由于系统的录入和手续传递需要时间，客户需提前申请）
- 交易双方达成现货买卖协议后，应向交易所提交下述材料：
  - （一）期转现申请；
  - （二）现货买卖协议；
  - （三）相关的货款证明；
  - （四）相关的标准仓单、入库单、存货单等货物持有证明。
- 买方提交期转现申请前应当保证可用资金大于等于除保证金占用以外的剩余货款，货款不足的不予批准或者办理。
- 期转现批准日结算时，交易所将交易双方的期转现持仓按协议价格进行结算处理，产生的盈亏计入当日平仓盈亏。
- 增值税专用发票由卖方客户向买方客户按照双方商定的转让价格开具。

期货转现货业务具有很方便的期货合约变现能力，客户可以委托期货公司去寻找匹配方，而不必总是等到合约到期交割变现。

## 十九、相关费用

品种	交割单位	交割手续费	仓储费	入库费	出库费	检验费用
JD	5 吨	1 元/吨	6 元/吨/天	施行最高限价标准 (0-80 元/吨) 具体标准参照交易所网站 内容	施行最高限价标准 (30-80 元/吨) 具体标准参照交易所网站 内容	与质检机构 商定

## 免责声明

本交易备查中信息均来源于交易所公开资料，我公司对这些信息的准确性和完



整性不作任何保证。

国联期货