

苹果期货（AP） 交割业务手册



目录

一、 苹果基本参数.....	3
1.1 合约参数.....	3
1.2 限仓标准.....	4
二、 交割基础知识.....	4
2.1 交割概念.....	4
2.2 交割条件.....	4
2.3 交割单位.....	5
2.4 交割方式.....	5
三、 交割商品的要求.....	5
3.1 基准交割品的质量标准.....	5
3.2 替代交割品及其升贴水.....	6
3.3 苹果入出库硬度指标.....	6
3.4 包装要求.....	6
四、 交割流程.....	7
4.1 滚动交割.....	7
4.2 集中交割.....	8
4.3 车船板交割.....	9
4.4 期转现交割.....	13
4.5 交割票据流转.....	14
五、 交割违约.....	15
六、 交割费用.....	15
6.1 苹果交割相关费用.....	16
6.2 车（船）板交割服务费.....	16
6.3 装果容器使用费.....	16
6.4 苹果期货检验费用.....	17
七、 仓单业务.....	17
7.1 仓单注册业务.....	18
7.2 仓单注销业务.....	20
7.3 仓单转让业务.....	21
7.4 仓单质押、折抵业务.....	22
八、 套保申请.....	23
8.1 套保申请流程.....	23
8.2 套保额度种类.....	23
8.3 申请时间.....	24
8.4 申请材料.....	25
8.5 审核时间.....	26
8.6 注意事项.....	26
九、 仓库名录.....	26
9.1 指定交割仓库.....	26
9.2 指定交割厂库.....	26
9.3 车船板交割服务机构.....	28
十、 质检机构.....	29

一、苹果基本参数

1.1 合约参数

交易品种	鲜苹果（简称“苹果”）
交易单位	10 吨/手
报价单位	元（人民币）/吨
最小变动价位	1 元/吨
每日价格波动限制	上一交易日结算价±5%及《郑州商品交易所期货交易风险控制管理办法》相关规定
最低交易保证金	合约价值的 7%
合约交割月份	1、3、4、5、10、11、12 月
交易时间	每周一至周五（北京时间 法定节假日除外） 上午 9：00-11：30，下午 1：30-3：00 及交易所规定的其他交易时间
最后交易日	合约交割月份的第 10 个交易日
最后交割日	仓单交割：合约交割月份的第 13 个交易日 车（船）板交割：合约交割月份的次月 10 日
交割品级	见《郑州商品交易所鲜苹果期货业务细则》
交割地点	交易所指定交割地点
交割方式	实物交割
交易代码	AP
上市交易所	郑州商品交易所
仓单性质	非通用仓单、仓库及厂库仓单
仓单有效期	每年 3 月第 15 个交易日之前（含该日）注册的苹果仓库标准仓单，应当在当年 3 月的第 15 个交易日之前（含该日）全部注销；每年 3 月第 16 个交易日（含该日）至 9 月最后一个交易日（含该日）不受理苹果仓库标准仓单注册申请。 每年 1 月、5 月第 15 个交易日之前（含该日）注册的苹果厂库标准仓单，应当在当年 1 月、5 月的第 15 个交易日之前（含该日）全部注销；每年 5 月第 16 个交易日（含该日）至 9 月最后一个交易日（含该日）不受理苹果厂库标准仓单注册申请。
预报定金	30 元/吨

交割结算价	滚动交割结算价为期货合约配对日（含该日）前 10 个交易日交易结算价的算术平均价。 集中交割结算价为期货合约最后交易日（含该日）前 10 个交易日交易结算价的算术平均价。
交割基准价	基准交割品在基准交割服务机构或者基准仓库散果出库时汽车板交货的含税价格（不含包装）。

注：1、自进入交割月第一个交易日起，自然人客户不得开新仓，交易所有权对自然人客户的交割月份持仓予以强行平仓。自然人客户持仓进入交割月被交易所执行强平的，交易所依据规则给予相关客户纪律处分。

2、交易所可以根据市场情况调整各合约涨跌停板幅度和交易保证金标准。

1.2 限仓标准

交易时间段	非期货公司会员和客户的最大单边持仓量(手)
自合约挂牌至交割月前一个月第 15 个日历日期期间的交易日	1000
自交割月前一个月第 16 个日历日至交割月前一个月最后一个日历日期期间的交易日	200
交割月份	20（自然人客户最大单边持仓量为 0）

注：限仓是指交易所规定会员或者客户按单边计算的、可以持有某一期货合约投机持仓的最大数量。

二、交割基础知识

2.1 交割概念

期货交割是指期货合约到期时，按照交易所的规则和规定程序，交易双方通过该期货合约标的物所有权的转移，了结到期未平仓合约的过程。苹果期货交割为实物交割。

2.2 交割条件

- 不能交付或者接收增值税专用发票或农产品销售发票的客户不得交割；
- 客户的期货交割须由会员办理，并以会员名义在交易所进行，交割结果由客户承担。
- 交割配对时，买方交割客户须准备足够的交割货款，卖方交割客户须准备足够的可供交割的仓单或车（船）板货物。

注意：小规模纳税人能参与交割。根据财税[2017]37号文：《关于简并增值税税率有关政策的通知》“从按照简易计税方法依照 3%征收率计算的缴纳增

值税的小规模纳税人取得增值税专用发票的，以增值税专用发票上注明的金额和11%的扣除率计算进项税额。

2.3 交割单位

苹果期货的交割单位为10吨（对应1手期货合约）

2.4 交割方式

郑商所期货交割可分为仓库交割、厂库交割和车（船）板交割。其中仓库交割和厂库交割属于标准仓单交割，交割参与品为符合交割要求的基准品或替代品在仓库或厂库注册生成的仓单；车（船）板交割属于直接货物交收，卖方在交易所指定交割计价点将货物装至买方汽车板、火车板或轮船板。

苹果期货适用期货转现货、仓库标准仓单交割、厂库标准仓单交割和车（船）板交割。根据交割时间不同可分为以下三种模式：

1、滚动交割

自进入交割月第一个交易日起至最后交易日的前一交易日（**苹果的最后交易日为交割月第十个交易日，配对方式为响应配对和组织配对**），持有交割月合约且持有标准仓单的卖方可在每个交易日下午2时30分之前，通过会员提出交割申请，经买方响应后进行确认配对，并最终在规定时间内完成交割。未得到买方响应的，卖方可于申请当日下午2时30分之前撤销交割申请；没有撤销的，由交易所系统判为作废。

2、集中交割

对于同一会员同一交易编码客户所持有的某交割月买卖持仓，若客户未提出不自动平仓申请，则最后交易日闭市后，其相对应部分买卖持仓由交易所系统自动平仓，平仓价按当日结算价计算；其他未平仓合约，一律视为交割合约，进入集中交割。

3、期转现交割

期转现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。期货合约自上市之日起到该合约最后交易日期间，均可进行期转现，双方达成协议后，在每个交易日的下午2时30分之前向交易所提交期转现申请，交易所批准后，按买卖双方达成的平仓价格平仓并进行相应的货、款流转。

三、交割商品的要求

3.1 基准交割品的质量标准

项目	基准品质量标准
等级	符合《中华人民共和国国家标准 鲜苹果》（GB/T 10651-2008）一等及以上等级质量指标

果径	≥80mm
品种	红富士苹果
果径容许度	≤5%
质量容许度	≤20%（虫伤计入质量容许度）
磨伤、碰压伤、刺伤不合格果之和占比	不做要求
可溶性固形物	≥12.5%

3.2 替代交割品及其升贴水

(1) 符合《中华人民共和国国家标准 鲜苹果》(GB/T 10651-2008) 一等级及以上等级质量指标且果径≥80mm 的红富士苹果。其中，果径容许度≤5%，20% < 质量容许度 ≤ 25%（虫伤计入质量容许度，磨伤、碰压伤、刺伤不合格果之和占比不做要求），可溶性固形物≥12.5%，贴水 500 元/吨。

(2) 符合《中华人民共和国国家标准 鲜苹果》(GB/T 10651-2008) 一等级及以上等级质量指标且 75mm ≤ 果径 < 80mm 的红富士苹果。其中，果径容许度 ≤ 5%，质量容许度 ≤ 20%（虫伤计入质量容许度，磨伤、碰压伤、刺伤不合格果之和占比不做要求），可溶性固形物 ≥ 12.5%，贴水 1500 元/吨。

(3) 符合《中华人民共和国国家标准 鲜苹果》(GB/T 10651-2008) 一等级及以上等级质量指标且 75mm ≤ 果径 < 80mm 的红富士苹果。其中，果径容许度 ≤ 5%，20% < 质量容许度 ≤ 25%（虫伤计入质量容许度，磨伤、碰压伤、刺伤不合格果之和占比不做要求），可溶性固形物 ≥ 12.5%，贴水 2000 元/吨。

未发生褐变的水心病苹果不计入不合格果。

苹果期货替代交割品升贴水

序号	指标	升水替代 品(元/吨)	基准品	贴水替代品(元/吨)		
1	类别	/	果径 80, 容 许度 20	果径 80, 容许度 25	果径 75, 容许度 20	果径 75, 容许度 25
	升贴水	/	0	-500	-1,500	-2,000

3.3 苹果入出库硬度指标

(1) 苹果入库硬度不得低于 7kgf/cm²;

(2) 每年 10 月 1 日至次年 2 月 10 日（含该日）出库的苹果，硬度不得低于 6.2kgf/cm²；其他时间出库的苹果，硬度不得低于 6kgf/cm²。

苹果车(船)板交货时，按照本条规定的出库硬度指标执行。

3.4 包装要求

- 同一客户同一批次交割的苹果，装果容器要求规格统一。
- 苹果入库时的装果容器采用塑料筐或者木（铁）筐。

四、交割流程

4.1 滚动交割

- 滚动交割：交割月第一个交易日起至最后交易日前一交易日。卖方可在每日下午 2:30 之前，通过会员的服务系统提出申请，有买方响应后即可进入交割环节，当日即为配对日。
- 苹果可适用标准仓单交割和车（船）板交割。标准仓单交割流程如下：

日期	卖方	买方
临近交割月	1、有交割月份 AP 的相应卖持仓 2、有足够的可用 AP 仓单	1、有交割月份 AP 的相应买持仓 2、保证金账户有足够的资金覆盖交割货款
第一交割日 配对日	1、14:30 之前，卖方根据交割意向提交滚动交割意向书，写明需要卖出交割的仓单信息。 AP 仓单为非通用仓单，需在意向书中注明仓单编号。 （滚动交割仓单需为流通仓单，质押仓单需提前解押，期货持仓需为单向卖持仓） 2、会员代客户挂出仓单信息。 3、得到响应的申请则配对成功；未得到响应的申请可在 14:30 前撤销；14:30 后未得到响应或未撤销的申请判废。 4、卖方配对成功后，其相应的标准仓单予以冻结，相应的交割保证金予以释放，收取交割手续费。	1、买方客户提交滚动交割意向书及开票资料。AP 仓单为非通用仓单，需在意向书中注明仓单编号。 2、会员代客户选择仓单。 3、买方确认后进入配对交割，并确保保证金账户资金覆盖货款，若资金不足需及时入金补足。结算后冻结相应货款。 4、配对后，结算时收取客户交割手续费。 注意：未得到买方会员响应的交割申请，交易所通过计算机系统，先按照“建仓时间最早的法人持仓优先”原则，确定参与配对的买方持仓后予以配对， 有强制配对风险。
第二交割日	通过交易所会员服务系统收取《交割通知单》，接收买方增值税发票开票信息。	通过交易所会员服务系统收取《交割通知单》。
第三交割日	1、结算时收取 80% 货款，余款在买方收到发票确认后结清。 2、依据《交割结算清单》及买方开票资料开具发票，先验票后邮寄。	9:30 之后，客户收到相应的仓单，可办理后续仓单业务（注销、仓转等）。结算时，从保证金账户扣除 100% 货款，并同时释放保证金，交割结束。
· · · ·		

发票流转	1、自第三交割日（不含该日）起 7 个工作日内，卖方客户应当提交增值税专用发票或者农产品销售发票。 2、发票流转完成后，卖方客户收到剩余 20% 货款，交割结束。	1、配对日后的一个工作日内，买方客户应按照税务机关的规定将开具增值税发票所需的具体信息通知卖方。 2、买方会员应在收到卖方会员转交的增值税专用发票或者农产品销售发票两个工作日内（含该日），对发票进行确认。
-------------	--	---

4.2 集中交割

- 集中交割是指在合约最后交易日闭市后，交易所组织所有未平仓合约持有者进行的交割。
- 苹果可适用标准仓单交割和车（船）板交割。标准仓单交割流程如下：

日期	卖方	买方
最后交易日前	1、有交割月份 AP 的相应卖持仓 2、有足够的可用 AP 仓单（自交割日最后交易日下午 3 时起，交易所不再受理仓库提出的用于当月交割的仓库仓单注册申请。）	1、有交割月份 AP 的相应买持仓 2、保证金账户有足够的资金覆盖交割货款
最后交易日	1、卖方客户提交交割意向书，写明需要卖出交割的仓单信息。AP 仓单为非通用仓单，需在意向书中注明仓单编号。 2、由会员代为提交仓单到交易所冻结仓单（交割仓单需为自由仓单，质押仓单需提前解押），结算时释放卖方交割保证金。（如果未冻结仓单则不释放卖方交割保证金） 3、闭市后，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，平仓价按当日结算价计算。	1、买方客户提交交割意向书及开票资料，交割意向书至少写明两个顺序意向，方便会员挑选仓单。 2、闭市后，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，平仓价按当日结算价计算。 3、结算后冻结相应货款。
第一交割日	闭市前会员按照客户指定的仓单编号公布卖交割的仓单。（本日为卖方提交仓单最后期限）	闭市后会员把卖方提交的仓单情况发给买方，买方提交交割意向
第二交割日 配对日	1、结算时，交易所按买卖双方确认结果进行配对，其他仍未配对的持仓，由计算机按数量取整、最少配对数原则予以配对。 2、通过交易所会员服务系统收取《交割通知单》，接收买方增值税发票开	1、买方挑选仓单（注：不一定能满足买方意向）。 2、结算时，交易所按买卖双方确认结果，其他仍未配对的持仓，由计算机按数量取整、最少配对数原则予以配对。

	票信息。	3、通过交易所会员服务系统收取《交割通知单》，传递发票开票信息。
第三交割日	1、结算时，收到 80%货款，余款在买方收到发票确认后结清。 2、依据《交割结算清单》及买方开票资料开具发票，先验票后邮寄。	9:30 之后，客户收到相应的交割仓单，可办理后续仓单业务（注销、仓转等）。结算时，从保证金账户扣除 100%货款，并同时释放保证金，交割结束。
· · · ·		
发票流转	1、自第三交割日（不含该日）起 7 个交易日内，卖方客户应当提交增值税专用发票或者农产品销售发票。 2、发票流转完成后，卖方客户收到剩余 20%货款，交割结束。	1、配对日后的一个工作日内，买方客户应按照税务机关的规定将开具增值税发票所需的具体信息通知卖方。 2、买方会员应在收到卖方会员转交的增值税专用发票或者农产品销售发票两个工作日内（含该日），对发票进行确认。

注意事项：

（1）郑商所标准仓单（简称仓单）分为通用仓单和非通用仓单。通用仓单在流通时代表同一品质的货物，可以在任一仓库提货任一品牌，其升贴水在仓单注册注销时划转；非通用仓单在流通时代表的货物品质不一，只能在指定仓库指定垛位提货，其升贴水同货款一起结算。

（2）当客户持有同一交割月合约买卖持仓时，可申请不对冲平仓，双向持仓进入交割；客户未提出不自动平仓申请，则最后交易日闭市后，其相对应部分买卖持仓由交易所自动平仓，平仓价按当日结算价计算。

（3）卖方客户的仓单必须为可用状态才能提出交割申请，若为质押或折抵状态须先解除质押或折抵。买方客户根据市场信息挑选仓单时，交易所依据买卖双方相对应的持仓量、买卖双方确认申请量和卖方持有标准仓单量，取最小数进行配对。

（4）交割货款的计算： $(\text{交割结算价} + \text{非通用仓单升贴水}) \times \text{交割数量} \times \text{交易单位}$ ，买方客户最迟需在配对日收盘前将所需货款划入会员保证金账户，因货款未及时到账而造成的违约情况将由买方客户自行承担。

4.3 车船板交割

1. 概念

（1）交割地点为交易所指定交割计价点或者卖方货物所在地；

(2) 交割方式是卖方将货物直接装至买方汽车板、火车板或轮船板来完成货物交收；

(3) 买卖双方责任是以货物装上买方车（船）板为界，实现货物的所有权和风险转移，各自承担对货物的数量、质量责任。

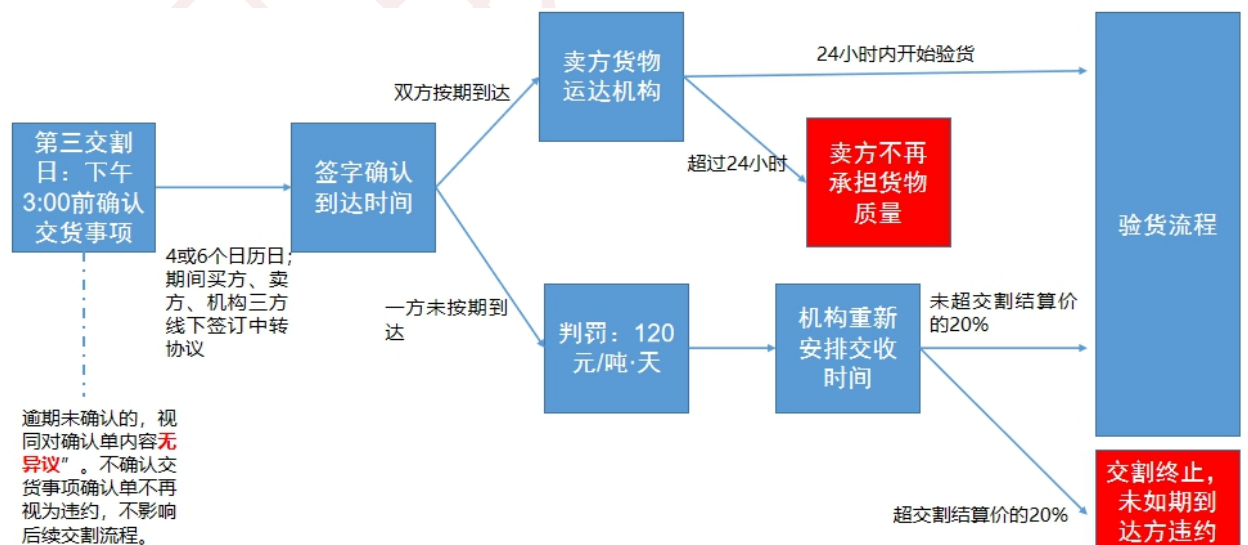
2. 交割特点

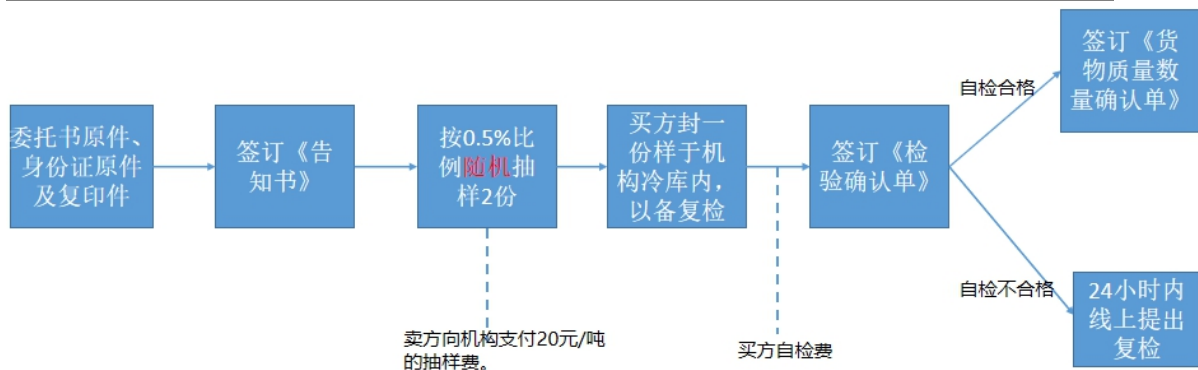
- 买卖双方直接见面交割。
- 买卖双方责任各自分担。
- 买卖双方先交割后划款。
- 交货地点由双方协商确定。

3. 卖方交割条件要求

- 卖方拟在货物存放地点开展车船板交割时，货物存放地点应具备以下条件：
 - （一）交通便利，核定载重 30 吨货车能够顺畅通行；
 - （二）计量设施完好，计量衡器应经具有国家认可资质的技术监督部门鉴定合格，且在鉴定的有效期内，计量衡器最大称重不低于 60 吨；
 - （三）装运能力强，发货速度不低于 300 吨/天（双方另有约定的除外）；
 - （四）具备开展期货交割质量检验的检化验设备，检化验设备符合国标检验规定，且运行良好。
- 卖方货物存放地点不具备以上条件的，卖方须承担由此产生的相应责任。

4. 车船板交割流程





- 苹果车（船）板卖方提出交割申请时，应当同时提交相应的拟交割货物信息，包括：品种、果径、等级、质量容许度、数量、交割服务机构等。
- 第三交割日下午 3 时前，苹果买卖双方通过会员在会员服务系统确认《车（船）板交货事项确认单》，逾期未确认的，视为对确认单内容无异议。
- 苹果在交割服务机构进行交割。买卖双方达成协议的，可以按照协议里约定的地点进行交割；未达成协议的，买方可以在《车（船）板交货事项确认单》中选择交割服务机构进行交割，卖方应当按买方的要求交付货物。苹果期货 10 月合约的买卖双方，应当在第三交割日之后（不含该日）第 6 个日历日进行货物交收；苹果期货 10 月合约之外其他交割月份合约的买卖双方，应当在第三交割日之后（不含该日）第 4 个日历日进行货物交收。苹果卖方未在货物交收日下午 1 时 30 分之前将货物运达交割服务机构或者买方未按时到场监收的，视为未按规定时间交收货物，新的交收时间由交割服务机构根据自身服务能力重新确定并通知买卖双方。当日交收量或者交收客户数超过交割服务机构每日最大可交割数量或者每日最大服务客户数的，交割服务机构可以根据自身服务能力调整交收时间，并通知买卖双方。交割服务机构的每日最大可交割数量、每日最大服务客户数由交易所另行公布。
- 苹果买方应当在卖方货物到达交割服务机构后 24 小时内完成货物质量检验，并在质量验收确认后 24 小时内装车发运。买方在规定的时间内因自身原因不能装车发运的，卖方不再承担该批货物的质量责任。质量验收完成后，买卖双方签署《质量验收确认单》，作为交割货物质量判定及升贴水处理的依据。
- 苹果买卖双方发生质量争议的，应当协商解决；协商不一致的，应当在货物未离开指定车（船）板交割场所的情况下向交易所提出复检申请，并说明需要复检的质量指标。复检机构由交易所在指定质检机构中确定。复检机构应当在收到交易所复检通知之日起（不含该日）5 个工作日内做出复检结果，复检结果作为解决争议的依据。复检结果中，质量容许度等级高于或者等于车（船）板货物信息标示等级的，以车（船）板货物信息标示的等级为准，由此产生的复检及相关费用由复检申请方承担；质量容许度等级低于车（船）板货物信息标示等级，但在交割标准允许范围以内的，以复检结果确定的等级为准，买方应当接受，由此产生的复检及相关费用由卖方承担，卖方对买方按照交易所规定的升贴水标准进行补偿。除前款规定的情形之外，复检结果符合交割质量标准的，复检及相关费用由复检申请方承担；复检结果不符合交割质量标准的，复检及相关费用由卖方承

担。复检费用应当在复检结果出具之日起（不含该日）2个工作日内通过交割服务机构支付。

- 苹果货物发运时，买方应当到场验收并监装、监运，卖方应当安排足够人力、设备，确保正常发货。苹果重量验收采用发货地抽筐（箱）检斤或者双方认可的其他计量方式验重。采用抽筐（箱）检斤方式的，苹果重量 = （抽取苹果总毛重 - 抽取装果容器的总重量）/ 抽取件数 × 货物件数。货物发运完毕后，根据每天双方签字确认的交接过磅码单，经核准累计后确认货物重量。**买卖双方签署《重量验收确认单》，作为交割货物重量的判定依据。**买卖双方有权对计量衡器的准确性进行确认。对计量衡器的准确性有异议的，应当停止交接货物，并书面通知交易所，由交易所组织国家计量技术监督部门现场检测，差旅费、交通费、检测费等相关费用由过错方承担。
- 苹果交收时，买卖双方未按规定时间交收货物，造成延误的，买卖双方协商解决；协商不成的，守约方可以向交易所提出补偿申请，并提交相应证据。交易所核实后，对过错方扣罚滞纳金补偿给守约方。滞纳金金额 = $\sum [120 (\text{元/吨} \cdot \text{天}) \times \text{延误天数} \times \text{应发} (\text{收}) \text{而未发} (\text{收}) \text{商品数量}]$ 。滞纳金扣罚总额不超过合约价值的 20%，合约价值按照该批商品的交割结算价计算。因不可抗力因素导致无法按计划发货或者提货的，发货或者提货时间可以顺延。
- 苹果买卖双方确认货物质量、重量后，在货款划转时，通过会员服务系统选择货款结算方式。

5. 车船板交割结算流程

(1) 第三交割日上午 9 时之前，买方会员应当将 100% 货款（不含买方保证金）划入交易所账户。

(2) 自第三交割日起，买卖双方在交易所规定时间内对车（船）板交割货物的交收事宜进行协商，办理交收。车（船）板交割货物交收具体事宜见相关品种期货业务细则有关规定。

(3) 配对后至最后交割日次日，交易所按双方确认情况进行结算。

买卖双方委托交易所结算，且在相关品种合约规定的最后交割日之前全部货物交收完毕的，买方或者卖方一次性提交此次交割货物数量、质量、增值税专用发票（普通）发票流转及应划转货款等信息，对方应当在当日内进行确认，若有异议，应当在提交信息之日起（含该日）三个交易日内提交有效证明。逾期未提交有效证明的，计算机系统将按照发起方提交的信息自动确认。交易所按双方确认结果进行资金划转，释放买卖双方的剩余资金。

在最后交割日仍没有全部货物交收完毕的，按照以下方式处理：

1. 卖方按照约定或者正常速度发货但仍未完成全部货物交收的，可以延期交收，买方不得拒绝。待货物交收完毕后，按照规定流程予以划款；

2. 一方未按照约定或者正常速度完成全部货物交收的，另一方可以申请终止交收。守约方通过会员服务系统提交《终止交收申请书》及相关证据，过错方在两个工作日内予以确认，逾期不予确认且未提出异议的，视为确认。交易所与卖方结清已发运部分的货款，剩余货款返还给买方。其余未交收部分双方可以协商

另行交收，协商不成的，按过错方交割违约处理。

买卖双方不委托交易所结算的，交易所退还买卖双方交易保证金和买方货款。买卖双方终止交割。

4.4 期转现交割

期转现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。

期转现交割分为标准仓单期转现和非标准仓单期转现。标准仓单期转现仓单通过交易所转让，货款可选择通过交易所结算或自行结算；非标准仓单期转现货权和货款均由买卖双方自行转让，需提供相关现货买卖协议。

日期	卖方	买方
提出期转现申请之前	1、有期转现合约AP的相应卖持仓 2、有足够的可用AP仓单或现货	1、有期转现合约AP的相应买持仓 2、保证金账户有足够的资金覆盖交割货款
期转现申请日，即审批日/平仓日（T日）	1、卖方客户提交《期货转现货协议（审批）表》，写明需要平仓的期货合约及平仓价格，卖出期转现的仓单信息及转让单价，货款结算方式等。AP仓单为非通用仓单，需在授权书中注明仓单编号 2、上午9时至下午2时30分之间通过会员提出卖出期转现申请。 3、闭市后，交易所按协议平仓价格进行平仓，收取交易手续费。 4、非标准仓单期转现时，客户在授权书中无需写明仓单信息但需额外提供相关现货买卖协议，货物交收和货款划转由买卖双方自行协商确定，由此产生的纠纷自行解决，交易所不承担责任。闭市后交易所代为平仓。	1、买方客户提交《期货转现货协议（审批）表》，写明需要平仓的期货合约及平仓价格，买入期转现的仓单信息及转让单价，货款结算方式等。AP仓单为非通用仓单，需在授权书中注明仓单编号。 2、上午9时至下午2时30分之间通过会员提出买入期转现确认，若通过交易所结算货款，在业务确认之前会员先行冻结相应货款金额的保证金。 3、闭市后，交易所按协议平仓价格进行平仓，收取交易手续费。 4、非标准仓单期转现时，客户在授权书中无需写明仓单信息但需额外提供相关现货买卖协议，货物交收和货款划转由买卖双方自行协商确定，由此产生的纠纷自行解决，交易所不承担责任。闭市后交易所代为平仓。
申请日次日，即交收日（T+1日）	标准仓单期转现时： 1、仓单：从卖方客户划转仓单至买方客户 2、货款：通过交易所结算时，结算时收到80%或100%货款，并收取仓转手续费；不通过交易所结算时，客户自行划转货款。	标准仓单期转现时： 1、仓单：早上9:30之后买方客户收到仓单 2、货款：通过交易所结算时，结算时划转100%货款并收取仓转手续费；不通过交易所结算时，客户自行划转货款。

注意事项:

(1) 通过交易所结算时客户可选择 80% 货款划转或者 100% 货款划转。100% 货款划转时，卖方客户在交收日收到 100% 货款；80% 货款划转时，卖方客户在交收日收到 80% 货款，其余 20% 货款在发票流转完成后收到。

(2) 期转现货款的计算：转让单价×转让数量。若通过交易所结算，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。

(3) 期货合约自上市之日起至该合约最后交易日期间，可以进行期转现。买卖双方可以通过交易所会员服务系统发布期转现意向。持有同一交割月份合约的买卖双方达成协议后，可以在每个交易日下午 2 时 30 分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）

(4) 买卖双方达成的平仓价格应当在审批日合约价格限制的范围内。

(5) 期转现平仓日收取交易手续费，交收日若通过交易所结算则收取仓转手续费，不通过交易所结算就不收取费用。

(6) 增值税专用发票由卖方客户向买方客户按照双方商定的交货价格开具（由仓单转让结算清单作为依据）。期转现发票流转参照交割发票流转。

4.5 交割票据流转

- 苹果期货交割开具增值税专用发票或者农产品销售发票。
- 期货交割由交割卖方向对应的买方开具增值税专用发票或者农产品销售发票。发票由双方会员协助客户直接联系、办理发票交收。双方会员负责调解、处理相关纠纷。
- 配对日后的一个工作日内，买方应按照税务机关的规定将开具增值税发票所需的具体信息通知卖方。自第三交割日（不含该日）起超过 7 个交易日，买方会员仍未提供有关资料的，交易所划转剩余 20% 货款至卖方会员，由此造成的后果由买方自负。
- 标准仓单交割的，自第三交割日（不含该日）起 7 个工作日内，卖方应当提交增值税专用发票。延迟 1 至 10 个日历日的，卖方会员应当每天支付货款金额 0.5% 的滞纳金；超过 10 个日历日仍未提供增值税专用发票的，视为拒绝提供增值税专用发票，卖方会员应当按照货款金额的规定比例支付违约金。各品种违约金比例按照国家税务部门公布的增值税税率执行。滞纳金或者违约金从货款余额中扣除，补偿给买方会员，剩余货款属于卖方会员。卖方会员先行支付滞纳金或者违约金的，有权向客户追偿。
- **车（船）板交割的，卖方应在交货完毕后 7 个工作日内或者合同约定的时间向买方交付增值税专用发票或农产品销售发票。**
- 买方会员应在收到发票两个工作日内（含该日），对发票进行确认。
- 因买方提供资料有误，致使发票作废的，买方责任自负；买方提供资料延迟的，卖方提供发票的时间可以顺延。自第三交割日（不含该日）起超过 7 个交易日，买方仍未提供有关资料的，交易所划转剩余 20% 货款至卖方会员，由此造成的后果由买方自负。

五、交割违约

交割违约	卖方	买方
违约原因	1、规定期限内，卖方未能如数交付标准仓单或者未能如数交付实物的。 2、车（船）板卖方交割的货物质量不符合交割质量规定的。 3、第三交割日起（含该日）第3个交易日，卖方在当日下午3时前未确认《车（船）板交货事项确认单》。	1、规定期限内，买方未能如数解付货款的。 2、第三交割日起（含该日）第3个交易日下午1时30分前，买方未通过会员在会员服务系统提交《车（船）板交货事项确认单》。
违约合约数量计算	$\text{卖方交割违约合约数量（手）} = [\text{应交标准仓单数量（张）} - \text{已交标准仓单数量（张）}] \times \text{交割单位（吨/手）} \div \text{交易单位（吨/手）}$	买方接到的仓单为完税标准仓单的，买方交割违约合约数量（手）= [应交货款（元）- 已交货款（元）] ÷ (1-20%) ÷ [交割结算价（元/吨）+ 包装物单价（元/吨）] ÷ 交易单位（吨/手） 买方接到的仓单为保税标准仓单的，买方交割违约合约数量（手）= [保税应交货款（元）- 已交货款（元）] ÷ 保税交割结算价（元/吨） ÷ (1-20%) ÷ 交易单位（吨/手）
违约处理	1、构成交割违约的，由违约方支付违约部分合约价值20%的违约金给守约方，合约价值按交割结算价计算。买卖双方终止交割。 2、买卖双方同时违约的，交易所按终止交割处理，并对双方分别处以违约部分合约价值5%的罚款。 3、部分交割违约的，违约客户所接标准仓单或者所得货款可以用于违约处理。	

六、交割费用

- 苹果期货标准仓单对应货物运达仓库指定货位前的一切费用和货物装到汽车板的出库费用由标准仓单注册人承担，货物出库装到汽车板后的一切费用由提货人承担。
- 苹果期货车（船）板交割中，货物自交割服务机构或者双方协商的其他交割地点装至车（船）板之前的一切费用（不含包装）由卖方客户承担，之后的一切费用由买方客户承担。双方协商买方自行提货或者卖方送货的，可以根据距离交割服务机构的远近协商各自承担的运费。
- 苹果期货交割手续费、仓储费、出入库费、检验费等交割相关费用标准由交易所另行公布。查询方式：

- <http://www.czce.com.cn/cn/jysfw/hyfw/jgywzy/jgfy/webinfo/2021/08/1605595001216922.htm>
- 苹果以散果方式进行交割，买方需要包装物的，包装物由买方自理或者委托他人代办，包装物及包装费用由买方自行支付。

6.1 苹果交割相关费用

项目	费用标准	备注
仓储费	0.5 元/吨·天	苹果期货仓单注册前的费用由客户与仓库结算
交割手续费	0.5 元/吨	
仓单转让、期转现手续费	0.5 元/吨	

注意事项：

(1) 不委托交易所结算的仓单转让和期转现免收手续费，委托交易所结算的仓单转让和期转现按原标准收取手续费；同一客户编码的仓单转让和期转现免收手续费。

(2) 仓储费收取节点：自标准仓单注册之日起至交易所开出《提货通知单》前一日止，交易所代交割仓库收取仓储费，会员在每月第一个交易日从客户的保证金账户按月计算划转上个月发生的仓储费。交易所代收之外的费用，交割仓库直接向货主收取。

(3) 以上均为交割环节中产生的费用，其他还需考虑交割货款和保证金的资金成本、现货运输成本等。

6.2 车（船）板交割服务费

货物状态	费用（元/吨）	备注
已在库货物	0	-
新入库货物	150	包括出入库费及 15 天冷库储存费用

备注：1. 买方验货时发生抽样搬倒的，支付 20 元/吨的抽样搬倒费，费用由卖方承担；发生复检抽样的，费用由过错方承担；

2. 装果容器为中转筐或纸箱的，另加收人工装卸费，费用由各车（船）板交割服务机构公示标准为准，由卖方承担。

交割完成后，买方使用原装果容器的，需支付装果容器使用费（具体见表 2）；需要分拣装箱服务的，收费标准以各车（船）板交割服务机构公示标准为准，费用由买方承担。

6.3 装果容器使用费

装果容器种类	押金	租金
大铁（木）筐	300 元/个	1 元/天/个
中转筐	30 元/个	0.1 元/天/个

备注：使用装果容器至该果季结束（次年 9 月 15 日）仍未归还的，押金可不退

回。

6.4 苹果期货检验费用

项目		收费标准	
检验项目	感官指标	果径	600 元/样
		色泽	
		果形	
		缺陷	
		果梗	
	理化指标	果实硬度	300 元/样
可溶性固形物			
	农药和污染物残留	按照检测单位对外公布的检测项目收费标准计收。	
其他项目	抽样费	500 元/人/天	

备注：委托指定苹果质检机构检验的：
 (1) 差旅费：
 中华全国供销合作总社济南果品研究所
 山东、河南地区：1200 元/人/天 其他地区：1500 元/人/天
 中国检验认证集团河南有限公司、华测检测认证集团股份有限公司
 山东地区：1500 元/人/天 其他地区：1200 元/人/天
 (2) 每个样品最大数量 100 吨，不足 100 吨的按 100 吨计算。
 (3) 郑州商品交易所可根据工作量商质检机构确认检验人员数量。

七、仓单业务

标准仓单是指由仓库或者厂库按照交易所规定的程序提交仓单注册申请后，经交易所注册，可用于证明标准仓单持有人拥有实物或者可予提货的财产凭证。

根据申请注册的主体不同，标准仓单分为仓库标准仓单和厂库标准仓单。根据流通性质的不同，标准仓单分为通用标准仓单和非通用标准仓单。根据期货商品完税状态的不同，标准仓单分为保税标准仓单和完税标准仓单。

苹果期货标准仓单可以分为仓库标准仓单和厂库标准仓单。

苹果期货标准仓单为非通用标准仓单。

	通用仓单	非通用仓单
流通	流通时，不同仓单代表的货物价值一致；在集中买入交割时，仓单由交易所按一定规则分配	流通时，不同仓单代表的货物价值根据货物不同而不同；在集中买入交割时，仓单可先由会员代客户进行挑选，未挑选配对的由交易所按一定规则分配
注销	在库存允许的情况下，可以到标准仓单载明品种所在的任一仓库或者厂库选择提货	只能到标准仓单载明品种所在的仓库或者厂库提取对应货物

升贴水	升贴水在仓单注册、注销时划转，升贴水发票由注册方开给注销方	升贴水包含在货款中，随货款一起开具发票
------------	-------------------------------	---------------------

客户通过仓单注册、仓单转让、仓单交割、仓单期转现等获得仓单后，可授权会员办理仓单转让、仓单质押、仓单折抵、仓单交割、仓单期转现、仓单注销等业务。

7.1 仓单注册业务

仓库标准仓单的生成包括交割预报、入库验收、质量检验、仓库申请注册及交易所办理注册等环节；厂库标准仓单的生成包括厂库申请注册及交易所办理注册等环节。

苹果仓单分为仓库仓单和厂库仓单，其注册流程分别为：

1. 仓库仓单注册

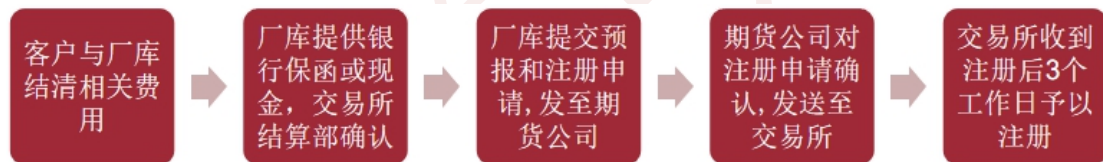


- 货主在入库预报之前可自行先与各交割仓库沟通，确保有库容的情况下再报交割预报，沟通时需将各种由交割仓库直接收取的费用询价，并询问清楚需要提供的单证以及质检方式或者免检要求等。
- 苹果期货交割预报时，应当按 **30 元/吨向仓库交纳交割预报定金**。对已存放在仓库的商品申请期货交割的，仍应提交交割预报，无须交付交割预报定金。相对应数量的商品全部到库的，自商品入库完毕之日起 2 个工作日内，交割预报定金予以返还；部分到库的，按实际到货量返还；未到库部分，交割预报定金不予返还。
- 办理完交割预报的货主发货前，须将运输方式、车（船）号、数量、到货时间等通知仓库。
- **苹果仓库开具的《入库通知单》有效期为 15 个日历日。**
- 苹果入库时的装果容器采用塑料筐或者木（铁）筐。
- 苹果入库硬度不得低于 7kgf/cm²。
- 苹果入库时，仓库对入库商品进行重量验收。苹果重量验收采用抽筐检斤方式。苹果重量=（抽取苹果总毛重—抽取装果容器的总重量）/抽取件数×货物件数。
- 苹果入库质量检验由指定质检机构负责，检验费用由标准仓单注册人承

担。入库苹果符合交割质量标准且质量容许度 $\leq 15\%$ 的，可以申请注册标准仓单。苹果抽样检验按每 100 吨一个样品抽取；不足 100 吨的，按 100 吨计。取样重量不低于总重量的 5%。指定质检机构应当于样品检验结束之日起（不含该日）3 个工作日内出具检验结果，并及时通知仓库。标准仓单注册人或者仓库对入库质量检验结果有异议的，可以向交易所提出复检申请。

- 苹果重量验收及入库采样时，标准仓单注册人应当到场监督。仓库和标准仓单注册人应当对验收结果签章确认，并共同对入库商品的真实性负责；入库商品未经仓库、标准仓单注册人签章确认的，不得用于期货交割。苹果入库后，仓库应当对标准仓单注册人的名称、联系人及联系方式、商品数量、存放库房及垛位等事项登记造册，并由标准仓单注册人签字确认。
- **苹果仓库标准仓单对应商品出库后，不得再次注册标准仓单。**
- 自出具或者接到质检机构的检验结果之日起 1 个工作日内，仓库对检验结果进行确认并通知货主。对于质量符合交割规定的货物，货主无异议的，自通知货主之日起 2 个工作日内，仓库应当向交易所申请注册仓库仓单。
- 自交割月最后交易日下午 3 时起，交易所不再受理仓库提出的用于当月交割的仓库仓单注册申请。该日下午 3 时以后的注册申请所形成的标准仓单可以参与后续月份交割。

2. 厂库仓单注册



(1) 客户注册

非期货公司成员或客户与厂库结清贷款等费用后，厂库通过交易所仓单系统提交仓单注册申请。

(2) 信用担保

厂库申请仓单注册，必须提供交易所认可的银行履约保函、现金或交易所认可的其他支付保证方式。

(3) 担保金额

厂库提交的保证金数额按照最近交割月合约前一交易日结算价计算。

(4) 注册时间

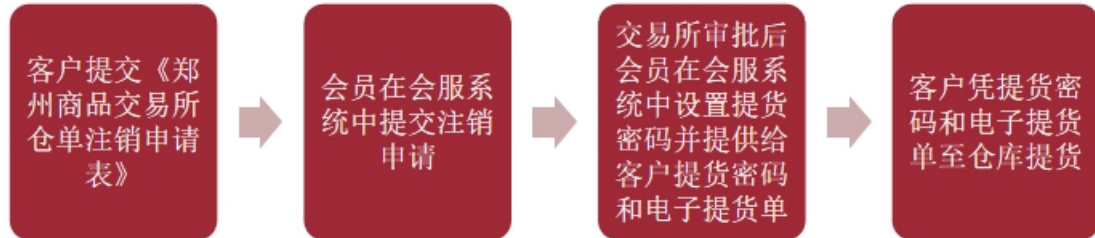
用于当月交割的厂库仓单，厂库最迟应当在合约交割月最后交易日前三个交易日下午 3 时前提交仓单注册申请，之后的不能用于当月交割。厂库提交的担保方式符合规定的，交易所可在自厂库提出仓单注册申请之日起 3 个工作日予以注册。

(5) 调整数额

当商品市值发生较大波动，可要求厂库调整银行履约保函、现金或交易所认可的其他支付保证方式数额。

7.2 仓单注销业务

标准仓单的注销是指标准仓单持有人直接或者委托会员到交易所办理标准仓单提货手续的过程。具体流程如下：



1. 仓库仓单注销

- 苹果仓库标准仓单注销后，提货人应当在交易所开具《提货通知单》之日起 10 个工作日内，凭提货人身份证、提货人所在单位证明及《提货通知单》验证密码到仓库办理提货手续，确认商品质量、运输方式，并预交各项费用。
- 提货人提供运输工具的，自提货人凭《提货通知单》与仓库联系出库事宜、运输工具到达仓库之日起，仓库开始发货，并停止收取已装运货物的仓储费。提货人委托仓库代办运输的，自提货人凭《提货通知单》与仓库联系确认出库事宜、指定运达地点并预交相关费用（包括铁路代办费、港杂费等）之日起，采用汽车、船舶运输的，仓库在 10 个日历日内发货；采用火车运输的，仓库在 20 个日历日内发货。仓库不能在规定时间内发出货物的，不得收取规定时间后产生的仓储费。由于提货人变更发货方式或者发货时间、提货手续不全、费用未按时交纳、特殊要求等原因，致使商品装运推迟的，仓库发货时间不受前款规定限制。
- 标准仓单均具有有效期，需在到期前提起注销。每年 3 月第 15 个交易日之前（含该日）注册的苹果仓库标准仓单，应当在当年 3 月的第 15 个交易日之前（含该日）全部注销；每年 3 月第 16 个交易日（含该日）至 9 月最后一个交易日（含该日）不受理苹果仓库标准仓单注册申请。
- 每年 1 月、5 月第 15 个交易日之前（含该日）注册的苹果厂库标准仓单，应当在当年 1 月、5 月的第 15 个交易日之前（含该日）全部注销；每年 5 月第 16 个交易日（含该日）至 9 月最后一个交易日（含该日）不受理苹果厂库标准仓单注册申请。
- 苹果出库重量验收由仓库和提货人共同实施，具体办法参照入库重量验收规定。苹果出库时数量发生损耗造成短少的，仓库应当及时补足。不能及时补足的，仓库按照《提货通知单》开具日之前（含该日）苹果期货最近交割月最高交割结算价核算短少商品价款，赔偿提货人。
- 苹果出库时，提货人对商品质量有异议的，可以向交易所申请一次复检，并预交复检费用。质量异议应当在《提货通知单》开具之日起 10 个工作日内提出。
- 苹果出库复检结果中，质量容许度等级高于或者等于标准仓单标示等级的，以标准仓单标示等级为准，由此产生的复检及相关费用由复检申请方承担。复检结果中质量容许度等级低于标准仓单标示等级，但在交割标准

允许范围以内的，以复检结果确定的等级为准，提货人应当接受，由此产生的复检及相关费用由仓库承担，仓库对提货人按照交易所规定的升贴水标准进行补偿。

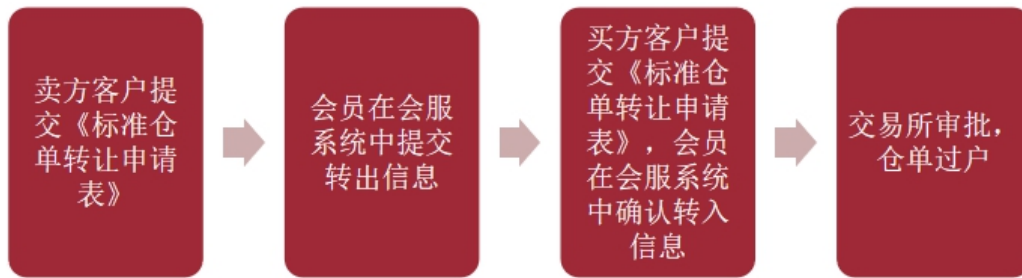
- 每年 10 月 1 日至次年 2 月 10 日（含该日）出库的苹果，硬度不得低于 6.2kgf/cm²；其他时间出库的苹果，硬度不得低于 6kgf/cm²。

2. 厂库仓单注销

- 苹果厂库标准仓单注销后，提货人应当在交易所开具《提货通知单》之日起 10 个工作日内，凭提货人身份证、提货人所在单位证明及《提货通知单》验证密码到厂库办理提货手续，确认商品质量、运输方式，并预交各项费用。提货人办理提货手续时，应当就发货速度及最后完成出库时间与厂库协商一致，协商不成的，厂库应当按照交易所批准的日发货速度发货。
- 厂库应当在提货手续办妥之日起 3 个日历日内开始发货，提货人与厂库协商一致的除外。提货人可以自行到库提货或者委托厂库代为发运。由于提货人变更发货方式或者发货时间、提货手续不全、未按时交纳费用及其他特殊要求等原因，致使发货推迟的，厂库发货时间不受前款规定限制。
- 厂库苹果出库重量验收由提货人与厂库共同实施，以厂库检重为准，足量出库。厂库苹果重量验收采用抽筐（箱）检斤方式。苹果重量=（抽取苹果总毛重—抽取装果容器的总重量）/抽取件数×货物件数。苹果出库重量发生短少的，厂库应当及时补足。不能补足的，厂库应当按照《提货通知单》开具日之前（含该日）苹果期货最近交割月最高交割结算价核算短少商品价款，赔偿提货人。提货人在货物交收时应当到交收地点监发，未到场监发的，视为对货物重量没有异议。
- 厂库应当保证交割商品的质量符合交易所规定的交割标准，双方协商一致的除外。苹果出库时，厂库应当向提货人提供《产品质量证明书》，证明货物符合交割标准。提货人可以到场查验货物质量，厂库应当予以配合。
- 提货人或者厂库对苹果重量、质量有异议的，由提货人和厂库协商解决；协商不成的，可以向交易所申请一次复检，并由申请方预交复检及相关费用。复检申请应当在苹果出库前提出。
- 苹果复检结果中，质量容许度等级高于或者等于标准仓单标示等级的，以标准仓单标示等级为准，复检及相关费用由复检申请方承担。复检结果中质量容许度等级低于标准仓单标示等级，但在交割标准允许范围以内的，以复检结果确定的等级为准，提货人应当接受，由此产生的复检及相关费用由厂库承担，厂库对提货人按照交易所规定的升贴水标准进行补偿。
- 厂库或者提货人因故不能按照约定计划发货或者提货的，双方应当及时协商并妥善调整发货速度或者发货计划，并且过错方应当支付滞纳金。
- 仓单业务办理时间为每个交易日上午 9 时至下午 2 时 30 分。
- 由于苹果仓单为非通用仓单，客户提交苹果业务单据时需写明仓单编号。

7.3 仓单转让业务

客户可以自行协商买卖仓单，授权会员办理仓单转让业务。其转让流程为：



注意事项：

(1) 客户办理仓单转让时可以选择是否通过交易所结算货款。

若通过交易所结算，则在结算时通过保证金账户划转货款，买方客户在申请仓转业务前需确保保证金账户资金可以覆盖货款，我司会在转入确认前冻结客户货款以控制风险，资金不足时不予办理业务。通过交易所结算时客户还可选择80%货款划转或100%货款划转，80%货款划转时卖方客户在仓转当日收到80%货款，剩余20%货款需等至发票流转完成；100%货款划转时卖方客户在仓转当日收到100%货款。若通过交易所结算货款，客户还需支付仓转手续费，苹果的仓转手续费为0.5元/吨（买卖双方均需收取），我司在交易所手续费标准上不加收。

若不通过交易所结算，买卖双方自行划转货款，交易所不收取仓转手续费。

(2) 仓单业务办理时间为每个交易日上午9时至下午2时30分。由于系统的录入和手续传递需要时间，客户需提前申请。

(3) 标准仓单转让的货款划转及增值税专用发票的开具、传递参照《郑州商品交易所期货交割细则》执行。

7.4 仓单质押、折抵业务

1. 质押与折抵的区别

	质押（充抵）	折抵
概念	通过申请仓单充抵可以获得一定额度的保证金用作交易担保	通过申请仓单折抵可以减免与仓单数量相同的卖持仓的保证金
用途	获得的保证金可以开新仓（多、空），但不能作为货款、亏损、手续费等，也不能出金	由近及远减免空头净仓位的保证金，无符合仓位时不减免
金额	最近交割月份合约的前一日结算价×仓单数量×交割单位×0.8，其中0.8为折扣率；质押金额每日根据结算价变动	对应品种相应数量的空头保证金，每日根据结算价和持仓变动，减免的合约数量为空头持仓数量和折抵仓单数量对应手数的较小值
期现	仓单有效期	仓单有效期
要求	客户自有资金与质押资金必须满足1:4的配比关系，同时需承担质押利息	无
流程	1、客户提交《郑州商品交易所客户资产作为保证金专项授权书》；	1、客户提交《郑州商品交易所标准仓单折抵头寸申请表》；

	2、会员在会服系统中提交申请； 3、交易所审批后当日结算时增加质押资金	2、会员在会服系统中提交申请； 3、交易所审批后当日结算时减免空头保证金
解除流程	1、客户补足交易保证金； 2、客户提交《郑州商品交易所标准仓单解除充抵头寸申请表》； 3、会员在会服系统中提交申请； 4、交易所审批后仓单可用，扣除客户质押得到的资金。	1、客户补足交易保证金； 2、客户提交《郑州商品交易所标准仓单解除折抵头寸申请表》； 3、会员实时冻结除客户折抵减免的资金； 4、会员在会服系统中提交申请； 5、交易所审批后仓单可用，结算时冻结取消，保证金加收。

2. 注意事项

(1) 客户办理质押业务时需确保保证金账户中有足够的自有资金用作配比资金，其中配比资金为质押金额的 1/4。

(2) 客户成功申请质押或者折抵业务后，仓单状态为质押或折抵状态，不可用于其他仓单业务。同时客户需承担质押、折抵期间产生的其他费用，如质押利息、标准仓单仓储费等，现行郑商所质押利息为年化 0%。

(3) 每次质押的仓单价值不得低于 10 万元（人民币）。

(4) 客户申请解除质押或折抵时，需先补足对应的交易保证金，再提交相应申请书。资金不足时，业务不予办理。解除成功后，仓单为可用状态，可办理其他仓单业务。

(5) 仓单业务办理时间为每个交易日上午 9 时至下午 2 时 30 分。

(6) 由于苹果仓单为非通用仓单，客户提交苹果业务单据时需写明仓单编号。

八、套保申请

8.1 套保申请流程



8.2 套保额度种类

按套期保值持仓额度使用阶段，套期保值持仓额度分为**一般月份套期保值持仓额度**和**临近交割月份套期保值持仓额度**。按套期保值持仓额度申请和使用方向，套期保值持仓额度分为**买入套期保值持仓额度**和**卖出套期保值持仓额度**。买入套期保值持仓额度可以用于建立期货合约买方向、看涨期权合约买方向、看跌期权合约卖方向的套期保值持仓；卖出套期保值持仓额度可以用于建立期货合约

卖方向、看涨期权合约卖方向、看跌期权合约买方向的套期保值持仓。

8.3 申请时间

一般月份套期保值持仓额度申请方式分为**按合约申请**和**按品种申请**。客户按合约方式申请一般月份套期保值持仓额度的，获批额度只能用于对应合约；客户按品种方式申请一般月份套期保值持仓额度的，获批额度可以用于该品种已挂牌的所有合约。

适用按品种申请一般月份套保额度的参数表

品种	品种代码	套保和投机持仓合计限额	套保持仓限额	投机持仓限额	品种额度是否生效	是否有单独管理按合约申请的合约
甲醇	MA	相应投机限仓标准的 2 倍	获批的套期保值持仓额度	相应投机限仓标准	生效	否
短纤	PF	相应投机限仓标准的 2 倍	获批的套期保值持仓额度	相应投机限仓标准	生效	否
白糖	SR	相应投机限仓标准的 2 倍	获批的套期保值持仓额度	相应投机限仓标准	生效	否
PTA	TA	相应投机限仓标准的 2 倍	获批的套期保值持仓额度	相应投机限仓标准	生效	否

注：1. 按品种方式申请一般月份套期保值持仓额度的，**在全年的任一交易日均可提出，获批额度有效期为获批之日至申请之日下一年度 6 月 30 日之间的交易日。**

2. 按品种申请并获批一般月份套期保值持仓额度的非期货公司会员或者客户，在有效期内该品种已挂牌所有处于一般月份的合约均获得该获批额度。

其他品种适用按合约方式申请一般月份套期保值持仓额度。交易所可以根据市场情况，调整品种适用的一般月份套期保值持仓额度申请方式、使用时间以及获批额度。

按品种方式申请一般月份套期保值持仓额度：在全年的任一交易日均可提出，获批额度自获批之日至申请之日下一年度 6 月 30 日之间的交易日生效。获批一般月份套期保值持仓额度的客户，在该品种已挂牌的所有合约获得数量相等的一般月份套期保值持仓额度。一般月份套期保值持仓额度使用时间为期货合约挂牌至交割月前一个月第 15 个日历日之间的交易日。

按合约方式申请一般月份套期保值持仓额度：在合约挂牌至交割月前一个月的第 5 个日历日之间的交易日提出。客户可以一次申请多个合约的一般月份套期保值持仓额度。一般月份套期保值持仓额度使用时间为期货合约挂牌至交割月前一个月第 15 个日历日之间的交易日。

临近交割月份套期保值持仓额度：合约交割月前二个月第 15 个日历日至交割月前一个月第 20 个日历日之间的交易日提出。临近交割月份套期保值持仓额度使用时间为交割月前一个月第 16 个日历日至合约最后交易日。

8.4 申请材料

• 一般月份额度申请：

- 1、《郑州商品交易所一般月份套期保值持仓额度申请表》；
- 2、企业营业执照副本（复印件）；
- 3、企业现货经营情况及套期保值交易方案（主要内容包括风险来源分析、保值目标、预期交割或平仓的数量）；
- 4、情况说明 word 版（主要内容包含企业注册成立时间，主要股东情况，注册资本、住所，经营范围；实控关系介绍；经营业绩情况，采购、销售、生产总量；套期保值交易方案内容）；（非必须）
- 5、证明企业现货经营规模的相关材料，如当年或者下一年度生产计划书、最新经审计的年度财务报表、现货仓单、库存证明、加工订单、购销合同、拥有实物的其他有效凭证等；（非必须）
- 6、交易所要求的其他证明材料。

• 临近交割月份额度申请：

- 1、《郑州商品交易所临近交割月份套期保值持仓额度申请（审批）表》；
- 2、企业营业执照副本（复印件）。
- 3、企业现货经营情况及套期保值交易方案（主要内容包括风险来源分析、保值目标、预期交割或平仓的数量）；
- 4、情况说明 word 版（主要内容包含企业注册成立时间，主要股东情况，注册资本、住所，经营范围；实控关系介绍；经营业绩情况，采购、销售、生产总量；套期保值交易方案内容）。
- 5、根据不同客户性质提供如下材料：

按客户性质分类	买方提供资料	卖方提供资料
生产类	上一年度生产计划书。可用经审计的往年资产负债表、利润表、报表说明替代。	上一年度生产计划书； 卖出套保需提供本次保值额度所对应的现货仓单或拥有实物的其他凭证（购销合同或发票）、合同清单。可用经审计的往年资产负债表、利润表、报表说明替代。
加工类	上一年度生产计划书、本次保值额度所对应的加工订单； 买入套保需提供本次保值额度所对应的购销计划（合同）、合同清单。可用经审计的往年资产负债表、利润表、报表说明替代。	上一年度生产计划书、本次保值额度所对应的加工订单； 卖出套保需提供本次保值额度所对应的现货仓单或拥有实物的其他凭证（购销合同或发票）、合同清单。可用经审计的往年资产负债表、利润表、报表说明替代。
贸易及其他类	买入套保需提供本次保值额度所对应的购销计划（购销合同或发票）、合同清单。可用经审计的往年资产负债表、利	卖出套保需提供本次保值额度所对应的现货仓单或拥有实物的其他凭证（购销合同或发票）、合同清单。可用经审计的往年资产负债表、利润

润表、报表说明替代。

表、报表说明替代。

8.5 审核时间

- 一般月份额度在申请提交后 5 个工作日内交易所进行审核并予以答复。
- 交易所对临近交割月份套期保值持仓额度申请分两次集中审核并予以答复。第一次在交割月前一个月第 5 个日历日后的 5 个工作日内集中审核，第二次在申请截止日后的 5 个工作日内集中审核。全年各合约月份临近交割月份套期保值持仓额度累计不超过其当年生产能力、当年生产计划或者上一年度该商品经营数量。

8.6 注意事项

- 1、在对应的运行期到期前建仓。
- 2、套期保值持仓额度自交割月第一个交易日起（含该日）不得重复使用。
- 3、获批套期保值持仓额度的客户，可通过交易指令直接建立套期保值持仓，也可通过对历史投机持仓确认的方式建立套期保值持仓。
- 4、按品种方式申请并获批一般月份套期保值持仓额度的客户，套期保值持仓和投机持仓合计不得超过交易所规定的限额，其中套期保值持仓不得超过获批的套期保值持仓额度，投机持仓不得超过相应投机持仓限仓标准。

九、仓库名录

- 查询方法：首页 >> 交易所服务 >> 会员服务 >> 交割业务指引 >> 仓库名录。点击查询：
- http://www.czce.com.cn/cn/jysfw/hyfw/jgywzy/ckml/H7704020409index_1.htm

9.1 指定交割仓库

编号	名称	简称	联系人	联系电话	升贴水	地址
1836	中国供销集团延长果业有限责任公司	延长果业	张兆华	15962868000	0	陕西省延安市延长县七里村街道郭家川村 68 号

9.2 指定交割厂库

编号	名称	简称	联系人	联系电话	传真或邮箱	升贴水	地址
1801	陕西华圣企业（集团）股份有限公司	西安华圣	冀浩平	13772496849	029-86672946	0	陕西省西安市未央湖旅游度假区

1802	白水盛隆果业有限责任公司	白水盛隆	侯保智	18691318818	0913-6188880	0	陕西省渭南市白水县北井头乡李家卓村
1805	延安中果生态农业科技有限公司	延长中果	王志玲	0911-8964699 13359113053	0911-8964699	0	陕西省延安市延长县七里村镇白家川工业园区
1809	栖霞德丰食品有限公司	栖霞德丰	杜永斌	0535-3371789 13370927500	0535-3371769	0	山东省栖霞市德丰路一号
1812	莱州天赐宝物产有限公司	莱州天赐宝	卓芳屹	0535-2418968 15854537456	0535-2412028	0	山东省莱州市程郭镇西程村
1813	三门峡二仙坡绿色果业有限公司	陕州二仙坡	赵跃文	13703814168	0398-3806988	0	河南省三门峡市陕州区禹王路中段
1822	宝鸡海升现代农业有限公司	宝鸡海升	郭健	18691080612	0917-4293156	0	陕西省宝鸡市千阳县南寨镇
1828	甘肃德美地缘现代农业集团有限公司	静宁德美	吕满会	15293309929	0933-2538888	0	甘肃省平凉市静宁县城川镇红旗村农产品冷链物流产业园
1829	天水花牛苹果(集团)有限责任公司	天水花牛	胡旭辉	18993853121	-	0	甘肃省天水市麦积区廿里铺工业园区
1830	秦安雪原果品有限责任公司	秦安雪原	宋晓荣	18093808400	-	0	甘肃省天水市秦安县安伏工业园区
1831	威海市翠虹果品股份有限公司	荣成翠虹	岳建东	18463166134	-	0	山东省荣成市城西街道办事处东岭后村
1832	烟台联盛果蔬有限公司	烟台联盛	代高波	13806389919	-	0	山东省烟台市经济技术开发区潮水镇衙前村
1835	陕西粮农洛川果业有限公司	陕粮农洛川	魏远亮	13324636939	-	0	陕西省延安市洛川县苹果产业园区17号
1836	中国供销集团延长果业有限责任公司	延长果业	张兆华	15962868000	-	0	陕西省延安市延长县七里村街道郭家川村68号
1837	蓬莱昊林果蔬有限公司	蓬莱昊林	仵云仲	13562583333	-	0	山东省烟台市蓬莱区大辛店镇三甲村

1838	渭南天顺农产品商贸有限公司	渭南天顺	郭俊锋	18329361935	-	0	陕西省渭南市白水县林皋镇南马村
1839	陕西果业铜川集团有限公司	陕果铜川	王一哲	13201587905	-	0	陕西省铜川市新材料产业园区
1840	陕西子午实业发展有限公司	富县子午	李昊泽	17868814777	-	0	陕西省延安市富县吉子现乡安子头村

9.3 车船板交割服务机构

编号	名称	简称	联系人	联系电话	传真或邮箱	升贴水	地址
1801	陕西华圣企业(集团)股份有限公司	西安华圣	冀浩平	13772496849	029-86672946	0	陕西省西安市未央湖旅游开发区
1802	白水县盛隆果业有限责任公司	白水盛隆	侯保智	18691318818	0913-6188880	0	陕西省渭南市白水县北井头乡李家卓村
1805	延安中果生态农业科技有限公司	延长中果	王志玲	0911-8964699 13359113053	0911-8964699	0	陕西省延安市延长县七里村镇白家川工业园区
1809	栖霞德丰食品有限公司	栖霞德丰	杜永斌	0535-3371789 13370927500	0535-3371769	0	山东省栖霞市德丰路一号
1812	莱州天赐宝物产有限公司	莱州天赐宝	卓芳屹	0535-2418968 15854537456	0535-2412028	0	山东省莱州市程郭镇西程村
1828	甘肃德美地缘现代农业集团有限公司	静宁德美	吕满会	15293309929	0933-2538888	0	甘肃省平凉市静宁县城川镇红旗村农产品冷链物流产业园
1829	天水花牛苹果(集团)有限责任公司	天水花牛	胡旭辉	18993853121	-	0	甘肃省天水市麦积区甘里铺工业园区
1830	秦安雪原果品有限责任公司	秦安雪原	宋晓荣	18093808400	-	0	甘肃省天水市秦安县安伏工业园区
1831	威海市翠虹果品股份有限公司	荣成翠虹	岳建东	18463166134	-	0	山东省荣成市城西街道办事处东岭后村
1832	烟台联盛果蔬	烟台	代高波	13806389919	-	0	山东省烟台市经

	有限公司	联盛					济技术开发区潮水镇衙前村
1834	栖霞市沃尔德果蔬冷藏有限公司	栖霞沃尔德	林涛	13808927777	-	0	山东省烟台市栖霞市观里镇古村
1835	陕西粮农洛川果业有限公司	陕粮农洛川	魏远亮	13324636939	-	0	陕西省延安市洛川县苹果产业园区17号
1836	中国供销集团延长果业有限责任公司	延长果业	张兆华	15962868000	-	0	陕西省延安市延长县七里村街道郭家川村68号
1837	蓬莱昊林果蔬有限公司	蓬莱昊林	仵云仲	13562583333	-	0	山东省烟台市蓬莱区大辛店镇三甲村
1838	渭南天顺农产品商贸有限公司	渭南天顺	郭俊锋	18329361935	-	0	陕西省渭南市白水县林皋镇南马村
1839	陕西果业铜川集团有限公司	陕果铜川	王一哲	13201587905	-	0	陕西省铜川市新材料产业园区
1840	陕西子午实业发展有限公司	富县子午	李昊泽	17868814777	-	0	陕西省延安市富县吉子现乡安子头村

十、质检机构

- 查询方法： 首页 >> 交易所服务 >> 会员服务 >> 交割业务指引 >> 质检机构
- <http://www.czce.com.cn/cn/jysfw/hyfw/jgywzy/zjjg/webinfo/2021/08/1605594991150167.htm>

单位名称	地址	联系人	联系方式
中国检验认证集团河南有限公司	河南省郑州市金水区民航路17号	乔彦辉	0371-55196702
中华全国供销合作总社济南果品研究所	济南市燕子山小区东路24号	郑晓冬	18764178991
华测检测认证集团股份有限公司	深圳市宝安区新安街道兴东社区华测检测大楼	滕娇琴	15004624098

免 责 声 明

本资料根据《郑州商品交易所期货交割细则》、《郑州商品交易所标准仓单管理办法》、《郑州商品交易所苹果期货业务细则》、《郑州商品交易所期货交易细则》、《郑州商品交易所期货结算细则》以及《郑州商品交易所期货交易风险控制管理办法》编写，内容仅供参考。对于资料内容上的错误、遗漏或差异，请以交易所最新规则为准。