

# 烧碱期货（SH） 交割业务手册



目录

一、合约及交割要素.....	2
二、交割资格.....	3
三、交割单位.....	3
四、质量标准.....	3
五、交割仓（厂）库名录.....	3
六、交割方式.....	5
七、仓单注册流程.....	5
八、标准仓单有效期.....	8
九、交割流程.....	8
十、期货转现货.....	11
十一、仓单转让.....	12
十二、仓单注销及出库.....	13
十三、发票流转.....	14
十四、交割相关费用.....	14
十五、商品仓储费用收取方式.....	15
十六、质检机构.....	15
十七、套保申请.....	16



## 一、合约及交割要素

### 《烧碱期货合约及交割要素》

交易品种	烧碱
交易单位	30 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±4%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 5%
合约交割月份	1-12 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	合约交割月份的第 13 个交易日
交割品级	见《郑州商品交易所期货交割细则》
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	SH
上市交易所	郑州商品交易所
仓单性质	仓库及厂库仓单, 非通用仓单
仓单有效期	每年 1 月、3 月、5 月、7 月、9 月、11 月第 15 个交易日（含该日）之前注册的标准仓单，应在当月的第 15 个交易日（含该日）之前全部注销。
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。

注：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。



## 二、交割资格

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. 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。
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。
4. 烧碱交割需要危化品经营许可证。

## 三、交割单位

30 吨（对应 1 手期货合约）

## 四、质量标准

- 基准交割品：符合《中华人民共和国国家标准 工业用氢氧化钠》（GB/T209-2018）规定的 IL-III 型液碱，且氢氧化钠含量 $\geq 32\%$ 。
- 基准交割品的干吨重量=湿吨重量 $\times 0.32$ 。
- 替代交割品及升贴水：符合《中华人民共和国国家标准 工业用氢氧化钠》（GB/T209-2018）规定的 IL-I 型液碱，升贴水以交易所公告为准。
- 替代交割品的干吨重量=湿吨重量 $\times 0.5$ 。

## 五、交割仓（厂）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  
 详见 [http://www.czce.com.cn/cn/jysfw/hyfw/jgywzy/ckml/H7704020409index\\_1.htm](http://www.czce.com.cn/cn/jysfw/hyfw/jgywzy/ckml/H7704020409index_1.htm)

### 1. 指定交割仓库

仓库编号	仓库名称	联系人	电 话	地 址	升贴水 (元/ 吨)
0803	南通千红石化港储有限公司	万军	15851303590	江苏省南通市经济技术开发区通盛南路6号	100
0807	江苏海企化工仓储股份有限公司	毛莉	15152993690	江苏省泰州市高港区永安洲工业园	100
2401	连云港千红石化仓储有限公司	邓金玉	13783570172	江苏省连云港市连云区旗台作业区	100

### 2. 指定交割厂库



厂库编号	名称	联系人	联系电话	公司地址	提货点地址	日发货速度 (吨/天)	厂库额度 (万吨)	升贴水 (元/吨)
2402	茌平信发华兴化工有限公司	宋世振	13869561777	山东省聊城市茌平区信发街道顺河北街747号		500	1	0
2403	山东鲁泰化学有限公司	陈昂	18863728726	山东省济宁市鱼台县张黄镇鹿洼工业园		500	1	0
2404	山东海化氯碱树脂有限公司	王铭之	13863695096	山东省潍坊市滨海经济技术开发区		500	1	0
2405	山东恒通化工股份有限公司	孟冠宇	15610677700	山东省临沂市郯城县人民路327号		600	1.2	0
2406	陕西北元化工集团股份有限公司	焦永平	15591232318	陕西省榆林市神木市锦界工业园区		1500	3	-200
2407	浙江镇洋发展股份有限公司	祝征伟	13805878616	浙江省宁波市镇海区宁波石化经济技术开发区海天中路655号		500	1	300
0841	厦门国贸石化有限公司	刘俊星	18705926788	福建省厦门市湖里区仙岳路4688号国贸中心A栋20楼	江苏海企化工仓储股份有限公司 (江苏省泰州市高港区永安洲工业园)	300	0.6	100



## 六、交割方式

1、按交割地点分：**仓库交割、厂库交割**

2、按交割时间分：**滚动交割、到期交割、期转现**

- 仓库交割是指卖方通过将指定仓库开具的相关商品仓库仓单转移给买方以完成实物交割的交割方式。
- 厂库交割是指卖方通过将指定交割厂库开具的相关商品标准仓单转移给买方以完成实物交割的交割方式。
- 到期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。
- 期转现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。

## 七、仓单注册流程

### 1. 仓库仓单注册流程



### 交割预报

- 客户或者非期货公司会员向仓库发货前，应当由会员填写《交割预报单》，并以书面形式或者交易所认可的其他形式向仓库预报。
- 预报数量较大的，交易所可以要求货主提供拥有商品的相关证明。特殊情况下，交易所可以要求仓库优先批准有近期月份持仓的交割预报。



- 自接到会员《交割预报单》之日起 2 个工作日内，仓库应当以书面形式或者交易所认可的其他形式回复会员能够接收的商品数量。自接到仓库同意入库的回复之日起 2 个工作日内，客户应当向仓库缴纳 30 元/吨的交割预报定金。仓库在收到交割预报定金的当日（工作日），开具《入库通知单》。
- 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。
- 《入库通知单》自开具之日起生效。烧碱的入库有效期（公历日）为 15 天。
- 《入库通知单》有效期内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。
- 交易所公告暂停仓库入库业务的，自公告之日（含该日）下午闭市起，该仓库发生的交割预报视为无效预报，交易所不再受理相关商品的仓库仓单注册申请。
- 货主应当按交易所有关规定向仓库交纳各项费用。
- 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。

### 烧碱入库

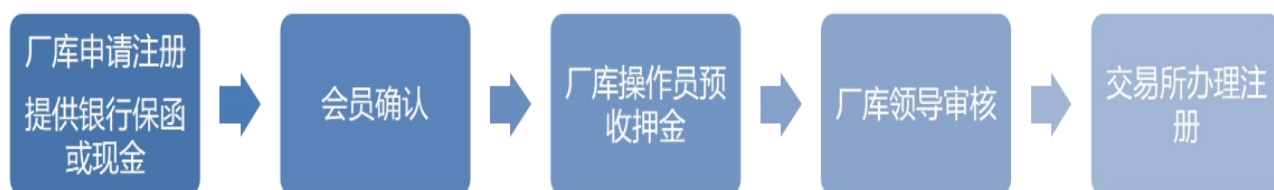
- 烧碱入库时，应当向仓库提交本批烧碱生产厂家出具的符合交割标准的《产品质量证明书》或者其他能证明产品质量的书面材料。《产品质量证明书》应当载有生产厂家、生产日期、适用的质量标准以及该批商品的质量检验结果等信息。
- 仓库应当对前款规定的入库商品单证以及标准仓单注册人的危险化学品经营资质进行审验。
- 烧碱入库时，采用汽车运输的，以地磅计量为准，由仓库负责重量验收；采用火车、船舶运输的，以仓库储罐打尺计量为准。标准仓单注册人可以委托指定质检机构进行验重，仓库应当予以配合，由此产生的费用由标准仓单注册人承担。
- 经交易所批准，烧碱重量验收可以使用国家质量技术监督部门认可的其他先进衡器计量。
- 烧碱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。
- 烧碱入库后，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、生产厂家、存放罐号、氢氧化钠含量等事项登记造册，并由标准仓单注册人签字确认。
- 期货、现货混罐存储的烧碱，仓库应当确保整罐商品符合烧碱期货交割标准的规定，不符合规定的，不允许混罐存储或者申请注册标准仓单。

### 仓单注册

- 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。
- 交易所可在自仓库提出仓单注册申请之日起 7 个工作日内予以注册。
- 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. 厂库仓单注册流程



### 1 客户注册

非期货公司会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。**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。

## 八、标准仓单有效期

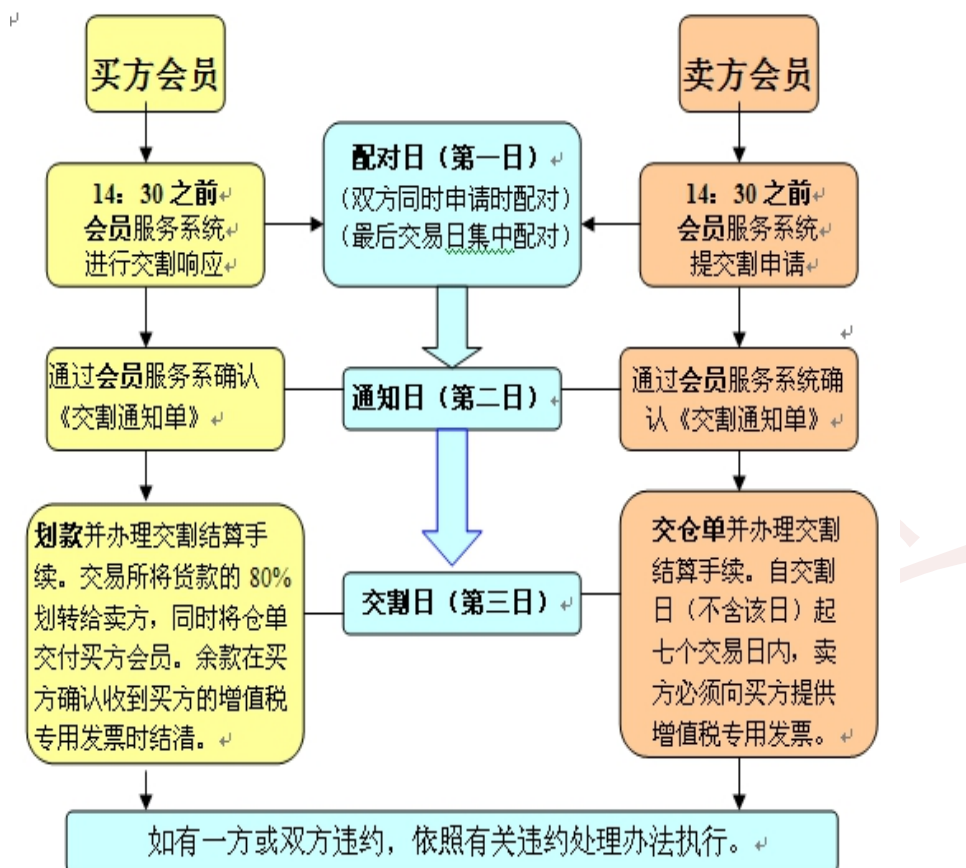
- 标准仓单在有效期内可以在期货上流通，超过有效期只能注销变成提货单，退出期货市场。
- **烧碱：每年 1 月、3 月、5 月、7 月、9 月、11 月第 15 个交易日（含该日）之前注册的标准仓单，应在当月的第 15 个交易日（含该日）之前全部注销。**

## 九、交割流程

### 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、红枣、花生、烧碱、对二甲苯滚动交割强制配对）。
- 通用仓单：提交仓单；非通用：提交仓单信息；车船板：提交货物信息

时间	事项		事项及备注
	卖方	买方	
配对日前	注册标准仓单（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。）		
第一交割日 配对日	1、14:30 之前，可提出交割申请，同时提交相应的仓单信息；（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、得到响应的申请则配对成	1、14:30 之前，可响应卖方提出的交割申请。响应成功则配对成功； 2、提出交割申请时，保证账户中有足够的资金支付货款；	买方会员响应的，即视为确认，买卖双方均不得撤销。对于得到买方会员响应的交割申请，交易所依据买卖双



	功；未得到响应的申请可在14:30前撤销； 3、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； 4、收取交割手续费。	3、提交增值税发票开票信息。 4、收取交割手续费。 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， <b>有强制配对风险</b> 。	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。
<b>第二交割日 通知日</b>	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》	
<b>第三交割日 交割日</b>	1、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，客户收到相应的交割仓单，可办理后续仓单业务（注销、仓转等）。交易所扣划买方全额交割货款	
.	.	.	.
.	.	.	.
.	.	.	.
.	.	.	.
<b>发票截止日</b> 第三交割日(不含该日)起7个交易日内	发票最迟需于本日内被买方客户或会员确认无误；买方客户收到发票后，收取20%余款。	发票最迟需于本日内被买方客户或会员确认无误。收到卖方客户开具的交割发票后，委托期货公司提交20%余款划转申请。	

## 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。

时间	事 项		
	卖方	买方	备注



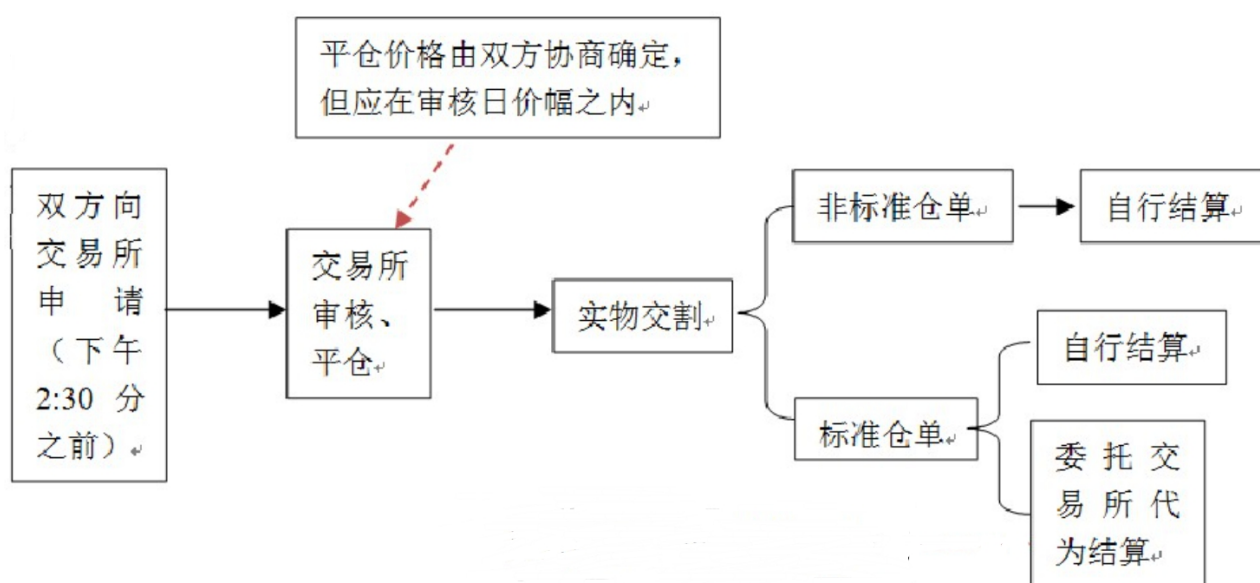
<b>最后交易日前</b>	1、注册标准仓单（自交割月最后交易日下午3时起，交易所不再受理仓库提出的用于当月交割的仓库仓单注册申请。） 2、提交交割意向书，确认所提交的交割仓单	<b>最后交易日前三个交易日</b> 保证账户中有足够的资金支付货款，提交增值税开票信息，收件人信息，营业执照扫描件	
<b>最后交易日</b>	由会员代为提交仓单到交易所冻结仓单（交割仓单需为自由仓单，质押仓单需提前解押），结算时释放卖方交割保证金。（如果未冻结仓单则不释放卖方交割保证金）	保证账户中有足够的资金支付货款	闭市后，所有未平仓合约的持有者须以交割履约，同一客户号买卖持仓相对应部分的持仓视为自动平仓，平仓价按一次性交割的交割结算价计算。
<b>第一交割日 标准仓单提交日</b>	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	
<b>第二交割日 配对日</b>	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。 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。	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。 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。	
<b>第三交割日 交割日</b>	1、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，客户收到相应的交割仓单，可办理后续仓单业务（注销、仓转等）。交易所扣划买方全额交割货款。	
. .		. .	
<b>发票截止日 第三交割日（不含</b>	发票最迟需于本日内被买方客户或会员确认妥收无误；买方	发票最迟需于本日内被买方客户或会员确	



该日)起 7 个交易日 日内	客户收到发票后, 收取 20% 余款。	认妥收无误。收到卖方客户开具的交割发票后, 委托期货公司提交 20% 余款划转申请。	
-------------------	---------------------	--	--

## 十、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。



- 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。
- 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, 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。(由于系统的录入和手续传递需要时间, 客户需提前申请)
- 交易所批准后, 期转现的买卖双方持有的期货持仓, 由交易所在审批日的下午闭市之后, 按买卖双方达成的平仓价格平仓。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之内。
- 用标准仓单进行期转现, 可由交易所进行货款划转。
  - 1、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。
  - 2、期转现申请批准后的下一交易日, 交易所为平仓成功的期转现买卖双方办理标准仓单过户手续。
  - 3、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)
  - 4、买卖双方的相应持仓平仓后, 办理标准仓单过户手续时, 卖方未能如数交付标准仓单或者买方未能如数解付货款的, 由交易所按照买卖双方达成的转让价格代扣违约方违约部分 20% 的违约金支付给守约方。
- 非标准仓单的期转现, 货款划转方式由双方协商确定。

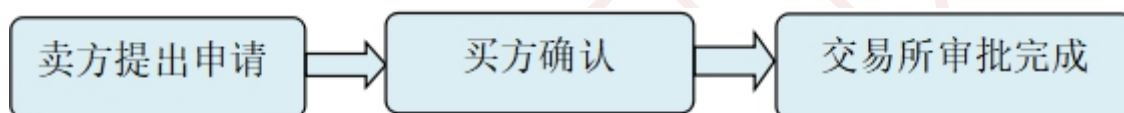


- 1、买卖双方应当提供相关现货买卖协议。
- 2、货物交收和货款划转由买卖双方自行协商确定，由此产生的纠纷自行解决，交易所不承担责任。

### 期转现的优点

- 1、不受交割月的限制，灵活掌握经营节奏；
- 2、可以选择物流便捷，运距最近，服务更优的仓库，节约物流成本；
- 3、可以选择自己生产、经营的等级；
- 4、灵活确定价格，进行合理避税；
- 5、降低交割成本，实现利润最大化；
- 6、交割效率明显提高，提货更加便捷、快速；
- 7、期转现适合大、中、小企业参与。

## 十一、仓单转让



- 客户的标准仓单转让须委托会员办理。
- **在每个交易日的下午 2 时 30 分之前**向交易所提交仓单转让申请。（由于系统的录入和手续传递需要时间，客户需提前申请）
- 仓单转让委托交易所结算，需收取仓单转让费，货款和发票通过交易所交接；自行结算，不收取仓单转让费，货款和发票自行交接。
- 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；
- 标准仓单转让手续费标准由交易所公告。

### 与期转现的区别

1. 买卖双方无须拥有期货部分持仓；
2. 只需确认转让价格，无平仓价格。

## 十二、仓单注销及出库



### 仓单注销

- 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叫做标准仓单注销；
- 客户注销仓单应当通过会员向交易所提交仓单注销申请。



- 客户办理提货手续前，会员或客户应及时编制《提货通知单》验证密码，《提货通知单》验证密码为提货必备要件。
- 自交易所开出《提货通知单》之日起 10 个工作日内，《提货通知单》持有人应当凭《提货通知单》验证密码、提货人身份证、提货人所在单位证明到仓库或厂库办理提货手续、确认商品质量、确定运输方式、预交各项费用。
- 逾期未办提货手续的，按现货提货单处理，交割仓库不再保证全部交割商品质量符合期货标准；厂库不再保证按期货规定承担日发货速度等责任，具体提货事宜由货主与厂库自行协商。

### 烧碱出库

- 烧碱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。
- 烧碱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（含该日）之前烧碱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。
- 烧碱出库时，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。具体流程按照《郑州商品交易所标准仓单管理办法》“仓库商品出库复检”有关规定办理。

### 厂库仓单出库

- 厂库应当在提货人办理提货手续之日起 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。
- 厂库应当保证烧碱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。
- 烧碱厂库出库时，厂库应当在提货人监督下在货物装运到提货人运输工具前进行抽样，双方确认后共同封样。样品一式三份，一份由提货人保存，两份由厂库保存。厂库应当在发货后至少保留样品 30 个日历日，作为发生质量争议时的处理依据。

## 十三、发票流转

- 期货交割由交割卖方向对应的买方开具增值税专用发票。增值税专用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。
- **标准仓单交割的，自第三交割日（不含该日）起 7 个交易日内，卖方应当提交增值税专用发票。**
- 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。
- 因买方会员提供资料有误，致使发票作废的，买方会员责任自负；买方会员提供资料延迟的，卖方会员提供发票时间可以顺延。
- 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。



## 十四、交割相关费用

- 查询方法：首页 >> 交易所服务 >> 会员服务 >> 交割业务指引 >> 交割费用

项目	费用标准	备注
仓储费	32%液碱与 50%液碱均为 2.5 元/吨·天（湿吨）	
交割手续费	0.5 元/吨（干吨）	
仓单转让、期转 现手续费	0.5 元/吨（干吨）	
入库费用	汽车 10 元/吨（湿吨）	采用船运方式的,采用最高限价,入库费用不超过 27 元/吨,由入库方向交割仓库支付;出库费用:内贸装船费不超过 27 元/吨,外贸装船费不超过 30 元/吨。船运出库费用由提货方向交割仓库支付。入出库费均按湿吨收取。
出库费用	汽车 0 元/吨（湿吨）	
<b>质检机构检验费用</b>		
检测项目	通标标准技术服务有限 公司	中国检验认证集团检验有 限公司
氢氧化钠	300	300
碳酸钠	300	300
氯化钠	300	300
三氧化二铁	300	300
合计	1200	1200
质检机构对应交割 仓库差旅费用	通标标准技术服务有限 公司	中国检验认证集团检验有 限公司
连云港千红石化仓 储有限公司	1300	100
南通千红石化港储 有限公司	1000	1400
江苏海企化工仓储 股份有限公司	1000	1000



备注	取样费用 1000 元/罐。 委托质检机构检重的，费用为 1200 元/罐。 差旅费用含一次差旅往返交通费、住宿费。差旅费标准可根据市场情况进行调整。
----	---

#### 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，交易所在每月第一个交易日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。

## 十五、商品仓储费用收取方式

时间区间	收取标准	收取方式
商品入库至仓单注册前一日	现货标准	仓库与货主结清
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	期货标准	交易所代交割仓库收取仓储费，交易所在每月第一个交易日按月计算划转上个月发生的仓储费。
开出《提货通知单》后第一日后	现货标准	仓库与货主结清

## 十六、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

质检机构名称	地址	联系人	联系电话
中国检验认证集团检验有限公司	北京市朝阳区西坝河东里 18 号中检大厦 18 层	陈宏 毛翔宇	13801063685 18611246254
通标标准技术服务（青岛）有限公司	青岛市崂山区株洲路 143 号通标中心矿产部	李广安	18905328596

## 十七、套保申请

### 套保申请流程





## 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。

## 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。

**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起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。

## 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、利润表、报表说明替代。	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。

## 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。

## 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。

## 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

