

附件 4

郑州商品交易所纯碱期货业务细则

(2023 年 11 月 20 日郑州商品交易所第八届理事会第八会议审议通过，适用于纯碱期货 2406 及后续合约，自 2023 年 11 月 27 日起施行)

第一章 总 则

第一条 为了规范郑州商品交易所（以下简称交易所）纯碱期货相关业务，根据《郑州商品交易所交易规则》及纯碱期货合约，制定本细则。

第二条 交易所、会员、客户、交割仓库（以下简称仓库）、交割厂库（以下简称厂库）、指定质检机构及期货市场其他参与者应当遵守本细则。

第二章 交易业务

第三条 纯碱期货合约交易单位为20吨/手。

第四条 纯碱期货合约报价单位为元（人民币）/吨。

第五条 纯碱期货合约最小变动价位为1元/吨。

第六条 纯碱期货合约交割月份为1至12月。

第七条 纯碱期货合约交易指令每次最小下单量为1手，限价指令每次最大下单量为1000手，市价指令每次最大下单量为200手。

交易所可以根据市场情况，对纯碱期货合约交易指令每次最小下单量、每次最大下单量进行调整，具体标准由交易所另行公布。

第八条 纯碱期货合约交易时间分为夜盘交易时间和日盘交易时

间。夜盘交易时间为每周一至周五(法定节假日除外)下午9:00-11:00。

日盘交易时间为每周一至周五(法定节假日除外)上午9:00-11:30,下午1:30-3:00;其中,上午10:15-10:30为休息时间。

交易所暂停、取消纯碱期货夜盘交易或者对夜盘交易时间进行调整的,以交易所公告为准。

第九条 纯碱期货合约最后交易日为合约交割月份的第10个交易日。

第十条 纯碱期货合约交易代码为SA。

第三章 交割业务

第一节 一般规定

第十一条 纯碱期货适用期货转现货、仓库标准仓单交割和厂库标准仓单交割。

纯碱期货滚动交割的配对方式为响应配对。

具体交割流程按照《郑州商品交易所期货交割管理办法》及本细则相关规定执行。

第十二条 纯碱期货的交割单位为20吨。

第十三条 纯碱期货合约的最后交割日为合约交割月份的第13个交易日。

第十四条 纯碱期货标准仓单可以分为仓库标准仓单和厂库标准仓单。

纯碱期货标准仓单为通用标准仓单。

第十五条 每年1月、3月、5月、7月、9月、11月第15个交易日之

前（含该日）注册的纯碱期货标准仓单，应当在当年1月、3月、5月、7月、9月、11月的第15个交易日之前（含该日）全部注销。

第十六条 纯碱期货交割开具增值税专用发票。

第十七条 纯碱期货仓库、厂库及相关升贴水由交易所确定并公布，交易所可以视情况对纯碱期货仓库、厂库及相关升贴水进行调整。

第十八条 纯碱期货仓库或者厂库升贴水在标准仓单注册、注销时划转，相应的增值税专用发票由标准仓单注册人向标准仓单注销人开具，仓库或者厂库负责监督。仓库或者厂库按照增值税适用税率收取押金，增值税专用发票开具后押金应予退还。

第十九条 纯碱期货的交割基准价为基准交割品在基准交割地出库时汽车板交货的含税价格（含包装）。

第二十条 纯碱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。

纯碱期货交割手续费、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。

第二十一条 纯碱包装物价格包含在相应期货合约价格中，不另行计价。

第二十二条 纯碱期货标准仓单生成、流通、注销等相关业务，本细则未规定的，适用《郑州商品交易所标准仓单管理办法》相关规定。

第二节 交割标准

第二十三条 纯碱期货交割适用国家标准及本细则规定。

第二十四条 基准交割品：符合《中华人民共和国国家标准 工业碳酸钠》（GB/T 210-2022，以下简称《纯碱国标》）II类优等品的重质纯碱，且氯化钠含量（以干基的NaCl的质量分数计） $\leq 0.6\%$ 。

第二十五条 纯碱交割品的包装应当符合《纯碱国标》规定。纯碱单包净重为1吨或者交易所公告的其他规格。

第三节 仓库标准仓单交割

第二十六条 纯碱期货交割预报时，应当按30元/吨向仓库交纳交割预报定金。

第二十七条 纯碱仓库开具的《入库通知单》有效期为15个日历日。

第二十八条 纯碱入库时，标准仓单注册人应当向仓库提交本批纯碱生产厂家出具的《产品质量证明书》，证明入库商品符合交割质量标准。《产品质量证明书》应当注明生产厂家、生产日期、适用的质量标准和该批产品的质量检验结果等信息。

不同生产厂家生产的纯碱应当分开进行交割预报。

第二十九条 纯碱生产日期超过90天的，不得入库。

纯碱出现破包、潮包、结块、严重污染等情况的，不得入库。

第三十条 纯碱入库时，仓库对入库商品进行重量验收。纯碱重量验收可以采用过地磅同时抽包检斤或者单独抽包检斤的方式进行。

第三十一条 纯碱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。纯碱质量检验按每500吨一个样品抽取；不

足 500 吨的按 500 吨计。样品一式三份，仓库和标准仓单注册人共同封样后寄送指定质检机构两份。

指定质检机构应当自收到每批样品之日起 5 个工作日内出具检验结果并通知仓库。

标准仓单注册人或者仓库对入库质量检验结果有异议的，可以向交易所提出质量复检申请。具体流程按照《郑州商品交易所标准仓单管理办法》“仓库商品入库复检”有关规定办理。

第三十二条 纯碱期货实行免检品牌制度。免检品牌生产厂家直接申请入库的，入库纯碱质量可以免检；标准仓单注册人向交易所和仓库提交免检品牌生产厂家出具符合交易所要求的产品质量责任承诺书及相关材料的，入库纯碱质量可以免检。纯碱免检品牌由交易所另行公告。

第三十三条 纯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。

纯碱入库后，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。

第三十四条 纯碱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 10 个日历日内开始发货；采用火车运输的，仓库 20 个日历日内开始发货。仓库不能在规定时间内发货的，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。

第三十五条 纯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。

纯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》开具日之前（含该日）纯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。

第三十六条 纯碱出库时，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。

第三十七条 纯碱出库时，出现破包、潮包、结块、严重污染等

情况的，仓库应当承担赔偿责任。

第四节 厂库标准仓单交割

第三十八条 纯碱厂库允许注册标准仓单的最大数量由交易所确定，交易所可以根据情况予以调整。

纯碱厂库申请注册标准仓单前，应当按照交易所规定提供标准仓单注册担保。

第三十九条 纯碱厂库标准仓单的交货地点为提货人在厂库配送范围内选择的仓库或者其他指定交货地点，厂库配送范围由交易所另行公告。厂库应当承担纯碱运至指定交货地点买方车板前的费用，包括仓库等收取的中转费用。指定交货地点存在升贴水的，提货人与厂库可按照交易所规定的升贴水标准自行结算。

提货人和厂库协商一致的，可以在其他地点进行交货，具体交收事宜及相关费用由双方协商确定。

第四十条 纯碱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发货手续，确认商品质量，确定运输方式，并预交各项费用。

第四十一条 自提货人与厂库联系发货之日起 3 个工作日内，双方应当就相关事项达成发货协议，包括交货地点、运输方式、发货速度、费用承担等。双方无法就发货速度协商一致的，厂库应当按照交易所批准的日发货速度发货。在仓库交货的，厂库、提货人应当及时与仓库联系，安排交收事宜。

厂库采用汽车运输的，应当在达成发货协议之日起 3 个日历日内发货；采用火车、轮船运输的，应当在达成发货协议之日起 15 个日历日内发货。发货后，厂库应当将相应单据及时交付提货人及拟交货的仓库。

提货人应当在每批货物运达交货仓库之日起（不含该日）3 个日历日内完成货物验收、提货或者存储手续，逾期未提货产生的费用及质量责任由提货人自行承担。

本细则所称厂库日发货速度，是指厂库在 24 小时内安排期货商品发货的最低数量。厂库日发货速度由交易所确定和调整。

第四十二条 纯碱交收时，重量验收实施及费用分担由厂库与提货人协商确定。协商不一致的，重量验收由仓库或者其他指定交货地点负责，费用由厂库承担。

纯碱交货数量发生短少的，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）纯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。

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。

第四十三条 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。

纯碱交货时，厂库应当向提货人提供符合交割标准的《产品质量证明书》，生产日期早于标准仓单注销日 150 天（含 150 天）的纯碱，提货人可以拒收。

厂库纯碱交货时，不得出现破包、潮包、结块、严重污染等情况。

第四十四条 提货人或者厂库对纯碱重量、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。重量异议应当在纯碱交货前提出；质量异议应当在纯碱交货之日起5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》“厂库商品出库复检”有关规定办理。

第四十五条 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。滞纳金=Σ[5（元/吨•天）×延误天数×应发（收）而未发（收）商品数量]。

因厂库原因在约定的最后发货日起5个日历日内仍不能完成所有商品发货的，提货人可以要求厂库终止发货并支付赔偿金。赔偿金额=纯碱期货最近交割月最高交割结算价×应发未发的商品数量×120%。

因天气原因及其他不可抗力因素导致无法按计划发货或者提货的，厂库或者提货人不需支付滞纳金或者赔偿金。

厂库和提货人应当妥善保管商品发货计划、协商确认材料以及发货和提货单据等，作为纠纷解决的依据。

第四十六条 多名提货人同时提货的，厂库可以根据提货人预约时间及办理提货手续的先后顺序等因素合理安排发货。

第四十七条 厂库发生违约行为，且厂库未赔偿或者赔偿金额不

足的，交易所可以动用厂库提供的担保对提货人进行赔偿。

第四十八条 厂库发货完毕后，交易所书面确认无质量、数量责任的，经厂库申请，交易所退还厂库提交的担保财产或者担保凭证。

第四章 风险管理

第四十九条 纯碱期货合约最低交易保证金标准为合约价值的5%。

纯碱期货合约交易保证金标准见下表：

交易时间段	交易保证金标准
自合约挂牌至交割月前一个月第15个日历日期间的交易日	合约价值的5%
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间的交易日	合约价值的10%
交割月份	合约价值的20%

第五十条 纯碱期货合约每日涨跌停板幅度为前一交易日结算价的±4%。

第五十一条 纯碱期货合约限仓标准见下表：

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个日历日期间的交易日	20000
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间的交易日	2000
交割月份	800（自然人客户最大单边持仓量为0）

本条所称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。

第五十二条 根据《郑州商品交易所期货交易风险控制管理办法》等有关规定，交易所对纯碱期货合约交易保证金标准、涨跌停板幅度进行调整的，按照相关标准执行。

第五章 附 则

第五十三条 违反本细则规定的，交易所按照《郑州商品交易所违规处理办法》和其他业务规则的有关规定处理。

第五十四条 本细则未规定的，按照交易所相关业务规则的规定执行。

第五十五条 本细则解释权属于郑州商品交易所。

第五十六条 本细则自 2023 年 11 月 27 日起施行。