

附件 3

郑州商品交易所烧碱期货业务细则

(2023年8月11日郑州商品交易所第八届理事会第五次会议审议通过,自2023年9月15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)烧碱期货相关业务,根据《郑州商品交易所交易规则》及烧碱期货合约,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 烧碱期货合约交易单位为30吨/手(干吨重量)。

第四条 烧碱期货合约报价单位为元(人民币)/吨。

第五条 烧碱期货合约最小变动价位为1元/吨。

第六条 烧碱期货合约交割月份为1至12月。

第七条 烧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,对烧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 烧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、取消烧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 烧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 烧碱期货合约交易代码为SH。

第三章 交割业务

第一节 一般规定

第十一条 烧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。

烧碱期货滚动交割的配对方式为响应配对和组织配对。

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 烧碱期货的交割单位为30吨（干吨重量）。

第十三条 烧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 烧碱期货标准仓单可以分为仓库标准仓单和厂库标准仓单。

烧碱期货标准仓单为非通用标准仓单。

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）注册的烧碱标准仓单，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 烧碱期货交割开具增值税专用发票。

第十七条 烧碱期货仓库、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烧碱仓库、厂库及相关升贴水进行调整。

第十八条 烧碱期货的交割基准价为基准交割品在基准交割地出

库时的汽车板交货的含税价格。

第十九条 烧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。

烧碱期货交割手续费、仓储费、出入库手续费、检验费等交割相关费用标准由交易所另行公布。

第二十条 不具备烧碱生产、储存、使用、经营或者运输资质的客户，不得参与烧碱期货交割。

第二十一条 烧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

第二十二条 烧碱期货交割适用国家标准及本细则规定。

第二十三条 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 $\times 0.32$ 。

第二十四条 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 $\times 0.5$ 。

第三节 仓库标准仓单交割

第二十五条 烧碱期货交割预报时，应当按 30 元/吨（湿吨重量）向仓库交纳交割预报定金。

第二十六条 烧碱仓库开具的《入库通知单》有效期为 15 个日历日。

第二十七条 烧碱运输应当符合国家对危险化学品运输的有关规定。

第二十八条 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。

第二十九条 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。

第三十条 烧碱入库采样和质量检验由指定质检机构负责，按有关国家标准执行，由此产生的费用（不含仓库配合费用）由标准仓单注册人承担。标准仓单注册人与交割仓库协商一致的，可以委托交割仓库进行采样。指定质检机构应当自完成采样之日起 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。

第三十一条 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。

第三十二条 已经在库的烧碱，能够提供指定质检机构出具的检验报告，证明该批商品符合烧碱期货交割标准的，经仓库认可后，可以申请注册标准仓单。

第三十三条 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。

第三十四条 烧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。提货人应当在办理完成提货手续之日起 2 个工作日内开始提货，双方协商一致的除外。

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。

提货人可以委托仓库代办运输，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 个日历日内开始发货；采用火车运输的，仓库在 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 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。

第三十六条 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。

第四节 厂库标准仓单交割

第三十七条 烧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。

烧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。

第三十八条 烧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。

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。

第三十九条 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。

第四十条 烧碱厂库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。

烧碱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（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。

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

对货物重量无异议。

第四十一条 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。

第四十二条 提货人或者厂库对烧碱重量、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。重量异议应当在烧碱出库前提出；质量异议应当在烧碱出库之日起 5 个工作日内提出。烧碱质量复检样品仅限于保留样品。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。

第四十三条 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（湿吨重量）·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=烧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，厂库或者提货人无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。

第四十四条 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。

第四十五条 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。

第四十六条 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

第四十七条 烧碱期货合约最低交易保证金标准为合约价值的5%。

烧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期间的交易日	合约价值的10%
交割月份	合约价值的20%

第四十八条 烧碱期货合约每日涨跌停板幅度为前一交易日结算价的±4%。

第四十九条 烧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个日历日期期间的交易日	3000
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	500

交割月份	50 (自然人客户最大单边持仓量为0手)
------	-------------------------

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，交易所对烧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

第五十一条 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。

第五十二条 本细则未规定的，按照交易所相关业务规则的规定执行。

第五十三条 本细则解释权属于郑州商品交易所。

第五十四条 本细则自2023年9月15日起施行。