

## 附件 3

# 上海期货交易所铸造铝合金期货业务细则

## 第一章 总 则

**第一条** 为了规范上海期货交易所（以下简称交易所）铸造铝合金期货相关业务，根据《上海期货交易所交易规则》《上海期货交易所铸造铝合金期货合约》以及相关业务规则，制定本细则。

**第二条** 交易所、会员、客户、交割库、指定检验机构、期货保证金存管机构以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** 铸造铝合金期货合约的交易单位为 10 吨/手。

**第四条** 铸造铝合金期货合约的报价单位为元（人民币）/吨。

**第五条** 铸造铝合金期货合约的最小变动价位为 5 元/吨。

**第六条** 铸造铝合金期货合约月份为 1~12 月。

**第七条** 铸造铝合金期货合约的交易时间为上午 9:00~11:30，下午 1:30~3:00 和交易所规定的其他交易时间。

**第八条** 铸造铝合金期货合约的最后交易日为合约月份的 15 日，遇国家法定节假日顺延，春节月份等最后交易日交易所可另行调整并通知。

**第九条** 铸造铝合金期货合约的交易代码为 AD。

**第十条** 铸造铝合金期货套期保值交易头寸和套利交易头寸，所涉的一般月份是指合约挂牌至交割月前第二月的最后一个交

易日，所涉的临近交割月份是指交割月前第一月和交割月份。

**第十一条** 铸造铝合金期货一般月份套期保值交易头寸的申请应当在该套期保值所涉合约交割月前第二月的最后一个交易日之前提出，逾期交易所不再受理。

铸造铝合金期货临近交割月份套期保值交易头寸的申请应当在该套期保值所涉合约交割月前第三月的第一个交易日至交割月前第一月的最后一个交易日之间提出，逾期交易所不再受理；铸造铝合金期货临近交割月份套利交易头寸的申请应当在该套利所涉合约交割月前第二月的第一个交易日至交割月前第一月的最后一个交易日之间提出，逾期交易所不再受理。

**第十二条** 铸造铝合金期货套期保值交易头寸自交割月份第一交易日起不得重复使用。

### 第三章 交割业务

#### 第一节 一般规定

**第十三条** 铸造铝合金期货适用期货转现货、仓库交割。

铸造铝合金期货实行完税交割。

**第十四条** 铸造铝合金交割品级详见《上海期货交易所铸造铝合金期货合约》。

**第十五条** 交割商品

铸造铝合金期货交割商品应当是在交易所注册的生产企业生产的注册商标的商品。

交割铸造铝合金的检验方法应当按照《上海期货交易所所有有色金属交割商品管理规定》的要求执行。

铸造铝合金仓库每一标准仓单的有效期为该批次产品最早

生产日期起 360 天以内，并且该批次产品应在最早生产日期起 180 天内进入交割仓库方可制成标准仓单。

## **第十六条 交割商品的规格与包装**

（一）每一标准仓单的铸造铝合金，应当是同一生产企业生产、同一牌号、同一注册商标、同一块形、同一包装数量（捆重近似）的商品组成，并且组成每一标准仓单的铸造铝合金生产日期应当不超过连续 60 日，且以最早日期作为该标准仓单的生产日期。注册生产企业自行选定注册产品捆重，但要利于组手。每捆包装应采用聚酯打包带井字形捆扎，具体要求由交易所另行公告。捆扎应当坚固，同时标有醒目的、不易脱落的产品标识，注明牌号、注册商标、生产厂商、重量、生产批号（熔炼号）、生产日期等。每捆重量应在 700KG 至 1000KG。

（二）到库商品中，遇有聚酯打包带断裂的捆件及散块商品，应当重新组合，用规定的打包带捆扎紧固，方可用于交割。包装费用由货主承担。

（三）铸造铝合金每锭重量为  $6\text{KG} \pm 1\text{KG}$ 。

（四）到库商品应覆盖塑料薄膜。交割仓库应对到库商品进行外观检查，铸锭表面应整洁，不应有霉斑及外来夹杂物，允许有轻微的夹渣、修整痕迹、因浇铸收缩而引起的轻微裂纹存在，如发现有明显雨渍、污染等影响使用的情况，不得用于交割。

## **第十七条 交割商品必备单证**

（一）国产商品：应当提供注册生产企业出具的产品质量证明书。

（二）进口商品：应当提供产品质量证明书、产地证明书、

交易所指定检验机构出具的质检证书（夹渣量除外）、进口货物报关单、海关代征增值税专用缴款书，经本交易所审定合格为有效。

国家税收、商检等政策调整的，应当遵守其规定，相关进口商品的单证要求由交易所另行发布。

**第十八条** 溢短和磅差：铸造铝合金交割以净重进行计量。每张标准仓单所列铸造铝合金锭的重量为 30 吨，溢短不超过 $\pm 3\%$ ，磅差不超过 $\pm 0.1\%$ 。

**第十九条** 铸造铝合金期货合约的交割单位为 30 吨。

**第二十条** 铸造铝合金期货合约的交割日期为最后交易日后连续二个工作日。

**第二十一条** 铸造铝合金期货合约交割结算的基准价为该期货合约最后交易日的结算价。

**第二十二条** 交割地点：交易所交割仓库，由交易所另行公告。用于铸造铝合金期货交割的铸造铝合金锭应当存放在室内库房。

**第二十三条** 实物交割完成后，若买方对交割商品的质量、数量有异议的（有异议的铸造铝合金应当在交割仓库内），应当在实物交割月份的下一月份的 15 日之前（含当日，遇法定假日时顺延至假日后的第一个工作日），向交易所提出书面申请，并应当同时提供交易所指定检验机构出具的质量鉴定结论。用于交割的铸造铝合金每批商品的有效期应当涵盖本次交割的最后交割日。即使交割铸造铝合金每批商品的有效期截止时间早于质量异议期的提交截止时间，如果该批商品的质量鉴定结论不合格，

卖方对该批交割商品的实际质量仍需承担全部责任。

**第二十四条** 期转现使用标准仓单并通过交易所结算发生铸造铝合金交割实物质量纠纷的，买方应当在货款和标准仓单交换日后的 25 天内提出质量异议申请，并应当同时提供交易所指定检验机构出具的质量鉴定结论。

## **第二节 发票流程**

**第二十五条** 铸造铝合金增值税专用发票由卖方客户、非期货公司会员向买方客户、非期货公司会员开具。买卖双方客户有关增值税专用发票开具所需的具体信息、增值税专用发票等应当由会员进行核实、传递及确认。双方会员负责调解、处理相关纠纷。

**第二十六条** 第二交割日内，买方会员应当向卖方会员提供有关增值税专用发票开具所需的具体信息。卖方会员最迟应当在最后交易日后第七个工作日，将增值税专用发票交至买方会员。

**第二十七条** 第二交割日 14:00 之前，卖方会员未办妥增值税专用发票事宜的，交易所当日对相应交割头寸以该合约交割结算价收取不低于 15% 的保证金，保证金在买卖双方办妥增值税专用发票事宜并经双方会员申请、确认后清退。

卖方会员迟交增值税专用发票 3 至 10 天的，每天处以货款金额 0.5% 的滞纳金；迟交 11 至 30 天，每天处以货款金额 1% 的滞纳金；超过 30 天未交增值税专用发票的，视作不交增值税专用发票，由此产生的违约金按国家税收政策规定的增值税税额计算。滞纳金、违约金在买卖双方确认、申请后，由交易所向卖方会员收取，划转给买方会员。买卖双方另有约定的，遵其约定。

卖方会员向卖方客户收取保证金。会员与客户应当就保证金、滞纳金、违约金的收取、支付等事项做好安排。卖方会员先行支付滞纳金、违约金的，有权向卖方客户追偿。

**第二十八条** 买方会员应当在收到增值税专用发票之日的下一个工作日内，对增值税专用发票进行确认，并将结果告知卖方会员。

因买方会员、买方客户提供资料有误，致使发票作废的，责任自负；买方会员提供资料延迟的，卖方会员提供发票的时间可以顺延。

**第二十九条** 铸造铝合金期转现使用标准仓单并通过交易所结算的，卖方客户、非期货公司会员向买方客户、非期货公司会员开具增值税专用发票。买方会员应当在办理期转现手续后的一个工作日内，向卖方会员提供有关增值税专用发票开具所需的具体信息。卖方会员最迟应当在办理期转现手续后的第七个工作日，将增值税专用发票交至买方会员。

卖方会员在办理期转现手续后的下一个工作日 14:00 之前未办妥增值税专用发票事宜的，交易所当日对相应交割头寸以该合约期转现的交割结算价收取不低于 15% 的保证金，保证金在买卖双方办妥增值税专用发票事宜并经双方会员申请、确认后清退。

纠纷调解、滞纳金以及违约金的处理等其他发票相关未尽事宜参照本细则第二十五条至第二十八条的有关规定执行。

## 第四章 风险管理

**第三十条** 铸造铝合金期货合约的最低交易保证金为合约价值的 5%。

**第三十一条** 铸造铝合金期货合约上市运行不同阶段的交易保证金收取标准为：

交易时间段	铸造铝合金交易保证金比例
合约挂牌之日起	5%
交割月前第一月的第一个交易日起	10%
交割月份第一个交易日起	15%
最后交易日前二个交易日起	20%

**第三十二条** 铸造铝合金期货合约涨跌停板幅度为上一交易日结算价 $\pm 3\%$ 。

**第三十三条** 期货公司会员、非期货公司会员和客户的铸造铝合金期货合约在不同时期的限仓比例和限仓数额具体规定如下：

(单位：手)

	合约挂牌至 交割月份		合约挂牌至交割月前第二月的 最后一个交易日			交割月前 第一月		交割月份	
	某一期 货合约 持仓量	限仓比例 (%)	某一期货 合约持仓 量	限仓比例 (%) 和限仓数额(手)		限仓数额(手)		限仓数额(手)	
		期货公司 会员		非期货公司 会员	客户	非期货公 司会员	客 户	非期货公 司会员	客 户
铸造 铝合 金	$\geq 9000$ 手	25	$\geq 9000$ 手	10	10	300	300	90	90
			$< 9000$ 手	900	900				

**注：**表中持仓量、限仓数额为单向计算；期货公司会员的限仓比例为基数。

**第三十四条** 交割月前第一月的最后一个交易日收盘前，各会员、各客户在每个会员处铸造铝合金期货合约的投机持仓应当调整为3手的整倍数（遇市场特殊情况无法按期调整的，可以顺延一天）；进入交割月后，铸造铝合金期货合约投机持仓应当是3手的整倍数，新开仓、平仓也应当是3手的整倍数。

**第三十五条** 交易所对某一铸造铝合金期货合约采取强制减仓的，其申报平仓数量、持仓盈利客户平仓范围以及平仓数量的分配原则及方法按照下列方法确定：

（一）申报平仓数量。在强制减仓基准日收市后，已在计算机系统中以涨跌停板价申报无法成交的，且客户该铸造铝合金期货合约的单位净持仓亏损大于或者等于强制减仓基准日结算价6%的所有申报平仓数量的总和为平仓数量。

（二）持仓盈利客户平仓范围。根据《上海期货交易所风险控制管理办法》所述方法计算的客户单位净持仓盈利的投机头寸以及客户单位净持仓盈利大于或者等于强制减仓基准日结算价6%的保值头寸都列入平仓范围。

（三）平仓数量的分配原则。在平仓范围内按盈利的大小和投机与保值的不同分成四级，逐级进行分配。首先分配给属平仓范围内单位净持仓盈利大于或者等于强制减仓基准日结算价6%的投机头寸；其次分配给单位净持仓盈利大于或者等于强制减仓基准日结算价3%，小于6%的投机头寸；再次分配给单位净持仓盈利小于强制减仓基准日结算价3%的投机头寸；最后分配给单位净持仓盈利大于或者等于强制减仓基准日结算价6%的保值头寸。上述各级分配比例均按申报平仓数量（剩余申报平仓数量）



与各级可平仓的盈利头寸数量之比进行分配。

（四）平仓数量的分配方法。盈利6%以上的投机头寸数量大于或者等于申报平仓数量的，根据申报平仓数量与盈利6%以上的投机头寸数量的比例，将申报平仓数量向盈利6%以上的投机客户分配实际平仓数量；

盈利6%以上的投机头寸数量小于申报平仓数量的，根据盈利6%以上的投机头寸数量与申报平仓数量的比例，将盈利6%以上投机头寸数量向申报平仓客户分配实际平仓数量。再把剩余的申报平仓数量按上述的分配方法向盈利3%以上的投机头寸分配；还有剩余的，再向盈利3%以下的投机头寸分配；再有剩余的，再向盈利6%以上的保值头寸分配。还有剩余的不再分配。

## 第五章 附 则

**第三十六条** 本细则未规定的，按照交易所相关业务规则的规定执行。

**第三十七条** 违反本细则规定的，交易所按照《上海期货交易所违规处理办法》的有关规定处理。

**第三十八条** 本细则的解释权属于上海期货交易所。

**第三十九条** 本细则自 2025 年 6 月 10 日起实施。