

## 附件 3

# 上海期货交易所不锈钢期货业务细则 (修订草案)

## 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）不锈钢期货相关业务，根据《上海期货交易所交易规则》《上海期货交易所不锈钢期货合约》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** 不锈钢期货合约的交易单位为 5 吨/手。

**第四条** 不锈钢期货合约的报价单位为元（人民币）/吨。

**第五条** 不锈钢期货合约的最小变动价位为 5 元/吨。

**第六条** 不锈钢期货合约月份为 1~12 月。

**第七条** 不锈钢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** 不锈钢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** 不锈钢期货合约的交易代码为 SS。

**第十条** 不锈钢期货套期保值交易持仓额度和套利交易持仓额度，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** 按合约方式申请不锈钢期货一般月份套期保值交易持仓额度的，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。按品种方式申请一般月份套期保值交易持仓额度的，按照《上海期货交易所套期保值交易管理办法》相关规定执行。

不锈钢期货临近交割月份套期保值交易持仓额度的申请应当在该套期保值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；不锈钢期货临近交割月份套利交易持仓额度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** 不锈钢期货套期保值交易持仓额度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** 不锈钢期货适用期货转现货、仓库交割、厂库交割。

不锈钢期货实行完税交割。

**第十四条** 不锈钢期货交割品级详见《上海期货交易所不锈钢期货合约》。

**第十五条** 交割不锈钢质量规定

交割不锈钢应当是在交易所注册的生产企业生产的注册品牌，或者是交易所认可的生产企业生产的指定品牌（由交易所规定并公告）。

交割不锈钢的质量应当符合 GB/T3280-2015《不锈钢冷轧钢板和钢带》或者 JIS G 4305:2021《冷轧不锈钢钢板及钢带》，以及《上海期货交易所钢材交割商品注册管理规定》的规定。

交割不锈钢的表面质量检验按照《上海期货交易所钢材交割商品注册管理规定》执行。

#### **第十六条** 交割商品的规格

每一标准仓单不锈钢，应当是同一生产企业生产、同一（注册）商标、同一牌号、同一宽度、同一厚度和同一边部状态的商品组成。

#### **第十七条** 交割不锈钢的包装

交割不锈钢标志以及质量证明书等应当符合 GB/T3280-2015《不锈钢冷轧钢板和钢带》或者 JIS G 4305:2021《冷轧不锈钢钢板及钢带》的规定。

交割不锈钢的包装应当符合《上海期货交易所钢材交割商品注册管理规定》的规定。

#### **第十八条** 交割商品必备单证

应当提供注册生产企业或者交易所认可生产企业出具的产品质量证明书。

#### **第十九条** 计量和溢短

交割不锈钢按净重进行计量。每张不锈钢标准仓单的溢短不超过 $\pm 5\%$ ，磅差不超过 $\pm 0.3\%$ 。

#### **第二十条** 不锈钢期货合约的交割单位为 60 吨。

**第二十一条** 不锈钢期货合约的交割日期为最后交易日后连续二个工作日。

**第二十二条** 不锈钢期货合约交割结算的基准价为该期货合约最后 5 个有成交交易日的结算价的算术平均值。

**第二十三条** 交割地点：交易所交割仓库和交割厂库，由交易所另行公告。

**第二十四条** 包装以及表面质量异议的处理

（一）包装以及表面质量异议不属于交割违约。

（二）货主对不锈钢商品包装或者表面质量如麻点、擦划伤、海水浸泡痕迹等提出异议的，应当由生产企业、交割仓库、卖方或者首次制成标准仓单的一方配合解决。

指定检验机构可以根据货主等异议主体的申请，按照《上海期货交易所钢材交割商品注册管理规定》出具质量检验报告。检验报告的结果仅适用于被检验的该卷货物。

**第二十五条** 期转现使用标准仓单并通过交易所结算发生不锈钢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 仓库交割

**第二十六条** 不锈钢仓库标准仓单有效期限为该批次产品最早生产日起的 360 天内。

**第二十七条** 用于交割的不锈钢每一仓库标准仓单的标的实物应当作为一个堆放垛位进行堆放。

**第二十八条** 实物交割完成后，若买方对交割商品的质量、数量有异议的，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。用于交割的不锈钢每批商品的有效期限应当涵盖本次交割的最后交割日。即使交割不锈钢每批商品的有效期限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。

### **第三节 厂库交割**

**第二十九条** 申请单位申请交割厂库，净资产不足 1 亿元的，应当向交易所提供有关单位出具的担保函。

**第三十条** 厂库提货地包括交易所相关钢材期货品种注册企业（生）产地、交割库以及其他经交易所公布的提货地。

**第三十一条** 厂库提货地分为基准提货地和非基准提货地。

基准提货地名单以及对应的提货升贴水由交易所确定并公告。

非基准提货地名单以及对应的提货升贴水由厂库确定、调整，并通过交易所网站公布。

提货地的提货升贴水由厂库和厂库标准仓单货主按厂库标准仓单重量自行结算。

厂库标准仓单货主在提交提货申请时，应当选择并确认提货地。

**第三十二条** 申请

厂库签发厂库标准仓单前应当向交易所提交签发申请。申请内容包括品种、牌号、商标、规格、会员单位、货主名称、拟申请签发标准仓单数量等。

**第三十三条** 厂库标准仓单的有效期为厂库标准仓单生成之日起的 150 天内。

**第三十四条** 提货申请

(一) 货主应按照对应提货地最小提货量、提前申请日数等规定通过标准仓单管理系统向厂库提交提货申请，具体内容交易所另行公告。申请内容应当包括数量、拟提货日、提货方式、提货计划（每日提货量）、提货人身份证件号码、联系电话等相关内容。

(二) 厂库在收到货主提货申请后的 3 个工作日内、参照货主提交的提货日以及企业的生产计划等，确认货主的提货申请。

如果货主提交的拟提货日有多个持有厂库标准仓单的货主同时申请提货，且日提货总量超出厂库的日发货量时，厂库可以参照各个货主申请提货日的先后、提货计划及生产计划等统筹安排发货，并在货主提交提货申请后的 3 个工作日内，向货主提供一个可供选择的提货时间范围和发货计划（每日发货量）。厂库提供的可供货主选择的最早提货日，应当在货主提交的拟提货日后的 10 天内。货主无异议的，可选择并确定其中一天为提货日，并确定发货计划。货主有异议的，可以重新和厂库协商。

(三) 因第二项所述多个货主同时申请提货而造成货主提货时间的延迟，厂库不承担经济责任。但是厂库应当及时报告交易所书面备案，阐明原因。

**第三十五条** 出库商品的生产日期应在货主和厂库之间已经

确定的提货日之前的三百六十日之内，组成每一厂库标准仓单出库的不锈钢生产日期应当不超过连续三十日。

**第三十六条** 出库商品重量以出库商品标签净重为准。

**第三十七条** 货主应当按约定的提货日和发货计划到厂库提货。过了提货日但在约定的提货日后 15 日内（含第十五日）到厂库提货，或者因非厂库过错的原因而无法按约定的日发货计划提货，厂库仍应当按照不锈钢期货合约规定的质量标准承担有关商品质量的责任，并按照当时各货主的提货情况统一安排发货计划，直至全部发完。

货主应当向厂库支付滞纳金。滞纳金金额=2 元/吨·天×应提而未提的商品数量×该批商品的滞留天数

因为货主原因造成发货延迟的，由双方约定另行协商处理。

**第三十八条** 货主未在约定的提货日后 15 日内（含第十五日）到厂库提货，货主应当向厂库支付滞纳金，具体提货事宜由双方自行协商。

滞纳金金额=35 元/吨×应提而未提的商品数量

**第三十九条** 货主在约定的提货日到库提货，厂库未按约定的发货计划发货，但在约定的提货日后 15 日内（含第十五日）完成了相应商品的发货，厂库应当向货主支付赔偿金。

赔偿金金额=50 元/吨×按日发货计划应发而未发的商品数量

**第四十条** 厂库在约定的提货日后 15 日（含第十五日）内未完成按日发货计划相应商品的发货，货主可以做如下选择：

（一）货主在约定提货日后的第 15 日向厂库提出自约定提

货日后的第 16 日起，终止接受厂库应发而未发的剩余商品，厂库应当向货主返还货款并支付追加赔偿金。

返还货款和追加赔偿金的金额=赔偿结算价×应发而未发的商品数量×130%

赔偿结算价为约定提货日后的第 16 日前一交易日交易所挂牌交易的最近月份对应期货合约的结算价

(二) 货主在约定提货日后的第 15 日未向厂库提出终止接受厂库应发而未发的剩余商品，则剩余商品具体提货事宜由双方自行协商。

**第四十一条** 当厂库发生第三十九条、第四十条中的违约行为时，厂库直接向货主支付赔偿金、返还货款和追加赔偿金。

厂库未支付或者支付数额不足的，交易所按照以下步骤向货主支付：

(一) 动用厂库提供的担保方式支付；

(二) 交易所代为垫付，并通过包括法律程序在内的其他手段向厂库追索。

**第四十二条** 当货主发生第三十七条、第三十八条中的违约行为时，货主直接向厂库支付滞纳金。货主未支付的或支付数额不足的，厂库可以通过包括法律程序在内的其他手段向货主追索。

**第四十三条** 当发生第三十七条、第三十八条、第三十九条、第四十条所述情况而给厂库或货主其中一方造成损失，如双方约定另行协商处理，则按双方协议而定，书面协议报交易所备案。

#### **第四十四条 质量争议处理**

提货方对交割商品的质量有异议的，应当在实物交收完成后十日内，向交易所提出书面申请，并同时提供交易所指定检验机构出具的质量鉴定结论。逾期未提出申请的，视为提货方对所交割商品无异议，交易所不再受理交割商品有异议的申请。

**第四十五条** 厂库持有的厂库标准仓单被注销后，厂库可以向交易所申请调整担保数额。

### 第四章 风险管理

**第四十六条** 不锈钢期货合约的最低交易保证金为合约价值的5%。

**第四十七条** 不锈钢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	不锈钢交易保证金比例
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%

**第四十八条** 不锈钢期货合约涨跌停板幅度为上一交易日结算价 $\pm 4\%$ 。

**第四十九条** 不锈钢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 (%) 和限仓数额 (手)		限仓数额 (手)		限仓数额 (手)	
		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
		≥7万手	10	10	1800	1800	360
<7万手	7000	7000					

注：表中持仓量、限仓数额为单向计算。

**第五十条** 交割月前第一月的最后一个交易日收盘前，交易者（即客户、非期货公司会员，下同）在每个交易编码上的不锈钢期货合约的一般持仓应当调整为 12 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，不锈钢期货合约一般持仓应当是 12 手的整倍数，新开仓、平仓也应当是 12 手的整倍数。

**第五十一条** 交易所对某一不锈钢期货合约采取强制减仓的，其申报平仓数量、持仓盈利交易者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，且交易者该不锈钢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）持仓盈利交易者平仓范围。根据《上海期货交易所风险控制管理办法》所述方法计算的交易者单位净持仓盈利的一般持仓以及交易者单位净持仓盈利大于或者等于强制减仓基

准日结算价6%的套期保值交易持仓都列入平仓范围。

(三) 平仓数量的分配原则。在平仓范围内按盈利的大小和一般持仓与套期保值交易持仓的不同分成四级，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%的一般持仓；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%的一般持仓；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%的一般持仓；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%的套期保值交易持仓。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持仓数量之比进行分配。

(四) 平仓数量的分配方法。盈利6%以上的一般持仓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%以上的一般持仓数量的比例，将申报平仓数量向盈利6%以上的一般持仓分配实际平仓数量；盈利6%以上的一般持仓数量小于申报平仓数量的，根据盈利6%以上的一般持仓数量与申报平仓数量的比例，将盈利6%以上一般持仓数量向申报平仓交易者分配实际平仓数量。再把剩余的申报平仓数量按上述的分配方法向盈利3%以上的一般持仓分配；还有剩余的，再向盈利3%以下的一般持仓分配；再有剩余的，再向盈利6%以上的套期保值交易持仓分配。还有剩余的不再分配。

## 第五章 附则

**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** 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。

**第五十四条** 本细则的解释权属于上海期货交易所。

**第五十五条** 本细则自 年 月 日起实施。