

附件 8

上海期货交易所铸造铝合金期货业务细则 (征求意见稿)

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 按合约方式申请铸造铝合金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。

铸造铝合金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；铸造铝合金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 铸造铝合金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坚固，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。

第四章 风险管理

第二十五条 铸造铝合金期货合约的最低交易保证金为合约价值的 5%。

第二十六条 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%

第二十七条 铸造铝合金期货合约涨跌停板幅度为上一交易日结算价 $\pm 3\%$ 。

第二十八条 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 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
铸造 铝合 金	≥ 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。

第二十九条 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铸造铝合金期货合约的一般持仓应当调整为 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一般持仓应当是 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

第三十一条 本细则未规定的，按照交易所相关业务规则的规定执行。

第三十二条 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。

第三十三条 本细则的解释权属于上海期货交易所。

第三十四条 本细则自 年 月 日起实施。