附件1

**纯碱期货合约测试参数**

一、纯碱期货合约（测试用）

|  |  |
| --- | --- |
| 交易品种 | 纯碱 |
| 交易单位 | 20吨/手 |
| 报价单位 | 元（人民币）/吨 |
| 最小变动价位 | 1元/吨 |
| 每日价格最大波动限制 | 上一交易日结算价±4%及《郑州商品交易所期货交易风险控制管理办法》相关规定 |
| 最低交易保证金 | 合约价值的5％ |
| 合约交割月份 | 1-12月 |
| 交易时间 | 每周一至周五（北京时间 法定节假日除外）  上午 9:00-11:30，下午 1:30-3:00及交易所规定的其他时间 |
| 最后交易日 | 合约交割月份的第10个交易日 |
| 最后交割日 | 合约交割月份的第12个交易日 |
| 交割品级 | 见《郑州商品交易所期货交割细则》 |
| 交割地点 | 交易所指定交割地点 |
| 交割方式 | 实物交割 |
| 交易代码 | SA |
| 上市交易所 | 郑州商品交易所 |

二、挂牌合约月份

首日挂牌合约月份为2005、2006、2007、2008、2009、2010、2011。

测试挂盘基准价1700元/吨。

三、合约相关参数

（一）交易保证金标准

|  |  |
| --- | --- |
| **交易时间段** | **交易保证金标准** |
| 自挂牌至交割月前一个月第15个日历日期间的交易日 | 5% |
| 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 | 10% |
| 交割月份 | 20% |

（二）限仓标准

纯碱期货合约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，当合约的单边持仓量大于或等于一定规模时，非期货公司会员和客户按单边持仓量的10%确定限仓数额；当合约的单边持仓量小于一定规模时，非期货公司会员和客户按绝对量方式确定限仓数额。具体限仓标准见下表：

|  |  |  |
| --- | --- | --- |
| 品 种 | 期货合约单边持仓量 | 非期货公司会员及客户最大单边持仓 |
| 纯碱 | 单边持仓量＜20万 | 20000 |
| 单边持仓量≥20万 | 单边持仓量×10% |

注：单位，手。

各品种期货合约自交割月前一个月第16个日历日至交割月限仓标准见下表：

|  |  |  |
| --- | --- | --- |
| 品 种 | 非期货公司会员及客户最大单边持仓（手） | |
| 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 | 交割月份  （自然人客户限仓为0） |
| 纯碱 | 4000 | 800 |

注：单位，手

（三）交易手续费

交易手续费为4元/手，当日开平仓暂无优惠政策，套保开仓手续费免收。