附件1

**短纤期货合约测试参数**

1. 短纤期货合约（草案）

|  |  |
| --- | --- |
| **交易品种** | 涤纶短纤（简称“短纤”） |
| **交易单位** | 5吨/手 |
| **报价单位** | 元（人民币）/吨 |
| **最小变动价位** | 2元/吨 |
| **每日价格波动限制** | 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  以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13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** | PF |
| **上市交易所** | 郑州商品交易所 |

二、短纤期货合约相关参数

9月26日测试挂盘基准价5360元/吨，10月10日测试挂盘基准价与上市首日基准价相同。

（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

短纤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（手） | 非期货公司会员及客户最大单边持仓量（手） |
| 短纤 | 单边持仓量＜10万 | 10000 |
| 单边持仓量≥10万 | 单边持仓量×10% |

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量（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） |
| 短纤 | 1500 | 300 |

（三）交易手续费

交易手续费为3元/手，套保开仓手续费免收。