

中国金融期货交易所 国债期货合约交割细则

2015! 6" 26# \$% 2017! 1" 4# &' () *
2018! 8" 6# &+ () * 2018! 12" 28# &, () *
2020! 3" 1# &- () * 2020! 6" 12# &. () * /

! " # \$

! % 0123456789: ; <=>? 9: ; /
4@78AB9CDOEF GH3456789: ; 9: 1
I J K L M N O P I E Q R S P I T

&% 4@78ABUVNW9CXYT

' % 9: ; Z [\ Z] ^ K 78 _ ` abcdef
ghi S P I T

(% 9Cj Kk 4@l mnop4@l mqr s
a 1 I K L M 1 R t u T

v w; ? 4@l mqr O 3x 4@y z { | } ~ 责任
公司 <=>? 3x { | / 和 34 证券 y z { | } ~ 责任公
司 <=>? 34 { | / T

&") * + , -

. % 4@78ABk 可 9C4@f g 满足 <= 条

件：

' / 3 华人民共和 4 财政部在境内 \$ D k z 账 Y 4 @ ;
+ / 同时在全 4 银 D 间 @ 券 _ ` Z 上海证券 9 : ; 和
深圳证券 9 : ; 上 _ 9 : ;

, / 固 R 利率且 R 7 付息；

- / A B 到 7 " 份首 # 剩余 7 ~ 符 A A B 1 R k 2 围；

. / 符 A 4 @ 转 I m k L M 1 R ;

六 / 9 : ; 1 R k a b 条件 T

/ % 2 ! 7 4 @ 7 8 A B k 9 C 单位 O 面值 200 万
元人民币 k 4 @ E 5 ! 7 和 10 ! 7 4 @ 7 8 A B k 9 C 单位
O 面值 100 万元人民币 k 4 @ T 每 9 C 单位 k 4 @ 仅 ~ 于同
' 4 @ I m q r I m k 同 ' 4 @ T 3 4 { | 上海分公司和 3
4 { | 深圳分公司 I m k 4 @ 分别计 | T

O % 4 @ 7 8 A B k 可 9 C 4 @ K a 转换因子数
值 p 9 : ; 确 R 并向 _ ` 公 % T

' " , - 1 2 3 4 5 6

7 % c d 9 C k 非 7 8 公司 [\ f g 事先向 9 :
; 申报 4 @ I m 账 ^ T c d 9 C k] ^ f g 事先通过 [\ 向
9 : ; 申报 4 @ I m 账 ^ T [\ Z] ^ f g 确保; 申报 k 4
@ I m 账 ^ 真 N Z } 效 T

非 7 8 公司 [\ Z] ^ 按照 9 : 编码申报 4 @ I m 账 ^ E
申报 3 x { | 开立 k 4 @ I m 账 ^ k E 只能申报 ' 个 4 @ I

m账^；申报34{ | 开立k 4@l m账^k E f g同时申报在34{ | 上海分公司和34{ | 深圳分公司开立k 4@l m账^E且只能分别申报' 个4@l m账^T

8% [\ 申报4@l m账^ E f g向9: ; 提9=列材料:

- ' / 4@l m账^ 申报表;
- + / 4@l m账^ 证明材料;
- , / } 效身份证明材料;
- / 9: ; ! k a b 材料T

[\ f g 确保材料内" k 真NZ # 确和\$%T

9% [\ 可< 在9: # 9:30-14:00 向9: ; 申报4@l m账^E9: ; 在&Y' u 申报(, 个9: # 内) D* + 并, < - . T9: ; 在* + 过/ 3可< ! [\ O 申报材料) D1 2 3 明E 1 2 材料时间4 计5* + 时间T

9! % 在4@78AB9C" 份6vk + 个9: # 78通过4@l m账^ * + k 非78公司[\ Z] ^ E 9 9C" 份6vk' 个9: #: ; (9: # Ea 在< 4@78 9C" 份ABk => f g O 0 ? T

99C" 份6vk' 个9: # @E9: ; 按照H345 6789: ; ABCQmu t DJ k L M 1 R E O 8 通过4@l m账^ * + k 非78公司[\ Z] ^ k 9C" 份AB=> , < E D F > T

9&% 4@l m账^ G 息\$ H I J k E 非78公司 [\ f g K 时向9: ; 申报E] ^ f g K 时通过[\ 向9:

; 申报T

(" * + : ;

9' % AB) 59C" 份(: ; (9: # 6vEp
KXLM提N9C申报E并p9: ; OPQRSX在1Rk
时间内\$T9CTAB; (9: # U_(k 8F > 部分按照
9: ; k 1 R) 59CT

非78公司[\ Z] ^ cd 9CVOWX9: ; YI L
M4@I mqr Oa 申报账^ 内k Of 4@) DZ 转[u T

9(% 99C" 份6vk + 个9: # @: ; (9
: # 6v' 个9: # E每# U_(E同' 9: 编码k 9C"
份ABS向=>O\F>EF>] ^ O<ABv' 9: # k
{ |] T O\F > { _ 4 计5g#{ |] k 计| T

9. % ; (9: # 6v 申` 9Ck Eg#{ | 时E
9: ; 按照同' 9: 编码k 申报9C数a和=>akbc
值确R} 效申报9C数aT; } KX} 效申报9C数a) 5
9CT

9: ; 按照“申报d向e先E=>#; fe先EL同=>
#按gh分R”ki I 确R) 59Ckj X=>Tj X} 效申
报9C数ak于KX} 效申报9C数akE按照j X[\ d
向申报时间e先ki I 确R) 59Ckj X=>E8) 59
Ckd向申报I 效T

; }) 59Ckj X和KX=>m9C" 份AB=>

3noT

9/% ; (9: #6v 申` 9Ck E非78公司[
\
fg向9: ; 申报9Cd向E] ^fg通过[\
向9: ; 申报9Cd向T{ | [\
可<WX9: [\
向9: ; 申报9Cd向T

9Cd向fg在g# 15:15v 申报: 9: ; T

KX申报d向内" f g p q可9C4@r ? Z数a < K
9券k 4@l m账^s G息T

j X申报d向内" f g p q 9C数a和U券k 4@l
m账^s G息Tj X<在34{ | 开立k账^U券k E f g
同时提t 在34{ | 上海分公司和34{ | 深圳分公司开
立k账^T

[\
fg确保申` 9Ck] ^uv9CwB能x T

90% ; (9: #6v8) D9C申报yz 9:
; 确R) 59Ckj X=>E9: ; FGKX9券k 4@l
m账^E按照同4@l mqr e先i l 在<j X事先申报k
4@l m账^3{ RU券账^T

97% ; (9: #U_(E同'] ^ | k S向=>
O\F>EF>] ^O<ABv' 9: #k{ |] E同']
^ | k } =>) 59CTO\F>{ _4计59C{ |] k
计| T

98% ; (9: #) 59Ck E[\
fg在; (9: # 15:15v 向9: ; 申报j XU券k 4@l m账^和KX
k可9C4@r ? Z数a < K9券k 4@l m账^s G息T

j X < 在 34 { | 开立 k 账 ^ U 券 k E f g 同时提 t 在 34 { | 上海分公司和 34 { | 深圳分公司开立 k 账 ^ T

; (9: #) 59Ck E [\ 8 在 1R 时间内申报 j X 9CG 息 k E 9: ; F G K X 9 券 k 4 @ I m 账 ^ E 按照同 4 @ I m q r e 先 i l 在 < j X 事先申报 k 4 @ I m 账 ^ 3 { R U 券 账 ^ T [\ 8 在 1R 时间内申报 K X 9CG 息 k E V O K X 8 能在 1R 7 ~ 内 ~ 数 9 付可 9C 4 @ T

& 9 % j X Z K X = >) 59Ck g # E 9: ; 在 { | 时 F G 同 4 @ I m q r e 先 i l E U V ; c R O 数 X D) D 9 C R O E 并将 R O { _ 和 f g 缴纳 k 9C 8 w 通知 L M [\ T

& 9 ! % 9C 模 Y 分 O ' 般 模 Y 和 券 w O 付 模 Y T

) D 券 w O 付 模 Y 9Ck E f g 满足 < = 条件:

' / R O S X 均 < 3 x { | 开立 k 4 @ I m 账 ^ c d 9C;

+ / R O S X c d 9Ck 4 @ I m 账 ^ 4 O 同 ' 账 ^ ; , / 9: ; 1Rk a b 条件 T

& 9 & % 9C 在 R O (k 连续, 个 9: # 内 \$ T E s (O & ' Z & + Z & , 9C # T

' / & ' 9C #

< ' 般 模 Y) D 9Ck E g # O 9 券 # T K X f g 确保 9 券 k 4 @ I m 账 ^ 内 } 符 A ! k 可 9 9 9 @ # T

+ / & + 9C#

1. <' 般模Y) D9Ck Eg # O缴w# Tg # { | 时E
9: ; 将9C8wmj X{ | [\k { | #v 5Z 转: K
X{ | [\k { | #v 5E 同时释放) 59Ck => 占Vk
保证5T

2. < 券wO付模Y) D9Ck Eg # O券wO付# TK
X和j XFG9CRO{ _E 按照3x { | k } M1 R) D
券wO付T

, / &, 9C#

1. <' 般模Y) D9Ck Eg # OU券# T9: ; 将可
9C4@Z 转: j XU券k 4@I m账^ T

2. < 券wO付模Y) D9Ck Eg # { | 时E9: ; 释
放) 59Ck => 占Vk 保证5T

&9' % 因_` N现异常情况si 因导致9C无
D&常) Dk E 9: ; } XO9C流/) D调%T

&9(% KX8能在1 R 7 ~ 内~ 数9付可9C
4@或ej X8能在1 R 7 ~ 内~ 数缴纳9C8wk E 可<
U取差额1 偿k XY了{ 8F > ABT 申` U取差额1 偿k E
{ | [\f g 在&+ 9C# 10:00 6v 向9: ;) D申报T

&9. % ' X) D差额1 偿k E f g 按照= 列标#
通过9: ; 向OX支付1 偿5E 并向9: ; 支付差额1 偿部
分AB] 值' Rgh 2! 74@780 0.5%E 5! 74@
780 0.8%E 10! 74@780 1%/ k 惩罚性违B5T

' / 1 偿5

1. K X) D 差额1 偿k Ef g 支付差额1 偿部分AB] 值' Rgh 2! 74@780 0.5% E! 74@780 0.8% E 10! 74@780 1%/k 1 偿5; 若基# 4@] ^ k 于9 C{ |] d 转换因子乘积k EK X 还f g 按照< = 计| 公Y 继续支付差额1 偿5:

$$\text{差额1 偿5} = \text{差额1 偿部分AB数} a \times \text{基\# 4@] } ^ - 9 C\{ |] \times \text{转换因子} / \times \text{AB 面值} / 100 \text{ 元} /$$

2. j X) D 差额1 偿k Ef g 支付差额1 偿部分AB] 值' Rgh 2! 74@780 0.5% E! 74@780 0.8% E 10! 74@780 1%/k 1 偿5; 若9C{ |] d 转换因子乘积k 于基# 4@] ^ k E j X 还f g 按照< = 计| 公Y 继续支付差额1 偿5:

$$\text{差额1 偿5} = \text{差额1 偿部分AB数} a \times 9 C\{ |] \times \text{转换因子} - \text{基\# 4@] } ^ / \times \text{AB 面值} / 100 \text{ 元} /$$

差额1 偿(E 9: ; 向K X 退还已9付k 差额1 偿部分 L f k 4@T

$$+ / \text{基\# 4@}$$

; (9: # 6v 申` 9Ck E < K X 申报k 4@作O基 # 4@; ; (9: #) 59Ck E < < AB; } K X } 效申报9C数a; k k 4@作O基# 4@E; } K X } 效申报9 C数a; k k 4@4唯' k E < a 3上_ 9: # 7; 近k 4 @作O基# 4@T

按照上述XY 无D确R基# 4@k E 9: ; } X{ R基 # 4@T

, / 基# 4@] ^

基# 4@] ^ < 9: ; 认Rkqr \$%k 估值数GO
T

; (9: # 6v 申` 9Ck E < KX9C 申报g# < 基
4@k 估值作O基# 4@] ^ ; ; (9: #) 59Ck E
< ; (9: # < 基# 4@k 估值作O基# 4@] ^ T

9: ; } XO基# 4@] ^) D调%T

&9/% SX8能在1R7 ~ 内~ 数9付可9C
4@或e 9C8wk E9: ; 向SX分别U取Lf AB] 值
' Rgh 2! 74@780 1%E5! 74@780 1.6%E
10! 74@780 2%/k 惩罚性违B5T

. " * + < =

&90% 4@78AB; (9: # 6vk 9C{
|] OKX9C 申报g# k { |] E; (9: # k 9C{ |
] O集39: 3 < AB; (9: # 全部T9] ^ 按照T9
ak 加XF 均] T 计| { _ 保留: c 数点(, 位T

AB; (9: # 无T9k E9C{ |] 计| 公YO: 9
C{ |] =< AB上' 9: # { |] +基# ABg# { |]
-基# AB上' 9: # { |] Ea 3E 基# ABOg# } T
9k 离9C" 份; 近k ABTFGS 公Y 计| Nk 9C{ |
] 超NAB 涨跌停板] ^ k E 取涨跌停板] ^ 作O9C{ |
] T

9: ; } XFG_` 情况O9C{ |]) D调%T
&97% 9C8w<9C{ |] O基础) D计| E
计| 公Y ~ =:

9C8w=9C数a × 9C{ |] ×转换因子+f 计利
息/ × AB面值/100 元/

a 3Ef 计利息O<可9C4@上' 付息#: &+ 9C
k 利息T

&98% 4@78ABk 9C? 续费标# O每? 5
元T 9: ; } XO9C? 续费标#) D调%T

' 9% 9Cj Kk 4@过^ 费s 费V按照4@I
mqr k } M1 R执DE\$H跨4@I mqr 9C过^ k E
pj X承担转I m费T

/ " > \$

' 9! % SPI ; ?AB] 值k 计| 公YO: AB
] 值=9C{ |] × AB面值/100 元/T

' 9&% 违反SPI 1Rk E9: ; 按照H345
6789: ; 违1 违B[ut DJ } M1 R[uT

' 9' % SPI p9: ; 负责解释T

' 9(% SPI 9 2020! 7" 20 # @NOT