

华泰期货有限公司交易者 交割资质认定规则

(2024年10月修订)

第一章 总则

第一条 根据《中华人民共和国期货和衍生品法》、上海期货交易所、上海国际能源交易中心、郑州商品交易所、大连商品交易所、广州期货交易所、中国金融期货交易所相关业务规则和《期货经纪合同》约定，制定以下交易者交割资质认定规则，对未满足交割资质认定条件的持仓交易者，视为不符合交割资质交易者，公司有权根据《期货经纪合同》的相关约定，不接受交易者的交割申请或对交易者的未平仓合约强行平仓，由此产生的费用和结果由交易者自行承担。

第二条 交易者应知晓并遵守法律法规、监管机构和行政管理部门的规定、行业自律规则以及期货交易场所制定的各项业务规则，特别是有关期货交割的规则。交易者应在交易前学习、掌握相关期货法律法规、规定和规则，并在交易、交割过程中严格遵守。交易者应当知晓从事期货交易、交割具有风险。

第三条 如相关法律法规、规定、规则或公司对交割资质认定标准有调整，公司将根据《期货经纪合同》约定的通知方式，通过网站公告、电话、手机短信、电子邮箱等任一方式向交易者发送通知。

第二章 上海期货交易所交割资质认定

第四条 能在上海期货交易所规定时间内按量交付或接收对应交割品种、交割金额的增值税专用发票（普通）发票或者上海期货交易所认可的其他票据。

第五条 持仓合约最后交易日前五个交易日收市前开通好上海期货交易所标准仓单管理系统并确保该系统能正常登录使用直至最后交割日。

第六条 持仓合约进入交割月份需满足交割单位整数倍要求。

第七条 买入交割交易者在最后交易日前一个交易日收市前，其期货账户中未占用货币资金需大于预计交割货款，公司将以预计交割货款（以交割结算价为基础，加减相应的升贴水和包装款）及相关费用为限，冻结其期货账户中的资金直至交易场所划扣。如其期货账户中未占用货币资金小于预计交割货款，则公司有权对其期货账户进一步采取下列一项或多项措施：

- 1、关闭其期货账户开仓权限；
- 2、关闭其期货账户出金权限；
- 3、对其期货账户内的部分或全部持仓执行强行平仓；
- 4、公司认为可以保障免受买入交割交易者交割货款不足导致公司损失的其他措施。

第八条 使用标准仓单交割的交易者，需在最后交易日前三个交易日收市前提交持有足够交割数量且符合交割要求的有效标准仓单的证明。

第九条 公司可根据合约流动性等市场因素提前要求交易者出具以上相关证明。

第三章 上海国际能源交易中心交割资质认定

第十条 能在上海国际能源交易中心规定时间内按量交付或接收对应交割品种、交割金额的增值税专用发票或上海国际能源交易中心规定的其他票据。

第十一条 持仓合约最后交易日前五个交易日收市前开通好上海国际能源交易中心标准仓单管理系统并确保该系统能正常登录使用直至最后交割日。

第十二条 持仓合约进入交割月份需满足交割单位整数倍要求。

第十三条 买入交割交易者在最后交易日前一个交易日收市前，其期货账户中未占用货币资金需大于预计交割货款，公司将以预计交割货款（以交割结算价为基础，加减相应的升贴水和包装款）及相关费用为限，冻结其期货账户中的资金直至交易场所划扣。如其期货账户中未占用货币资金小于预计交割货款，则公司有权对其期货账户进一步采取下列一项或多项措施：

- 1、关闭其期货账户开仓权限；
- 2、关闭其期货账户出金权限；
- 3、对其期货账户内的部分或全部持仓执行强行平仓；
- 4、公司认为可以保障免受买入交割交易者交割货款不足导致公司损失的其他措施。

第十四条 使用标准仓单交割的交易者，需在最后交易日前三个交易日收市前提交持有足够交割数量且符合交割要求的有效标准仓单证明。

第十五条 公司可根据合约流动性等市场因素提前要求交易者出具以上相关证明。

第四章 郑州商品交易所交割资质认定

第十六条 能在郑州商品交易所规定时间内按量交付或接收对应交割品种、交割金额的增值税专用发票或者郑州商品交易所认可的其他票据。

第十七条 持仓合约在最后交易日收市前需满足交割单位整数倍要求。

第十八条 交割甲醇、烧碱、对二甲苯等品种的交易者需在进入交割月前提交有效期覆盖交割月份最后一个交易日的《危险化学品经营许可证》等交易场所认可的文件，且其中经营许可范围包含甲醇、烧碱、对二甲苯等品种。

第十九条 买入交割交易者在最后交易日前一个交易日收市前，其期货账户中未占用货币资金需大于预计交割货款。其中：苹果、红枣、花生、烧碱、对二甲苯等品种交易者持有多头头寸（不考虑多空对冲）进入交割月时起，其期货账户中未占用货币资金需大于预计交割货款。公司将以预计交割货款（以交割结算价为基础，加减相应的升贴水和包装款）及相关费用为限，冻结其期货账户中的资金直至交易场所划扣。如其期货账户中未占用货币资金小于预计交割货

款，则公司有权对其期货账户进一步采取下列一项或多项措施：

- 1、关闭其期货账户开仓权限；
- 2、关闭其期货账户出金权限；
- 3、对其期货账户内的部分或全部持仓执行强行平仓；
- 4、公司认为可以保障免受买入交割交易者交割货款不足导致公司损失的其他措施。

第二十条 使用标准仓单交割的交易者，需在最后交易日前提提交持有足够交割数量且符合交割要求的有效标准仓单的证明。使用非标准仓单交割的交易者，需在最后交易日前三个交易日收市前提提交足够交割数量且符合交割要求的货物库存证明和货物质量证明书等相关证明。

第二十一条 公司可根据合约流动性等市场因素提前要求交易者出具以上相关证明。

第五章 大连商品交易所交割资质认定

第二十二条 能在大连商品交易所规定时间内按量交付或接收对应交割品种、交割金额的增值税专用发票（普通）发票或者大连商品交易所认可的其他票据。其中：黄大豆1号、黄大豆2号、豆粕、豆油、棕榈油等品种的交易者，须在进入交割月前提提交合法有效的能够接收或者开具增值税发票的资质证明。

第二十三条 持仓合约在最后交易日收市前需满足交割单位整数倍要求。

第二十四条 交割苯乙烯、液化石油气等品种的交易者需在进入交割月前提交有效期覆盖交割月份最后一个交易日的《危险化学品经营许可证》等交易场所认可的文件，且其中经营许可范围包含苯乙烯、液化石油气等品种。

第二十五条 选择车板交割卖出鸡蛋品种的交易者需在进入交割月之前获批车板交割资格。

第二十六条 买入交割交易者在最后交易日前一个交易日收市前，其期货账户中未占用货币资金需大于预计交割货款。其中：黄大豆一号、黄大豆二号、玉米、豆粕、豆油、玉米淀粉、粳米、乙二醇、苯乙烯、液化石油气、焦煤、焦炭、鸡蛋、生猪、铁矿石等品种交易者持有多头头寸（不考虑多空对冲）进入交割月时起，其期货账户中未占用货币资金需大于预计交割货款。公司将以预计交割货款（以交割结算价为基础，加减相应的升贴水和包装款）及相关费用为限，冻结其期货账户中的资金直至交易场所划扣。如其期货账户中未占用货币资金小于预计交割货款，则公司有权对其期货账户进一步采取下列一项或多项措施：

- 1、关闭其期货账户开仓权限；
- 2、关闭其期货账户出金权限；
- 3、对其期货账户内的部分或全部持仓执行强行平仓；
- 4、公司认为可以保障免受买入交割交易者交割货款不足导致公司损失的其他措施。

第二十七条 使用标准仓单交割的交易者，需在最后交易日前提交持有足够交割数量且符合交割要求的有效标准

仓单的证明。使用非标准仓单交割的交易者，需在最后交易日前三个交易日收市前提交足够交割数量且符合交割要求的货物库存证明和货物质量证明书等相关证明。

第二十八条 公司可根据合约流动性等市场因素提前要求交易者出具以上相关证明。

第六章 广州期货交易所交割资质认定

第二十九条 能在广州期货交易所规定时间内按量交付或接收对应交割品种、交割金额的增值税专用发票或者广州期货交易所认可的其他票据。

第三十条 持仓合约在最后交易日收市前需满足交割单位整数倍要求。

第三十一条 买入交割交易者在最后交易日前一个交易日收市前，其期货账户中未占用货币资金需大于预计交割货款。其中：工业硅、碳酸锂等品种交易者持有多头头寸（不考虑多空对冲）进入交割月时起，其期货账户中未占用货币资金需大于预计交割货款。公司将以预计交割货款（以交割结算价为基础，加减相应的升贴水和包装款）及相关费用为限，冻结其期货账户中的资金直至交易场所划扣。如其期货账户中未占用货币资金小于预计交割货款，则公司有权对其期货账户进一步采取下列一项或多项措施：

- 1、关闭其期货账户开仓权限；
- 2、关闭其期货账户出金权限；
- 3、对其期货账户内的部分或全部持仓执行强行平仓；

4、公司认为可以保障免受买入交割交易者交割货款不足导致公司损失的其他措施。

第三十二条 使用标准仓单交割的交易者，需在最后交易日前提提交持有足够交割数量且符合交割要求的有效标准仓单的证明。使用非标准仓单交割的交易者，需在最后交易日前三个交易日收市前提提交足够交割数量且符合交割要求的货物库存证明和货物质量证明书等相关证明。

第三十三条 公司可根据合约流动性等市场因素提前要求交易者出具以上相关证明。

第七章 中国金融期货交易所国债交割资质认定

第三十四条 交易者应当在交割月之前的二个交易日收市前具有中国金融期货交易所审核通过的国债托管账户。

第三十五条 买入交割交易者在进入交割月时起，其期货账户中未占用货币资金需大于预计交割货款，公司将以预计交割货款（交割数量*（交割结算价*转换因子+应计利息）*（合约面值/100 元））及相关费用为限，冻结其期货账户中的资金直至交易场所划扣。如其期货账户中未占用货币资金小于预计交割货款，则公司有权对其期货账户进一步采取下列一项或多项措施：

- 1、关闭其期货账户开仓权限；
- 2、关闭其期货账户出金权限；
- 3、对其期货账户内的部分或全部持仓执行强行平仓；
- 4、公司认为可以保障免受买入交割交易者交割货款不足导致公司损失的其他措施。

第三十六条 卖出交割交易者需在最后交易日之前的三个交易日前提交持有足够交割数量且符合交割要求的国债证明。

第三十七条 公司可根据合约流动性等市场因素提前要求交易者出具以上相关证明。

第八章 附则

第三十八条 华泰期货有限公司有权依据相关期货法律法规、规定和规则变动对本规则要求进行调整。

第三十九条 本规则的解释权属于华泰期货有限公司。

第四十条 本规则自发布之日起实施。原《华泰期货有限公司交易者交割资质认定规则》（华泰期字〔2023〕226号）同步废止。