

关于提示国债期货交割相关事项的通知

中金所发〔2020〕24号

各会员单位：

现就2020年12月份5年期国债期货、10年期国债期货、2年期国债期货交割相关事项提示如下：

一、5年期国债期货、10年期国债期货、2年期国债期货合约最后交易日为合约到期月份的第二个星期五，最后交易日为国家法定节假日或者因异常情况等原因未交易的，以下一交易日为最后交易日。TF2012、T2012、TS2012合约的最后交易日为2020年12月11日。

二、国债期货实行持仓限额制度，自交割月份之前的一个交易日起，客户TF2012、T2012、TS2012合约持仓限额分别为600手、1200手、600手；非期货公司会员TF2012、T2012、TS2012合约持仓限额分别为1200手、2400手、1200手。超出持仓限额标准的，交易所按照《中国金融期货交易所风险控制管理办法》的相关规定，对超仓头寸予以强行平仓。

三、参与交割的非期货公司会员应当事先向交易所申报国债托管账户。参与交割的客户应当事先通过会员向交易所申报国债托管账户。会员、客户应当确保所申报的国债托管账户真实、有效。

非期货公司会员、客户按照交易编码申报国债托管账户，申报中央结算开立的国债托管账户的，只能申报一个国债托管账户；申报中国结算开立的国债托管账户的，应当同时申报在中国结算上海分公司和中国结算深圳分公司开立的国债托管账户，且只能分别申报一个国债托管账户。

四、自交割月份之前的二个交易日起至最后交易日之前一个交易日，每日收市后，同一交易编码的交割月份合约双向持仓对冲平仓，平仓价格为该合约前一交易日的结算价。对冲平仓结果不计入当日结算价的计算。

五、自交割月份之前的一个交易日起，交易所按照《中国金融期货交易所风险控制管理办法》的相关规定，对未通过国债托管账户审核的非期货公司会员、客户的交割月份合约持仓予以强行平仓。

六、合约进入交割月份后至最后交易日之前，由卖方主动提出交割申报，并由交易所按照“申报意向优先，持仓日最久优先，相同持仓日按比例分配”的原则确定进入交割的买方持仓。最后交易日之前未进行交割申报但被交易所确定进入交割的买方持仓，交易所根据卖方交券的国债托管账户，按照国债托管机构优先原则在该买方事先申报的国债托管账户中指定收券账户。

七、最后交易日收市后，同一客户号的双向持仓对冲平仓，平仓价格为该合约前一交易日的结算价，同一客户号的净持仓进入交割。对冲平仓结果不计入交割结算价的计算。

八、最后交易日进入交割的，会员应当在最后交易日15:15前向交易所申报买方收券的国债托管账户和卖方的可交割国债名称、数量以及交券的国债托管账户等信息。买方以在中国结算开立的账户收券的，应当同时提供在中国结算上海分公司和中国结算深圳分公司开立的账户。

最后交易日进入交割的，会员未在规定时间内申报买方交割信息的，交易所根据卖方交券的国债托管账户，按照国债托管机构优先原则在该买方事先申报的国债托管账户中指定收券账户。会员未在规定时间内申报卖方交割信息的，视为卖方未能在规定期限内如数交付可交割国债。

请各会员单位加强风险控制，做好相关风险提示与风险管理工作，确保市场平稳运行。

特此通知。

中国金融期货交易所
2020年11月20日