



国金期货有限责任公司
中金所国债期货交割服务手册



目录

一、交割条件	3
二、托管账户申报	3
1. 申报材料清单	3
2. 申报流程	3
三、交割方式	4
四、交割结算价	4
五、交割参数	4
六、交割意向	4
七、交割流程	5
1. 滚动交割	5
2. 集中交割	6




一、交割条件

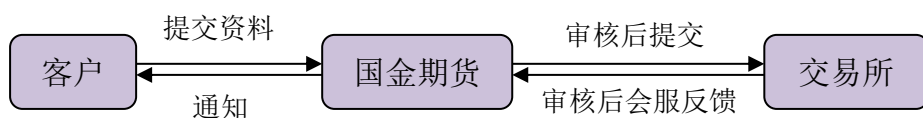
交割月之前的二个交易日前（含）具有交易所审核通过的国债托管账户。

二、托管账户申报

1. 申报材料清单

申报材料		备注
国债期货交割客户国债托管账户申报表		 国债交割客户国债托管账户申报表.do
中债登	中债登开具的开户通知书复印件或其他相关证明材料	
中证登	中证登开具的 A 股证券账户卡、证券账户开户办理确认单复印件或其他相关证明材料	
客户国债托管账户的开户证件复印件； 期货账户的开户证件复印件；		开户证件名称或证件号码不一致的，应当提供能够证明其为同一身份的必需材料。
交易所要求的其他材料。		

2. 申报流程





三、交割方式

国债期货适用的交割方式包括滚动交割和集中交割。

滚动交割指期货合约在进入交割月后的第一交易日至最后交易日（不含当日）期间，该期货合约持仓的买卖双方通过主动申请的方式提交交割意向，由交易所组织匹配双方在规定时间内完成交割的交割方式。

集中交割，又叫一次性交割，指在最后交易日，交易所组织所有未平仓合约持有者进行交割的交割方式。

四、交割结算价

滚动交割结算价：配对日的当日结算价；

集中交割结算价：当日全部成交价格按照成交量加权的平均价（保留小数点后3位）。

五、交割参数



国债交割单位为1手，交割手续费为10元/手。¹

六、交割意向

参与国债交割的，需通过我公司向中金所提交交割意向申请。如

¹ 截止到2022年12月31日，中金所国债期货交割手续费减半收取。

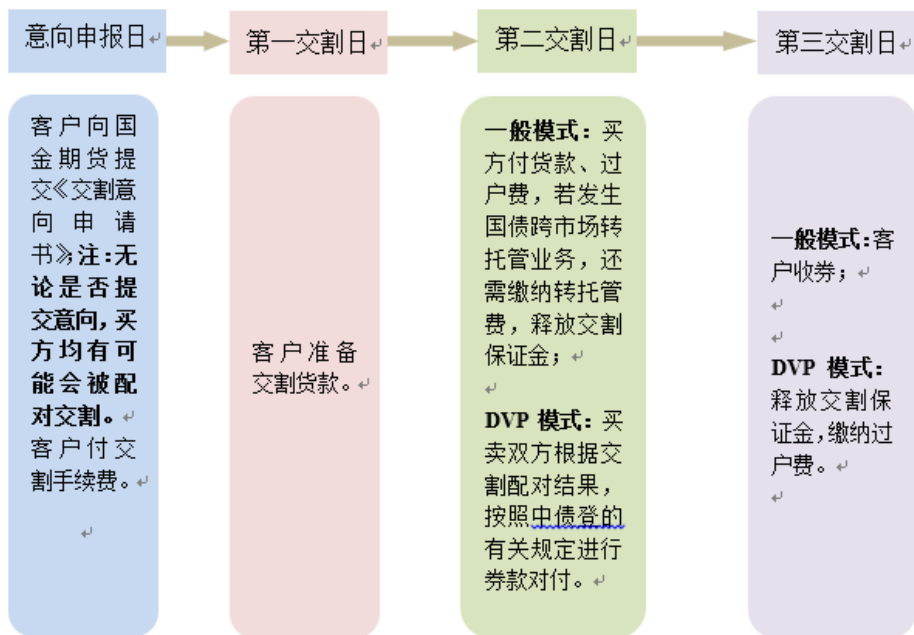
买方客户滚动交割期间被动配对，无需提交。

买方客户	卖方客户
 国债买方交割意向. docx	 国债卖方交割意向. docx

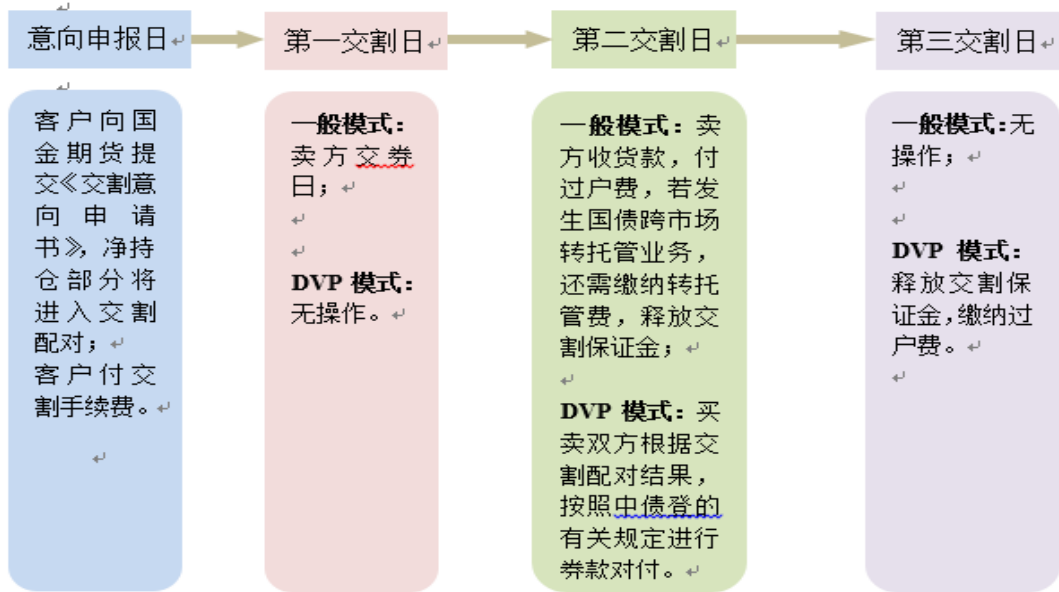
七、交割流程

1. 滚动交割

买方客户滚动交割流程如下图

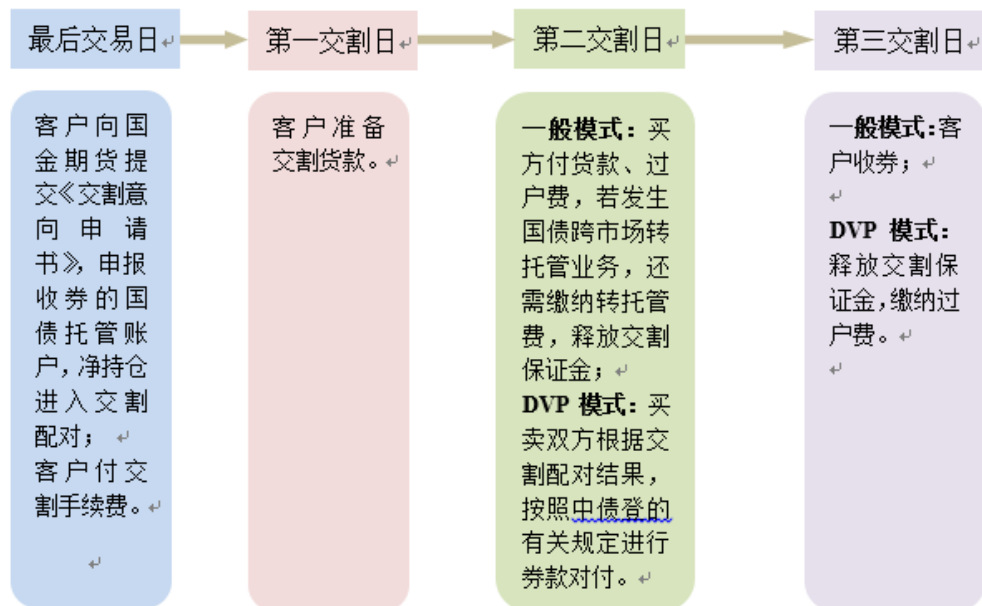


卖方客户滚动交割流程如下图



2. 集中交割

买方客户集中交割流程如下图



卖方客户集中交割流程如下图

