

## 关于 30 年期国债期货合约上市交易有关事项的通知

尊敬的客户：

根据中国金融期货交易所相关通知。现就 30 年期国债期货合约上市交易有关事项通知如下：

### 一、上市交易时间

30 年期国债期货合约自 2023 年 4 月 21 日（星期五）起上市交易。

### 二、上市交易合约和挂盘基准价

30 年期国债期货首批上市合约为 2023 年 6 月（TL2306）、2023 年 9 月（TL2309）和 2023 年 12 月（TL2312）。各合约挂盘基准价由交易所在合约上市交易前一交易日公布。

### 三、交易保证金和涨跌停板幅度

30 年期国债期货各合约的公司交易保证金为合约价值的 4%，自交割月份之前的两个交易日结算时起，公司交易保证金标准为合约价值的 5.5%。对 2 年期国债期货、5 年期国债期货、10 年期国债期货和 30 年期国债期货的跨品种双向持仓，按照交易保证金单边较大者收取交易保证金。上市当日各合约的涨跌停板幅度为挂盘基准价的  $\pm 7\%$ 。

### 四、相关费用

30 年期国债期货合约的公司交易手续费为每手 15 元，平今仓交易免收手续费。

## 五、交易指令每次最大下单数量

30 年期国债期货各合约限价指令每次最大下单数量为 50 手，市价指令每次最大下单数量为 30 手。

## 六、可交割国债、转换因子及应计利息

30 年期国债期货各合约的可交割国债和转换因子由交易所在合约上市交易前公布。其转换因子计算公式如下：

$$\text{转换因子} = \frac{1}{\left(1 + \frac{r}{f}\right)^{\frac{xf}{12}}} \times \left[ \frac{c}{f} + \frac{c}{r} + \left(1 - \frac{c}{r}\right) \times \frac{1}{\left(1 + \frac{r}{f}\right)^{n-1}} \right] - \frac{c}{f} \times \left(1 - \frac{xf}{12}\right)$$

其中，r：30 年期国债期货合约票面利率 3%；

x：交割月到下一付息月的月份数；

n：剩余付息次数；

c：可交割国债的票面利率；

f：可交割国债每年的付息次数。

计算结果四舍五入至小数点后 4 位。

其应计利息的日计数基准为“实际天数/实际天数”，即每 100 元可交割国债的应计利息计算公式如下：

$$\text{应计利息} = \frac{\text{可交割国债票面利率} \times 100}{\text{每年付息次数}} \times \frac{\text{第二交割日} - \text{上一付息日}}{\text{当前付息周期实际天数}}$$

应计利息 = (可交割国债票面利率 × 100) / 每年付息次数 × (第二交割日 - 上一付息日) / 当前付息周期实际天数

计算结果四舍五入至小数点后 7 位。

## 七、做市商持仓限额

做市商所有月份 30 年期国债期货合约单边持仓限额为 6000 手，某一合约在交割月份之前的一个交易日起，单边持仓限额为 1200 手。

30 年期国债期货合约上市交易其他事项另行公布。

各会员单位要认真做好 30 年期国债期货合约上市交易的各项准备工作，严格控制市场风险，确保 30 年期国债期货平稳推出和安全运行。

特此通知。

兴业期货有限公司

二〇二三年四月十七日