

# 关于发布 PTA 期货引入境外交易者相关业务规则的公告

〔2018〕66 号

为满足 PTA 期货引入境外交易者相关业务需要,根据《期货交易管理条例》《期货交易所管理办法》等有关法规和规章,我所制定了《郑州商品交易所特定品种交易者适当性管理办法》《期货公司会员接受境外经纪机构委托开展期货业务管理办法》和《郑州商品交易所保税交割实施细则》,并对《郑州商品交易所期货交易细则》《郑州商品交易所期货结算细则》《郑州商品交易所指定存管银行管理办法》《郑州商品交易所期货交割细则》《郑州商品交易所标准仓单及中转仓单管理办法》《郑州商品交易所指定商品交割仓库管理办法》《郑州商品交易所夜盘交易细则》《郑州商品交易所期货交易风险控制管理办法》《郑州商品交易所套期保值管理办法》《郑州商品交易所异常交易管理办法》《郑州商品交易所实际控制关系账户管理办法》和《郑州商品交易所违规处理办法》等 12 部规则进行了修改,相关草案及修订案已经郑州商品交易所第六届理事会第十二次会议审议通过,并已报告中国证监会,现予公告。除以下条款外,本次制定、修改的规则自发布之日起施行,原《郑州商品交易所保税交割实施细则(试行)》同时废止。

《郑州商品交易所期货交割细则》第七十一条、第七十五条、第九十一条、第一百零六条修改部分，以及《郑州商品交易所保税交割实施细则》第二十七条、第二十八条、第三十条至第三十二条、第三十四条至第三十七条、第三十九条至第四十一条、第四十三条、第四十四条自2019年5月2日起施行。

特此公告。

- 附件：1. 《郑州商品交易所特定品种交易者适当性管理办法》
2. 《期货公司会员接受境外经纪机构委托开展期货交易业务管理办法》
3. 《郑州商品交易所保税交割实施细则》
4. 《郑州商品交易所期货交易细则》修订案及净稿
5. 《郑州商品交易所期货结算细则》修订案及净稿
6. 《郑州商品交易所指定存管银行管理办法》修订案及净稿
7. 《郑州商品交易所期货交割细则》修订案及净稿
8. 《郑州商品交易所标准仓单及中转仓单管理办法》修订案及净稿
9. 《郑州商品交易所指定商品交割仓库管理办法》修订案及净稿

10. 《郑州商品交易所夜盘交易细则》修订案及净稿
11. 《郑州商品交易所期货交易风险控制管理办法》修订案及净稿
12. 《郑州商品交易所套期保值管理办法》修订案及净稿
13. 《郑州商品交易所异常交易行为管理办法》修订案及净稿
14. 《郑州商品交易所实际控制关系账户管理办法》修订案及净稿
15. 《郑州商品交易所违规处理办法》修订案及净稿

郑州商品交易所

2018年11月9日

## 附件 1

# 郑州商品交易所特定品种交易者适当性管理办法

(2018年10月23日第六届理事会第十二次会议审议通过,2018年11月9日发布,自发布之日起施行)

## 第一章 总 则

**第一条** 为了引导交易者理性参与特定品种期货交易,维护交易者合法权益,保障期货市场平稳、规范、健康发展,根据《期货交易管理条例》《境外交易者和境外经纪机构从事境内特定品种期货交易管理暂行办法》《证券期货投资者适当性管理办法》等法律、法规、规章及郑州商品交易所(以下简称交易所)业务规则,制定本办法。

**第二条** 本办法所称的交易者是指依照中华人民共和国法律法规规定从事特定品种期货交易并承担交易结果的自然人、法人和其他经济组织。

**第三条** 交易所特定品种期货交易实行交易者适当性制度。

本办法所称的开户机构是指参与特定品种期货交易,评估交易者对期货的认知水平和风险承受能力,审慎选择适当的交易者参与特定品种期货交易,落实适当性制度的相关要求的期货公司会员和境外经纪机构。

**第四条** 交易者应当全面评估自身经济实力、市场及产品认知能力、风险控制与承受能力,审慎决定是否参与特定品种期货交易。

## 第二章 适当性管理的标准

**第五条** 单位客户应符合以下标准：

（一）相关业务人员具备期货基础知识，了解交易所特定品种相关业务规则，通过相关测试；

（二）申请交易编码或开通交易权限前 5 个交易日每日结算后保证金账户可用资金余额均不低于人民币 10 万元或者等值外币；

（三）最近三年内具有境内期货交易成交记录，或者最近三年内具有在与中国证券监督管理委员会（以下简称中国证监会）签署监管合作谅解备忘录的国家（地区）期货监管机构监管的境外期货交易场所的期货交易成交记录；

（四）具有参与期货交易的内部控制、风险管理等相关制度；具有健全的信息通报制度，包括向开户机构提供和及时更新负责期货交易的部门主管人员及相关业务人员信息的机制；

（五）不存在严重不良诚信记录或者被有权监管机关宣布为期货市场禁止进入者的情形；

（六）不存在法律、法规、规章和交易所业务规则禁止或者限制从事期货交易的情形；

（七）交易所要求的其他条件。

**第六条** 个人客户应符合以下标准：

（一）具备完全民事行为能力；

（二）具备期货基础知识，了解交易所特定品种相关业务规则，通过相关测试；

（三）申请交易编码或开通交易权限前 5 个交易日每日结算后保证金账户可用资金余额均不低于人民币 10 万元或者等值外币；

（四）最近三年内具有境内期货交易成交记录，或者最近三年内具有在与中国证监会签署监管合作谅解备忘录的国家（地区）期货监管机构监管的境外期货交易场所的期货交易成交记录；

（五）不存在严重不良诚信记录或者被有权监管机关宣布为期货市场禁止进入者的情形；

（六）不存在法律、法规、规章和交易所业务规则禁止或者限制从事期货交易的情形；

（七）交易所要求的其他条件。

**第七条** 交易所可以根据市场情况对交易者适当性标准进行调整。

**第八条** 除法律、法规、规章以及中国证监会另有规定外，开户机构为交易所认可的特殊类型客户申请交易编码或开通交易权限，可以不适用本办法第五条第（一）项至第（三）项、第六条第（二）项至第（四）项规定的标准。

前款所称特殊类型客户，是指符合以下条件之一的交易者：

（一）符合《证券期货投资者适当性管理办法》规定的专业投资者；

（二）已直接通过期货公司申请并开通或开立特定品种交易权限或交易编码，再通过其他期货公司申请开通或开立特定品种交易权限或交易编码的境内外交易者；

(三) 已开通或开立其他境内期货交易所特定品种交易权限或交易编码的境内外交易者；

(四) 交易所规定的其他交易者。

### 第三章 适当性管理的实施

**第九条** 开户机构应当根据中国证监会有关规定、本办法及交易所特定品种交易者适当性制度操作指引要求，制定特定品种期货交易者适当性管理的具体标准、业务流程以及执行交易者适当性制度的保障措施，对客户的资产状况、知识水平、交易经历、风险承受能力等进行综合评估。

**第十条** 开户机构应当建立并有效执行客户开发责任追究制度，明确相关岗位工作人员的责任。

**第十一条** 开户机构应当向客户充分揭示期货交易风险，客观介绍期货法律法规、交易所特定品种业务规则及有关的规定和决定，验证客户资金、特定品种知识测试、期货交易经历、审慎评估客户的诚信状况和风险承受能力，严格审核客户交易编码或交易权限申请材料。

**第十二条** 客户的期货交易基础知识测试应当符合以下要求：

(一) 客户应当参加交易所认可的知识测试，测试分数不得低于交易所公布标准；

(二) 个人客户本人及单位客户的指定下单人应当参加测试，不得由他人替代；

(三) 开户机构的客户开发人员不得兼任知识测试监督人员。

开户机构应当对客户进行辅导，督促客户遵守期货交易相关法律、法规、规章、交易所业务规则及有关规定和决定，持续开展客户风险教育，加强客户交易行为的合法与合规性管理。

**第十三条** 开户机构应当建立客户资料档案，妥善保存相关材料并严格为客户保密。

**第十四条** 开户机构应当为客户提供合理的投诉渠道，告知投诉的方法和程序，妥善处理纠纷，督促客户依法维护自身权益。

**第十五条** 交易者应当如实申报交易编码或交易权限申请材料，不得采取虚假申报等手段规避交易者适当性制度要求。

**第十六条** 交易者应当遵守买卖自负的原则，承担期货交易的结果，不得以不符合交易者适当性标准为由拒绝承担交易结果与履约责任。

**第十七条** 交易者应该通过正当途径维护自身合法权益，交易者维护自身合法权益时应当遵守法律法规的相关规定，不得侵害国家、社会、集体利益和他人合法权益，不得扰乱公共秩序、交易所及相关单位的工作秩序。

**第十八条** 期货公司会员与境外经纪机构之间存在委托协议的，应当建立业务对接规则，落实交易者适当性制度的相关要求。

**第十九条** 期货公司会员委托具有中间业务介绍资格的公司协助办理交易编码申请手续的，应当与该公司建立业务对接规则，落实交易者适当性制度的相关要求，并对该公司的相关业务进行复核。

## 第四章 适当性管理的监督

**第二十条** 交易所可以对开户机构落实交易者适当性制度情况进行检查，开户机构应当配合，如实提供客户交易编码及权限申请相关资料，不得隐瞒、阻碍和拒绝。

**第二十一条** 违反本办法规定的，交易所按《郑州商品交易所违规处理办法》的有关规定处理。

## 第五章 附 则

**第二十二条** 本办法解释权属于交易所。

**第二十三条** 本办法自发布之日起实施。

## 附件 2

# 期货公司会员接受境外经纪机构委托开展 期货交易业务管理办法

（2018 年 10 月 23 日第六届理事会第十二次会议审议通过，2018 年 11 月 9 日发布，自发布之日起施行）

## 第一章 总 则

**第一条** 为加强期货公司会员接受境外经纪机构委托开展期货交易业务的管理，根据《郑州商品交易所交易规则》和《郑州商品交易所会员管理办法》，制定本办法。

**第二条** 本办法所称境外经纪机构，是指在中华人民共和国境外依法设立、具有所在国（地区）期货监管机构认可的可以接受交易者资金和交易指令并以自己名义为交易者进行期货交易资质的金融机构。

**第三条** 期货公司会员接受境外经纪机构委托开展期货交易业务的，应当符合中国证券监督管理委员会（以下简称中国证监会）规定的条件。

**第四条** 本办法适用于期货公司会员、境外经纪机构及其从业人员。

## 第二章 业务规则

**第五条** 委托期货公司会员开展期货交易业务的境外经纪机构应当满足以下条件：

（一）在境外依法注册成立的金融机构，并取得所在国（地区）期货监管机构认可的可以接受交易者资金和交易指令并以自己名义为交易者进行期货交易的资质；

(二) 持续经营 1 年以上；

(三) 接受所在国（地区）期货监管机构监管，且该期货监管机构已与中国证监会签署监管合作谅解备忘录；

(四) 具有健全的治理机构和完善的内部控制制度，经营行为规范；

(五) 净资本不低于 3000 万元人民币或等值外币；

(六) 业务设施和技术系统符合相关技术规范且运行状况良好；

(七) 交易所规定的其他条件。

**第六条** 期货公司会员与境外经纪机构应当以书面形式签订委托协议。

委托协议应当包含以下条款：

(一) 委托范围；

(二) 最低保证金标准，办理相关资产作为保证金使用的流程及费用标准；

(三) 风险管理措施、条件及程序；

(四) 账户类型及管理模式、结算流程；

(五) 手续费标准；

(六) 信息许可及保密；

(七) 通知事项、方式及时限；

(八) 交易数据传送的安全与畅通；

(九) 交易、结算、交割、资金管理、行情和交易系统设置、客户服务及风险控制等事项的协作程序和规则；

(十) 发生强行平仓产生亏损的追索责任；

(十一) 不可归责于协议双方当事人所造成损失的情形及其处理方式；

- (十二) 协议变更和解除；
- (十三) 违约责任；
- (十四) 争议处理方式及司法管辖地；
- (十五) 法律适用；
- (十六) 交易所规定的其他事项。

境外经纪机构应当在委托协议中承诺从事境内期货相关业务活动时遵守中国法律、法规、规章和交易所业务规则及各项规定和决定，并不得损害客户和其他市场参与者的合法权益。

**第七条** 期货公司会员与境外经纪机构签订委托协议后，应当在办理业务前向交易所备案。

向交易所备案时，应当提交下列材料：

- (一) 备案说明；
- (二) 境外经纪机构证明可以满足本办法第五条相关条件的材料，以及境外经纪机构的期货业务风险控制负责人的有效身份证明、简历及签名印鉴卡；
- (三) 期货公司会员受托开展期货交易相关业务制度、内部控制制度和风险管理制度的材料；
- (四) 与境外经纪机构签订的委托协议；
- (五) 交易所规定的其他申请材料。

自收到符合规定的全部备案文件之日起 15 个交易日内，交易所决定是否准予备案。决定准予备案的，交易所核发备案号，并书面告知期货公司会员；决定不予备案的，书面说明原因。

**第八条** 变更委托协议内容的，期货公司会员应当在变更协议前向交易所提交变更备案申请及相关材料。交易所于收到正式文件之日起 10 个交易日内向期货公司会员书面确认备案情况。

**第九条** 终止委托协议的，期货公司会员应当在终止协议后 5 个交易日内向交易所提交材料，申请取消相关备案。交易所于收到相关文件之日起 10 个交易日内向期货公司会员书面确认备案情况。

**第十条** 期货公司会员可以为境外经纪机构开立综合资金账户，用于境外经纪机构的境外客户的期货结算、交割等，期货公司会员按照综合资金账户收取保证金，登记明细账至境外经纪机构（综合资金账户）为止。

**第十一条** 境外经纪机构应当遵守交易所风险控制制度和其他相关要求，配合期货公司会员严格控制风险。

**第十二条** 境外经纪机构应当对其受托的客户进行实名制审核，留存客户的开户材料和影音文件，并按照中国期货市场监控中心有限责任公司的业务规则申请交易编码。境外经纪机构应当协助期货公司会员履行相应的风险管理职责。

期货公司会员按照中国期货市场监控中心有限责任公司的业务规则协助境外经纪机构为境外客户开立交易账户，获取交易编码。

**第十三条** 境外经纪机构和期货公司会员之间期货业务资金的往来应当通过境外经纪机构的期货结算账户和会员保证金专用账户办理。

**第十四条** 境外经纪机构应当向客户提供交易所行情信息及交易通道，维护设备良好运行，保持信息、交易渠道通畅。

**第十五条** 境外经纪机构应当将客户交易指令直接传送至期货公司会员，不得进行私下对冲等交易。

**第十六条** 每日交易闭市后，期货公司会员应当对境外经纪机构进行结算，并将结算结果按照约定方式及时通知境外经纪机构。

**第十七条** 境外经纪机构的客户参与实物交割、期转现业务的，应当由境外经纪机构委托期货公司会员办理。

**第十八条** 境外经纪机构应当建立交易、结算、财务数据的备份制度。有关开户、变更、销户的客户资料档案、交易指令记录、交易结算记录、错单记录、客户投诉档案以及其他业务记录应当自期货经纪合同终止之日起至少保存 20 年。

**第十九条** 期货公司会员负责境外经纪机构在交易所从事期货交易的资金检查和风险控制。

**第二十条** 客户与境外经纪机构终止业务关系的，境外经纪机构应当及时办理销户手续，相关期货公司会员应当予以协助。

### **第三章 附 则**

**第二十一条** 违反本办法规定的，交易所按《郑州商品交易所违规处理办法》的有关规定处理。

**第二十二条** 本办法解释权属于郑州商品交易所。

**第二十三条** 本办法自发布之日起实施。

## 附件 3

# 郑州商品交易所保税交割实施细则

（2018年10月23日第六届理事会第十二次会议审议通过，2018年11月9日发布，第二十七条、第二十八条、第三十条至第三十二条、第三十四条至第三十七条、第三十九条至第四十一条、第四十三条、第四十四条自2019年5月2日起施行，其他条款自发布之日起施行）

## 第一章 总 则

**第一条** 为保证郑州商品交易所（以下简称交易所）保税交割业务的正常进行，规范交割行为，根据《郑州商品交易所交易规则》等相关规定，制定本细则。

**第二条** 交易所保税交割业务按本细则进行，交易所、会员、客户、境外经纪机构、保税交割仓库及质检机构等期货市场参与者办理与期货保税交割有关的各项业务，应当遵守本细则。

**第三条** 保税交割是指以海关特殊监管区域或保税监管场所内处于保税监管状态的期货合约所载商品作为交割标的物进行期货交割的过程。

**第四条** 保税交割仓库是指经交易所指定的、具有保税功能、履行期货保税交割的地点。

**第五条** 保税标准仓单是指由保税交割仓库按照交易所规定的程序提交仓单注册申请后，经交易所认可并登记注册，用于证明货主拥有实物或者可予提货的财产凭证。

**第六条** 保税标准仓单适用于交割、期转现、转让及交易所认可的其他用途。

**第七条** 本细则所称含税标准仓单、含税交割结算价是指《郑州商品交易所章程》《郑州商品交易所交易规则》及有关实施细则中的标准仓单、交割结算价。

## **第二章 甲醇期货的保税交割**

### **第一节 保税标准仓单的注册**

**第八条** 保税标准仓单的交割预报、入库和注册除按《郑州商品交易所标准仓单及中转仓单管理办法》办理外，客户还应提供相应的货权凭证、商检证书以及其他海关单证。

**第九条** 出入库费用、仓储费标准等遵循《郑州商品交易所期货交割细则》中的相关规定。

### **第二节 保税标准仓单的流通**

**第十条** 保税标准仓单在有效期内可用于交割、期转现、转让、充抵保证金等。保税标准仓单的有效期在对应期货品种含税标准仓单有效期的基础上顺延 5 个交易日。

**第十一条** 保税标准仓单可充抵保证金。交易所以保税标准仓单充抵保证金办理日前一交易日该保税标准仓单对应期货品种最近交割月期货合约结算价扣除进口增值税、进口消费税和进口关税后的数额为基准计算价值。具体流程按照《郑州商品交易所期货结算细则》办理。

**第十二条** 保税标准仓单折抵和含税标准仓单折抵的业务流程一致，具体按照《郑州商品交易所期货结算细则》相关规定办理。

**第十三条** 保税标准仓单在注销并办理报关完税手续后可申请注册含税标准仓单。

### **第三节 保税交割结算、发票流转及违约处理**

**第十四条** 保税交割的结算、发票流转及买卖双方违约的认定和处理等流程按照《郑州商品交易所期货交割细则》办理，本章另有规定的除外。

**第十五条** 交割配对后，卖方相应的保税标准仓单予以冻结，相应的交易保证金暂不予释放。

**第十六条** 交割日上午9点前买方应当补齐按照保税交割结算价计算的全额货款的差额。

**第十七条** 保税交割的货款结算按下列程序办理：

（一）保税标准仓单的交割货款根据交割数量、保税交割结算价和保税升贴水等计算。

（二）交割日闭市后，交易所向卖方开具报关所需的保税交割结算单和保税标准仓单持有清单。保税交割结算单包括买卖双方客户名称、会员单位名称、交割仓库名称、实际数量、保税交割结算价以及保税升贴水等内容。

（三）卖方应以保税交割结算单上注明的保税交割结算价加上保税升贴水作为成交价格向海关申报，及时完成报关手续，并按规定向买方交付增值税专用发票（普通）发票。

保税交割结算价 = [ (含税交割结算价 - 相关费用) / (1 + 进口增值税税率) - 消费税 ] / (1 + 进口关税税率)

保税升贴水 = [ 升贴水 / (1 + 进口增值税税率) ] / (1 + 进口关税税率)

保税交割货款 = (保税交割结算价 + 保税升贴水) × 保税交割数量

以上公式适用于消费税从量计征、关税从价计征的期货品种，公式中升贴水为考虑交割品级、品质和仓库地区分布等因素对交割结算价进行的调整。公式中升贴水及相关费用由交易所另行公告。

遇国家税收政策调整的，交易所可对保税交割结算价的计算公式进行调整，并适时予以公布。

(四) 货款划转和仓单过户应在卖方办理完报关手续后进行。同时，该批保税标准仓单交割后经审核变更为含税标准仓单。

**第十八条** 对实行保税交割的期货品种，交易所在交割月配对日闭市后，同时公布当日合约含税交割结算价和保税交割结算价。

**第十九条** 卖方应按下列流程办理报关手续、开具增值税发票：

(一) 报关期内，即自交割日（不含该日）起 7 个交易日内，卖方应当凭保税交割结算单、保税仓单持有清单以及其他单证完成报关手续，逾期未完成视为交割违约。

(二) 报关期结束后的 7 个交易日内，卖方应向买方开具增值税专用发票（普通）发票。延迟 1 至 10 日（日历日）交付增值税专用发票（普通）发票的，卖方应当每天支付按交割结算价计算的货款金额 0.5‰

的滞纳金；超过 10 日（日历日）仍未提供增值税专用发票（普通）发票的，视为拒绝提供增值税专用发票（普通）发票，按《郑州商品交易所期货交割细则》的有关规定处理。

发生上述违约行为的，卖方应当根据《郑州商品交易所期货交割细则》的规定支付违约金。因海关或其他政策性原因导致卖方报关延迟完成和增值税专用发票（普通）发票延迟交付的，货款划转及仓单过户顺延办理，卖方无需支付相应的滞纳金，且不作违约处理。

**第二十条** 非经配对交割实现的保税标准仓单货权转让，交易所不开具保税交割结算单，货款结算及票据流转由会员或客户自行协商办理。该笔保税仓单报关的完税价格由海关根据有关规定进行审价。

#### **第四节 保税期货转现货**

**第二十一条** 保税期货转现货（以下简称保税期转现）是指持有同一交割月份合约的多空双方之间达成现货买卖协议后，变期货部位为现货部位的交易。

保税期转现只允许保税标准仓单期转现。

**第二十二条** 用保税标准仓单进行期转现，交易所不开具保税交割结算单，货款结算及票据流转由会员或客户自行协商办理。

**第二十三条** 保税期转现办理流程按照《郑州商品交易所期货交割细则》“期货转现货”一章有关规定执行。

#### **第五节 保税标准仓单的注销和提货出库**

**第二十四条** 保税标准仓单注销和提货按照《郑州商品交易所标准仓单及中转仓单管理办法》办理，本章另有规定的除外。

**第二十五条** 保税标准仓单按照《郑州商品交易所标准仓单及中转仓单管理办法》注销后，在办理注销货物出库时，提货人除了提供交易所开具的《提货通知单》验证密码、提货人身份证、提货人所在单位办理提货手续的证明等材料外，还应提供海关放行单等单证。

### **第三章 PTA 期货的保税交割**

#### **第一节 保税标准仓单的注册**

**第二十六条** 保税标准仓单的生成流程按照交易所标准仓单的有关规定执行。

**第二十七条** 保税交割仓库申请注册的标准仓单应当明确对应货物为保税状态或完税状态，并对不同状态的货物分别管理。

**第二十八条** 被我国征收反倾销税的境外厂商生产的 PTA 不得用于注册保税标准仓单。

#### **第二节 保税标准仓单的流通**

**第二十九条** PTA 保税标准仓单可用于交割、期转现、充抵保证金、转让及交易所认可的其他用途。

**第三十条** PTA 保税标准仓单的交割及期转现，除本章第三节、第四节规定外，按照《郑州商品交易所期货交割细则》、《郑州商品交易所期货结算细则》有关规定办理。

**第三十一条** 保税标准仓单转让应当在交易所办理过户手续，委托交易所划转货款，转让价格应当在提交转让申请当日最近交割月份合约涨跌停板价格扣除税费的范围内。交易所完成仓单过户和货款划转后，为卖方开具《保税交割结算单》（税务专用、记账专用），为买方开具《保税交割结算单》（记账专用）。《保税交割结算单》中应包

括价格信息、买卖双方客户名称、会员单位名称、产地、实际数量、交割时间、交割方式等内容，交割方式中应当标注“转让”。卖方会员应在仓单转让完成后 7 个交易日闭市前向交易所提交增值税普通发票，未提交发票的，交易所对其按货款的 5%预扣相应的款项，并按照《郑州商品交易所期货交割细则》及《郑州商品交易所期货结算细则》相关规定处理。

**第三十二条** 保税标准仓单可充抵保证金。保税标准仓单充抵保证金的，交易所办理日前一交易日最近交割月期货合约结算价扣除相关税费后的数额作为基准计算价值。具体流程按照《郑州商品交易所期货结算细则》办理。

保税仓单充抵保证金的基准价格= $[(\text{申请日前一日最近交割月份合约结算价}-\text{相关费用})/(1+\text{进口增值税税率})-\text{消费税}]/(1+\text{进口关税税率})$ 。本条所称相关费用包括商品进口报关、报检及代理服务费用等，具体由交易所另行发布。消费税从量计征，关税从价计征。

### 第三节 保税交割结算、发票流转及违约处理

**第三十三条** 保税标准仓单的交割配对流程按照《郑州商品交易所期货交割细则》执行。

**第三十四条** 交割日上午 9 时之前，买方会员应当补齐与其交割月份合约持仓相对应的差额货款。

保税标准仓单货款=保税交割结算价 $\times$ 保税标准仓单数量 $\times$ 交易单位；其中，保税交割结算价= $[(\text{交割结算价}-\text{相关费用})/(1+\text{进口增值税税率})-\text{消费税}]/(1+\text{进口关税税率})$ 。

本条所称相关费用包括商品进口报关、报检及代理服务费用等，具体由交易所另行发布。消费税从量计征，关税从价计征。

保税交割结算价由交易所在交割月配对日闭市后公布。遇国家税收政策调整的，交易所可以对保税交割结算价的计算公式进行调整，并及时公布。

**第三十五条** 交割日闭市后，交易所将卖方会员提交的保税标准仓单交付买方会员，将保税标准仓单货款付给卖方会员，并给卖方开具《保税交割结算单》（税务专用、记账专用），给买方开具《保税交割结算单》（记账专用）和《保税交割结算单》（报关专用）。《保税交割结算单》中应包括价格信息、买卖双方客户名称、会员单位名称、产地、实际数量、交割时间、交割方式等内容。交割方式中应当标注“交割”。

**第三十六条** 参与 PTA 保税标准仓单交割的，境内卖方客户应向卖方会员开具增值税普通发票，境外卖方客户或境外经纪机构应向卖方会员开具相应的收款凭证；卖方会员应向交易所开具增值税普通发票；交易所应向买方会员开具增值税普通发票；买方会员应向买方客户、境外经纪机构开具增值税普通发票。

**第三十七条** 卖方会员应在交割日后 7 个交易日闭市前向交易所提交增值税普通发票，未提交发票的，交易所对其按货款的 5%预扣相应的款项，并按照《郑州商品交易所期货交割细则》及《郑州商品交易所期货结算细则》相关规定处理。

#### 第四节 保税期货转现货

**第三十八条** 保税期转现的保税标准仓单交收和货款支付由交易所负责办理，手续费按照《郑州商品交易所期货结算细则》和《郑州商品交易所期货交割细则》等相关规定收取。

**第三十九条** 保税期转现结算时，交易所按照申请日前一日最近交割月份合约结算价对买卖双方的相应持仓进行平仓，结算盈亏；按照保税期转现交割结算价划转货款。每个交易日结束后，交易所将当日执行的保税期转现有关信息予以公布。

保税期转现货款=保税期转现交割结算价×申请期转现保税仓单数量×交易单位

其中，保税期转现交割结算价=[(申请日前一日最近交割月份合约结算价-相关费用)/(1+进口增值税税率)-消费税]/(1+进口关税税率)。本条所称相关费用包括商品进口报关、报检及代理服务费用等，具体由交易所另行发布。消费税从量计征，关税从价计征。

**第四十条** 保税期转现批准日闭市后，交易所将卖方会员提交的标准仓单交付买方会员，为卖方开具《保税交割结算单》（税务专用、记账专用），为买方开具《保税交割结算单》（记账专用）和《保税交割结算单》（报关专用）。《保税交割结算单》中应包括价格信息、买卖双方客户名称、会员单位名称、产地、实际数量、交割时间、交割方式等内容，交割方式中应当标注“期转现”。

**第四十一条** 卖方会员应在期转现批准日后7个交易日闭市前向交易所提交增值税普通发票，未提交发票的，交易所对其按货款的5%预扣相应的款项，并按照《郑州商品交易所期货交割细则》及《郑州商品交易所期货结算细则》相关规定处理。

## 第五节 保税标准仓单的注销和提货出库

**第四十二条** 保税标准仓单的注销业务流程和基本要求，除本节规定外，按照《郑州商品交易所标准仓单及中转仓单管理办法》办理。

**第四十三条** 保税标准仓单持有人需要对保税商品办理报关进口或转运出境的，按照当地海关的相关规定办理进口报关或转运出境手续。

**第四十四条** 货主办理报关进口时，按照保税交割结算单（报关专用）上标明的交割结算价向海关申报，供海关审定 PTA 完税价格，并按照海关相关规定缴纳税款。

## 第四章 附 则

**第四十五条** 本细则的解释权属于郑州商品交易所。

**第四十六条** 本细则未尽事宜，参照《郑州商品交易所交易规则》及其实施细则等有关规定执行。

**第四十七条** 本细则自发布之日起实施。

## 郑州商品交易所期货交易细则修订案

(2018 年 10 月 23 日郑州商品交易所第六届理事会第十二次  
会议审议通过)

对《郑州商品交易所期货交易细则》作如下修改：

一、第二十条第二款修改为：“境外客户是指通过期货公司会员直接开户，或者通过境外经纪机构转委托期货公司会员开户的境外交易者。境外客户不得通过同一家期货公司会员同时采取以上两种方式开户，或者同时通过两家境外经纪机构转委托同一家期货公司会员开户”。

二、新增第二十条第三款“除交易所业务规则另有规定外，前款所述境外交易者参与特定品种期货交易应当适用交易所业务规则关于客户的相关规定”。

# 郑州商品交易所期货交易细则

(2008年1月7日第五届理事会通讯会议审议通过,2008年1月15日发布,自发布之日起施行;2009年3月28日第五届理事会通讯会议审议通过,2009年4月15日发布,自2009年4月20日施行;2013年6月14日第五届理事会第四次通讯会议修改,2013年7月9日发布,自2013年9月16日起施行;2014年6月13日第五届理事会第七次通讯会议修改,2014年11月21日发布,自2014年12月12日起施行;2018年9月20日第六届理事会第十次会议修订,2018年9月28日发布,自2018年10月8日起施行;2018年10月23日第六届理事会第十二次会议修订,2018年11月9日发布,自2018年11月9日起施行)

## 第一章 总 则

**第一条** 为规范期货交易,保护期货交易当事人的合法权益,保障郑州商品交易所(以下简称交易所)期货交易的顺利进行,根据《郑州商品交易所交易规则》,制定本细则。

**第二条** 交易所、会员、境外经纪机构、客户应当遵守本细则。

## 第二章 席位管理

**第三条** 交易席位是会员将交易指令输入交易所计算机交易系统参与集中竞价交易的通道。

交易所提供的交易席位为远程交易席位。远程交易席位是指会员在其营业场所,通过同交易所计算机交易系统联网的电子通信系统直接输入交易指令,参加交易所集中竞价交易的通道。

根据业务发展需要,交易所可以设置特别席位,与席位使用人约定相关权利和义务。

禁止私下将交易席位全部或者部分以发包、转包、转租、抵押、转让等形式交由其他机构和个人使用。

**第四条** 会员取得会员资格,即可申请使用远程交易席位。经交

易所批准，可以增加远程交易席位。

**第五条** 会员增加交易席位仅是增加该会员的交易通道，交易所对会员的持仓限额、风险控制及其他有关方面的管理规定不变。

**第六条** 会员使用远程交易席位，应当按照远程交易席位数量按年缴纳远程交易席位使用费。撤销远程交易席位的，已收取的远程交易席位费不予退还。

远程交易席位费收费标准由交易所另行公布。

**第七条** 会员申请远程交易席位，应当具备下列条件：

- （一）经营状况良好，无严重违规违约记录；
- （二）拟开设远程交易的所在地的通讯、资金划拨条件能满足交易所期货交易运作要求；
- （三）有固定的远程交易场所及参与交易所竞价交易所需的计算机交易系统、通讯系统等软硬件设施和必要的备份措施；
- （四）有健全的规章制度和远程交易管理办法；
- （五）符合中国证监会相关技术管理规范的要求。

**第八条** 会员申请远程交易席位，应当通过会员服务系统向交易所提交下列材料：

- （一）包括开设远程交易席位的理由、条件、可行性论证等内容的申请；
- （二）远程交易管理的业务制度（包括数据安全管理制度）；
- （三）计算机系统、通讯系统（包括通讯线路）、系统软件、应用软件等配置清单；

(四) 交易所要求提供的其他材料。

**第九条** 自收到会员提交的远程交易席位申请之日起 10 个工作日内，交易所应当作出是否批准的答复。

**第十条** 会员收到交易所批准回复后方可向交易所申请进行模拟测试，通过模拟测试后，方可投入使用。启用起始日期由交易所通知会员。

**第十一条** 交易时间内，会员远程交易席位不能正常使用时，会员可以申请使用应急交易场所。

**第十二条** 会员应当加强对其远程交易席位的管理和远程交易系统的维护。主要交易设施需要更换或者远程交易系统升级时，应当及时向交易所报备。交易所所有权对远程交易席位的使用情况进行监督检查。因公共通信网络及第三方交易软件导致远程交易席位不能正常使用的，交易所不承担责任。

**第十三条** 非交易所管理原因，应急交易终端或者前置服务器自身发生故障，需要交易所为会员更换交易设施或者重新连接交易系统的，交易所不承担责任。

**第十四条** 有下列情况之一的，交易席位予以撤销：

- (一) 会员提出撤销申请，经交易所批准的；
- (二) 私下发包、转包、转租或者转让席位的；
- (三) 管理混乱有严重违规行为的；
- (四) 利用席位窃密或者破坏交易系统的。

**第十五条** 会员丧失交易所会员资格的，其拥有的交易席位全部

终止使用。

**第十六条** 因计算机交易系统、通讯系统等交易设施发生故障，致使 10%以上的会员不能交易时，交易所应当暂停交易，直至故障消除为止。

### 第三章 交易编码制度

**第十七条** 交易所实行交易编码制度。

交易编码是由交易所分配给非期货公司会员、客户进行期货交易的专用代码，是进行交易、结算、交割和标准仓单确认的依据。

**第十八条** 交易编码由会员号和客户编号两部分 12 位数字组成，其中前四位是会员号，后八位是客户编号。

**第十九条** 非期货公司会员交易编码原则上为一个，确需增加交易编码的，应当向交易所提交书面申请，并阐明理由。交易所根据交易情况决定是否添加。

**第二十条** 一个客户同一时期内在交易所只能有一个客户编号，但可以在不同的期货公司会员、境外经纪机构开户，其交易编码只是四位会员号不同，而八位客户编号必须相同。

境外客户是指通过期货公司会员直接开户，或者通过境外经纪机构转委托期货公司会员开户的境外交易者。境外客户不得通过同一家期货公司会员同时采取以上两种方式开户，或者同时通过两家境外经纪机构转委托同一家期货公司会员开户。

除交易所业务规则另有规定外，前款所述境外交易者参与特定品种期货交易应当适用交易所业务规则关于客户的相关规定。

**第二十一条** 期货公司会员、境外经纪机构应当按照中国期货市场监控中心有限责任公司（以下简称监控中心）相关开户规定通过监控中心统一开户系统为客户申请、注销交易编码，以及修改与交易编码相关的客户资料。

**第二十二条** 期货公司会员、境外经纪机构应当保证客户资料的真实、合法、有效、准确，并妥善保存客户开户、变更及销户资料档案。

**第二十三条** 客户资料不真实或被认定为市场禁入者的，交易所可对其交易编码实施暂停开新仓、限期平仓、注销等措施。

**第二十四条** 非期货公司会员及客户提供虚假开户资料或者期货公司会员、境外经纪机构协助客户使用虚假资料开户的，交易所责令限期平仓；平仓后取消交易编码，同时按《郑州商品交易所违规处理办法》的有关规定进行处理。

## 第四章 交易指令与价格

**第二十五条** 期货交易指令的种类包括限价指令、市价指令、套利指令、取消指令和交易所规定的其他指令。

限价指令指执行时以限定价格或者更好价格成交的指令。集合竞价结束后，剩余未成交的限价指令于开市后继续执行。

市价指令指没有标明具体价位，按当时市场上可执行的最好价格（报价）成交的指令。市价指令不参与集合竞价；交易期间，市价指令先于限价指令执行；行情出现单方无报价时，未成交的市价指令自动撤销。

套利指令分跨期套利指令和跨品种套利指令。跨期套利指令指同时买进（卖出）和卖出（买进）两个相同标的物但不同到期日期货合约的指令；跨品种套利指令指同时买进（卖出）和卖出（买进）两个不同标的物期货合约的指令。套利指令不参与集合竞价；行情出现单方无报价时，不得下达套利指令。

适用跨品种套利指令的具体品种由交易所公告。

取消指令指客户要求将某一指令取消的指令。

期货交易指令每次最小下单量为 1 手，限价指令每次最大下单数量为 1000 手，市价指令每次最大下单数量为 200 手。

**第二十六条** 交易所应当及时发布以下与交易有关的信息：

（一）开盘价，是指某一期货合约开市前 5 分钟内经集合竞价产生的成交价格。集合竞价未产生成交价格的，以集合竞价后第一笔成交价为开盘价。第一笔成交价按《郑州商品交易所交易规则》有关撮合原则的规定确定，此时前一成交价为上一交易日收盘价。

（二）收盘价，是指某一期货合约当日交易的最后一笔成交价格。

（三）最高价，是指一定时间内某一期货合约成交价中的最高成交价格。

（四）最低价，是指一定时间内某一期货合约成交价中的最低成交价格。

（五）最新价，是指某一交易日某一期货合约交易期间的即时成交价格。

（六）涨跌，是指某交易日某一期货合约交易期间的最新价与上

一交易日结算价之差。

（七）最高买价，是指某一期货合约当日买方申请买入的即时最高价格。

（八）最低卖价，是指某一期货合约当日卖方申请卖出的即时最低价格。

（九）申买量，是指某一期货合约当日交易所交易系统中未成交的最高买价申请买入的下单数量。

（十）申卖量，是指某一期货合约当日交易所交易系统中未成交的最低卖价申请卖出的下单数量。

（十一）结算价，是指某一期货合约当日成交价格按成交量的加权平均价。当日无成交的，当日结算价按照《郑州商品交易所期货结算细则》相关规定执行。结算价是进行当日未平仓合约盈亏结算和制定下一交易日涨跌停板额的依据。

（十二）成交量，是指某一期货合约在当日交易期间所有成交合约的双边数量。

（十三）持仓量，是指期货交易者的未平仓合约的双边数量。

**第二十七条** 开盘集合竞价在某品种某月份合约每一交易日开市前 5 分钟内进行，其中前 4 分钟为期货合约买、卖指令申报时间，后 1 分钟为集合竞价撮合时间，开市时产生开盘价。

交易系统自动控制集合竞价申报的开始和结束并在计算机终端上显示。

**第二十八条** 集合竞价采用最大成交量原则，即以此价格成交能够得到最大成交量。

**第二十九条** 开盘集合竞价中的未成交申报单自动参与开市后竞价交易。

**第三十条** 交易所计算机自动撮合系统将买卖申报指令以价格优先、时间优先的原则进行排序。当买入价大于、等于卖出价则自动撮合成交，撮合成交价等于买入价(bp)、卖出价(sp)和前一成交价(cp)三者中居中的一个价格。即：

当  $bp \geq sp \geq cp$ , 则：最新成交价=sp

当  $bp \geq cp \geq sp$ , 则：最新成交价=cp

当  $cp \geq bp \geq sp$ , 则：最新成交价=bp

## 第五章 信息管理

**第三十一条** 交易所期货交易信息是指在交易所期货交易活动中所产生的所有上市品种的期货交易行情、各种期货交易数据统计资料、交易所发布的各种公告信息以及中国证监会指定披露的其他相关信息。

**第三十二条** 交易所拥有期货交易信息所有权。未经交易所许可，任何机构和个人不得擅自发布期货交易信息，不得将之用于商业用途。

**第三十三条** 交易所向会员、客户和社会公众提供即时、每日、每周、每月和每年期货交易信息。

**第三十四条** 即时信息内容主要有：合约名称、交割月份、最新价、涨跌、成交量、持仓量、持仓量变化、申买价、申卖价、申买量、

申卖量、每笔成交量、结算价、开盘价、收盘价、最高价、最低价和前结算价。

即时行情信息由交易所在交易时间内与交易活动同步发布。

**第三十五条** 每日信息内容主要有：

（一）每日行情：合约名称、交割月份、开盘价、最高价、最低价、收盘价、前结算价、结算价、涨跌、成交量、持仓量、持仓量变化和成交额；

（二）最近交割月及活跃月份前 20 名会员的成交量和买卖持仓量、所有月份期转现量、品种套期保值额度及持仓量；

（三）各上市商品标准仓单数量及与上次发布的增减量情况；

（四）交割配对结果、实物交割量。

每日期货交易信息由交易所在每个交易日结束后发布。

**第三十六条** 每周信息内容主要有：合约名称、交割月份、周开盘价、最高价、最低价、周收盘价、涨跌（周末收盘价与上周末结算价之差）、持仓量、持仓量变化（本周末持仓量与上周末持仓量之差）、周末结算价、成交量和成交额。

每周期货交易信息由交易所在每周最后一个交易日结束后发布。

**第三十七条** 每月信息内容主要有：

（一）每月行情：合约名称、交割月份、月开盘价、最高价、最低价、月末收盘价、涨跌（月末收盘价与上月末结算价之差）、持仓量、持仓量变化（本月末持仓量与上月末持仓量之差）、月末结算价、成交量和成交额；

(二) 所有品种成交量、成交金额，分品种成交量和成交金额；

(三) 月度实物交割量。

每月期货交易信息由交易所在每月最后一个交易日结束后发布。

**第三十八条** 每年信息内容主要有：

(一) 所有品种总交易量和总交易金额、分品种交易量和交易金额；

(二) 会员成交量及成交金额排名；

(三) 总交割量和分品种交割量，期转现量。

每年期货交易信息由交易所在每年最后一个交易日结束后发布。

**第三十九条** 交易所期货即时行情通过计算机网络传送至交易席位，并通过与交易所签订协议的有关公共媒体和信息业对社会公众发布。

**第四十条** 交易所应当采取有效通信手段，建立同步报价和即时成交回报系统。

**第四十一条** 交易所和会员对不宜公开的交易资料、资金情况等信息有保密义务。

**第四十二条** 因信息经营机构或者公众媒体转发交易行情信息发生故障，影响会员或者客户正常交易的，交易所不承担责任。

**第四十三条** 任何单位或者个人不得发布虚假的或者带有误导性质的交易信息。

## 第六章 附 则

**第四十四条** 违反本细则规定的，交易所按《郑州商品交易所违

规处理办法》有关规定处理。

**第四十五条** 有关夜盘交易相关的交易业务,《郑州商品交易所夜盘交易细则》有特殊规定的,从其规定。

**第四十六条** 本细则解释权属于郑州商品交易所。

**第四十七条** 本细则自 2018 年 11 月 9 日起施行。

## 附件 5

# 郑州商品交易所期货结算细则修订案

(2018 年 10 月 23 日郑州商品交易所第六届理事会第十二次会议审议通过)

对《郑州商品交易所期货结算细则》作如下修改：

一、第三条修改为：“交易所作为中央对手方，统一组织期货交易的结算。结算实行保证金制度、当日无负债结算制度和风险准备金制度等。”

二、第四条修改为：“交易所实行全员结算制度。交易所对会员进行结算，期货公司会员对其客户、境外经纪机构进行结算，境外经纪机构对其客户进行结算。”

三、第五条修改为：“交易所的期货结算业务按本细则进行。交易所及其工作人员、会员及其工作人员、境外经纪机构及其工作人员、客户和期货保证金指定存管银行（以下简称存管银行）及其工作人员必须遵守本细则。”

四、第七条删除最后一款，修改为：“交易所结算部门负责期货交易、交割的统一结算，保证金管理，风险准备金管理以及结算风险的防范。

“所有在交易所交易系统中成交的合约必须通过结算部门进行统一结算。”。

五、新增第八条：“交易所结算部门的主要职责：

- “（一）编制会员的结算账表；
- “（二）办理资金往来汇划业务；
- “（三）统计、登记和报告交易结算情况；
- “（四）处理会员交易中的账款纠纷；
- “（五）办理交割结算业务；
- “（六）控制结算风险；
- “（七）按规定管理保证金；
- “（八）按规定办理其他结算业务。”

六、新增第九条：“交易所依据业务规则对会员、境外经纪机构和客户涉及期货交易的相关资料，包括交易记录、结算资料、财务报表及相关的凭证和账册等进行检查时，会员、境外经纪机构和客户应当予以配合。”

七、原第八条修改为：“会员应当设立结算部门。期货公司会员结算部门负责会员与交易所、会员与客户、会员与境外经纪机构之间的结算工作；非期货公司会员结算部门负责会员与交易所之间的结算工作。

“会员结算部门应当妥善保管交易记录、结算资料、财务报表及相关凭证、账册，以备查询和核实。”

八、原第九条修改为：“结算相关主体及其工作人员应当保守与结算业务有关的商业秘密。”

九、原第三章删除。

十、新增第十二条：“存管银行是指由交易所指定、协助交易所

办理期货交易结算业务的银行业金融机构。

“交易所所有权对存管银行的期货结算业务进行监督。

“存管银行应当遵守《郑州商品交易所指定存管银行管理办法》及交易所其他有关规定。”

十一、第十三条修改为：“交易所根据业务需要在存管银行开设不同币种的专用结算账户，用于存放会员的保证金及相关款项。”

十二、第十四条修改为：“会员应当在存管银行开设业务需要币种的专用账户，用于存放保证金及相关款项。其中，会员根据交易所要求在存管银行分支机构开设的保证金专用账户为会员专用资金账户。”

十三、第十七条修改为：“期货公司会员应当对其客户、境外经纪机构的保证金实行分账管理，为每一客户、境外经纪机构设立明细账户，按日序时登记核算每一客户、境外经纪机构出入金、盈亏、保证金、手续费等。期货公司会员通过保证金专用账户与客户、境外经纪机构进行期货业务资金往来。

“期货公司会员可以以境外经纪机构的名义在内部开设综合资金账户，允许其将一个及以上境外客户的资金合并综合资金账户中。期货公司会员对境外经纪机构通过综合资金账户进行统一结算和风险控制。

“境外经纪机构应当对其每个境外客户所交付的保证金实行分账管理，为每一境外客户设立明细账户，按日序时登记核算每一境外客户出入金、盈亏、保证金、手续费等。”

十四、第二十条修改为：“会员更换或者注销专用资金账户，应当向交易所提出申请，经交易所批准后方可办理。”

十五、第二十二條修改为：“保证金分为结算准备金和交易保证金。

“人民币作为交易所结算币种。经交易所批准，会员可用外汇资金、标准仓单、可流通的国债等价值稳定、流动性强的资产充抵保证金。”

十六、第二十三条修改为：“结算准备金是指会员为了交易结算在交易所专用结算账户中预先准备的资金，是未被合约占用的保证金。

“期货公司会员的结算准备金最低余额为 200 万元；非期货公司会员的结算准备金最低余额为 50 万元。

“期货公司会员每接受一家境外经纪机构委托交易结算的，该会员的结算准备金最低余额应当增加 200 万元。

“会员结算准备金最低余额应当以人民币自有资金缴纳。”

十七、第二十四条修改为：“交易所根据会员当日结算准备金中的货币资金部分，以不低于中国人民银行公布的同期银行活期存款利率计算利息，并在每年 3 月、6 月、9 月、12 月存管银行支付利息后的下一个交易日内，将利息转入会员结算准备金。具体执行利率由交易所确定、调整并公布。”

十八、第二十五条第一款修改为：“交易保证金是指会员在交易所专用结算账户中确保合约履行的资金，是已被合约占用的保证金。买卖双方成交后，交易所按持仓合约价值的规定比率或交易所规定的

其他方式收取交易保证金。”

增加第四款“夜盘交易小节，交易所不受理标准仓单折抵、质押等业务。”

十九、第二十七条修改为：“交易所结合成交数量、成交金额、开仓数量、平仓数量、持仓数量、申报数量、撤单数量、申报撤单比等因素制定交易手续费的计收标准。交易所可以根据市场情况，调整部分或者全部合约的交易手续费计收标准。

“交易所可以对会员应缴纳的交易手续费进行减收，减收方案由交易所另行制定并根据市场情况进行调整。”

二十、删除第二十八条

二十一、原第二十九条修改为：“期货公司会员、境外经纪机构受托为客户交易，向客户收取的保证金属于客户所有，禁止挪作他用。”

二十二、原第三十条修改为：“期货公司会员向客户、境外经纪机构收取的交易保证金不得低于交易所向会员收取的交易保证金。”

二十三、原第三十一条增加第五款：“新上市合约连续三个交易日无成交，交易所可另外调整结算价。”

二十四、原第三十三条第三款修改为：“手续费等各项费用从会员的结算准备金中扣划。盈亏、费用、货款、税金和期权权利金等款项应当以人民币货币资金支付。”

二十五、原第三十四条修改为：“结算准备金余额的具体计算公式如下：

“当日结算准备金余额 = 上一交易日结算准备金 + 上一交易

日交易保证金—当日交易保证金 + 当日充抵保证金实际可用金额—  
上一交易日充抵保证金实际可用金额 + 当日盈亏+ 当日期权权利金  
收入-当日期权权利金支出 + 入金—出金—手续费等

“充抵保证金实际可用金额的具体核算方法见本细则第六章有关规定。”

二十六、原第三十五条第二款修改为“交易所发出追加保证金的通知后，可以通过存管银行从会员的专用资金账户中扣划人民币或用外汇资金强制换汇方式补足。”

二十七、原第三十七条增加第二款“夜盘交易小节，交易所不受理出金申请、不办理出金业务。”

二十八、原第三十八条修改为：“会员的出金标准为：

“（一）当交易保证金实有货币资金部分大于等于充抵保证金金额的 25%时，可出金额=结算准备金—结算准备金最低余额；

“（二）当交易保证金实有货币资金部分小于充抵保证金金额的 25%时，可出金额=结算准备金实有货币资金部分—（充抵保证金金额×25%-交易保证金实有货币资金部分）—结算准备金最低余额。

“实有货币资金指实有人民币资金和外汇资金价值按照折扣比率折算后的人民币金额之和，外汇资金的折算方法见本细则第六章有关规定。

“外汇资金折算的人民币资金不可以人民币方式出金，外汇可出金额以交存的外汇资金为限。

“交易所可根据市场风险状况对会员出金标准做适当调整。”

二十九、原第三十九条修改为：“会员、境外经纪机构或者客户有下列情况之一的，交易所可以限制会员出金，要求会员限制其客户、境外经纪机构出金，以及要求境外经纪机构配合限制客户出金：

“（一）涉嫌重大违规，经交易所立案调查的；

“（二）因投诉、举报、交易纠纷等被司法部门、交易所或者其他有关部门正式立案调查，且正处在调查期间的；

“（三）交易所认为市场出现重大风险的；

“（四）会员未在规定的时间内补足人民币至结算准备金最低余额或不配合交易所为其客户、境外经纪机构进行结购汇的；

“（五）交易所认为必要的其他情况。”

三十、原第四十一条修改为：“会员应当每天及时获取交易所提供的结算数据，做好核对工作，并应当妥善保存至少 20 年，但对有关期货交易存在争议的，应保存至该争议消除时为止。”

三十一、原第四十四条修改为：“发生下列情况之一的，可由非期货公司会员或期货公司会员和客户共同提出申请，经交易所批准后，可以进行移仓：

“（一）会员因故不能从事期货业务，或发生经监管部门批准的合并、分立、破产等变更；

“（二）期货公司会员和客户违反《郑州商品交易所期货交易风险控制管理办法》，引发交易、交割违规、违约风险；

“（三）期货公司会员变更与境外经纪机构委托关系；

“（四）交易所认可的其他移仓情况。”

“发生本条第一款第（一）、（二）项规定情形的，会员应当按照国家法律、法规和其它规定予以公告，并将有关公告提交交易所。

“移仓应当由移出会员提出申请，申请材料应当包括移入会员、涉及客户同意移仓的相关声明以及相关持仓详细清单。

“在会员破产但未申请移仓的特殊情形下，为保护客户权益，交易所可以启动应急预案，办理客户移仓。

“发生本条第一款第（三）项规定的情形，由移入期货公司会员提出申请。申请材料应当包括移出期货公司会员、境外经纪机构同意移仓和变更委托关系的声明以及相关持仓详细清单。

“发生本条第一款第（四）项规定的情形，移仓办理由交易所另行规定。”

三十二、原第四十五条修改为：“移仓申请经批准后，交易所与会员约定具体的移仓结算日。

“移仓结算日当日结算完成后，交易所为会员实施移仓，并提供移仓前和移仓后的相关结算报表由会员确认。相关会员应当核对并确认相关结算报表，一经确认，不得更改。

“移仓内容仅包括持仓，不包括当日的盈亏、交易手续费、保证金等其他款项。”

三十三、原第四十六条修改为：“会员进行交割，应当按规定向交易所交纳交割手续费。具体标准由交易所确定、调整并公布。

“交割手续费在配对日结算时由交易所直接从会员的结算准备金中扣划。”

三十四、原第五十条修改为：“充抵的保证金仅用于交易担保。”

三十五、原第五十一条修改为：“充抵保证金业务由交易所结算部门负责办理。交易所受理充抵保证金业务的时间为每个工作日交易时间的下午 2 时 30 分之前。

“交割月最后交易日下午不再进行交易的合约，交易所当日不办理该品种标准仓单充抵保证金业务。

“夜盘交易小节，交易所只受理外汇资金入金申请，不受理外汇资金出金申请及其他资产充抵保证金业务。”

三十六、原第五十二条修改为：“会员办理充抵保证金时，须将资产移转交易所验证、交存或质押登记。

“非期货公司会员办理充抵保证金业务的，须以自己的名义办理。客户办理充抵保证金业务的，须委托期货公司会员并以期货公司会员名义办理，并向交易所申明愿为期货公司会员名下期货交易提供担保。

“以书面或电子方式办理申请时，须提交《郑州商品交易所充抵保证金资产所有人专项授权书》，并签订《郑州商品交易所充抵保证金协议书》。”

三十七、原第五十三条修改为：“经交易所批准充抵保证金的资产限于以下种类：

“（一）可在交易所流通的标准仓单；

“（二）可流通并能够实现质押权登记的国债；

“（三）外汇资金（币种类别、折算方式和适用范围由交易所另行确定、调整并公布）；

“（四）交易所认可的其他资产。

“依前款规定办理充抵保证金业务的，充抵的期限不得超过资产的有效期限，每次充抵的资产价值不得低于 10 万元（人民币）。 ”

三十八、删除原第五十四条。

三十九、原第五十五条修改为：“充抵保证金的资产市值按以下方法计算：

“（一）标准仓单充抵保证金时，以办理日前一交易日该标准仓单对应品种最近交割月份期货合约的结算价为基准价计算其价值，充抵保证金的金额不高于标准仓单市值的 80%（折扣比例）；

“（二）充抵保证金使用的其他资产基准价及折扣比例由交易所核定。充抵保证金的资产市值折算后金额为充抵金额。交易所每日结算时，按规定的折扣比例和当日基准价调整充抵金额。 ”

四十、删除原第五十六条。

四十一、新增第五十四条：“资产充抵保证金的累计总金额以不超过会员在交易所专用结算账户中的实有货币资金的 4 倍（配比乘数）为限，作为资产充抵保证金的实际可用金额。 ”

四十二、原第五十七条修改为：“充抵保证金业务生效当日，交易所结算部门按照充抵金额进行账务核算，同时按照可用充抵金额增加会员保证金。 ”

四十三、删除原第五十八条。

四十四、原第五十九条修改为：“交易所所有权根据市场状况调整资产充抵保证金的基准价、折扣比例和配比乘数。

“充抵期限内，有价证券的价值发生变化时，交易所可以对充抵金额作相应调整。调整会员充抵金额时，交易所结算部门向会员出具<sup>1</sup>有价证券充抵保证金调整单，同时调整会员保证金。”

四十五、新增第五十七条：“充抵期限内，会员配比货币资金不足时，交易所按照充抵保证金配比规定及时对该会员的实际可用充抵金额作相应调减；会员增加货币资金时，交易所按照充抵配比规定及时调增其实际可用充抵金额。”

四十六、原第六十条修改为：“出现下列情况之一的，交易所<sup>2</sup>有权取消充抵保证金的额度：

“（一）使用资产充抵保证金的会员或者客户运用资金出现较大风险并有可能危及交易所合法权益的；

“（二）充抵期内，市场出现较大风险，并有可能危及交易所合法权益的；

“（三）资产出现瑕疵或者发生重大风险的；

“（四）充抵业务申办会员或者客户（资产所有人）存在违规、违约行为嫌疑的；

“（五）由于其他原因需要停止充抵保证金业务的。”

“取消充抵保证金额度的当日，交易所结算部门减少会员保证金，同时计算并收取充抵保证金手续费。会员保证金不能满足结算要求的，充抵关系不得解除。”

四十七、原第六十一条修改为：“交易所依据本细则第五十六条、第五十七条调整会员充抵金额或取消会员充抵保证金额度后，会员出

现保证金不足又未及时追加的，交易所有权按照强行平仓制度对其采取措施。因交易所采取措施造成会员损失的，由会员先行承担，然后由会员向客户追偿；造成交易所损失的，交易所有权将充抵的资产按市场价格变现或兑现并从中优先受偿。交易所受偿结束前，会员保证金充抵关系不予解除。”

四十八、原第六十二条修改为：“资产充抵保证金期满，交易所解除充抵关系，应当减少会员保证金，向会员返还资产。充抵期内，会员提出申请要求提前解除充抵保证金的，必须在弥补应交保证金之后，方可办理相应手续，取回充抵的资产。

“解除标准仓单充抵关系时，结算部门当日办理仓单解除充抵保证金手续。

“解除其他资产充抵保证金时，结算部门按有关程序和规定办理解除充抵保证金手续，归还其原有的资产。”

四十九、原第六十三条修改为：“资产所充抵的保证金不能全额及时清偿时，交易所有权将用作充抵保证金的资产按市场价兑现或者变现，用于清偿其充抵的保证金和相关债务。清偿后有余额的，将余额部分退还会员；兑现或者变现金额不足以清偿其充抵的保证金和相关债务的，交易所有权向会员追索。

“兑现或者变现时，资产可以分割的，按其不能清偿的保证金数额、充抵费用、兑现或者变现费用以及相关费用等的合计数额进行分割兑现或者变现；资产不能分割的，全部兑现或者变现。”

五十、原第六十四条修改为：“会员应当承担资产充抵保证金期

内的手续费用和其他相关费用。其他相关费用包括资产的仓储费、保管费等相关费用。

“资产充抵保证金的手续费收取标准由交易所规定并公告。资产充抵保证金手续费在充抵关系解除时收取。

“资产的仓储费、保管费等按有关规定交纳。”

五十一、原第六十五条修改为：“交易所应当建立充抵保证金业务相关资料的保管制度，完善相关手续。充抵保证金业务的相关资料保管期限与会计档案相同。”

五十二、原第六十六条修改为：“期货交易风险防范实行分级负责制度。交易所防范会员风险，会员防范其客户、境外经纪机构的风险，境外经纪机构防范其客户的风险。”

五十三、原第六十七增加第二、第三款：“交易所组织期货交易，已经成交的交易指令、了结的期货交易持仓、收取的保证金、已经划转或者完成质押处理的充抵保证金的资产、配对完成的标准仓单等交易、结算和交割行为或者财产的法律属性，以及采取的违约处理措施，不因会员进入破产程序而使得相关行为或者财产的法律属性被撤销或者无效。

“会员进入破产程序，交易所仍可以按照交易规则及其实施细则，对该会员未了结的合约进行净额结算。”

五十四、新增第六十六条：“存管银行发生破产或者其他债权债务纠纷的，保证金不属于其破产财产，不属于冻结或者划拨的财产范围。”

五十五、新增第六十七条：“交割仓库发生破产或者其他债权债务纠纷的，期货市场参与者存放的非交割仓库所有的期货商品，不属于交割仓库的破产财产和查封、扣押的财产范围。”

五十六、原第六十八条第（四）项修改为：“（四）将充抵保证金的资产变现，用变现所得履约赔偿。”

作上述修订后，原章节及条款顺序相应调整。

# 郑州商品交易所期货结算细则

(2008年1月7日第五届理事会通讯会议修改,2008年1月15日发布,自发布之日起施行;2009年3月28日第五届理事会通讯会议审议通过,2009年4月15日发布,自2009年4月20日起施行;2012年8月14日第五届理事会第七次通讯会议修改,2012年9月3日发布,自发布之日起施行;2013年6月14日第五届理事会第四次通讯会议修改,2013年7月9日发布,自2013年9月16日起施行;2014年6月13日第五届理事会第七次通讯会议修改,2014年11月21日发布,自2014年12月12日起施行;2016年3月24日第五届理事会第六次通讯会议修改,2016年4月14日发布,自2016年8月1日起施行;2017年6月12日第六届理事会第二次会议修改,2017年8月14日发布,自发布之日起施行;2018年10月23日第六届理事会第十二次会议修订,2018年11月9日发布,自2018年11月9日起施行)

## 第一章 总 则

**第一条** 为规范郑州商品交易所(以下简称交易所)期货交易的结算行为,保护期货交易当事人的合法权益和社会公众利益,防范和化解期货市场风险,根据《郑州商品交易所交易规则》,制定本细则。

**第二条** 结算是指根据交易结果和交易所有关规定对会员保证金、盈亏、手续费、交割货款及其他有关款项进行计算、划拨的业务活动。

**第三条** 交易所作为中央对手方,统一组织期货交易的结算。结算实行保证金制度、当日无负债结算制度和风险准备金制度等。

**第四条** 交易所实行全员结算制度。交易所对会员进行结算,期货公司会员对其客户、境外经纪机构进行结算,境外经纪机构对其客户进行结算。

**第五条** 交易所的期货结算业务按本细则进行。交易所及其工作人员、会员及其工作人员、境外经纪机构及其工作人员、客户和期货保证金指定存管银行（以下简称存管银行）及其工作人员必须遵守本细则。

## **第二章 结算机构**

**第六条** 结算机构包括交易所和会员的结算部门。

**第七条** 交易所结算部门负责期货交易、交割的统一结算，保证金管理，风险准备金管理以及结算风险的防范。

所有在交易所交易系统中成交的合约必须通过结算部门进行统一结算。

**第八条** 交易所结算部门的主要职责：

- （一）编制会员的结算账表；
- （二）办理资金往来汇划业务；
- （三）统计、登记和报告交易结算情况；
- （四）处理会员交易中的账款纠纷；
- （五）办理交割结算业务；
- （六）控制结算风险；
- （七）按规定管理保证金；
- （八）按规定办理其他结算业务。

**第九条** 交易所依据业务规则对会员、境外经纪机构和客户涉及期货交易的相关资料，包括交易记录、结算资料、财务报表及相关的凭证和账册等进行检查时，会员、境外经纪机构和客户应当予以配合。

**第十条** 会员应当设立结算部门。期货公司会员结算部门负责会员与交易所、会员与客户、会员与境外经纪机构之间的结算工作；非期货公司会员结算部门负责会员与交易所之间的结算工作。

会员结算部门应当妥善保管交易记录、结算资料、财务报表及相关凭证、账册，以备查询和核实。

**第十一条** 结算相关主体及其工作人员应当保守与结算业务有关的商业秘密。

## 第三章 保证金

### 第一节 保证金账户开立与管理

**第十二条** 存管银行是指由交易所指定、协助交易所办理期货交易结算业务的银行业金融机构。

交易所对存管银行的期货结算业务进行监督。

存管银行应当遵守《郑州商品交易所指定存管银行管理办法》及交易所其他有关规定。

**第十三条** 交易所根据业务需要在存管银行开设不同币种的专用结算账户，用于存放会员的保证金及相关款项。

**第十四条** 会员应当在存管银行开设业务需要币种的专用账户，用于存放保证金及相关款项。其中，会员根据交易所要求在存管银行分支机构开设的保证金专用账户为会员专用资金账户。

**第十五条** 交易所与会员之间期货业务资金的往来通过交易所专用结算账户和会员专用资金账户办理。

**第十六条** 交易所对会员存入交易所专用结算账户的保证金实行分账管理，为每一会员设立明细账户，按日序时登记核算每一会员出入金、盈亏、保证金、手续费等。

**第十七条** 期货公司会员应当对其客户、境外经纪机构的保证金实行分账管理，为每一客户、境外经纪机构设立明细账户，按日序时登记核算每一客户、境外经纪机构出入金、盈亏、保证金、手续费等。期货公司会员通过保证金专用账户与客户、境外经纪机构进行期货业务资金往来。

期货公司会员可以以境外经纪机构的名义在内部开设综合资金账户，允许其将一个及以上境外客户的资金合并综合资金账户中。期货公司会员对境外经纪机构通过综合资金账户进行统一结算和风险控制。

境外经纪机构应当对其每个境外客户所交付的保证金实行分账管理，为每一境外客户设立明细账户，按日序时登记核算每一境外客户出入金、盈亏、保证金、手续费等。

**第十八条** 会员开设专用资金账户时，须提交《印鉴授权书》等相关资料，并须经交易所审核同意；会员使用资金管理系统，须向交易所提交《郑州商品交易所会员开设专用资金账户申请表》。

交易所所有权在不通知会员的情况下，通过存管银行从会员的专用资金账户中收取各项应收款项，并且有权随时查询该账户的资金情况。

**第十九条** 《印鉴授权书》中被授权的公章、财务章、法定代表人章或者被授权人章及《郑州商品交易所会员开设专用资金账户申请

表》确定的电子签章均为会员的有效印鉴，会员应当对使用以上印鉴所产生的一切后果承担责任。

**第二十条** 会员更换或者注销专用资金账户，应当向交易所提出申请，经交易所批准后方可办理。

**第二十一条** 会员更名或者资格转让，须重新向交易所提交《印鉴授权书》，并办理相关专用资金账户的变更手续。

## 第二节 保证金管理

**第二十二条** 保证金分为结算准备金和交易保证金。

人民币作为交易所结算币种。经交易所批准，会员可用外汇资金、标准仓单、可流通的国债等价值稳定、流动性强的资产充抵保证金。

**第二十三条** 结算准备金是指会员为了交易结算在交易所专用结算账户中预先准备的资金，是未被合约占用的保证金。

期货公司会员的结算准备金的最低余额为 200 万元；非期货公司会员的结算准备金最低余额为 50 万元。

期货公司会员每接受一家境外经纪机构委托交易结算的，该会员的结算准备金最低余额应当增加 200 万元。

会员结算准备金最低余额应当以人民币自有资金缴纳。

**第二十四条** 交易所根据会员当日结算准备金中的货币资金部分，以不低于中国人民银行公布的同期银行活期存款利率计算利息，并在每年 3 月、6 月、9 月、12 月存管银行支付利息后的下一个交易日内，将利息转入会员结算准备金。具体执行利率由交易所确定、调整并公布。

**第二十五条** 交易保证金是指会员在交易所专用结算账户中确保合约履行的资金，是已被合约占用的保证金。买卖双方成交后，交易所按持仓合约价值的规定比率或交易所规定的其他方式收取交易保证金。

持有标准仓单的卖方会员向交易所提交折抵头寸申请并征得同意后，与其标准仓单所示数量相同的卖持仓（不含按照本细则规定已经取得交易保证金优惠的持仓）交易保证金在结算时不再收取。会员向交易所提交申请之前须取得客户授权。最后交易日交割配对时，客户需要配对交割的仓单处于折抵状态的，交易所根据交割配对情况解除其相应的仓单折抵，用以交割配对。

交割月最后交易日下午不再进行交易的品种，交易所当日不办理该品种标准仓单折抵业务。

夜盘交易小节，交易所不受理标准仓单折抵、质押等业务。

**第二十六条** 各品种期货合约的交易保证金比例及不同阶段的交易保证金比例按交易所有关规定执行。同一会员、同一客户、同一合约月份双向持仓按照单边收取交易保证金。

**第二十七条** 交易所结合成交数量、成交金额、开仓数量、平仓数量、持仓数量、申报数量、撤单数量、申报撤单比等因素制定交易手续费的计收标准。交易所可以根据市场情况，调整部分或者全部合约的交易手续费计收标准。

交易所可以对会员应缴纳的交易手续费进行减收，减收方案由交易所另行制定并根据市场情况进行调整。

**第二十八条** 期货公司会员、境外经纪机构受托为客户交易，向客户收取的保证金属于客户所有，禁止挪作他用。

**第二十九条** 期货公司会员向客户、境外经纪机构收取的交易保证金不得低于交易所向会员收取的交易保证金。

## **第四章 交易结算**

### **第一节 当日结算**

**第三十条** 交易所实行当日无负债结算制度。

每日交易结束后，交易所按当日结算价结算所有合约的盈亏、交易保证金，收取手续费等费用，对应收应付的款项同时划转，相应增加或者减少会员的结算准备金。

当日有成交价格的期货合约，其当日结算价是指该合约当日成交价格按照成交量的加权平均价。违法违规交易行为影响当日结算价格公平产生的，交易所所有权消除违法违规交易行为的不利影响。当日无成交价格的期货合约，其当日结算价按照下列方法确定：

（一）当日收盘时交易所计算机系统中该合约有买、卖双方报价的，按照最优的买方报价、卖方报价和该合约上一交易日的结算价格三者中居中的一个价格为该无成交合约的当日结算价。

（二）当日该合约收盘前连续五分钟报价保持停板价格的，则以该停板价格为该无成交合约的当日结算价。

（三）除上述第（一）、（二）项之外的其他情况，该无成交价格期货合约的当日结算价按照下列方法确定：

1、当日无成交合约其当日前一有成交的最近月份合约结算价的涨跌幅度（%）小于等于当日无成交合约当日涨跌停板的，则当日无成交合约结算价=该合约上一交易日的结算价×（1±该合约当日前一有成交的最近月份合约结算价的涨跌幅度）；当日无成交合约前面所有月份合约不存在或没有成交的，则取该品种最活跃月份合约为参照，结算价的确定方法同上。

2、当日无成交合约其当日前一有成交的最近月份合约结算价的涨跌幅度（%）大于当日无成交合约当日的涨跌停板，则当日无成交合约结算价=该合约上一交易日的结算价×（1±该合约的当日涨跌停板）；当日无成交合约前面所有月份合约不存在或没有成交的，则取该品种最活跃月份合约为参照，结算价的确定方法同上。

3、当日无成交合约前面所有月份合约当日均不存在或没有成交，并且最活跃月份合约当日也没有成交的，则当日无成交合约结算价=上一交易日该合约的结算价。当上述方法确定的结算价明显偏离公允价格的，交易所可调整结算价，同时价幅参照新上市期货合约管理。

最活跃月份合约是指当日“成交量×交易单位”的值最大的合约，若存在两个及以上合约“成交量×交易单位”的值一致的情况，则取其中最近到期月份合约为最活跃月份合约。

新上市合约连续三个交易日无成交，交易所可另外调整结算价。

**第三十一条** 交易所结算部门根据会员的平仓、持仓情况及各期货合约的当日结算价计算各个会员的当日盈亏，当日盈亏 = 平仓盈亏 + 持仓盈亏 + 交割差额。

(一) 结算部门根据会员平仓合约计算会员平仓盈亏。平仓盈亏的计算公式如下：

$$\text{平仓盈亏} = \text{平历史仓盈亏} + \text{平当日仓盈亏}$$

$$\text{平历史仓盈亏} = \sum [(\text{卖出平仓价} - \text{上一交易日结算价}) \times \text{卖出平仓量}] + \sum [(\text{上一交易日结算价} - \text{买入平仓价}) \times \text{买入平仓量}]$$

$$\text{平当日仓盈亏} = \sum [(\text{当日卖出平仓价} - \text{当日买入开仓价}) \times \text{卖出平仓量}] + \sum [(\text{当日卖出开仓价} - \text{当日买入平仓价}) \times \text{买入平仓量}]$$

(二) 结算部门根据会员持仓合约和当日结算价计算持仓盈亏。持仓盈亏的计算公式如下：

$$\text{持仓盈亏} = \text{历史持仓盈亏} + \text{当日开仓持仓盈亏}$$

$$\text{历史持仓盈亏} = \sum [(\text{上一交易日结算价} - \text{当日结算价}) \times \text{卖出历史持仓量}] + \sum [(\text{当日结算价} - \text{上一交易日结算价}) \times \text{买入历史持仓量}]$$

$$\text{当日开仓持仓盈亏} = \sum [(\text{卖出开仓价} - \text{当日结算价}) \times \text{卖出开仓量}] + \sum [(\text{当日结算价} - \text{买入开仓价}) \times \text{买入开仓量}]$$

(三) 结算部门根据会员交割配对合约、当日结算价和交割结算价计算交割差额。交割差额的计算公式如下：

$$\text{交割差额} = \sum [(\text{当日结算价} - \text{交割结算价}) \times \text{卖出配对量}] + \sum [(\text{交割结算价} - \text{当日结算价}) \times \text{买入配对量}]$$

**第三十二条** 当日盈亏在每日结算时进行划转，当日盈利划入会员结算准备金，当日亏损从会员结算准备金中扣划。

当日结算时的交易保证金超过上一交易日结算时的交易保证金部分从会员结算准备金中扣划。当日结算时的交易保证金低于上一交易日结算时的交易保证金部分划入会员结算准备金。

手续费等各项费用从会员的结算准备金中扣划。盈亏、费用、货款、税金和期权权利金等款项应当以人民币货币资金支付。

**第三十三条** 结算准备金余额的具体计算公式如下：

当日结算准备金余额 = 上一交易日结算准备金 + 上一交易日交易保证金 - 当日交易保证金 + 当日充抵保证金实际可用金额 - 上一交易日充抵保证金实际可用金额 + 当日盈亏 + 当日期权权利金收入 - 当日期权权利金支出 + 入金 - 出金 - 手续费等；

充抵保证金实际可用金额的具体核算方法见本细则第六章有关规定。

**第三十四条** 当日结算完毕后，交易所通过会员服务系统向会员发送结算结果。会员的结算准备金低于最低余额时，该结算结果即视为交易所向会员发出的追加保证金通知。

交易所发出追加保证金的通知后，可以通过存管银行从会员的专用资金账户中扣划人民币或用外汇资金强制换汇方式补足。

会员必须在下一个交易日开市前补足至结算准备金最低余额。未补足的，结算准备金余额大于零而低于结算准备金最低余额时，禁止开新仓；结算准备金余额小于零时，交易所所有权对该会员持仓强行平仓。

交易所可根据市场风险和保证金变动情况，在交易期间发出追加保证金通知，会员须在通知规定的时间内补足保证金。结算准备金未按时补足且余额为负数的，交易所所有权对其持仓强行平仓。

## 第二节 出入金

**第三十五条** 会员入金方式：会员可用相关转账凭证、资金管理系统向交易所专用结算账户划入资金。会员划入的资金，经存管银行确认到账后，交易所将及时增加会员的保证金。

**第三十六条** 会员出金方式：会员出金须在每交易日上午 8：30 至下午 3 时之间办理。使用资金管理系统出金的，会员应在资金管理系统上提出出金申请，经交易所审核后办理出金手续；特殊情况下使用转账凭证出金的，会员应加盖预留印鉴作为会计核算的依据。交易所可根据业务发展需要，变更出金方式和流程。

夜盘交易小节，交易所不受理出金申请、不办理出金业务。

**第三十七条** 会员的出金标准为：

（一）当交易保证金实有货币资金部分大于等于充抵保证金金额的 25%时，可出金额=结算准备金-结算准备金最低余额；

（二）当交易保证金实有货币资金部分小于充抵保证金金额的 25%时，可出金额=结算准备金实有货币资金部分-（充抵保证金金额×25%-交易保证金实有货币资金部分）-结算准备金最低余额。

实有货币资金指实有人民币资金和外汇资金价值按照折扣比率折算后的人民币金额之和，外汇资金的折算方法见本细则第六章有关规定。

外汇资金折算的人民币金额不可以人民币方式出金，外汇可出金额以交存的外汇资金为限。

交易所可根据市场风险状况对会员出金标准做适当调整。

**第三十八条** 会员、境外经纪机构或者客户有下列情况之一的，交易所可以限制会员出金，要求会员限制其客户、境外经纪机构出金，以及要求境外经纪机构配合限制客户出金：

（一）涉嫌重大违规，经交易所立案调查的；

（二）因投诉、举报、交易纠纷等被司法部门、交易所或者其他有关部门正式立案调查，且正处在调查期间的；

（三）交易所认为市场出现重大风险的；

（四）会员未在规定的时间内补足人民币至结算准备金最低余额或不配合交易所为其客户、境外经纪机构进行结购汇的；

（五）交易所认为必要的其他情况。

### 第三节 结算数据

**第三十九条** 当日交易结束后，交易所对每一会员的盈亏、交易手续费、保证金等款项进行结算。交易所采用发放纸质结算单据或电子结算单据等方式向会员提供当日结算数据。结算数据是会员核对当日有关交易并对客户结算的依据。因特殊情况不能按时提供结算数据的，交易所另行通知提供结算数据的时间。

**第四十条** 会员应当每天及时获取交易所提供的结算数据，做好核对工作，并应当妥善保存至少 20 年，但对有关期货交易存在争议的，应保存至该争议消除时为止。

**第四十一条** 会员对结算结果有异议的，应当在下一交易日开市前以书面形式通知交易所。如遇特殊情况，会员可在下一交易日开市后 2 小时内以书面形式通知交易所。在规定时间内，会员没有对结算结果提出异议的，视作已认可结算结果的正确性。

**第四十二条** 交易所在每月月初向会员提供上月的《郑州商品交易所保证金结算核对单》，作为会员核查交易账簿记录的依据。

#### 第四节 移仓

**第四十三条** 发生下列情况之一的，可由非期货公司会员或期货公司会员和客户共同提出申请，经交易所批准后，可以进行移仓：

（一）会员因故不能从事期货业务，或发生经监管部门批准的合并、分立、破产等变更；

（二）期货公司会员和客户违反《郑州商品交易所期货交易风险控制管理办法》，引发交易、交割违规、违约风险；

（三）期货公司会员变更与境外经纪机构委托关系；

（四）交易所认可的其他移仓情况。

发生本条第一款第（一）、（二）项规定情形的，会员应当按照国家法律、法规和其它规定予以公告，并将有关公告提交交易所。

移仓应当由移出会员提出申请，申请材料应当包括移入会员、涉及客户同意移仓的相关声明以及相关持仓详细清单。

在会员破产但未申请移仓的特殊情形下，为保护客户权益，交易所可以启动应急预案，办理客户移仓。

发生本条第一款第（三）项规定的情形，由移入期货公司会员提出申请。申请材料应当包括移出期货公司会员、境外经纪机构同意移仓和变更委托关系的声明以及相关持仓详细清单。

发生本条第一款第（四）项规定的情形，移仓办理由交易所另行规定。

**第四十四条** 移仓申请经批准后，交易所与会员约定具体的移仓结算日。

移仓结算日当日结算完成后，交易所为会员实施移仓，并提供移仓前和移仓后的相关结算报表由会员确认。相关会员应当核对并确认相关结算报表，一经确认，不得更改。

移仓内容仅包括持仓，不包括当日的盈亏、交易手续费、保证金等其他款项。

## **第五章 交割结算**

**第四十五条** 会员进行交割，应当按规定向交易所交纳交割手续费。具体标准由交易所确定、调整并公布。

交割手续费在配对日结算时由交易所直接从会员的结算准备金中扣划。

**第四十六条** 交割货款结算实行一收一付，同时划转。

**第四十七条** 交割结算价的规定见交割细则。交割商品货款以交割结算价为基础，加减相应的升贴水和包装款。升贴水和包装款按交易所公布的标准结算。

**第四十八条** 交割配对日结算时，交易所对会员交割月份配对持仓按交割结算价进行结算处理，产生的交割差额计入会员当日盈亏。

## **第六章 充抵保证金**

**第四十九条** 充抵的保证金仅用于交易担保。

**第五十条** 充抵保证金业务由交易所结算部门负责办理。交易所受理充抵保证金业务的时间为每个工作日交易时间的下午 2 时 30 分之前。

交割月最后交易日下午不再进行交易的合约，交易所当日不办理该品种标准仓单充抵保证金业务。

夜盘交易小节，交易所只受理外汇资金入金申请，不受理外汇资金出金申请及其他资产充抵保证金业务。

**第五十一条** 会员办理充抵保证金时，须将资产移转交易所验证、交存或质押登记。

非期货公司会员办理充抵保证金业务的，须以自己的名义办理。客户办理充抵保证金业务的，须委托期货公司会员并以期货公司会员名义办理，并向交易所申明愿为期货公司会员名下期货交易提供担保。

以书面或电子方式办理申请时，须提交《郑州商品交易所充抵保证金资产所有人专项授权书》，并签订《郑州商品交易所充抵保证金协议书》。

**第五十二条** 经交易所批准充抵保证金的资产限于以下种类：

- （一）可在交易所流通的标准仓单；
- （二）可流通并能够实现质押权登记的国债；

（三）外汇资金（币种类别、折算方式和适用范围由交易所另行确定、调整并公布）；

（四）交易所认可的其他资产。

依前款规定办理充抵保证金业务的，充抵的期限不得超过资产的有效期限，每次充抵的资产价值不得低于 10 万元（人民币）。

**第五十三条** 充抵保证金的资产市值按以下方法计算：

（一）标准仓单充抵保证金时，以办理日前一交易日该标准仓单对应品种最近交割月份期货合约的结算价为基准价计算其价值，充抵保证金的金额不高于标准仓单市值的 80%（折扣比例）；

（二）充抵保证金使用的其他资产基准价及折扣比例由交易所核定。充抵保证金的资产市值折算后金额为充抵金额。交易所每日结算时，按规定的折扣比例和当日基准价调整充抵金额。

**第五十四条** 资产充抵保证金的累计总金额以不超过会员在交易所专用结算账户中的实有货币资金的 4 倍（配比乘数）为限，作为资产充抵保证金的实际可用金额。

**第五十五条** 充抵保证金业务生效当日，交易所结算部门按照充抵金额进行账务核算，同时按照可用充抵金额增加会员保证金。

**第五十六条** 交易所所有权根据市场状况调整资产充抵保证金的基准价、折扣比例和配比乘数。

充抵期限内，资产的价值发生变化时，交易所可以对充抵金额作相应调整。调整会员充抵金额时，交易所结算部门向会员出具资产充抵保证金调整单，同时调整会员保证金。

**第五十七条** 充抵期限内，会员配比货币资金不足时，交易所按照充抵保证金配比规定及时对该会员的实际可用充抵金额作相应调减；会员增加货币资金时，交易所按照充抵配比规定及时调增其实际可用充抵金额。

**第五十八条** 出现下列情况之一的，交易所所有权取消充抵保证金的额度：

（一） 使用资产充抵保证金的会员或者客户运用资金出现较大风险并有可能危及交易所合法权益的；

（二） 充抵期内，市场出现较大风险，并有可能危及交易所合法权益的；

（三） 资产出现瑕疵或者发生重大风险的；

（四） 充抵业务申办会员或者客户（资产所有人）存在违规、违约行为嫌疑的；

（五） 由于其他原因需要停止充抵保证金业务的。

取消充抵保证金额度的当日，交易所结算部门减少会员保证金，同时计算并收取充抵保证金手续费。会员保证金不能满足结算要求的，充抵关系不得解除。

**第五十九条** 交易所依据本细则第五十六条、五十七条调整会员充抵金额或取消会员充抵保证金额度后，会员出现保证金不足又未及时追加的，交易所所有权按照强行平仓制度对其采取措施。因交易所采取措施造成会员损失的，由会员先行承担，然后由会员向客户追偿；

造成交易所损失的，交易所所有权将充抵的资产按市场价格变现或兑现并从中优先受偿。交易所受偿结束前，会员保证金充抵关系不予解除。

**第六十条** 资产充抵保证金期满，交易所解除充抵关系，应当减少会员保证金，向会员返还资产。充抵期内，会员提出申请要求提前解除充抵保证金的，必须在弥补应交保证金之后，方可办理相应手续，取回充抵的资产。

解除标准仓单充抵关系时，结算部门当日办理仓单解除充抵保证金手续。

解除其他资产充抵保证金时，结算部门按有关程序和规定办理解除充抵保证金手续，归还其原有的资产。

**第六十一条** 资产所充抵的保证金不能全额及时清偿时，交易所所有权将用作充抵保证金的资产按市场价兑现或者变现，用于清偿其充抵的保证金和相关债务。清偿后有余额的，将余额部分退还会员；兑现或者变现金额不足以清偿其充抵的保证金和相关债务的，交易所所有权向会员追索。

兑现或者变现时，资产可以分割的，按其不能清偿的保证金数额、充抵费用、兑现或者变现费用以及相关费用等的合计数额进行分割兑现或者变现；资产不能分割的，全部兑现或者变现。

**第六十二条** 会员应当承担资产充抵保证金期内的手续费和其他相关费用。其他相关费用包括资产的仓储费、保管费等相关费用。

资产充抵保证金的手续费收取标准由交易所规定并公告。资产充抵保证金手续费在充抵关系解除时收取。

资产的仓储费、保管费等按有关规定交纳。

**第六十三条** 交易所应当建立充抵保证金业务相关资料的保管制度，完善相关手续。充抵保证金业务的相关资料保管期限与会计档案相同。

## 第七章 风险与责任

**第六十四条** 期货交易风险防范实行分级负责制度。交易所防范会员风险，会员防范其客户、境外经纪机构的风险，境外经纪机构防范其客户的风险。

**第六十五条** 会员对其在交易所成交的合约负有承担风险的责任。

交易所组织期货交易，已经成交的交易指令、了结的期货交易持仓、收取的保证金、已经划转或者完成质押处理的充抵保证金的资产、配对完成的标准仓单等交易、结算和交割行为或者财产的法律属性，以及采取的违约处理措施，不因会员进入破产程序而使得相关行为或者财产的法律属性被撤销或者无效。

会员进入破产程序，交易所仍可以按照交易规则及其实施细则，对该会员未了结的合约进行净额结算。

**第六十六条** 存管银行发生破产或者其他债权债务纠纷的，保证金不属于其破产财产，不属于冻结或者划拨的财产范围。

**第六十七条** 交割仓库发生破产或者其他债权债务纠纷的，期货市场参与者存放的非交割仓库所有的期货商品，不属于交割仓库的破产财产和查封、扣押的财产范围。

**第六十八条** 会员不能履行合约义务时，交易所所有权对其采取下列保障措施：

- （一）动用会员的结算准备金；
- （二）暂停开仓交易；
- （三）按规定强行平仓，直至用平仓后释放的保证金能够履约为止；
- （四）将充抵保证金的资产变现，用变现所得履约赔偿。

**第六十九条** 采取前条措施后会员仍不能清偿债务的，交易所可采取以下清偿措施：

- （一）转让会员资格，用转让所得抵偿；
- （二）经理事会批准，动用风险准备金进行履约赔偿；
- （三）动用交易所的自有资产进行履约赔偿；
- （四）通过法律程序继续对该会员追偿。

**第七十条** 交易所实行风险准备金制度。风险准备金由交易所设立，用于维护期货市场正常运转提供财务担保和弥补交易所难以控制的风险带来的亏损。

**第七十一条** 风险准备金的来源：

- （一）交易所按手续费收入 20% 的比例提取；
- （二）符合国家财政政策规定的其他收入。

当风险准备金余额达到一定规模时，经中国证监会批准可不再提取。

**第七十二条** 风险准备金必须单独核算，专户存储。

**第七十三条** 风险准备金的动用必须经交易所理事会批准，并报告中国证监会。

## 第八章 附则

**第七十四条** 违反本细则规定的，交易所按《郑州商品交易所违规处理办法》有关规定处理。

**第七十五条** 有关夜盘交易相关的结算业务，郑州商品交易所夜盘交易细则有特殊规定的，从其规定。

**第七十六条** 本细则解释权属于郑州商品交易所。

**第七十七条** 本细则自 2018 年 11 月 9 日施行。

# 郑州商品交易所指定存管银行管理办法修 订案

(2018 年 10 月 23 日郑州商品交易所第六届理事会第十二次  
会议审议通过)

对《郑州商品交易所指定存管银行管理办法》作如下修改：

一、新增第四条：“交易所期货保证金存管业务分为境内客户保  
证金存管业务和境外客户保证金存管业务。

“境内客户保证金存管业务是指从事与会员、境内客户相关的保  
证金存管业务；境外客户保证金存管业务是指从事与境外经纪机构、  
境外客户相关的保证金存管业务。”

二、原第四条修改为：“银行业金融机构从事交易所期货保证金  
存管业务，应当向交易所提出申请。

“申请期货保证金存管银行资格，应当具备下列条件：

“（一）中华人民共和国境内设立的全国性银行业金融机构法人；

“（二）在期货交易所所在地设有可以办理期货保证金存管业务  
和资金结算相关业务的分支机构；

“（三）符合中国银行保险业监督管理委员会对银行业金融机构  
资本充足率、流动性、资产负债比例等规定；

“（四）具有良好的公司治理、风险管理体系和内部控制制度；

“（五）具有符合开展期货保证金存管业务和配合期货保证金安

全存管监控所需要的设施和技术水平，具备先进、快速的异地资金划拨系统，且最近 3 年系统运行稳定。拥有全国范围内的本行系统实时汇划系统，以及服务良好的全国集中式银期转账系统；

“（六）具有健全的期货保证金管理制度、内部管理制度、业务操作流程以及发生技术和通讯系统故障等异常情况下的应急处理预案；

“（七）有专门部门或机构负责期货保证金存管业务。交易所指定的期货保证金存管分支机构中，取得中国期货从业资格考试合格证明的人员不得少于 3 名，且交易所结算专柜人员应当取得中国期货从业资格考试合格证明，其中管理人员应具有 5 年以上银行从业经验；

“（八）无严重影响其资信状况的未决诉讼和未清偿债务；

“（九）最近 3 年无重大违法违规行为，未发生过重大事故及未受到过监管机构的重大行政处罚；

“（十）交易所规定的其他条件。”

三、新增第六条：“申请从事境内客户期货保证金存管业务的银行业金融机构，应当满足本办法第五条的规定，并具备以下条件：

“（一）注册资本达到 100 亿元人民币，最近 3 个会计年度连续盈利；

“（二）总资产在 15000 亿元人民币以上，资本净额在 1000 亿元人民币以上；

“（三）境内分支机构 600 个以上。

“与交易所上市品种密切相关的政策性银行，申请从事交易所期

货保证金存管业务资格的，不适用第五条第一款第（一）项规定，不适用本条第一款第（一）至（三）项规定。”

四、新增第七条：“申请从事境外客户期货保证金存管业务的银行业金融机构，应当满足本办法第五条的规定，并具备以下条件：

“（一）注册资本达到 50 亿元人民币，最近 3 个会计年度连续盈利；

“（二）总资产在 15000 亿元人民币以上，资本净额在 1000 亿元人民币以上；或者其总资产在 300 亿元人民币以上，资本净额在 50 亿元人民币以上，且其母公司总资产在 15000 亿元人民币或者等值外币以上，资本净额在 1000 亿元人民币或者等值外币以上；

“（三）应当是有关大额实时支付系统的直接清算成员行，或者与有关大额实时支付系统的直接清算成员行建立代理行关系，能确保实时、高效完成资金划拨，且其或者其控股母公司在 1 个及以上全球性或者区域性金融中心设有可以办理期货保证金存管业务和资金结算相关业务的分支机构。”

五、原第五条第（四）项修改为：“（四）期货保证金存管业务部门的岗位设置、职责规定以及该业务部门负责人和业务人员名单、履历；”

原第五条第（五）项前增加两项：“（五）申请从事境外客户保证金存管业务的，应当提供是有关大额实时支付系统的直接清算成员行，或者与有关大额实时支付系统的直接清算成员行建立代理行关系的说明材料；

“（六）按照国家工商行政管理总局要求公示的最新企业年度报告；”

六、原第六条修改为：“银行业金融机构申请并通过交易所对其期货保证金存管银行资格预审后，应当按照交易所及中国期货市场监控中心有限责任公司（以下简称监控中心）的要求通过相关业务、技术、通讯设备等方面的测试，并向交易所提供下列材料：

“（一）通过监控中心存管业务数据报送系统测试的书面证明材料；

“（二）与期货公司等期货市场参与者进行全国集中式银期转账系统测试的报告；

“（三）交易所指定的存管银行分支机构营业执照复印件及设立情况说明，包括分支机构的营业场所、设施、岗位设置和职责规定，以及分支机构负责人和业务人员名单、履历、相关人员的中国期货业务资格考试合格证明；

“（四）交易所要求提供的其他文件。”

七、原第七条修改为：“交易所对银行业金融机构提交的申请材料与系统测试结果进行审核，并将审核结果报中国证券监督管理委员会备案。5个工作日后，交易所书面通知经核准具有存管银行资格的银行业金融机构，并在交易所网站上公告。获得指定存管银行资格的银行业金融机构应当在获得资格3日内向银行业监管部门报告。”

八、新增第十二条：“存管银行的权利：

“（一）开设交易所专用结算账户、会员保证金专用账户、境外

经纪机构和客户期货结算账户及其他与结算有关的账户；

“（二）吸收交易所和会员、境外经纪机构和客户等主体的存款；

“（三）了解会员等主体在交易所的资信情况。”

九、新增第十三条：“存管银行的义务：

“（一）向交易所提供会员保证金专用账户、境外经纪机构期货结算账户的资金情况；

“（二）根据交易所提供的票据或指令优先划转会员的资金，并及时将资金划转结果和相关账户变动信息反馈给交易所，并按规定及时完成期货交易相关结售汇；

“（三）协助交易所核查会员资金的来源和去向；

“（四）向交易所及时通报本所标准仓单的质押情况及会员在资金结算方面的不良行为和风险；

“（五）在交易所出现重大风险时，必须协助交易所化解风险；

“（六）根据中国证券监督管理委员会或交易所的要求，对会员保证金专用账户中的资金实行必要的监管措施；

“（七）保守交易所、会员、境外经纪机构和客户的商业秘密；

“（八）接受交易所对其期货相关业务进行监督。”

十、原第十条修改为：“存管银行应当保证交易所指定分支机构的业务稳定和人员稳定，定期组织业务人员培训，积极参加交易所组织的业务培训，保证业务人员熟练掌握期货保证金存管业务的流程及交易所关于期货保证金存管等结算业务的规则和要求。”

十一、原第十二条新增一款：“从事境外客户保证金存管业务的

指定存管银行，应当按照中国人民银行和国家外汇管理局有关规定，为交易所、会员、境外特殊参与者、境外经纪机构、境外客户开立期货业务相关的银行账户。”

十二、原第十三条新增一款：“存管银行应当按照国家外汇管理规定和交易所的相关要求，为交易所和会员办理结售汇业务，并按规定履行报告义务。”

十三、原第十四条修改为：“存管银行应当为交易所、会员、客户、境外经纪机构提供安全、准确、迅捷的期货保证金存管、划转服务。”

十四、原第十七条新增第（三）项：“（三）存管银行可以通过与其他机构业务合作的方式，提高资金划拨效率。”

十五、原第十八条第（二）项修改为：“（二）按照交易所的查询要求，提供专用结算账户余额及变动情况，存管银行应当实时回送查询结果；”

十六、原第二十条修改为：“存管银行应当向交易所提供交易所会员保证金专用账户的余额及变动情况，实时回送查询结果。”

十七、原第二十四条修改为：“存管银行不得协助会员在期货保证金账户上设定担保；不得挪用客户保证金偿还期货公司会员、境外经纪机构及交易所债务。”

十八、原第二十七条修改为：“存管银行的全国集中式银期转账系统应当能够支持会员系统多点接入，满足会员银期转账系统灾备和冗余的要求。”

十九、原第三十八条增加一款：“境外金融市场、资本市场发生潜在或者可预见风险的，指定存管银行应当及时向交易所通报市场风险情况，并协助做好风险防范工作。”

二十、原第四十二条修改为：“交易所对存管银行进行年度考评。综合考核其开展期货保证金存管业务的时效性、安全性、准确性和流动性控制，以及系统运维、人员服务、业务运营和满意度评价等。

“交易所可在安排存管银行的业务以及双方合作项目时，参考考评结果。”

二十一、原第四十三条删除第（四）项，第（一）和（二）项修改为：“（一）未履行本办法以及与交易所签订的业务协议规定的义务，或者违反交易所其他业务规则的；

“（二）发生影响或可能影响期货保证金存管业务的情况时，存管银行未采取有效措施，可能危及期货市场稳健运行，损害交易所会员、境外经纪机构、客户合法权益的；”

二十二、原第四十四条第（二）项修改为：“（二）协助会员在期货保证金账户上设定担保的；”

二十三、原第四十六条第（六）项修改为：“（六）最近1个年度考评结果不合格，且经过规定的整改期后仍不合格的；”

二十四、原第四十七条修改为：“交易所决定终止存管银行资格，应当提前10个工作日发出终止通知，上报中国证券监督管理委员会，并在交易所网站上公告。

“存管银行资格终止不影响该银行业金融机构与交易所在此之

前双方已经建立的法律关系，交易所有权依法与该银行业金融机构了结相关业务。”

作上述修订后，原章节及条款顺序相应调整。

# 郑州商品交易所指定存管银行管理办法

(2013年8月23日第五届理事会第十四次会议审议通过,2013年8月29日发布,自发布之日起施行;2018年10月23日第六届理事会第十二次会议修订,2018年11月9日发布,自2018年11月9日起施行)

## 第一章 总 则

**第一条** 为规范郑州商品交易所(以下简称交易所)期货保证金存管业务,确保期货保证金存管安全和期货交易的平稳运行,促进期货市场健康发展,根据国家有关期货市场发展的法规、政策以及《郑州商品交易所交易规则》和《郑州商品交易所结算细则》等规定,结合交易所期货交易活动的实际需要,制定本办法。

**第二条** 期货保证金指定存管银行(以下简称存管银行)是指由交易所指定、为交易所会员单位和投资者提供期货保证金存管和出入金等服务的银行业金融机构。

**第三条** 交易所依据本办法对存管银行进行管理,交易所、存管银行及其有关业务人员应该遵守本办法。

## 第二章 资格申请

**第四条** 交易所期货保证金存管业务分为境内客户保证金存管业务和境外客户保证金存管业务。

境内客户保证金存管业务是指从事与会员、境内客户相关的保证金存管业务;境外客户保证金存管业务是指从事与境外经纪机构、境

外客户相关的保证金存管业务。

**第五条** 银行业金融机构从事交易所期货保证金存管业务，应当向交易所提出申请。

申请期货保证金存管银行资格，应当具备下列条件：

- （一）中华人民共和国境内设立的全国性银行业金融机构法人；
- （二）在期货交易所所在地设有可以办理期货保证金存管业务和资金结算相关业务的分支机构；
- （三）符合中国银行保险业监督管理委员会对银行业金融机构资本充足率、流动性、资产负债比例等规定；
- （四）具有良好的公司治理、风险管理体系和内部控制制度；
- （五）具有符合开展期货保证金存管业务和配合期货保证金安全存管监控所需要的设施和技术水平，具备先进、快速的异地资金划拨系统，且最近 3 年系统运行稳定。拥有全国范围内的本行系统实时汇划系统，以及服务良好的全国集中式银期转账系统；
- （六）具有健全的期货保证金管理制度、内部管理制度、业务操作流程以及发生技术和通讯系统故障等异常情况下的应急处理预案；
- （七）有专门部门或机构负责期货保证金存管业务。交易所指定的期货保证金存管分支机构中，取得中国期货从业资格考试合格证明的人员不得少于 3 名，且交易所结算专柜人员应当取得中国期货从业资格考试合格证明，其中管理人员应具有 5 年以上银行从业经验；
- （八）无严重影响其资信状况的未决诉讼和未清偿债务；

(九) 最近 3 年无重大违法违规行为，未发生过重大事故及未受到过监管机构的重大行政处罚；

(十) 交易所规定的其他条件。

**第六条** 申请从事境内客户期货保证金存管业务的银行业金融机构，应当满足本办法第五条的规定，并具备以下条件：

(一) 注册资本达到 100 亿元人民币，最近 3 个会计年度连续盈利；

(二) 总资产在 15000 亿元人民币以上，资本净额在 1000 亿元人民币以上；

(三) 境内分支机构 600 个以上。

与交易所上市品种密切相关的政策性银行，申请从事交易所期货保证金存管业务资格的，不适用第五条第一款第（一）项规定，不适用本条第一款第（一）至（三）项规定。

**第七条** 申请从事境外客户期货保证金存管业务的银行业金融机构，应当满足本办法第五条的规定，并具备以下条件：

(一) 注册资本达到 50 亿元人民币，最近 3 个会计年度连续盈利；

(二) 总资产在 15000 亿元人民币以上，资本净额在 1000 亿元人民币以上；或者其总资产在 300 亿元人民币以上，资本净额在 50 亿元人民币以上，且其母公司总资产在 15000 亿元人民币或者等值外币以上，资本净额在 1000 亿元人民币或者等值外币以上；

（三）应当是有关大额实时支付系统的直接清算成员行，或者与有关大额实时支付系统的直接清算成员行建立代理行关系，能确保实时、高效完成资金划拨，且其或者其控股母公司在—个及以上全球性或者区域性金融中心设有可以办理期货保证金存管业务和资金结算相关业务的分支机构。

**第八条** 银行业金融机构申请期货保证金存管银行资格，应当向交易所提交下列预审材料：

（—）申请开展期货保证金存管业务的申请表、申请报告、可行性报告及业务计划书；

（二）分支机构、营业网点以及开展期货保证金存管业务所需设施的情况说明；

（三）期货保证金存管制度、内部管理制度以及出现技术通讯故障等异常情况下的相关应急处理预案；

（四）期货保证金存管业务部门的岗位设置、职责规定以及该业务部门负责人和业务人员名单、履历；

（五）申请从事境外客户保证金存管业务的，应当提供是有关大额实时支付系统的直接清算成员行，或者与有关大额实时支付系统的直接清算成员行建立代理行关系的说明材料；

（六）按照国家工商行政管理总局要求公示的最新企业年度报告；

（七）遵守期货保证金安全存管监控规定的承诺书；

（八）最新年检的《企业法人营业执照》复印件；

（九）《金融业务许可证》复印件；

(十) 最近 3 年的审计报告以及内部控制评价报告；

(十一) 企业法人授权书（授权书格式见附件 2）及经办人员的身份证明文件；

(十二) 交易所要求提供的其他文件。

**第九条** 银行业金融机构申请并通过交易所对其期货保证金存管银行资格预审后，应当按照交易所及中国期货市场监控中心有限责任公司（以下简称监控中心）的要求通过相关业务、技术、通讯设备等方面的测试，并向交易所提供下列材料：

(一) 通过监控中心存管业务数据报送系统测试的书面证明材料；

(二) 与期货公司等期货市场参与者进行全国集中式银期转账系统测试的报告；

(三) 交易所指定的存管银行分支机构营业执照复印件及设立情况说明，包括分支机构的营业场所、设施、岗位设置和职责规定，以及分支机构负责人和业务人员名单、履历、相关人员的中国期货业务资格考试合格证明；

(四) 交易所要求提供的其他文件。

**第十条** 交易所对银行业金融机构提交的申请材料与系统测试结果进行审核，并将审核结果报中国证券监督管理委员会备案。5 个工作日后，交易所书面通知经核准具有存管银行资格的银行业金融机构，并在交易所网站上公告。获得指定存管银行资格的银行业金融机构应当在获得资格 3 日内向银行业监管部门报告。

**第十一条** 存管银行在开展期货保证金存管业务前，应当就期货

保证金存管业务与交易所签订协议，明确双方权利和义务。

### 第三章 权利与义务

#### 第十二条 存管银行的权利：

（一）开设交易所专用结算账户、会员保证金专用账户、境外经纪机构和客户期货结算账户及其他与结算有关的账户；

（二）吸收交易所和会员、境外经纪机构和客户等主体的存款；

（三）了解会员等主体在交易所的资信情况。

#### 第十三条 存管银行的义务：

（一）向交易所提供会员保证金专用账户、境外经纪机构期货结算账户的资金情况；

（二）根据交易所提供的票据或指令优先划转会员的资金，并及时将资金划转结果和相关账户变动信息反馈给交易所，并按规定及时完成期货交易相关结售汇；

（三）协助交易所核查会员资金的来源和去向；

（四）向交易所及时通报本所标准仓单的质押情况及会员在资金结算方面的不良行为和风险；

（五）在交易所出现重大风险时，必须协助交易所化解风险；

（六）根据中国证券监督管理委员会或交易所的要求，对会员保证金专用账户中的资金实行必要的监管措施；

（七）保守交易所、会员、境外经纪机构和客户的商业秘密；

（八）接受交易所对其期货相关业务进行监督。

## 第四章 业务要求

**第十四条** 存管银行设置分支机构应当在交易所指定的距离范围内，分支机构内应当设置期货业务专柜。

**第十五条** 存管银行应当保证交易所指定分支机构的业务稳定和人员稳定，定期组织业务人员培训，积极参加交易所组织的业务培训，保证业务人员熟练掌握期货保证金存管业务的流程及交易所关于期货保证金存管等结算业务的规则和要求。

**第十六条** 根据交易所申请，存管银行应当为交易所开立专用结算账户等专用存款账户，账户名称应当体现业务性质。

**第十七条** 存管银行应当凭交易所签发的专用通知书，为会员办理开立、变更或者注销专用资金账户业务。交易所与会员之间期货业务资金的往来通过交易所专用结算账户和会员专用资金账户办理。

从事境外客户保证金存管业务的指定存管银行，应当按照中国人民银行和国家外汇管理局有关规定，为交易所、会员、境外特殊参与者、境外经纪机构、境外客户开立期货业务相关的银行账户。

**第十八条** 存管银行应当按照期货保证金安全存管有关规定通过转账方式办理期货保证金存取业务，对期货保证金实行封闭运行。

存管银行应当按照国家外汇管理规定和交易所的相关要求，为交易所和会员办理结售汇业务，并按规定履行报告义务。

**第十九条** 存管银行应当为交易所、会员、客户、境外经纪机构

提供安全、准确、迅捷的期货保证金存管、划转服务。

**第二十条** 存管银行应当早于交易所开市前 30 分钟开始当日营业。交易闭市后，期货结算时间确需延迟的，存管银行应当相应延迟其营业时间。

**第二十一条** 当有款项划入交易所专用结算账户时，存管银行应当在资金到账后，立即记入交易所账户，并实时通知交易所。

**第二十二条** 存管银行按照交易所的电子划款指令或书面划款指令办理划款业务时，应当遵守以下规定：

（一）对于本行系统内账户的资金划拨，存管银行在收到交易所划款指令后，应实时将资金汇划至交易所指定的会员专用资金账户；

（二）对于跨行的资金划拨，存管银行收到交易所划款指令后，应以最快捷的方式划出款项，并保证该款项及时到达交易所指定的收款账户开户银行。遇到特殊情况的，应在当日下午 4 时前到达交易所指定的收款账户开户银行；

（三）存管银行可以通过与其他机构业务合作的方式，提高资金划拨效率。

**第二十三条** 存管银行应当每日按照以下规定与交易所进行专用结算账户账务核对：

（一）每日结算资金业务终了后进行对账，或应交易所的需要随时对账；

（二）按照交易所的查询要求，提供专用结算账户余额及变动情

况，存管银行应当实时回送查询结果；

（三）在结算业务发生后当日，存管银行应当将交易所进账单、收付款明细清单等业务凭证送达交易所；

（四）存管银行应当按交易所的要求及时提供资金结算账户对账单。

**第二十四条** 存管银行应当按照期货保证金安全存管监控的规定，通过网络专线在规定的时间内向监控中心报送在该行开设的全部期货保证金账户前 1 交易日的账户余额、变动明细等相关信息。

**第二十五条** 存管银行应当向交易所提供交易所会员保证金专用账户的余额及变动情况，实时回送查询结果。

**第二十六条** 存管银行应当采取有效措施，减少资金的流动性风险；未经交易所书面同意，不得限制会员公司出入金；为测试保证金存款的安全性，交易所可随时对存管的保证金进行跨行调拨。

**第二十七条** 存管银行应当按照与交易所协商确定的存款利率向交易所支付利息。

**第二十八条** 当交易所的资金结算系统出现流动性等需求时，应交易所申请，存管银行必须给予相应的资金支持。

**第二十九条** 存管银行不得协助会员在期货保证金账户上设定担保；不得挪用客户保证金偿还期货公司会员、境外经纪机构及交易所债务。

**第三十条** 存管银行应当拒绝任何其他单位或个人对交易所专用结算账户内资金进行非法冻结、扣划；如有其他单位拟对会员专用资金账户采取冻结等影响保证金存管业务的措施时，存管银行应当及时通知交易所。

## 第五章 技术要求

**第三十一条** 存管银行应按照交易所相关资金划转系统接口规范完成资金划转系统建设，通过交易所的功能测试和性能测试，满足交易所相关技术规范要求。

**第三十二条** 存管银行的全国集中式银期转账系统应当能够支持会员系统多点接入，满足会员银期转账系统灾备和冗余的要求。

**第三十三条** 存管银行负责申请与交易所的主备通讯链路，相关网络参数由交易所统一分配。

**第三十四条** 存管银行应将资金划转系统纳入技术系统的统一运维管理流程，对资金划转系统、数据链路和硬件平台进行实时监控。

**第三十五条** 资金划转系统应用或网络系统变更，存管银行应提前 5 个工作日通知交易所技术运维部门，并提前做好系统测试工作。

**第三十六条** 存管银行应积极参与交易所组织的应急演练和联合测试。

**第三十七条** 存管银行应设立 7×24 小时的技术应急联系人，技术应急联系人发生变更时应及时向交易所技术运维部门进行报备。

## 第六章 应急处理

**第三十八条** 存管银行应建立、完善《期货保证金存管银行网络与信息安全事件应急预案》，做到职责明确、措施到位、反应快速、处置及时。

**第三十九条** 交易所或者存管银行发生可能影响期货资金结算业务的业务操作失误或技术系统故障时，应当立即通知对方，并积极采取行动进行补救。

**第四十条** 资金划转系统发生故障时，发现方应当立即通知对方，双方应当积极配合并对各自系统进行检查，以确定原因、排除故障、明确责任。必要时，立即启动应急措施。

**第四十一条** 存管银行发生影响期货保证金存管业务运行稳定和安全情况时，应当立即启动应急预案，尽快恢复正常运行，并将相关情况报告交易所和监控中心。

## 第七章 监督管理

**第四十二条** 存管银行期货业务部门岗位设置、职责规定、部门负责人、业务联系人等发生变更时，应当于3个工作日内书面报告交易所和监控中心。

**第四十三条** 存管银行出现影响该行资信状况的重大业务风险或损失时，应当于3个工作日内向交易所和监控中心报告，并提交该业务风险或损失对该行保证金存管业务的影响分析及应对措施。

境外金融市场、资本市场发生潜在或者可预见风险的，指定存管银行应当及时向交易所通报市场风险情况，并协助做好风险防范工作。

**第四十四条** 存管银行实施系统升级改造或者实施其他可能影响期货保证金存管业务的措施前，应当提前 5 个工作日书面通知交易所、监控中心和相关期货公司，做好信息披露和系统测试工作，并制定针对性应急预案。

**第四十五条** 存管银行应当在每一年度结束后 1 个月内，向交易所和监控中心提交期货保证金存管业务、技术运行、风险管理以及有关法律、法规、规章、政策执行情况的报告。

**第四十六条** 交易所对存管银行期货保证金存管业务资格条件进行年度检查，或者根据需要进行不定期检查，存管银行应当予以配合。

**第四十七条** 交易所对存管银行进行年度考评。综合考核其开展期货保证金存管业务的时效性、安全性、准确性和流动性控制，以及系统运维、人员服务、业务运营和满意度评价等。

交易所可在安排存管银行的业务以及双方合作项目时，参考考评结果。

## 第八章 违规处理

**第四十八条** 存管银行出现下列情形之一，责令改正，并根据情节轻重，采取警告、通报批评、暂停新增会员的存管业务等措施：

（一）未履行本办法以及与交易所签订的业务协议规定的义务，

或者违反交易所其他业务规则的；

（二）发生影响或可能影响期货保证金存管业务的情况时，存管银行未采取有效措施，可能危及期货市场稳健运行，损害交易所会员、境外经纪机构、客户合法权益的；

（三）未能按照监控中心相关要求报送期货保证金安全存管业务数据的；

（四）发生可能影响期货资金结算业务的业务操作失误或技术系统故障时，未立即通知交易所的；或未及时采取有效措施进行处理的；

（五）不符合银行业监管机构关于资本充足率、流动性、资产负债比例等指标要求的；

（六）不配合交易所对存管银行资金结算业务进行年检或不定期检查，不按要求提交上年度存管业务总结报告或其他要求提供材料的；

（七）无故限制会员出入金的；

（八）交易所会员普遍反映存管银行服务质量不高，银期转账系统不稳定的；

（九）交易所认定的其他情况。

**第四十九条** 存管银行出现下列情形之一的，暂停全部存管业务：

（一）未能采取有效措施，导致交易所结算账户内的资金被冻结或扣划的；

（二）协助会员在期货保证金账户上设定担保的；

（三）最近 1 个会计年度发生亏损的；

（四）交易所认定的其他情况。

**第五十条** 对于暂停期货保证金存管业务的存管银行，在整改后经交易所验收，确实具备正常开展期货保证金存管业务能力的，可以恢复其存管业务。

**第五十一条** 存管银行出现以下情形之一的，交易所可以取消其期货保证金存管业务资格：

- （一）申请终止其期货保证金存管业务资格的；
- （二）被依法撤销、解散或宣告破产的；
- （三）被收购或兼并且丧失法人地位的；
- （四）不再满足期货保证金存管业务资格的；
- （五）最近 3 个会计年度连续发生亏损的；
- （六）最近 1 个年度考评结果不合格，且经过规定的整改期后仍不合格的；
- （七）向交易所提供虚假材料信息的；
- （八）交易所认为该存管银行存在重大风险隐患的；
- （九）交易所认定的其他情况。

**第五十二条** 交易所决定终止存管银行资格，应当提前 10 个工作日发出终止通知，上报中国证券监督管理委员会，并在交易所网站上公告。

存管银行资格终止不影响该银行业金融机构与交易所在此之前双方已经建立的法律关系，交易所依法与该银行业金融机构了结相关业务。

**第五十三条** 被交易所终止存管银行资格的银行业金融机构，自终止之日起3年内不得申请期货保证金存管业务资格。

## **第九章 附 则**

**第五十四条** 除有国家法律、法规规定，对于涉及期货保证金存管业务的任何非公开信息，存管银行保证不以任何方式向第三方披露。

**第五十五条** 本办法实施前已经开展业务的存管银行，无需重新申请期货保证金存管业务资格，但应当遵守本办法的其他规定。

**第五十六条** 本办法由交易所负责解释。

**第五十七条** 本办法自发布之日起实施。

附件 1:

### 期货保证金存管银行资格申请表

申请人全称				
注册地址				
注册资本				
邮政编码				
法定代表人姓名				
企业法人营业执照号码				
金融业务许可证号码				
存管业务负责部门				
联系电话				
传真电话				
存管行业务负责人	姓名			
	部门及职务			
	联系方式			
河南分行业务负责人	姓名			
	部门及职务			
	联系方式			
河南分行技术负责人	姓名			
	部门及职务			
	联系方式			
指定网点上级机构业务负责人	姓名			
	部门及职务			
	联系方式			
经办人姓名				
经办人身份证号码				
经办人联系电话				
申请人基本财务状况及其他情况	上一年度期末（经审计） 总资产、净资产、净资本	总资产：		
		净资产：		
		净资本：		
	最近三年的净利润			
	最近三年资本充足率			
	最近三年资产负债率			
	最近三年流动比率			
	分支机构的数量			
与期货存管业务有关的内部控制制度				
其他情况说明				
法定代表人或授权代表人（签字并盖章） 申请人盖章				

附件 2:

## 授权书

郑州商品交易所:

特授权我行职员 \_\_\_\_\_ (女士/先生)(身份证号 \_\_\_\_\_)代表我行前往贵所办理期货保证金存管银行资格的申请事宜。其权限范围:代表我行办理与贵所期货保证金存管银行资格申请有关的全部工作,包括但不限于向贵所提出期货保证金存管银行资格申请并提交申请文件、签署与期货保证金存管银行资格申请相关的文件,接收贵所向我行提交的与期货保证金存管银行资格申请相关的文件。本授权有效期从 年 月 日到 年 月 日止。

特此授权。

授权人: \_\_\_\_\_ 银行(盖章)

法定代表人: \_\_\_\_\_ (签字并盖章)

年 月 日

## 郑州商品交易所期货交割细则修订案

(2018 年 10 月 23 日郑州商品交易所第六届理事会第十二次会议审议通过)

对《郑州商品交易所期货交割细则》作如下修改：

一、第一条第二款修改为“交易所交割业务按本细则进行，交易所、会员、客户、境外经纪机构、交割仓库（以下简称仓库）、交割中转仓库（以下简称中转仓库）、交割厂库（以下简称厂库）及指定质检机构应当遵守本细则。

二、第五条增加第二款：“委托境外经纪机构从事期货交易的客户的交割应当委托其境外经纪机构办理，境外经纪机构再委托会员办理，以会员名义在交易所进行。”

三、第六条第一款修改为：“不能交付或者接收增值税专用发票（普通）或交易所认可的其他单据的客户不得交割；持仓量为非交割单位整数倍的相应持仓不得交割；不具备甲醇生产、储存、使用、经营或运输资质的客户不得参与甲醇交割；中转仓单不得用于交割月最后交易日下午闭市后的配对交割。

四、第六十九条第一款中“普麦及适用非通用标准仓单的品种期货合约在最后交易日之前的配对原则：……”修改为“普麦、强麦、棉花、菜籽、动力煤、粳稻、甲醇、玻璃、白糖、硅铁、锰硅、棉纱、苹果期货合约在最后交易日之前的配对原则：……”

五、第七十条第一款中“普麦及适用非通用标准仓单的品种期货合约在最后交易日的配对原则：……”修改为“普麦、强麦、棉花、菜籽、动力煤、粳稻、甲醇、玻璃、白糖、硅铁、锰硅、棉纱、苹果期货合约在最后交易日的配对原则：……”。

第七十条第一款第（二）项修改为“当日下午 1 时 30 分之前，卖方应提出交割申请，提交车（船）板交割货物信息。卖方应主动公布用于交割的仓单信息，未主动公布的，交易所于下午 1 时 30 分公布卖方相应品种所有可流通标准仓单信息供买方挑选；买方挑选卖方标准仓单的总数量不超过卖方该合约的持仓量。卖方未提出车（船）板交割申请及未提交车（船）板交割货物信息的，交易所按标准仓单交割对待。

六、第七十一条“普麦及适用非通用标准仓单的品种期货合约之外的其他品种期货合约配对原则：……”修改为“PTA、菜油、菜粕、早籼稻、晚籼稻期货合约配对原则：……”。

增加第七十一条第（四）项：“（四）PTA 期货合约在最后交易日交割配对时，参与交割的 PTA 保税标准仓单优先分配给境外买方。若境外买方持仓数量合计小于或等于保税标准仓单数量，则境外买方均能分配到保税标准仓单。若境外买方持仓数量大于保税标准仓单数量，则按照“持仓时间长优先”的原则确定参与保税标准仓单交割配对的境外买方。其他未配对持仓和未分配标准仓单由计算机按数量取整、最少配对数原则予以配对（配对日）。”

七、第七十五条第（一）项修改为“通知日后的下一交易日（即

交割日)上午9时之前,买方会员应当将尚欠货款划入交易所账户,卖方会员应当持有可流通的标准仓单。交易所结算部门为买卖双方办理交割结算手续,买卖双方在《交割通知单》注明的时间通过交易所会员服务系统查收交割结算结果,同时,买方会员把客户名称和税务登记证号等事项提供给卖方会员。交割标的为PTA保税标准仓单的,卖方会员应将增值税普通发票交付交易所。”

第七十五条第(二)项修改为:“(二)交易所收取买方会员全额货款后,于交割日将全额货款的80%划转给卖方会员,同时将卖方会员的仓单交付买方会员。余款在买方会员确认收到卖方会员转交的增值税专用发票时结清。交割标的为PTA保税标准仓单的,卖方会员应在交割日向交易所开具增值税普通发票,交割日后7个交易日闭市前未向交易所提交增值税普通发票的,交易所按照本细则规定收取滞纳金或违约金。对发票的传递、余款的结算,会员均应按本细则规定办理。”

增加第七十五条第(三)项:“(三)境外买方分配到PTA完税标准仓单的,交易所负责组织对该PTA完税标准仓单进行竞卖,竞卖产生的损益和费用由境外买方承担。若竞卖不成功,境外买方支付对应交割货款20%的补偿金给配对卖方。”

八、第九十一条第一款修改为“期货交割由交割卖方向对应的买方开具增值税专用(普通)发票。增值税专用(普通)发票由双方会员协助客户直接联系、办理发票交收。双方会员负责调解、处理相关纠纷。保税交割开具发票流程按照《郑州商品交易所保税交割实施细则》执

行。”

九、第九十二条第一款修改为“配对日后的一个工作日内，买方应按照税务机关的规定将开具增值税发票所需的具体信息通知卖方。标准仓单交割的，自交割日（不含该日）起7个交易日内，卖方应当提交增值税专用（普通）发票。延迟1至10日（公历日）的，卖方会员应当每天支付货款金额0.5%的滞纳金；超过10日（公历日）仍未提供增值税专用（普通）发票的，视为拒绝提供增值税专用（普通）发票，卖方会员应当按货款金额的规定比例支付违约金。各品种违约金比例按照国家税务部门公布的增值税税率执行。滞纳金或者违约金从货款余额中扣除，补偿给买方会员，剩余货款属于卖方会员。卖方会员先行支付滞纳金或者违约金后，有权向客户追偿。”

十、第九十四条增加第二款：“期转现分为标准仓单期转现和非标准仓单期转现。标准仓单期转现根据标准仓单类型分为完税标准仓单期转现和保税标准仓单期转现（以下简称保税期转现）。《郑州商品交易所保税交割实施细则》对保税期转现具体流程有规定的，按照其规定执行。”

十一、第一百零六条修改为：“计算买方交割违约合约数量时，交易所应对违约部分预扣合约价值20%的违约金。

“计算卖方交割违约合约数量的公式为：

“卖方交割违约合约数量（手）=[应交标准仓单数量（张）-已交标准仓单数量（张）]×交割单位÷交易单位

“计算买方交割违约合约数量的公式为：

“买方接到的仓单为完税标准仓单的，买方交割违约合约数量（手）=（应交货款 - 已交货款）÷（1-20%）÷（交割结算价+包装物单价）÷交易单位

“买方接到的仓单为保税标准仓单的，买方交割违约合约数量（手）=[保税应交货款（元）-已交货款（元）]÷ 保税交割结算价（元/吨）÷（1-20%）÷交易单位（吨/手）”。

# 郑州商品交易所期货交割细则

(2008年1月7日第五届理事会通讯会议修改,2008年1月15日发布,自发布之日起施行;2009年3月28日第五届理事会通讯会议审议通过,2009年4月15日发布,自2009年4月20日施行;2011年10月17日第五届理事会第七次通讯会议修改,2011年10月24日发布,自2011年10月28日施行;2012年7月12日第五届理事会第六次通讯会议修改,2012年11月28日发布,自2012年12月3日施行;2012年11月22日郑州商品交易所第五届理事会第八次通讯会议修改,2012年12月24日发布,修改部分自一号棉花1311合约起施行;2012年12月17日第五届理事会第十次通讯会议修改,2012年12月25日发布,自2012年12月28日施行;2013年9月5日第五届理事会第九次通讯会议修改,2013年9月16日发布,自2013年9月26日起施行;2013年10月28日第五届理事会第十一次通讯会议修改,2013年11月11日发布,自2013年11月18日施行;2014年6月16日第五届理事会第八次通讯会议修改,2014年7月4日发布,自2014年7月8日施行;2014年7月4日第五届理事会第十一次通讯会议修改,2014年8月1日发布,自2014年8月8日施行;2014年6月13日第五届理事会第七次通讯会议修改,2014年11月21日发布,自2012年12月12日施行;2014年12月3日第五届理事会第十六次通讯会议修改,2014年12月3日发布,修改部分自一号棉花1601合约起施行;2014年11月27日第五届理事会第十四次通讯会议修改,2014年12月3日发布,修改部分自强麦1601合约、普麦1601合约起施行;2014年11月28日第五届理事会第十五次通讯会议修改,2014年12月4日发布,修改部分自早籼稻1601合约、粳稻1601合约起施行;2014年11月28日第五届理事会第十五次通讯会议修改,2014年12月10日发布,自公布之日起施行;2015年12月18日第五届理事会第十三次通讯会议修改,2016年1月4日发布,修改部分自动力煤1701合约起施行;2017年7月31日第六届理事会第三次会议修改,2017年8月14日发布,自2017年8月18日施行;2017年7月31日第六届理事会第三次会议修改,2017年9月6日发布,修改部分自精对苯二甲酸1809合约起施行;2017年10月20日第六届理事会第五次会议修改,2017年10月31日发布,修改部分自硅铁1901合约、锰硅1901合约起施行;2015年5月11日第五届理事会第四次通讯会议修改,2017年11月10日发布,自2017年11月22日施行;2017年12月7日第六届理事会第六次会议修订,2017年12月19日发布,自2017年12月22日施行;2018年5月18日第六届理事会第八次会议修改,2018年6月7日发布,修改部分自2019年12月1日起施行;2018年10月16日第六届理事会第十一次会议修改,2018年10月17日发布,修改部分自苹果1910合约起施行;2018年10月23日第六届理事会第十二次会议修订,2018年11月9日发布,除第七十一条、第七十五条、第九十一条、第一百零六条修改部分自2019年5月2日起施行之外,其他修改部分自2018年11月9日起施行)

## 第一章 总则

**第一条** 为保证郑州商品交易所（以下简称交易所）期货交割业务的正常进行，规范期货交割行为，根据《郑州商品交易所交易规则》，制定本细则。

交易所交割业务按本细则进行，交易所、会员、客户、境外经纪机构、交割仓库（以下简称仓库）、交割中转仓库（以下简称中转仓库）、交割厂库（以下简称厂库）及指定质检机构必须遵守本细则。

**第二条** 期货交割是指期货合约到期时，按照交易所的规则和规定程序，交易双方通过该期货合约标的物所有权的转移，了结到期未平仓合约的过程。

标准仓单的期货交割实行三日交割法。

标准仓单以外的期货交割根据品种不同确定具体的交货流程。

**第三条** 交易所上市期货品种采用仓库交割、中转仓库交割、厂库交割、车（船）板交割等交割方式。

仓库交割是指卖方通过将指定交割仓库开具的相关商品仓库仓单转移给买方以完成实物交割的交割方式。

中转仓库交割是指卖方通过将中转仓库开具的相关商品中转仓单转移给买方以完成实物交割的交割方式。

厂库交割是指卖方通过将指定交割厂库开具的相关商品标准仓单转移给买方以完成实物交割的交割方式。

车（船）板交割是指卖方在交易所指定交割计价点将货物装至买方汽车板、火车板或轮船板，完成货物交收的一种实物交割方式。

交割计价点是指车（船）板交割时由交易所指定的用于计算双方各自应承担交割费用的地点。

交易所在交割计价点设置指定交割仓库或者其他交割服务机构，买卖双方选择在交割计价点交割的，应通过以上机构开展，并须交付一定的费用。

**第四条** 各品种采用的交割方式如下：

强麦、早籼稻：仓库交割。

棉花：仓库交割和中转仓库交割。

甲醇、菜粕、晚籼稻、粳稻、白糖、PTA、菜油、硅铁、锰硅、棉纱：仓库交割和厂库交割。

普麦、菜籽：车（船）板交割和仓库交割。

玻璃：厂库交割。

动力煤：车（船）板交割和厂库交割。

苹果：车（船）板交割、仓库交割和厂库交割。

**第五条** 客户的期货交割须由会员办理，并以会员名义在交易所进行，交割结果由客户承担。

委托境外经纪机构从事期货交易的客户的交割应当委托其境外经纪机构办理，境外经纪机构再委托会员办理，以会员名义在交易所进行。

**第六条** 不能交付或者接收增值税专用发票（普通）发票或交易所认可的其他单据的客户不得交割；持仓量为非交割单位整数倍的相应持仓不得交割；不具备甲醇生产、储存、使用、经营或运输资质的客户

不得参与甲醇交割；中转仓单不得用于交割月最后交易日下午闭市后的配对交割。

菜粕交付增值税普通发票。

苹果交付增值税专用发票或农产品销售发票。

进入交割月前，不得交割的客户应当将交割月份的相应持仓予以平仓。自进入交割月第一个交易日起，自然人客户不得开新仓，交易所所有权对自然人客户的交割月份持仓予以强行平仓。不得交割的持仓被配对的，交易所对其处以合约价值（按配对日交割结算价计算）10%的违约金，违约金支付给对方，终止交割；买卖双方均属上述情况的，交易所按本条规定比例核算的金额对双方进行处罚，终止交割。

最后交易日下午闭市后被配对交割的卖方，仅持有中转仓单或同时持有中转仓单和标准仓单，但持有的标准仓单数量不能满足交易所规定的交割要求的，视为违约。由交易所对卖方的违约持仓部分处以合约价值（按配对日交割结算价计算）20%的违约金，违约金支付给买方，终止交割。

## **第二章 期货交割标准**

### **第一节 普通小麦**

**第七条** 交割单位：50 吨。

**第八条** 普通小麦（以下简称普麦）交割适用国家标准、国家相关规定及本细则规定。

基准交割品：符合《中华人民共和国国家标准 小麦》（GB 1351-2008）的三等及以上小麦，且不完善粒中生芽粒 $\leq 2.0\%$ 、霉变粒 $\leq 2.0\%$ 。

替代品质量差异及升贴水：

（一）入库时，水分 $\leq 12.5\%$ 的，足量入库； $12.5\% < \text{水分} \leq 13.5\%$ 的，以 $12.5\%$ 为基准，水分每超 $0.5\%$ ，扣量 $1.0\%$ ；不足 $0.5\%$ 的，不扣量。标准仓单出库时，水分 $\leq 12.5\%$ 的，足量出库； $12.5\% < \text{水分} \leq 13.5\%$ 的，水分每超 $0.5\%$ ，补量 $1.0\%$ ；不足 $0.5\%$ 的，不补量。车船板交货时，水分 $\leq 12.5\%$ 的足量交货； $12.5\% < \text{水分} \leq 13.5\%$ 的，水分每超 $0.5\%$ ，补量 $1.0\%$ ；不足 $0.5\%$ 的，不补量。

（二） $1.0\% < \text{杂质} \leq 1.5\%$ 的，以 $1.0\%$ 为基准，杂质每超 $0.5\%$ ，入库扣量（出库补量） $1\%$ ；不足 $0.5\%$ 的，入库不扣量（出库不补量）。车船板交货时按出库处理。

（三） $8.0\% < \text{不完善粒} \leq 12.0\%$ 的，以 $8.0\%$ 为基准，不完善粒每超 $1.0\%$ ，入库扣量（出库补量） $1.0\%$ 。车船板交货时按出库处理。

**第九条** 普麦接收、储存、发运采用散粮方式。

## 第二节 优质强筋小麦

**第十条** 交割单位：20吨。

**第十一条** 优质强筋小麦（以下简称强麦）交割适用国家标准、国家相关规定及本细则规定：

基准交割品：符合《中华人民共和国国家标准 小麦》（GB 1351-2008）的三等及以上小麦，容重 $\geq 770\text{g/L}$ ，不完善粒中霉变粒

≤2.0%，300s≤降落数值≤550s；内在品质指标稳定时间≥8 分钟、湿面筋≥30%、拉伸面积（135min）≥90cm<sup>2</sup>。

替代品质量差异及升贴水：

（一）内在品质指标稳定时间≥6 分钟、湿面筋≥28%、拉伸面积（135min）≥75cm<sup>2</sup>、容重≥750g/L，但不满足基准交割品及以上等级要求的，贴水 260 元/吨；稳定时间≥12 分钟、湿面筋≥30%、拉伸面积（135min）≥100cm<sup>2</sup>的，升水 80 元/吨；稳定时间≥16 分钟、湿面筋≥30%、拉伸面积（135min）≥120cm<sup>2</sup>的，升水 120 元/吨。

（二）强麦入库时，水分≤12.5%的，足量入库；12.5%<水分≤13.5%的，以 12.5%为基准，水分每超 0.5%，扣量 1.0%；不足 0.5%的，不扣量。出库时，水分≤12.5%的，足量出库；12.5%<水分≤13.5%的，水分每超 0.5%，补量 1.0%；不足 0.5%的，不补量。

（三）当贴水的替代品交割时，1.0%<杂质≤1.5%的，以 1.0%为基准，杂质每超 0.5%，入库扣量（出库补量）1.0%；不足 0.5%的，入库不扣量（出库不补量）。

（四）当贴水的替代品交割时，8.0%<不完善粒≤12.0%的，以 8.0%为基准，不完善粒每超 1.0%，入库扣量（出库补量）1.0%。

**第十二条** 强麦接收、发运采用散粮方式；储存采用麻袋包储与散粮存储相结合的方式。

### 第三节 棉花

**第十三条** 棉花合约按序号排列，分为一号棉和交易所公告的其他序号棉花。

**第十四条** 一号棉交割单位：185 包±5 包（227±10 公斤/包），对应 8 手期货合约。

**第十五条** 一号棉交割适用国家标准。

基准交割品：符合 GB1103.1-2012《棉花第 1 部分：锯齿加工细绒棉》规定的 3128B 级，且长度整齐度为 U3 档，断裂比强度为 S3 档，轧工质量为 P2 档的国产棉花。

替代品及升贴水：符合 GB1103.1-2012《棉花第 1 部分：锯齿加工细绒棉》规定的，颜色级为 11、21、41、12、22 级，平均长度级为 27mm、29mm 及以上，长度整齐度为 U1、U2、U4 档，主体马克隆值级为 A 级、C 级 C2 档，断裂比强度为 S1、S2、S4 档，轧工质量为 P1 档、P3 档的棉花，可以替代交割。替代交割品升贴水由交易所另行制定并公告。

一个交割单位棉花按照颜色级和轧工质量比例实行分级计价。有主体颜色级的棉花，升水 100 元/吨。

无主体颜色级的棉花，以其中占比例最大的颜色级为标注颜色级。升贴水和分级计价按重新检验的结果随货款一并结算。

**第十六条** N 年产锯齿细绒白棉从 N+1 年 8 月 1 日起每日历日贴水 4 元/吨，至 N+2 年 3 月的最后一个工作日止。

**第十七条** 棉花包装及包装物应符合国家有关棉花包装规定。

#### 第四节 白糖

**第十八条** 交割单位：10 吨。

**第十九条** 白糖交割适用国家标准及本细则规定。

基准交割品：符合《中华人民共和国国家标准 白砂糖》（GB/T317—2018）（以下简称《白糖国标》）规定的一级白糖。

替代品及升贴水：

（一）符合《白糖国标》的一级和二级（色值小于等于 170IU）的进口白糖（含进口原糖加工而成的白糖）可以交割；

（二）色值小于等于 170IU，其他指标符合《白糖国标》的二级白糖，可以在本制糖年度（每年的 10 月 1 日至次年的 9 月 30 日）的 9 月和该制糖年度结束后的当年 11 月合约替代交割，贴水标准为 50 元/吨；

**第二十条** N 制糖年度生产的白糖，只能交割到 N 制糖年度结束后的当年 11 月份，且从当年 9 月合约交割起（包括 9 月合约交割）每交割月增加贴水 20 元/吨，即 9 月贴水 20 元/吨，11 月贴水 40 元/吨，贴水随货款一并结算。

**第二十一条** 白糖包装应符合《白糖国标》的规定。

进口白糖的标志、标签，除应含有产品名称、净含量、生产厂商名称、生产日期等内容外，其他内容不作要求。

白糖包装有霉变、严重污染或者出现潮包、流包、真结块、有异味的，不得入库。

## 第五节 精对苯二甲酸

**第二十二条** 交割单位：5 吨。

**第二十三条** 精对苯二甲酸（以下统称 PTA）交割质量标准适用《工业用精对苯二甲酸》（GB/T32685-2016）。

基准交割品：符合 GB/T32685-2016 质量标准的优等品 PTA。

基准交割品必须是经交易所认定的 PTA 生产厂家生产的商品。具体生产厂家由交易所公告。

交易所所有权调整交割品生产厂家。

**第二十四条** 出现破包、潮包、结块、严重污染等情况的，不得入库。

## 第六节 菜籽

**第二十五条** 交割单位：10 吨。

**第二十六条** 菜籽交割适用国家标准及本细则规定。

基准交割品：符合以下质量指标的菜籽：含油量（以 8%水分计，下同） $\geq 38.0\%$ ，水分 $\leq 9.0\%$ ，杂质 $\leq 3.0\%$ ，热损伤粒 $\leq 2.0\%$ ，生霉粒 $\leq 2.0\%$ ，色泽气味正常。菜籽指标定义、卫生指标要求及检验方法等按照《中华人民共和国国家标准 油菜籽》（GB/T 11762-2006）执行。

替代品及升贴水：

（一）含油量以 38.0%为基准，每高（低）1 个百分点，升水（贴水）70 元/吨，高不足 1 个百分点的无升水，低不足 1 个百分点的按照 1 个百分点计，高于 42.0%的按照 42.0%升水。含油量低于 35.0%的不允许交割。

（二）杂质以 3.0%为基准，每低（高）0.5 个百分点升水（贴水）30 元/吨，不足 0.5 个百分点的无升贴水，低于 2.0%的按照 2.0%升

水。采用标准仓单交割的，杂质高于 3.0%的不允许交割。采用车板方式交割的，杂质高于 4.0%的不允许交割。

（三）采用车板方式交割的，水分以 9.0%为基准，每高 0.5 个百分点贴水 30 元/吨，不足 0.5 个百分点的无贴水，水分高于 12.0%的不允许交割。采用标准仓单交割的，水分高于 9.0%的不允许交割。

**第二十七条** 菜籽交割采用塑料编织袋包装方式。编织袋的长度为 1100-1250mm，宽度为 650-750mm，缝包机缝口，单包装载菜籽质量不少于 60 公斤。编织袋要求不破、不漏，应清洁、牢固、透气、无毒害物质污染、无霉变。同一客户同一批次交割的菜籽包装要求规格统一。

## 第七节 菜油

**第二十八条** 交割单位：10 吨。

**第二十九条** 菜油交割适用国家标准及本细则规定。

基准交割品：符合《中华人民共和国国家标准 菜籽油》（GB1536-2004）四级质量指标的菜油。

替代品及升贴水：

（一）符合 GB1536-2004 规定的三级、二级、一级质量指标的菜油可以替代交割，无升贴水。

（二）“加热试验（280℃）”项目中，仅  $0.5 \leq \text{蓝色增加值} \leq 1.0$ ，其他指标符合基准交割品质量要求的菜油，可以替代交割，贴水 30 元/吨。该菜油须以菜籽原油标示。

**第三十条** 自每年 6 月 1 日（含该日）起至当年 12 月 1 日止（不含该日）入库的菜油，其酸值不得超过 2.3mg/g，过氧化值不得超过 3.5mmol/kg，色泽黄 35 红不超过 6.0。

自每年 12 月 1 日（含该日）起至次年 6 月 1 日止（不含该日）入库的菜油，其酸值不得超过 2.5mg/g，过氧化值不得超过 4.0mmol/kg，色泽黄 35 红不超过 6.5。

菜油出库时，其过氧化值不得超过 5.5mmol/kg。

## 第八节 菜粕

**第三十一条** 交割单位：10 吨。

**第三十二条** 菜粕交割标准适用国家标准及本细则规定。

基准交割品：符合《中华人民共和国国家标准 饲料用菜籽粕》（GB/T 23736-2009）（以下简称《菜粕国标》）四级质量指标、氢氧化钾蛋白质溶解度不低于 35.0%的菜粕，粗脂肪和赖氨酸指标不作要求。

替代品及升贴水：

（一）氢氧化钾蛋白质溶解度不低于 35.0%， $34.5\% \leq$ 粗蛋白质  $< 35.0\%$ ，贴水 35 元/吨； $34.0\% \leq$ 粗蛋白质  $< 34.5\%$ ，贴水 70 元/吨，其他指标符合《菜粕国标》四级质量指标，其中粗脂肪和赖氨酸指标不作要求。

（二）95 型菜粕、进口菜粕不允许交割。

**第三十三条** 菜粕包装应符合以下规定：包装物为新编织袋，编织袋要求不破、不漏。对包装物的卫生要求为无毒害物质污染，无油

污，无霉变，无严重的煤灰、石灰、铁锈、泥土、水渍等污染。出现潮包、流包、真结块、有异味，不得入库。

国产菜粕编织袋上须有取得《饲料生产企业审查合格证》货物生产企业名称、地址、联系电话、产品名称、净重（千克）标识、是否转基因等。在编织袋上缝制印有产品执行标准、质量指标、生产日期、产品保质期（生产日期起不低于6个月）的标签。

同一客户同一批次交割的菜粕包装要求规格统一。

## 第九节 早籼稻

**第三十四条** 交割单位：20吨。

**第三十五条** 早籼稻交割适用国家标准、国家相关规定及本细则规定。

基准交割品：符合《中华人民共和国国家标准 稻谷》（GB1350—2009）的三等及以上等级质量指标的早籼稻谷。

替代品及升贴水：

（一）早籼稻入库时：水分 $\leq 13.5\%$ 的，足量入库； $13.5\% < \text{水分} \leq 14.5\%$ 的，以 $13.5\%$ 为基准，水分每超 $0.1\%$ ，扣量 $0.2\%$ 。早籼稻出库时：水分 $< 13.5\%$ 的，足量出库； $13.5\% < \text{水分} \leq 14.5\%$ 的，以 $13.5\%$ 为基准，水分每超 $0.1\%$ ，补量 $0.2\%$ ，由仓库承担。（仅适用于江西、湖南、湖北等主产区）

（二） $1.0\% < \text{杂质} \leq 1.5\%$ 的，入库扣量（出库补量） $0.5\%$ ； $1.5\% < \text{杂质} \leq 2.0\%$ 的，入库扣量（出库补量） $1\%$ 。

**第三十六条** 入出库脂肪酸值及黄粒米指标规定如下：

（一）入库时，脂肪酸值 $\leq 19\text{mg}/100\text{g}$ （干基）且黄粒米 $\leq 0.5\%$ 的，升贴水为零；出库时，脂肪酸值 $\leq 22\text{mg}/100\text{g}$ （干基）且黄粒米 $< 0.7\%$ 。

（二）入库时， $19\text{mg}/100\text{g}$ （干基） $<$ 脂肪酸值 $\leq 25\text{mg}/100\text{g}$ （干基）且黄粒米 $\leq 0.7\%$ 的，可替代交割，升贴水由交易所另行公告；出库时，脂肪酸值 $\leq 28\text{mg}/100\text{g}$ （干基）且黄粒米 $\leq 1.0\%$ 。

## 第十节 晚籼稻

**第三十七条** 交割单位：20 吨。

**第三十八条** 晚籼稻（含中籼稻，下同）交割适用国家标准、国家相关规定及本细则规定。

基准交割品：符合《中华人民共和国国家标准 稻谷》（GB 1350-2009）三等及以上等级质量指标的晚籼稻，垩白粒率 $\leq 30\%$ 且粒型（长宽比） $\geq 2.8$ 。

替代品及升贴水：晚籼稻各质量指标与基准交割品差异符合以下规定的，可以通过升贴水替代交割。

（一）晚籼稻入库时：水分 $\leq 13.5\%$ 的，足量入库；水分 $> 13.5\%$ 的，以 13.5%为基准，水分每超 0.1%，扣量 0.2%。每年 10 月 1 日（含该日，下同）起至次年 3 月 31 日止入库的晚籼稻，水分不得超过 15.0%，其他时间入库的晚籼稻，水分不得超过 14.5%。晚籼稻出库时：水分 $\leq 13.5\%$ 的，足量出库；水分 $> 13.5\%$ 的，以 13.5%为基准，水分每超 0.1%，补量 0.2%，由仓库承担。（本款仅适用于江西、湖南、湖北、安徽等主产区）

(二)  $1.0\% < \text{杂质} \leq 1.5\%$ 的, 入库扣量(出库补量)  $0.5\%$ ;  $1.5\% < \text{杂质} \leq 2.0\%$ 的, 入库扣量(出库补量)  $1.0\%$ 。

(三)  $30\% < \text{垩白粒率} \leq 40\%$ 且粒型(长宽比)  $\geq 2.8$ 的, 贴水  $150$ 元/吨。

**第三十九条** 入出库脂肪酸值及黄粒米指标规定如下:

每年10月1日起至次年3月31日止入库的晚籼稻, 脂肪酸值不得高于  $19\text{mg}/100\text{g}$ (干基), 黄粒米不得高于  $0.3\%$ ; 其他时间入库的晚籼稻, 脂肪酸值不得高于  $22\text{mg}/100\text{g}$ (干基), 黄粒米不得高于  $0.5\%$ 。

每年10月1日起至次年3月31日止出库的晚籼稻, 脂肪酸值不得高于  $22\text{mg}/100\text{g}$ (干基), 黄粒米不得高于  $0.5\%$ ; 其他时间出库的晚籼稻, 脂肪酸值不得高于  $25\text{mg}/100\text{g}$ (干基), 黄粒米不得高于  $0.7\%$ 。

厂库仓单出库时, 脂肪酸值和黄粒米指标按对应期间入库规定执行。

**第四十条** 垩白粒率及粒型(长宽比)的检验按照《中华人民共和国国家标准 优质稻谷》(GB/T 17891-1999)执行。脂肪酸值的检验按照《稻谷储存品质判定规则》(GB/T 20569-2006)执行。

### 第十一节 粳稻

**第四十一条** 交割单位:  $20$ 吨。

**第四十二条** 粳稻交割适用国家标准、国家相关规定及本细则规定。

基准交割品：符合《中华人民共和国国家标准 稻谷》（GB1350-2009，以下简称《稻谷国标》）的二等粳稻谷，且垩白粒率 $\leq 30\%$ 。

替代品及升贴水：粳稻各质量指标与基准交割品差异符合以下规定的，可以通过升贴水替代交割。

（一）出糙率和整精米率指标符合《稻谷国标》一等和三等质量指标要求的，一等升水 60 元/吨，三等贴水 80 元/吨。

（二）粳稻入库时：水分 $\leq 14.5\%$ 的，足量入库； $14.5\% < \text{水分} \leq 15.0\%$ 的，以 14.5%为基准，水分每超 0.1%，扣量 0.2%。粳稻出库时：水分 $\leq 14.5\%$ 的，足量出库； $14.5\% < \text{水分} \leq 15.0\%$ 的，以 14.5%为基准，水分每超 0.1%，补量 0.2%，由仓库承担。

（三） $1.0\% < \text{杂质} \leq 1.5\%$ 的，入库扣量（出库补量）0.5%； $1.5\% < \text{杂质} \leq 2.0\%$ 的，入库扣量（出库补量）1.0%。

（四） $30\% < \text{垩白粒率} \leq 40\%$ 的，贴水 50 元/吨；垩白粒率 $> 40\%$ 的，贴水 100 元/吨。

（五） $2.0\% < \text{谷外糙米} \leq 4.0\%$ 的，升贴水为零（仅适用于黑龙江、吉林、辽宁三省）。

**第四十三条** 入出库脂肪酸值及黄粒米指标规定如下：

每年 10 月 1 日（含该日，下同）起至次年 3 月 31 日止入库的粳稻，脂肪酸值不得高于 16mg/100g（干基），黄粒米不得高于 0.1%；其他时间入库的粳稻，脂肪酸值不得高于 19mg/100g（干基），黄粒米不得高于 0.3%。

每年 10 月 1 日起至次年 3 月 31 日止出库的粳稻，脂肪酸值不得高于 19mg/100g（干基），黄粒米不得高于 0.3%；其他时间出库的粳稻，脂肪酸值不得高于 22mg/100g（干基），黄粒米不得高于 0.5%。

厂库仓单出库时，脂肪酸值和黄粒米指标按对应期间入库规定执行。

**第四十四条** 垩白粒率的检验按照《中华人民共和国国家标准 优质稻谷》（GB/T17891—1999）中的规定执行。脂肪酸值的检验按照《稻谷储存品质判定规则》（GB/T20569—2006）中的规定执行。

## 第十二节 甲醇

**第四十五条** 交割单位：10 吨。

**第四十六条** 甲醇交割适用国家标准及本细则规定。

基准交割品：符合《中华人民共和国国家标准 工业用甲醇》（GB 338-2004）规定的优等品甲醇，其中“乙醇的质量分数”指标不作要求。

## 第十三节 玻璃

**第四十七条** 交割单位：20 吨。

**第四十八条** 玻璃交割适用国家标准及本细则规定。

基准交割品：符合《中华人民共和国国家标准 平板玻璃》（GB 11614-2009）（以下简称“国标”）的 5mm 无色透明平板玻璃（不大于 2m×2.44m）一等品。

替代品及升贴水：符合国标规定的 4mm 无色透明平板玻璃（不大于 2m×2.44m）一等品，无升贴水。

## 第十四节 动力煤

**第四十九条** 交割单位：20000 吨。

以船舶接货时，单船重量溢短范围为±500 吨（含）以内。在重量溢短规定范围内，交易所依据实际重量进行结算。溢货超出规定范围的，买卖双方对超出部分协商解决并自行结算。短货超出规定范围的，卖方需及时补装至规定范围以内；无法补装的，在计算货款时，交易所对短货超出规定范围的部分双倍扣减；双方协商一致的除外。

短货超出规定范围时双倍扣减的计算公式为：单船结算重量=应交重量-500-（应交重量-500-实测重量）×2。

**第五十条** 动力煤交割检验指标检测方法适用国家相关标准。

基准交割品：收到基低位发热量为 5500 千卡/千克，干燥基全硫≤0.6%，30%≤干燥无灰基挥发分≤42%，干燥基灰分≤30%，全水≤20%的动力煤。

替代品及升贴水：收到基低位发热量≥4800 千卡/千克，干燥基全硫≤1%，30%≤干燥无灰基挥发分≤42%，干燥基灰分≤30%的动力煤。

收到基低位发热量为 5000 千卡/千克时，货款结算价（四舍五入，保留小数点后两位）=交割结算价-90；4800 千卡/千克≤收到基低位发热量<5300 千卡/千克时，货款结算价（四舍五入，保留小数点后两位）=（交割结算价-90）/5000×实测发热量；收到基低位发热量≥5300 千卡/千克时，货款结算价（四舍五入，保留小数点后两位）=交割结算价/5500×实测发热量；收到基低位发热量超过 6000 千卡/千克的，按 6000 千卡/千克计算货款。

0.6%<干燥基全硫≤1%时,以0.6%为基准,每高0.1(四舍五入,保留小数点后一位)个百分点,贴水4元/吨。

全水>20%的动力煤可以交割。全水>20%时,以20%为基准,按照超出部分(四舍五入,保留小数点后一位)扣减重量(例如,实测全水为21.32%,扣重1.3%)。

## 第十五节 硅铁

**第五十一条** 交割单位:5吨(净重)<sup>1</sup>。

**第五十二条** 硅铁交割适用国家标准及本细则规定。

基准交割品:符合《中华人民共和国国家标准 硅铁》(GB/T 2272-2009)规定牌号为FeSi75-B(硅含量≥72.0%、磷含量≤0.04%、硫含量≤0.02%、碳含量≤0.2%)、粒度为10-60mm的硅铁,其中:锰、铬含量不作要求;粒度偏差筛下物不大于5%,筛上物不大于8%。

**第五十三条** 硅铁交割品包装物采用双层、中间加固拦腰围带的塑料编织袋。包装袋上应标明产品名称、产品牌号、执行标准及生产企业名称。单包净重为1000±10公斤。

硅铁交割品按照净重结算,包装物按照2.5公斤/条标准扣除重量,包装物价格包含在硅铁合约价格中。

## 第十六节 锰硅

**第五十四条** 交割单位:5吨(净重)<sup>2</sup>。

**第五十五条** 锰硅交割适用国家标准及本细则规定。

---

<sup>1</sup>自SF1901合约开始执行。

<sup>2</sup>自SM1901合约开始执行。

基准交割品：符合《中华人民共和国国家标准 锰硅合金》（GB/T 4008—2008）规定牌号为 FeMn68Si18（锰含量 $\geq$ 65.0%、硅含量 $\geq$ 17.0%、碳含量 $\leq$ 1.8%、磷含量 $\leq$ 0.25%、硫含量 $\leq$ 0.04%）、粒度为 10–60mm 的锰硅，其中：粒度偏差筛下物不大于 5%，筛上物不大于 8%。

**第五十六条** 锰硅交割品包装物采用双层、中间加固拦腰围带的塑料编织袋。包装袋上应标明产品名称、产品牌号、执行标准及生产企业名称。单包净重为 1000 $\pm$ 10 公斤。

锰硅交割品按照净重结算，包装物按照 2 公斤/条标准扣除重量，包装物价格包含在锰硅合约价格中。

## 第十七节 棉纱

**第五十七条** 交割单位：20 吨（公定重量）。同一交割单位内的交割商品应满足同一生产厂家及同一生产批次要求。

**第五十八条** 棉纱交割适用国家标准及本细则规定。

基准交割品：符合以下质量指标的 18.5tex(32 英支)普梳棉本色筒子单纱（环锭纺）：线密度 18.5tex、棉纤维含量 100%、单纱断裂强度 $\geq$ 15.0cN/tex、单纱断裂强力变异系数 $\leq$ 9.0%、条干均匀度变异系数 $\leq$ 16.0%、-50%千米细节 $\leq$ 25 个/103m、+50%千米粗节 $\leq$ 340 个/103m、+200%千米棉结 $\leq$ 520 个/103m、十万里纱疵 $\leq$ 10 个/105m、百米重量偏差 $\pm$ 2.0%、百米重量变异系数 $\leq$ 2.2%、实际捻系数 300–420、异性纤维含量 $\leq$ 80 处/20kg。

**第五十九条** 替代品及升贴水：棉纱异性纤维含量符合以下规定的，可以通过贴水替代交割。

80 处/20kg<异性纤维含量≤100 处/20kg 的，每吨贴水交割结算价的 2%；100 处/20kg<异性纤维含量≤120 处/20kg 的，每吨贴水交割结算价的 3%；异性纤维含量>120 处/20kg 的，每增加 10 处/20kg，每吨增加贴水交割结算价的 1%，增加不足 10 处/20kg 的，按增加 10 处/20kg 计。异性纤维含量不得高于 200 处/20kg。

**第六十条** 棉纱质量指标中，棉纤维含量的定义及检验方法按照《中华人民共和国纺织行业标准 纺织纤维鉴别试验方法》（FZ/T01057-2007）执行，异性纤维含量的定义及检验方法按照《棉纱期货异性纤维检验规范》执行，棉纱其他指标定义及检验方法按照《中华人民共和国国家标准 棉本色纱线》（GB/T398-2008）执行。

《棉纱期货异性纤维检验规范》及上述标准中单纱断裂强度、单纱断裂强力变异系数、线密度、十万米纱疵、-50%千米细节、+50%千米粗节、+200%千米棉结对检验仪器和检验方法的具体要求由交易所另行公告。

**第六十一条** 棉纱交割包装执行《中华人民共和国纺织行业标准 棉及化纤纯纺、混纺本色纱线标志与包装》（FZ/T10008-2009），同一客户同一批次交割的棉纱包装规格应当统一。

棉纱交割采用纸管、塑料内膜袋和塑料编织袋的组合包装方式，由打包绳缝口捆扎，中间加固拦腰围带。筒纱按定重量成包，按公定回潮率时的净重量确定，每包净重 25kg，误差不超过±0.2%。纸管硬度以不变形为准，每批号纸管头颜色一致，不易掉色污染纱线；塑

料内膜袋及塑料编织袋要求装纱后无破损。筒纱包装要求捆扎紧牢，筒纱不外露，满足搬运及运输要求。

## 第十八节 苹果

**第六十二条** 交割单位：20 吨。

**第六十三条** 苹果交割适用国家标准、国家相关规定及本细则规定。

基准交割品：符合《中华人民共和国国家标准 鲜苹果》（GB/T 10651-2008）（以下简称《苹果国标》）一等及以上等级质量指标且果径 $\geq 80\text{mm}$  的红富士苹果，其中果径容许度 $\leq 5\%$ ，质量容许度 $\leq 10\%$ （虫伤、磨伤、碰压伤、刺伤不合格果之和占比 $\leq 8\%$ ）。

替代品及升贴水：

（一）符合《苹果国标》一等及以上等级质量指标且果径 $\geq 80\text{mm}$  的红富士苹果，其中果径容许度 $\leq 5\%$ ， $10\% < \text{质量容许度} \leq 15\%$ （虫伤、磨伤、碰压伤、刺伤不合格果之和占比 $\leq 10\%$ ），贴水 400 元/吨；

（二）符合《苹果国标》一等及以上等级质量指标且  $75\text{mm} \leq \text{果径} < 80\text{mm}$  的红富士苹果，其中果径容许度 $\leq 5\%$ ，质量容许度 $\leq 10\%$ （虫伤、磨伤、碰压伤、刺伤不合格果之和占比 $\leq 8\%$ ），贴水 1500 元/吨；

（三）符合《苹果国标》一等及以上等级质量指标且  $75\text{mm} \leq \text{果径} < 80\text{mm}$  的红富士苹果，其中果径容许度 $\leq 5\%$ ， $10\% < \text{质量容许度} \leq 15\%$ （虫伤、磨伤、碰压伤、刺伤不合格果之和占比 $\leq 10\%$ ），贴水 2000 元/吨。

**第六十四条** 入出库硬度指标规定如下：

（一）每年10月1日至次年2月20日（含该日）入库的苹果，硬度不得低于 $7\text{kgf}/\text{cm}^2$ ；其他时间入库的苹果，硬度不得低于 $6.5\text{kgf}/\text{cm}^2$ ；

（二）每年10月1日至次年2月20日（含该日）出库的苹果，硬度不得低于 $6.5\text{kgf}/\text{cm}^2$ ；其他时间出库的苹果，硬度不得低于 $6\text{kgf}/\text{cm}^2$ 。

车（船）板交货时按出库处理。

**第六十五条** 苹果交割品采用抽筐（箱）检斤方式验重，按以下公式计算货物重量：

货物重量=（抽取苹果总毛重-抽取装果容器的总重量）/抽取件数×货物件数。

同一客户同一批次交割的装果容器要求规格统一。

### **第三章 交割基准价与升贴水**

**第六十六条** 各品种交割基准价如下：

普麦期货合约的交割基准价为该期货合约的基准交割品在指定交割计价点或指定交割仓库买方的车船（汽车、轮船）板交货的含税价格（不含包装）。

强麦、一号棉、白糖各期货合约的交割基准价为该期货合约的基准交割品在基准交割仓库交货的含税价格。

PTA、甲醇期货合约的交割基准价为该期货合约的基准交割品在基准仓库出库时的汽车板交货的含税价格。

菜籽期货合约的交割基准价为该期货合约的基准交割品在基准交割计价点或基准交割仓库出库时汽车板交货的含税价格(含包装)。

菜油期货合约的交割基准价为该期货合约的基准交割品在基准仓库出库时的车船(汽车、火车、轮船)板交货的含税价格。

菜粕、硅铁、锰硅期货合约的交割基准价为该期货合约的基准交割品在基准仓库出库时汽车板交货的含税价格(含包装)。

早籼稻、晚籼稻、粳稻期货合约的交割基准价为该期货合约的基准交割品在基准仓库的散粮交货(不含包装物)含税价格。

玻璃期货合约的交割基准价为该期货合约的基准交割品在基准交割地裸包出库时的汽车板交货的含税价格。

动力煤期货合约的交割基准价为该期货合约的基准交割品在基准交割地车(船)板交货的含税价格。

棉纱期货合约的交割基准价为该期货合约的基准交割品在基准交割地出库时汽车板交货的含税价格(含包装)。

苹果期货合约的交割基准价为该期货合约的基准交割品在基准交割计价点或基准交割仓库散果出库时汽车板交货的含税价格(不含包装物)。

**第六十七条** 仓库、厂库、指定交割计价点及升贴水由交易所确定并公告。

**第六十八条** 通用标准仓单的重量溢短的计价标准由交易所每年公告一次。

适用通用标准仓单品种的替代品升贴水、仓库或厂库升贴水和重量溢短价款在仓单注册、注销时划转，相应的增值税专用发票由标准仓单注册人向标准仓单注销人开具，仓库或厂库负责监督。仓库或厂库按照增值税适用税率收取押金，增值税发票开具后押金应予退还。

## 第四章 交割流程

**第六十九条** 普麦、强麦、棉花、菜籽、动力煤、粳稻、甲醇、玻璃、白糖、硅铁、锰硅、棉纱、苹果期货合约在最后交易日之前的配对原则：

（一）自进入交割月第一个交易日起至最后交易日的前一交易日，持有交割月合约且持有标准仓单或车（船）板交割货物或厂库非标准仓单棉纱<sup>3</sup>的卖方会员可在每个交易日下午 2 时 30 分之前，通过会员服务系统按照下列情形提出交割申请。

1. 卖方提出标准仓单交割申请时，应同时提交相应的标准仓单信息；

2. 卖方提出车（船）板交割申请时，应同时提交相应的拟交割货物信息。普麦、菜籽车（船）板信息包括：品种、等级、数量、生产年度、交割计价点、货物存放地点等；动力煤车（船）板信息包括：交割数量、交割地点（具体到港口某公司）、收到基低位发热量、干燥基高位发热量、干燥基全硫、干燥基挥发分、全水分、干燥基灰分、灰熔点、煤种（如为混煤则须注明掺混煤种）、产地以及该批动力煤

---

<sup>3</sup>指由交易所指定交割厂库生产，但未经交易所注册生成标准仓单的棉纱。

的检测报告等；苹果车（船）板信息包括：品种、果径、等级、质量容许度、数量、交割计价点等。

3. 卖方提出厂库非标准仓单棉纱交割申请时，应同时提交相应的拟交割货物信息，包括：线密度、单纱断裂强度、单纱断裂强力变异系数、条干均匀度变异系数、-50%千米细节、+50%千米粗节、+200%千米棉结、十万米纱疵、百米重量偏差、百米重量变异系数、实际捻系数、异性纤维含量、公定重量（20 吨的整数倍）、生产厂库、联系方式、提货地点（限生产厂库）等；并根据交割结算价在合理范围内自报升贴水。

（二）买方会员在会员服务系统响应卖方会员的交割申请。买方会员响应的，即视为确认，买卖双方均不得撤销。未得到买方会员响应的，卖方会员可于申请当日下午 2 时 30 分之前撤销交割申请；没有撤销的，由计算机系统判为作废，苹果品种除外。

（三）当日闭市后，交易所按确认结果进行配对。

苹果品种当日闭市后，对于未得到买方会员响应的交割申请，交易所通过计算机系统，先按照“建仓时间最早的法人持仓优先”原则，确定参与配对的买方持仓，后由计算机按先车（船）板后仓单的原则予以配对（配对日）。

**第七十条** 普麦、强麦、棉花、菜籽、动力煤、粳稻、甲醇、玻璃、白糖、硅铁、锰硅、棉纱、苹果期货合约在最后交易日的配对原则：

（一）当日下午，不再进行交易。对于同一会员同一交易编码客户所持有的该交割月买卖持仓，若客户未提出不自动平仓申请，则闭市后，其相对应部分买卖持仓由计算机自动平仓，平仓价按当日结算价计算。其他未平仓合约，一律视为交割合约。

（二）当日下午 1 时 30 分之前，卖方应提出交割申请，提交车（船）板交割货物信息。卖方应主动公布用于交割的仓单信息，未主动公布的，交易所于下午 1 时 30 分公布卖方相应品种所有可流通标准仓单信息供买方挑选；买方挑选卖方标准仓单的总数量不超过卖方该合约的持仓量。卖方未提出车（船）板交割申请及未提交车（船）板交割货物信息的，交易所按标准仓单交割对待。

（三）当日下午 1 时 30 分到 2 时 30 分，买方根据卖方提交的仓单信息或车（船）板交割的货物信息，自主选择并确认。卖方提出的、但未被买方选中的车（船）板交割申请，仍然按照车（船）板交割方式进行配对。

（四）当日闭市后，交易所按确认结果进行配对；其他仍未配对的持仓，由计算机按先车（船）板后仓单，再按数量取整、最少配对数原则予以配对（即配对日）。

厂库非标准仓单棉纱不得用于最后交易日的配对交割。

**第七十一条** PTA、菜油、菜粕、早籼稻、晚籼稻期货合约配对原则：

（一）自进入交割月第一个交易日起至最后交易日的前一交易日，持有交割月合约、标准仓单的卖方会员均可在每个交易日下午 2 时 30 分之前的交易时间内，通过会员服务系统提出交割申请。

（二）买方会员在会员服务系统响应卖方会员的交割申请；未得到买方会员响应的，卖方会员可于申请当日下午 2 时 30 分之前撤销交割申请，没有撤销的，由计算机系统判为作废；买方会员响应的，即视为确认，买卖双方均不得撤销。申请当日闭市后，交易所依据买卖双方相对应的持仓量、买卖双方确认申请量和卖方持有标准仓单量，取最小数进行配对（即配对日）。

（三）对于同一会员同一交易编码客户所持有的该交割月买卖持仓，若客户未提出不自动平仓申请，则最后交易日闭市后，其相对应部分买卖持仓由计算机自动平仓，平仓价按当日结算价计算；其他未平仓合约，一律视为交割合约，由计算机按数量取整、最少配对数原则予以配对（配对日）。

（四）PTA 期货合约在最后交易日交割配对时，参与交割的 PTA 保税标准仓单优先分配给境外买方。若境外买方持仓数量合计小于或等于保税标准仓单数量，则境外买方均能分配到保税标准仓单。若境外买方持仓数量大于保税标准仓单数量，则按照“持仓时间长优先”的原则确定参与保税标准仓单交割配对的境外买方。其他未配对持仓和未分配标准仓单由计算机按数量取整、最少配对数原则予以配对（配对日）。

**第七十二条** 配对后，标准仓单交割的，卖方相应的标准仓单予以冻结，相应的交易保证金予以释放。车（船）板或厂库非标准仓单棉纱交割的，卖方交易保证金不予释放。

**第七十三条** 交割关系一经确定，买卖双方不得擅自调整或者变更。

**第七十四条** 配对日后的下一交易日（即通知日），买卖双方通过交易所会员服务系统确认《交割通知单》。会员未收到《交割通知单》或者对《交割通知单》有异议的，应在通知日下午 5 时之前以书面形式通知交易所；规定时间内没有提出异议的，视为对《交割通知单》的认可。

**第七十五条** 标准仓单交割结算流程规定如下：

（一）通知日后的下一交易日（即交割日）上午 9 时之前，买方会员应当将尚欠货款划入交易所账户，卖方会员应当持有可流通的标准仓单。交易所结算部门为买卖双方办理交割结算手续，买卖双方在《交割通知单》注明的时间通过交易所会员服务系统查收交割结算结果，同时，买方会员把客户名称和税务登记证号等事项提供给卖方会员。交割标的为 PTA 保税标准仓单的，卖方会员应将增值税普通发票交付交易所。

（二）交易所收取买方会员全额货款后，于交割日将全额货款的 80%划转给卖方会员，同时将卖方会员的仓单交付买方会员。余款在买方会员确认收到卖方会员转交的增值税专用发票时结清。交割标的为 PTA 保税标准仓单的，卖方会员应在交割日向交易所开具增值税普

通发票，交割日后 7 个交易日闭市前未向交易所提交增值税普通发票的，交易所按照本细则规定收取滞纳金或违约金。对发票的传递、余款的结算，会员均应按本细则规定办理。

（三）境外买方分配到 PTA 完税标准仓单的，交易所负责组织对该 PTA 完税标准仓单进行竞卖，竞卖产生的损益和费用由境外买方承担。若竞卖不成功，境外买方支付对应交割货款 20%的补偿金给配对卖方。

### **第七十六条 车（船）板交割结算流程规定如下：**

（一）通知日后下一交易日上午 9 时之前，买方会员应当将 100% 货款（不含交割月保证金）划入交易所账户。

（二）买卖双方自通知日后规定时间，对车（船）板交割货物的交收事宜进行协商，办理交收。车（船）板交割具体事宜见本细则“车（船）板交割”一章有关规定。

（三）配对后至最后交货日次日，交易所按双方确认情况进行结算。

1. 委托交易所结算的，全部货物交收完毕后，卖方一次性提交此次交割货物数量、质量、增值税发票流转及应划转货款等信息，买方应在当日内进行确认，若有异议，应在卖方提交信息之日起（含该日）三个交易日内提供有效证明。逾期未提交有效证明的，系统将按照卖方提交的信息自动确认。交易所按双方确认结果进行资金划转、释放买卖双方的剩余资金。增值税发票流转参照本细则“增值税专用发票（普通）发票的流转”一章有关规定执行。

2. 不委托交易所结算的，交易所退还买卖双方交易保证金和买方货款。买卖双方终止交割。

**第七十七条** 厂库非标准仓单棉纱交割结算流程规定如下：

（一）通知日后下一个交易日上午 9 时之前，买方会员应当将 100%货款（不含交割月保证金）划入交易所账户。

（二）自通知日起（含该日）三个交易日内，买卖方可就厂库棉纱交割事宜进行协商，确定结算方式、交货方式、交货时间等，签订《厂库棉纱交割协议书》。买卖双方约定的交货时间不得超过最后交货日，即交割月最后一个日历日（含该日）；交货地点为该批棉纱生产的交割厂库。买方最迟应在第三个交易日下午 1 时 30 分前，通过会员在会员服务系统中提交《厂库棉纱交货事项确认单》，《厂库棉纱交货事项确认单》内容须经买卖双方协商一致。卖方会员应在下午 3 时前进行确认。逾期买方未提交或卖方未确认的，由违约方支付对应部分合约价值（按配对时的交割结算价计算）20%的违约金给守约方，终止交割。

买卖双方在货物发运前，应到场查验货物数量及质量。买方无异议的，验收完成后买卖双方签署《厂库棉纱交割验收确认单》，作为交割货物质量判定及处理的依据。买方对货物质量有异议的，可向交易所申请检验。检验费用由买方预交。检验机构自收到交易所检验通知之日（不含该日）起 10 个工作日内，应当做出检验结果，并书面通知交易所，交易所通知买卖双方。检验结果作为解决争议的依据。检验结果与卖方提交的交割货物信息一致的，正常发运，检验及相关

费用由买方承担；检验结果与卖方提交的交割货物信息不一致的，买卖双方自收到交易所通知之日（不含该日）起3个工作日内可协商处理，协商不一致的，检验及相关费用由卖方承担，由卖方支付违约部分合约价值（按配对时的交割结算价计算）20%的违约金给买方，终止交割。

（三）在最后交货日之前交割完毕的，配对后至最后交货日次日，交易所按买卖双方在会员服务系统中的确认情况进行结算。具体流程参照本细则七十六条第三项有关规定执行。

（四）在最后交货日仍没有交割完毕的，参照本细则九十条有关规定执行。

**第七十八条** 交割结算价为期货合约配对日前10个交易日（含配对日）交易结算价的算术平均价。

## **第五章 车（船）板交割**

**第七十九条** 卖方拟开展车（船）板交割时，货物存放机构应具备以下条件：

（一）交通便利，核定载重30吨货车能够顺畅通行；

（二）计量设施完好，计量衡器应经具有国家认可资质的技术监督部门鉴定合格，且在鉴定的有效期内，计量衡器最大称重不低于60吨；

（三）装运能力强，发货速度不低于300吨/天（双方另有约定的除外）；

（四）具备开展期货交割质量检验的检化验设备，检化验设备符合国标检验规定，且运行良好。

卖方货物存放机构不具备以上条件的，卖方须承担由此产生的相应责任。

**第八十条** 自通知日（含该日）起三个交易日内，买卖双方可就车（船）板交割事宜进行协商，确定结算方式、交货地点、交货方式、交货时间等，签订《车（船）板交割协议书》。买方最迟应在第三个交易日下午 1 时 30 分前，通过会员在会员服务系统中提交《车（船）板交货事项确认单》，《车（船）板交货事项确认单》内容须符合本细则相关规定或经买卖双方协商一致，否则按照未提交处理。卖方会员应在下午 3 时前进行确认。逾期买方未提交或卖方未确认的，视同违约，按照本办法“交割违约处理”的相关规定处理。

**第八十一条** 苹果在交割计价点交割。除苹果外，其他品种买方有权选择在卖方货物所在地或交割计价点交割。买卖双方达成协议的，可以按照协议里约定的地点进行交割；未达成协议的，买方可在《车（船）板交货事项确认单》中选择交割计价点进行交割，卖方应按买方的要求交付货物。

**第八十二条** 动力煤发运前，买方有权对货物质量进行检验，买方承担与检验相关的所有费用。指定质检机构通过移动煤流采样并出具的正式质检报告显示不符合交割标准的，按卖方违约处理，双方协商一致的除外；正式质检报告显示符合交割标准的，或买方不检验的，应正常发货。

动力煤之外的其他品种，在交割计价点交割的，买卖双方应在互相确认《车（船）板交货事项确认单》后三个工作日内与交割计价点指定交割仓库或者其他交割服务机构联系，签订交割中转协议，安排交割事宜。

**第八十三条** 动力煤买方使用车辆运输时，应自通知日起（含该日）7个工作日内抵达货物所在地；买方使用船舶运输时，全部或首批船舶应自通知日起（含该日）7个工作日内抵达交割货物所在指定港口锚地；出现不可抗力导致指定港口不能接收等特殊情形时，可以顺延。买方运输工具到达指定地点后应及时书面（加盖买方单位公章的传真件）通知卖方。卖方自收到买方运输工具抵达指定交货地点通知之日起（不含该日）1个日历日内向指定港口港务公司提交作业申请。

动力煤之外的其他品种，买卖双方应自达成中转协议之日起（含该日）三日内开始交收货物。卖方须按约定的时间及发货速度把货物运达交割计价点指定交割仓库或指定地点。买方应在卖方货物到达后24小时内完成货物质量检验，并在质量验收确认后24小时内装车发运。买方在规定的时间内因自身原因不能装车发运的，卖方不再承担该批货物的质量责任。交割数量较大的，卖方可分批（苹果不低于20吨/日，普麦、菜籽不低于300吨/日，双方另有约定的除外）发货到库，买方分批检验及接运货物。

卖方承担在交割计价点交割的中转费用。在交割过程中发生临时存储的，卖方承担存储期间的仓储费用。

交割计价点指定交割仓库或者其他交割服务机构仅提供交割中转、仓储及质量检化验服务，不承担货物临时存储期间的质量变化责任。

**第八十四条** 动力煤车（船）板交割检验在装车（船）过程中进行，由买方选择、卖方委托交易所指定质检机构按照移动煤流采样法进行采样，双方协商一致的除外。质检机构在采、制样结束后，样品分为四份，由买卖双方、质检机构三方签字确认后封存。

动力煤之外的其他品种，买方在货物装车发运前，应到场查验货物质量，卖方应予以配合。普麦、菜籽买卖双方按照国家相关标准共同扦取样品，就地分为二份，任选一份现场或者到双方认可的地点共同检验；另一份双方共同签字封样，作为发生质量争议时的复检样品。

买卖双方对检验结果无异议的，该检验结果作为货物质量判定的依据。对检验结果有异议的，应协商解决。协商不一致的，动力煤买卖双方中任何一方自收到质检结果之日（不含该日）起5个工作日内向交易所书面提出复检申请，并预交复检费用，逾期未提出复检申请的，视为同意质检结果。复检申请仅限一次，复检项目限于收到基低位发热量、干燥基全硫、干燥无灰基挥发分和干燥基灰分，计算收到基低位发热量时，全水采用初检结果。复检机构由交易所指定，只对保留的样品进行复检。复检机构自收到交易所复检通知之日（不含该日）起3个工作日内，应当做出复检结果，并将复检结果书面通知交易所，交易所通知异议方。复检结果为解决争议的依据。复检费用由过错方承担。

苹果买卖双方发生质量争议时，应协商解决。协商不一致的，应当在货物未离开指定车（船）板交割场所情况下向交易所提出复检申请，并说明需要复检的质量指标，争议提出方预交相关费用（检验费和差旅费等）。交易所指定质检机构进行检验，复检机构自收到交易所复检通知之日（不含该日）起5个工作日内应当做出复检结果，复检结果为解决争议的依据。复检费用由过错方承担。其中，复检结果确定的质量容许度的等级高于（包括等于）车（船）板信息标示的等级，以车（船）板信息标示的等级为准，由此产生的复检及相关费用由争议提出方承担；复检结果确定的质量容许度的等级低于车（船）板信息标示的等级，但在交割标准允许范围内，以复检结果确定的等级为准，买方应当接受，由此产生的一切费用和责任由卖方承担。

动力煤、苹果之外的其他品种发生质量争议时，应及时通知交易所。双方把复检样品共同寄送交易所指定质检机构或者双方认可的检验机构进行复检；复检结果为货物质量判定的依据。寄送及复检费用由双方共同承担。

**第八十五条** 普麦、菜籽在卖方货物所在地交割的，买卖双方可对已经检验的交割货物采取加锁、贴封条等双方认可的方式进行封仓或封货。卖方在保管过程中需要开仓通风、倒垛等，买方须在接到卖方的通知后24小时内到达卖方货仓进行配合。卖方对于未发运完的货物负有保管责任，因保管不善造成货物受潮、霉变的，买方有权要求对未发运货物重新扦样、检验，卖方不得拒绝。

**第八十六条** 普麦、菜籽、苹果未发运货物质量达不到交割标准的，卖方应及时更换货物，无法更换货物的，买卖双方可协商处理，协商不一致的，未发运货物按照本办法“交割违约处理”的相关规定处理。最终货物质量以每次检验结果及所发货物数量的加权平均值核定。

验收完成后，买卖双方签署《质量验收确认单》。《质量验收确认单》为交割货物质量判定及升贴水处理的依据。

**第八十七条** 动力煤重量检验由交易所指定质检机构或计量机构进行，双方协商一致的除外。买方使用船舶接货时，重量计量通过水尺确认。无法水尺计重时，由指定质检机构依据实际情况选择地磅或皮带秤计重；买方使用车辆接货时，重量计量通过地磅确认。装车（船）完毕后，质检或计量机构应及时出具装车（船）重量证明书，作为交割货物重量的判定依据。

动力煤之外的其他品种，货物发运时，买方应到场验收并监装、监运，卖方应安排足够人力、设备，确保正常发货。普麦、菜籽重量检验采用发货地过地磅称重或双方认可的其他计量方式验重。苹果重量检验采用发货地抽筐（箱）检斤或双方认可的其他计量方式验重。

买卖双方有权对计量衡器的准确性进行确认。对计量衡器有异议时，应停止交接货物，并书面通知交易所，交易所组织国家计量技术监督部门现场检测计量衡器，相关费用（包括差旅费、交通费、检测费等）由过错方承担。

动力煤之外的其他品种，货物发运完毕后，根据每天双方签字确认的交接过磅码单，经核准累计后，买卖双方签署《数量验收确认单》。

《数量验收确认单》为交割货物数量的判定依据。

以散装方式交割的，买方需要包装物时，包装物由买方自理或者委托卖方代办，包装物及包装费用由买方支付。

**第八十八条** 动力煤交割时，买方运输工具未按照约定或规定的时间抵达货物所在指定港口（或锚地），或卖方未将拟交割货物按照约定或规定的时间在指定港口备妥并按照约定或规定的时间向指定港口提交装车（船）作业申请（含符合约定或规定的采样方式、计重方式等信息），造成延误的，首先协商解决。协商不成的，守约方可以向交易所提出补偿申请，并提交相应证据。交易所核实后，对过错方扣罚滞纳金补偿给守约方。延误滞纳金金额=Σ[1（元/吨）×延误天数×应发（收）而未发（收）商品数量]。

除动力煤之外的其他品种，买卖双方未按约定的发运时间、发运速度交接货物，造成延误的，首先协商解决。协商不成的，守约方可以向交易所提出补偿申请，并提交相应证据。交易所经核实后，对过错方扣罚滞纳金补偿给守约方。滞纳金金额=Σ[5（元/吨）×延误天数×应发（收）而未发（收）商品数量]。

由于不可抗力导致商品装运推迟的，可以顺延。

**第八十九条** 已经发货的动力煤，按实际检验结果计算货款，计算结果保留小数点后两位。

收到基低位发热量 $\geq 5300$  千卡/千克时，货款结算价=交割结算价/5500 $\times$ 实测发热量；超过 6000 千卡/千克时，按照 6000 千卡/千克计算。

收到基低位发热量为 5000 千卡/千克时，货款结算价=交割结算价-90

4800 千卡/千克 $\leq$ 收到基低位发热量 $< 5300$  千卡/千克时，货款结算价=（交割结算价-90）/5000 $\times$ 实测发热量。

收到基低位发热量 $< 4800$  千卡/千克，货款结算价=（交割结算价-90）/5000 $\times$ 实测发热量 $\times 50\%$ 。

收到基低位发热量检验结果低于卖方配对环节公布的收到基低位发热量，且差值超过 300 千卡/千克（不含）的，在上述货款计算公式基础上再减 5 元/吨；收到基低位发热量检验结果高于卖方配对环节公布的收到基低位发热量，且差值超过 300 千卡/千克（含）的，计算货款结算价时，收到基低位发热量按照“卖方配对环节所公布收到基低位发热量+300”计算。

干燥基全硫、干燥无灰基挥发分、干燥基灰分指标超出交割品范围的，计算货款结算价时按照收到基低位发热量、干燥基全硫、干燥无灰基挥发分、干燥基灰分的顺序依次进行。相关计算方法如下表：

指标范围	计算方法
$1\% < \text{干燥基全硫} \leq 1.5\%$	依据实测发热量和干燥基全硫为 1% 时的计算值 $\times 80\%$
$1.5\% < \text{干燥基全硫} \leq 2\%$	依据实测发热量和干燥基全硫为 1% 时的计算值 $\times 50\%$

干燥基全硫>2%	依据实测发热量和干燥基全硫为1%时的计算值×20%
干燥无灰基挥发分或干燥基灰分超出交割品范围	依据实测发热量和实测干燥基全硫的计算值×80%

**第九十条** 在最后交货日之前交割完毕的，交易所根据买卖双方在会员服务系统中的确认结果进行划转货款。在最后交货日仍没有交割完毕的，按照以下方式处理：

（一）卖方按照约定或正常速度发货但仍未完成所有商品交收的，可以延期交收，买方不得拒绝。待最终交割完毕后，按照规定流程予以划款；

（二）一方未按照约定或正常速度完成所有商品交收的，另一方可以申请终止交收。守约方通过会员服务系统提交《终止交收申请书》及相关证据，过错方在两个工作日内予以确认，逾期没有确认又没有提出异议的视同确认，交易所与卖方结清已发运部分的货款，剩余货款返还给买方。其余未交收部分双方可以协商另行交收，协商不成的，按过错方违约处理。

## 第六章 增值税专用发票（普通）发票的流转

**第九十一条** 期货交割由交割卖方向对应的买方开具增值税专用发票（普通）发票。增值税专用发票（普通）发票由双方会员协助客户直接联系、办理发票交收。双方会员负责调解、处理相关纠纷。保税交割开具发票流程按照《郑州商品交易所保税交割细则》执行。

菜粕开具增值税普通发票。

苹果开具增值税专用发票或农产品销售发票。

**第九十二条** 配对日后的一个工作日内，买方应按照税务机关的规定将开具增值税发票所需的具体信息通知卖方。标准仓单交割的，自交割日（不含该日）起 7 个交易日内，卖方应当提交增值税专用（普通）发票。延迟 1 至 10 日（公历日）的，卖方会员应当每天支付货款金额 0.5% 的滞纳金；超过 10 日（公历日）仍未提供增值税专用（普通）发票的，视为拒绝提供增值税专用（普通）发票，卖方会员应当按货款金额的规定比例支付违约金。各品种违约金比例按照国家税务部门公布的增值税税率执行。滞纳金或者违约金从货款余额中扣除，补偿给买方会员，剩余货款属于卖方会员。卖方会员先行支付滞纳金或者违约金后，有权向客户追偿。

车（船）板或厂库非标准仓单棉纱交割的，卖方应在交货完毕后 7 个交易日内或者合同约定的时间向买方交付增值税专用（普通）发票。延期交付的，参考上款规定处理。

买方会员应在收到卖方会员转交的增值税专用（普通）发票两个工作日内（含该日），对增值税专用（普通）发票进行确认。

因买方会员提供资料有误，致使发票作废的，买方会员责任自负；买方会员提供资料延迟的，卖方会员提供发票时间可以顺延。

自交割日（不含该日）起超过 7 个交易日，买方会员仍未提供有关资料的，交易所划转剩余 20% 货款至卖方会员，由此造成的后果由买方自负。

**第九十三条** 交易所可根据国家税收政策变化，对违约金比例作相应调整。

## 第七章 期货转现货

**第九十四条** 期货转现货（以下简称期转现）是指持有同一交割月份合约的多空双方之间达成现货买卖协议后，变期货部位为现货部位的交易。

期转现分为标准仓单期转现和非标准仓单期转现。标准仓单期转现根据标准仓单类型分为完税标准仓单期转现和保税标准仓单期转现（以下简称保税期转现）。《郑州商品交易所保税交割实施细则》对保税期转现具体流程有规定的，按照其规定执行。

**第九十五条** 达成期转现协议的双方共同向交易所提出申请，获得交易所批准后，分别将各自持仓按双方达成的平仓价格由交易所代为平仓（现货的买方在期货市场应当持有多头部位，现货的卖方在期货市场应当持有空头部位）。同时双方按达成的现货买卖协议进行与期货合约标的物种类相同、数量相当的现货交换。

**第九十六条** 期转现流程：

（一）期货合约自上市之日起到该合约最后交易日期间，均可进行期转现，最后交易日下午不交易的品种，交易所当日不办理相应的期转现业务；

（二）买卖双方可以通过交易所会员服务系统发布期转现意向。持有同一交割月份合约的买卖双方达成协议后，在每个交易日的下午2时30分之前向交易所提交期转现申请；

（三）交易所批准后，期转现的买卖双方持有的期货持仓，由交易所在审批日的下午闭市之后，按买卖双方达成的平仓价格平仓。买卖双方达成的平仓价格应当在审批日合约价格限制的范围内；

（四）用标准仓单进行期转现，可由交易所进行货款划转；

1. 买方提交期转现申请前应当有 20%以上的货款，货款不足的不予批准或者办理。

2. 期转现申请批准后的下一交易日，交易所为平仓成功的期转现买卖双方办理标准仓单过户手续。货款的划转参照本细则有关规定执行。

3. 增值税专用发票（普通）发票由卖方客户向买方客户按照双方商定的交货价格开具，具体办法按照本细则有关规定执行。

4. 买卖双方的相应持仓平仓后，办理标准仓单过户手续时，卖方未能如数交付标准仓单或者买方未能如数解付货款的，由交易所按照买卖双方达成的交货价格代扣违约方违约部分 20%的违约金支付给守约方。

（五）非标准仓单的期转现，货款划转方式由双方协商确定。

1. 买卖双方应当提供相关现货买卖协议。

2. 货物交收和货款划转由买卖双方自行协商确定，由此产生的纠纷自行解决，交易所不承担责任。

（六）交易所适时公布期转现的有关信息。

**第九十七条** 买卖双方各自负担标准仓单期转现中仓单转让环节的手续费。

**第九十八条** 交易所发现会员或者客户在期转现中弄虚作假的，按《郑州商品交易所违规处理办法》的有关规定予以处罚。

## 第八章 交割费用

**第九十九条** 强麦、一号棉、白糖、早籼稻、晚籼稻、粳稻运达仓库指定货位前的一切费用由卖方客户承担；从指定货位到装上车、船（汽车、火车、轮船）板的费用由买方客户承担。

仓单普麦、PTA、菜油、仓单菜籽、菜粕、甲醇、硅铁、锰硅、棉纱、仓单苹果运达仓库指定货位前的一切费用和货物装到汽车板（菜油包括火车、轮船，普麦包括轮船）的出库费用由卖方客户承担，货物出库装到汽车板（菜油包括火车、轮船，普麦包括轮船）后的一切费用（普麦不含包装）由买方客户承担。

车（船）板普麦、车板菜籽、车板苹果交割时，自指定交割计价点或双方协商的其它交割地点装至车（船）板之前的一切费用（不含包装）由卖方客户承担，之后的一切费用由买方客户承担。双方协商买方自行提货或卖方送货的，可根据距离交割计价点的远近协商各自承担的运费。

玻璃、棉纱用汽车提货的，装到汽车板前的一切费用由厂库承担，装到汽车板后的一切费用由提货方承担。玻璃用船提货的，提货方需支付短驳费和码头使用费。

车（船）板动力煤交割时，动力煤装至车（船）板（汽车、轮船）前的一切费用由卖方客户承担，之后的一切费用由买方客户承担。厂库仓单动力煤出库时，用汽车或轮船提货的，动力煤装至车（船）板

前的一切费用由厂库承担，之后的一切费用由买方客户承担；用火车提货的，动力煤装至短倒车辆车板前的一切费用由厂库承担，其余费用由提货方承担。

**第一百条** 交割商品出入库费用收取标准，每年由各仓库或厂库申报，经交易所审核批准后公告执行；当年度没有公告新标准的，沿用上年度标准。

**第一百零一条** 各品种出入库费用、交割计价点中转费用、交割手续费、仓储费及检验费等标准由交易所公告。

仓单普麦、仓单菜籽、菜油、菜粕、早籼稻、晚籼稻、粳稻、仓单苹果入库检验费用由交割仓库承担，其他品种的入库检验费由卖方货主承担。

自标准仓单注册之日起至交易所开出《提货通知单》前一日止，交易所代交割仓库或厂库收取仓储费，交易所在每月第一个交易日按月计算划转上个月发生的仓储费；交易所代收之外的费用，仓库或厂库直接向货主收取。

**第一百零二条** 普麦、强麦、早籼稻、晚籼稻、粳稻、苹果无包装物。棉花、白糖、PTA、菜籽、菜粕、硅铁、锰硅、棉纱包装物不另行计价。

玻璃买方客户有需要的，玻璃厂库应该提供包装物及包装辅助物，收费方式及标准随厂库一并公告。

**第一百零三条** 根据国家政策规定和市场变化，交易所需要调整有关费用标准时，另行公告。

## 第九章 交割违约处理

**第一百零四条** 具有下列行为之一的，构成交割违约：

（一）规定期限内，卖方未能如数交付标准仓单或未能如数交付实物的；

（二）规定期限内，买方未能如数解付货款的；

（三）车（船）板卖方交割的货物质量不符合交割质量规定的；

（四）交易所认定的其他违约行为。

**第一百零五条** 构成交割违约的，由违约方支付违约部分合约价值（按交割结算价计算）20%的违约金给守约方。买卖双方终止交割。

**第一百零六条** 计算买方交割违约合约数量时，交易所应对违约部分预扣合约价值 20%的违约金。

计算卖方交割违约合约数量的公式为：

卖方交割违约合约数量（手）=[应交标准仓单数量（张）-已交标准仓单数量（张）]×交割单位÷交易单位

计算买方交割违约合约数量的公式为：

买方接到的仓单为完税标准仓单的，买方交割违约合约数量（手）  
=（应交货款 - 已交货款）÷（1-20%）÷（交割结算价+包装物单价）  
÷交易单位

买方接到的仓单为保税标准仓单的，买方交割违约合约数量（手）  
=[保税应交货款（元）-已交货款（元）]÷ 保税交割结算价（元/吨）  
÷（1-20%）÷交易单位

**第一百零七条** 买卖双方同时违约的，交易所按终止交割处理，并对双方分别处以违约部分合约价值 5%的罚款。

**第一百零八条** 会员发生部分交割违约时，违约会员所接标准仓单或者所得货款可用于违约处理。

**第一百零九条** 按本细则规定出现终止交割情形时，交易所的担保责任了结。

## 第十章 附 则

**第一百一十条** 违反本细则规定的，交易所按《郑州商品交易所违规处理办法》有关规定处理。

**第一百一十一条** 有关夜盘交易相关的交割业务，郑州商品交易所夜盘交易细则有特殊规定的，从其规定。

**第一百一十二条** 本细则解释权属于郑州商品交易所。

**第一百一十三条** 本细则自 2018 年 11 月 9 日起施行。

# 郑州商品交易所标准仓单及中转仓单管理 办法修订案

(2018 年 10 月 23 日郑州商品交易所第六届理事会第十二次  
会议审议通过)

对《郑州商品交易所标准仓单及中转仓单管理办法》作如下修改：

一、第三条修改为：“交易所、会员、客户、境外经纪机构、交割仓库(以下简称仓库)、交割中转仓库(以下简称中转仓库)、交割厂库(以下简称厂库)及指定质检机构(以下简称质检机构)办理与标准仓单及中转仓单有关的各项业务，应当遵守本办法。”

二、第四条增加第三款：“根据期货商品完税状态的不同，标准仓单分为保税标准仓单和完税标准仓单。”

三、第九条第二款修改为“适用通用标准仓单的品种包括普麦、PTA、菜油、菜粕、早籼稻、晚籼稻。完税标准仓单与保税标准仓单之间非通用。”

四、第三十六条第二款修改为：“境内生产的 PTA 申请注册完税仓单的，入库时应当向仓库提交本批 PTA 生产厂家出具的符合交割标准的《产品质量证明书》。《产品质量证明书》须载有生产厂家、生产日期、适用的质量标准和该批产品的质量检验结果等信息。”

第三十六条第三款修改为：“境外生产的 PTA 申请注册完税仓单的，入库时应当向仓库提交本批商品的船运证明、《中华人民共和国

海关进口货物报关单》，《海关进口关税专用缴款书》、《海关代征增值税专用缴款书》，生产厂家出具的《产品质量证明书》、《产地证明书》等材料的复印件，并加盖申请入库单位公章。商品所有人应当对所提供的单证签署《进口 PTA 单证合法、真实、有效保证书》。”

增加第三十六条第四款：“申请注册 PTA 保税标准仓单的，入库时应当向仓库提交本批商品的生产厂家出具的《产品质量证明书》、《产地证明书》及海关要求的其他单证等材料的复印件，并加盖申请入库单位公章。”

五、第九十九条修改为：“标准仓单交割按《郑州商品交易所期货交割细则》和《郑州商品交易所保税交割实施细则》的有关规定办理。”

六、增加第一百零一条第（六）项：“PTA 保税标准仓单的转让按照《郑州商品交易所保税交割实施细则》等相关规定执行。”

七、增加第一百零二条第四款：“保税标准仓单的注销，按照本办法与《郑州商品交易所保税交割实施细则》相关规定执行。”

作上述修订后，原章节及条款顺序未有调整。

# 郑州商品交易所标准仓单及中转仓单管理

## 办法

(2008年1月7日第五届理事会通讯会议修改,2008年1月15日发布,自发布之日起施行;2009年3月28日第五届理事会通讯会议审议通过,2009年4月15日发布,自2009年4月20日施行;2011年10月17日第五届理事会第七次通讯会议修改,2011年10月24日发布,自2011年10月28日施行;2012年8月14日第五届理事会第七次通讯会议修改,2012年9月3日发布,自发布之日起施行;2012年7月12日第五届理事会第六次通讯会议修改,2012年11月28日发布,自2012年12月3日施行;2012年11月22日第五届理事会第十次通讯会议修改,2012年12月24日发布,修改部分自一号棉花1311合约起施行;2012年12月17日第五届理事会第八次通讯会议修改,2012年12月25日发布,自2012年12月28日施行;2013年9月5日第五届理事会第九次通讯会议修改,2013年9月16日发布,自2013年9月26日施行;2013年10月28日第五届理事会第十一次通讯会议修改,2013年11月11日发布,自2013年11月18日施行;2014年6月16日第五届理事会第八次通讯会议修改,2014年7月4日发布,自2014年7月8日施行;2014年7月4日第五届理事会第十一次通讯会议修改,2014年8月1日发布,自2014年8月8日施行;2014年12月3日第五届理事会第十六次通讯会议修改,2014年12月3日发布,修改部分自一号棉花1601合约起施行;2014年11月27日第五届理事会第十五次通讯会议修改,2014年12月3日发布,修改部分自强麦1601合约、普麦1601合约起施行;2014年11月28日第五届理事会第十四次通讯会议修改,2014年12月4日发布,修改部分自早籼稻1601合约、粳稻1601合约施行;2015年12月18日第五届理事会第十三次通讯会议修改,2016年1月4日发布,修改部分自动力煤1701合约起施行;2016年1月12日第五届理事会第三次通讯会议修改,2016年1月15日发布,自精对苯二甲酸1701合约起施行;2016年6月23日第五届理事会第九次通讯会议修改,2016年7月27日发布,修改部分自2017年10月1日注册的标准仓单起施行;2017年7月31日第六届理事会第三次会议修改,2017年8月8日发布,修改部分自2018年8月第10个交易日、2018年11月第16个交易日起施行;2017年7月31日第六届理事会第三次会议修改,2017年8月14日发布,自2017年8月18日施行;2017年10月20日第六届理事会第五次会议修改,2017年10月31日发布,自2017年11月1日施行;2017年12月7日第六届理事会第六次会议修改,2017年12月19日发布,自2017年12月22日施行;2018年10月16日第六届理事会第十一次会议修改,2018年10月17日发布,修改部分自苹果1910合约起施行;2018年10月23日第六届理事会第十二次会议修订,2018年11月9日发布,修改部分自2018年11月9日起施行)

## 第一章 总则

**第一条** 为保障郑州商品交易所（以下简称交易所）商品期货交割业务的正常进行，规范标准仓单及中转仓单的管理，根据《郑州商品交易所交易规则》，制定本办法。

**第二条** 标准仓单及中转仓单的注册、流通和注销等业务，按本办法执行。

**第三条** 交易所、会员、客户、境外经纪机构、交割仓库（以下简称仓库）、交割中转仓库（以下简称中转仓库）、交割厂库（以下简称厂库）及指定质检机构（以下简称质检机构）办理与标准仓单及中转仓单有关的各项业务，应当遵守本办法。

## 第二章 标准仓单及中转仓单

**第四条** 标准仓单是指仓库或厂库按照交易所规定的程序提交仓单注册申请后，经交易所注册，可用于证明货主拥有实物或者可予提货的财产凭证。

根据申请注册的主体不同，标准仓单分为仓库标准仓单（以下简称仓库仓单）和厂库标准仓单（以下简称厂库仓单）两种。

根据期货商品完税状态的不同，标准仓单分为保税标准仓单和完税标准仓单。

**第五条** 中转仓单是指中转仓库按照交易所规定的程序提交仓单注册申请后，经交易所注册，用于证明货主拥有实物或者可予提货的财产凭证。

中转仓单所对应的货物从中转仓库运至仓库后，经验收合格可转为标准仓单。

**第六条** 交易所通过计算机系统办理标准仓单及中转仓单的注册、交割、转让、充抵保证金和注销等业务。

会员或客户使用标准仓单及中转仓单向商业银行等第三方提供担保的，须向交易所办理标准仓单及中转仓单质权登记手续。未经交易所办理质权登记的，不得约束其他会员或客户等第三人。

会员或客户在开通质权登记及质权行使通道的商业银行将标准仓单及中转仓单质押后，经交易所批准，可在该银行的质权登记及质权行使通道下，建立不超过质押标准仓单及中转仓单数量的空头头寸。该头寸只能进行实物交割，不得平仓，但因交易所监管需要专项批准的除外。

在交易所开通标准仓单及中转仓单质权登记及质权行使通道的商业银行，出现会员或客户到期未归还仓单质押贷款时，可通过转让仓单或建立对应期货空头头寸以交割等方式处置质押仓单；增值税专用发票的流转按照《郑州商品交易所期货交割细则》相关规定处理。

**第七条** 仓库标准仓单及中转仓单的生成包括交割预报、入库验收、质量检验、仓库申请注册及交易所办理注册等环节。

厂库标准仓单的生成包括厂库申请注册及交易所办理注册等环节。

经交易所注册的标准仓单及中转仓单，方可适用于与期货相关的业务。

**第八条** 标准仓单根据流通性质不同，分为通用标准仓单和非通用标准仓单两种。

仓库或厂库向标准仓单持有人承担质量及数量责任。标准仓单流通转让的，其载明货物的权利及风险相应转移。

**第九条** 通用标准仓单是指标准仓单持有人按照交易所的规定和程序可以到仓单载明品种所在的任一仓库或厂库选择提货的财产凭证。

适用通用标准仓单的品种包括普麦、PTA、菜油、菜粕、早籼稻、晚籼稻。完税标准仓单与保税标准仓单之间非通用。

通用标准仓单载明的内容包括：会员号、会员名称、客户交易编码、品种、标准仓单数量、冻结数量、充抵数量等。

**第十条** 非通用标准仓单是指标准仓单持有人按照交易所的规定和程序只能到仓单载明品种所在的仓库或厂库提取所对应货物的财产凭证。

适用非通用标准仓单的品种为强麦、棉花、菜籽、动力煤、粳稻、甲醇、玻璃、白糖、硅铁、锰硅、棉纱、苹果。

非通用标准仓单载明的内容包括：会员号、会员名称、客户交易编码、品种、标准仓单数量、仓库或厂库、检验时间、标准仓单编号、冻结数量、充抵数量等。

### **第三章 仓库仓单及中转仓单的交割预报**

**第十一条** 客户或者非期货公司会员向仓库发货前，应当由会员填写《交割预报单》，并以书面形式或者交易所认可的其他形式向仓库预报。

预报数量较大的，交易所可以要求货主提供拥有商品的相关证明。特殊情况下，交易所可以要求仓库优先批准有近期月份持仓的交割预报。

**第十二条** 自接到会员《交割预报单》之日起 2 个工作日内，仓库应当以书面形式或者交易所认可的其他形式回复会员能够接收的商品数量。自接到仓库同意入库的回复之日起 2 个工作日之内，会员应当向仓库缴纳 30 元/吨的交割预报定金。仓库在收到交割预报定金的当日（工作日），开具《入库通知单》。

对已存放在仓库的商品申请期货交割的，仍应提交交割预报，无须交付交割预报定金。

《入库通知单》自开具之日起生效。

**第十三条** 《入库通知单》有效期（公历日）分别为：

（一）仓单普通小麦（以下简称仓单普麦）、优质强筋小麦（以下简称强麦）、菜籽、菜油、菜粕、早籼稻、晚籼稻、粳稻、甲醇、硅铁、锰硅、棉纱为 40 天。

（二）一号棉仓库为 40 天、中转仓库为 15 天。

（三）白糖每年 11 月 1 日至次年 4 月 30 日，广东、广西及云南三省（区）等交易所认可的白糖主产区仓库为 15 天（公历日）；其他时间和其他地区仓库为 40 天。

（四）精对苯二甲酸（以下统称 PTA）、苹果为 15 天。

交易所可视情况，调整《入库通知单》的有效期。

**第十四条** 《入库通知单》有效期内相对应数量的商品全部到库的，自商品入库完毕之日起 2 个工作日内，交割预报定金予以返还；部分到库的，按实际到货量返还；未到库部分，交割预报定金不予返还。

**第十五条** 交易所公告暂停仓库入库业务的，自公告之日（含该日）下午闭市起，该仓库发生的交割预报视为无效预报，交易所不再受理相关商品的仓库仓单注册申请。

**第十六条** 货主应当按交易所有关规定向仓库交纳各项费用。

**第十七条** 办理完交割预报的货主发货前，须将运输方式、车（船）号、数量、到货时间等通知仓库。

#### **第四章 仓库仓单及中转仓单的商品入库**

**第十八条** 交割商品入库时，商品的重量、包装相关单证等的验收及扦（采）样由仓库或指定检验机构按照本办法的规定实施，货主应到场监督，验收结果须经仓库和货主认可。仓库、货主应对验收结果签章确认，并共同对入库商品的真实性负责。入库商品未经仓库、货主签章确认的，不得用于期货交割。

棉花样品的扦取由承检机构实施，仓库应当予以协助配合。仓库及货主有权对样品扦取进行监督。

**第十九条** 入库商品质量指标由质检机构检验的，自接到检验结果之日起 1 个工作日内，仓库应当对检验结果进行确认并通知客户。

**第二十条** 交易所认可的免检商品和适用非通用标准仓单的商品入库后，仓库应当对货主的名称、联系人及联系方式、商品数量、生产厂家、存放库房及垛位等事项登记造册，并由货主签字确认。

**第二十一条** 入库商品质量检验结束后，检验单位将检验报告以数字认证方式上传至交易所仓单注册注销系统。由质检机构检验的，质检机构应当及时将检验报告寄送仓库或由仓库领取。货主或者仓库业务急需的，质检机构可先行告知检验结果。

### **第一节 小麦入库**

**第二十二条** 仓单普麦、强麦重量验收应当在库内整车过地磅。强麦不同品种须分开储存，不得混存。

**第二十三条** 强麦入库质量检验由交易所组织实施。强麦降落数值、稳定时间、拉伸面积和湿面筋指标由质检机构检验；其他质量指标由交割仓库或质检机构检验。

仓单普麦入库质量检验由交割仓库组织实施，入库检验样品由交割仓库在卸车前抽取，检验结果不符合交割质量标准的不允许注册。入库过程中发现不符合交割质量标准的部分不允许注册。

需由质检机构检验的强麦质量指标，样品由交割仓库扦取，交易所、客户到场监督。客户未到场监督的，视为对扦样无异议。样品扦取后由交易所进行封样，并寄（送）质检机构。

质检机构作出的检验结论为强麦入库质量检验的最终结果，不予复检。

强麦样品的检验时间由交易所公告。

## 第二节 棉花入库

**第二十四条** 自新年度（每年 9 月 1 日）起，交易所开始接受新年度一号棉的报验申请。

**第二十五条** 棉花入库时，仓库按《入库通知单》、原验证书和码单接收棉花。

**第二十六条** 棉花重量和质量检验实行公证检验制度。按照棉花国家标准和《期货交割棉公证检验实施办法（暂行）》执行。

**第二十七条** 入库棉花为符合《中华人民共和国国家标准 棉花包装》（GB6975-2007）规定的 I 型号棉包（ $227 \pm 10$  公斤），且须附有检验证书及原码单。

**第二十八条** 一号棉入库过程中和仓单注册前发现有下列情况之一的，交割仓库应当拒绝转存为期货交割商品，并及时通知会员或者货主：

- （一）掺杂使假的；
- （二）不符合 GB1103.1-2012 组批规则的；
- （三）棉包出现严重污染、水渍，发现火烧、霉变等，或者有异味的以及包装不完整的；
- （四）未经检验，棉包标志不符合国家标准规定的；
- （五）崩包率大于 5%的；
- （六）非本棉花年度生产的；
- （七）单包回潮率大于 10%的；采用塑料套包法包装的，一批棉花中单包回潮率超过 9%，或者按批计算的平均回潮率超过 8.5%的；

（八）经检验发现颜色级有 51、32、13、23、33、14、24，长度有小于 27 毫米，长度整齐度有 U5 档，马克隆值有 C 级 C1 档，断裂比强度有 S5 档的棉花；

（九）其他不符合交割规定的。

**第二十九条** 中转仓单持有人负责中转仓单转为标准仓单的货物运输，并承担运输过程中货物损毁、灭失的责任。

**第三十条** 中转仓单对应的货物从中转仓库运至仓库转为标准仓单前出现下列情况之一的，仓库不得将其转存为期货交割商品，并及时通知会员或者客户：

（一）棉包存在严重污染、水渍，发现火烧、霉变，有异味或者包装不完整等情况的；

（二）崩包率大于 5%的；

（三）棉花质量指标不符合仓单注销出库规定的；

（四）因自然变异而导致棉花颜色级指标达到或超出仓单注销出库规定 80%的；

（五）中转仓单从中转仓库出库之日起，到运至仓库之日止，汽车运输超过 10 天或者铁路运输超过 25 天的；出现不可抗力情况的除外。

### 第三节 白糖入库

**第三十一条** 白糖包装应当符合《郑州商品交易所期货交割细则》规定。

**第三十二条** 白糖入库的，应当按以下要求提供单证：

(一)国产白糖:《全国工业产品生产许可证》、《产品合格证》、生产厂家营业执照(复印件)等;

(二)进口白糖:允许该批白糖在中国境内销售(贸易方式为“一般贸易”)的《中华人民共和国海关进口货物报关单》(复印件);该批商品报关口岸当地的中华人民共和国出入境检验检疫局对该批商品出具的《卫生证书》;生产厂商或者该批商品出口商出具的《产品质量证明书》、《产地证明书》,并签署《进口白砂糖单证合法、真实、有效保证书》。

**第三十三条 重量验收:**可采用过地磅同时抽包检斤方式,或者单独抽包检斤方式。

**第三十四条 质量检验:**一个垛位扦取一个样品,样品一式两份,封样后寄(送)质检机构。货主也可委托经国家质量技术监督部门认证的第三方扦样,仓库配合并监督扦样,由此产生的费用(不包括仓库配合扦样费)由货主承担。

**第三十五条** 自收到每批白糖样品起 5 个工作日内,质检机构应当出具检验结果并通知仓库。

#### 第四节 PTA 入库

**第三十六条** 生产日期超过 90 天的境内生产的 PTA 和自境外发运之日起超过 60 天的进口 PTA,仓库不得接收入库。

境内生产的 PTA 申请注册完税仓单的,入库时应当向仓库提交本批 PTA 生产厂家出具的符合交割标准的《产品质量证明书》。《产品

质量证明书》须载有生产厂家、生产日期、适用的质量标准和该批产品的质量检验结果等信息。

境外生产的 PTA 申请注册完税仓单的，入库时应当向仓库提交本批商品的船运证明、《中华人民共和国海关进口货物报关单》，《海关进口关税专用缴款书》、《海关代征增值税专用缴款书》，生产厂家出具的《产品质量证明书》、《产地证明书》等材料的复印件，并加盖申请入库单位公章。商品所有人应当对所提供的单证签署《进口 PTA 单证合法、真实、有效保证书》。

申请注册 PTA 保税标准仓单的，入库时应当向仓库提交本批商品的生产厂家出具的《产品质量证明书》、《产地证明书》及海关要求的其他单证等材料的复印件，并加盖申请入库单位公章。

不同生产厂家生产的 PTA 应当分开预报。

**第三十七条 重量验收：**PTA 单包净重为 1 吨或者 1.1 吨以及交易所公告的相关规格。重量验收可采用过地磅同时抽包检斤或单独抽包检斤的方式进行。

**第三十八条** PTA 质量检验按每 550 吨一个样品抽取；不足 550 吨的按 550 吨计。样品一式三份，双方封样后寄（送）质检机构两份。自收到每批样品之日起 5 个工作日内，质检机构应当出具检验结果并通知仓库。

免检交割品牌生产厂家直接申请入库的，入库 PTA 质量可以免检；货主向交易所和仓库提交指定生产厂家出具符合交易所要求的产品质量责任承诺书及相关材料的，入库 PTA 质量可以免检。

## 第五节 菜籽入库

**第三十九条** 菜籽重量验收采取在仓库内整车过地磅方式进行。

**第四十条** 入库质量检验由仓库负责。

仓库可全部或部分委托质检机构进行检验，检验费用由仓库承担。

**第四十一条** 入库菜籽采用仓房内堆放方式储存。不同客户入库的菜籽不允许混存。

**第四十二条** 入库检验样品由仓库在卸货前抽取，检验结果不符合交割质量标准的不允许注册。

每次抽取样品就库分为二份，每份 1 公斤。仓库任选一份用于检验；另一份由货主和仓库签字封样，由仓库妥善保存。

**第四十三条** 货物入库时，达不到交割质量标准的商品，经双方协商，仓库可提供整理等服务。

**第四十四条** 自每批货物样品抽取结束时起，仓库应于 24 小时内做出检验结果，并及时通知货主。

## **第六节 菜油入库**

**第四十五条** 菜油运输必须符合国家卫生标准规定。

**第四十六条** 入库菜油应当提供加盖生产厂家公章的《产品生产许可证》（复印件）和《食品卫生许可证》（复印件）以及随货同行的产品化验单。

产品化验单中须载明产品名称、产地（包括原产国）、压榨或者浸出、产品执行标准、等级、是否转基因产品及编号等。

**第四十七条** 采用汽车运输的，菜油重量验收以地磅计量为准；采用火车运输的以火车罐打尺或者储油罐打尺计量为准；采用船舶运输的，以过磅或者储油罐打尺计量为准。

经交易所批准，菜油重量验收可以使用质量技术监督部门认可的其他先进衡器计量。

**第四十八条** 菜油运达仓库时，质量检验样品由仓库在卸货前扦取。每次扦取的样品分为两份，每份不低于 1 公斤。仓库任选一份用于检验，另一份由货主和仓库签字封样，由仓库妥善保管。

入库菜油的质量检验和掺伪检验由仓库负责。仓库可全部或者部分委托经国家质量技术监督部门认证的质检机构进行检验，检验费用由仓库承担。

自每批商品样品扦取结束时起，仓库应当于 48 小时内提供检验结果，并及时通知货主。

**第四十九条** 对检验合格的菜油，仓库应当按商品到库先后安排储油罐，并于检验报告出具之日起 5 个工作日内入库完毕。

转基因菜油应当与非转基因菜油分罐储存。入库客户未在交割预报单中注明菜油是否转基因产品，导致转基因菜油和非转基因菜油混罐储存的，由此引起的法律责任由该客户承担。责任主体以入库时仓库保留的样品确定。

菜油储油罐必须符合国家卫生标准规定。

**第五十条** 货主应当保证入库菜油符合国家卫生标准。混罐储存的菜油不符合国家卫生标准的，根据入库时仓库保留的样品确定责任主体。

**第五十一条** 入库过程中和标准仓单注册前发现有下列情况之一的，仓库应当拒绝转存为期货交割商品，并及时通知会员或者货主：

- （一）掺伪的菜油；
- （二）菜油运输工具不符合国家规定；
- （三）入库菜油不符合交易所其他交割规定的。

### **第七节 菜粕入库**

**第五十二条** 菜粕重量验收采取在仓库内整车过地磅方式进行。

**第五十三条** 入库质量检验由仓库负责。检验结果不符合交割质量标准的不允许注册。入库过程中发现不符合交割质量标准的部分不允许注册。

**第五十四条** 检验原则上以垛为单位进行抽样，对同一厂家生产的同一批次的商品，以不超过 200 吨为单位进行抽样。

每次抽取样品就库分为二份，每份 1 公斤。仓库任选一份用于检验；另一份由货主和仓库签字封样，由仓库妥善保管。

**第五十五条** 自每批货物样品抽取结束时起，仓库应于 24 小时内做出检验结果，并及时通知货主。

### **第八节 早籼稻、晚籼稻、粳稻入库**

**第五十六条** 货物重量验收采取在仓库内整车过地磅方式进行。

**第五十七条** 入库质量检验由仓库负责。

仓库可全部或部分委托质检机构进行检验，检验费用由仓库承担。

**第五十八条** 卫生检验按国家有关标准和规定执行，检验费用由货主承担。

**第五十九条** 入库检验样品由仓库在卸货前抽取，检验结果不符合交割质量标准的不允许注册。

**第六十条** 货物入库时，达不到交割质量标准的商品，经双方协商，仓库可提供整理等服务。

**第六十一条** 自每批货物样品抽取结束时起，仓库应于 24 小时内做出质量检验结果，并及时通知货主。

### **第九节 甲醇入库**

**第六十二条** 甲醇运输必须符合国家关于危险化学品运输的规定。

**第六十三条** 入库货物单证及货主危险化学品经营资质由仓库负责审验。

境内生产的甲醇申请入库的，应当向仓库提交本批甲醇生产厂家出具的符合交割标准的《产品质量证明书》。《产品质量证明书》须载有生产厂家、生产日期、适用的质量标准和该批产品的质量检验结果等信息。

境外生产的甲醇申请入库的，应当向仓库提交本批商品的船运证明、进口货物报关单、生产厂家出具的《产品质量证明书》等材料的复印件、海关放行单原件。商品所有人应当对所提供的单证签署《进口甲醇单证合法、真实、有效保证书》。

**第六十四条 重量验收：**采用汽车运输的，以地磅计量为准，由仓库负责验重；采用火车、船舶运输的，以仓库储罐打尺计量为准。货主可以委托质检机构或者仓库验重，由质检机构验重时，仓库应予以配合，由此产生的费用由货主承担。

经交易所批准，甲醇重量验收可以使用国家质量技术监督部门认可的其他先进衡器计量。

**第六十五条 质量验收：**入库甲醇的采样、质检由质检机构负责，仓库应予协助，由此产生的费用（不含仓库配合费用）由货主承担。

已经入库的甲醇，货主能够提供质检机构出具的该货物符合期货交割标准的检验报告，经仓库认可，可以申请注册仓单。

对期货、现货混罐存储的甲醇，仓库必须确保整罐货物符合期货交割标准的规定，不符合规定的，不允许混罐存储或申请注册仓单。

**第六十六条** 自完成采样之日起 3 个工作日内，质检机构应当出具检验结果，并及时通知仓库。

## 第十节 硅铁入库

**第六十七条** 硅铁入库时，货主应当向仓库提交本批硅铁生产厂家出具的《质量证明书》。《质量证明书》须载有生产厂家、生产（出厂）日期、适用的质量标准和该批产品的质量检验结果等信息。

硅铁入库时，包装物应干燥、结实耐用、适宜储存。

硅铁生产（出厂）日期超过 90 天的不允许入库。

硅铁有粉化现象的不允许入库。

**第六十八条** 重量验收采用过地磅方式进行。

**第六十九条** 质量验收：入库硅铁的采样、制样、质检以及粒度检测由质检机构负责，按有关国家标准执行，仓库应予协助，质检机构检验费用及相关仓库配合检验费用由货主承担。

**第七十条** 自完成采样之日起 7 个工作日内，质检机构应当出具检验结果，并及时通知仓库。

**第七十一条** 硅铁包装因取样损坏的，仓库应按相应国家标准重新灌包，所需包装物由客户提供，灌包费用由客户承担。

### 第十一节 锰硅入库

**第七十二条** 锰硅入库时，货主应当向仓库提交本批锰硅生产厂家出具的《质量证明书》。《质量证明书》须载有生产厂家、生产（出厂）日期、适用的质量标准和该批产品的质量检验结果等信息。

锰硅入库时，包装物应结实耐用，适宜存储。

生产（出厂）日期超过 90 天的锰硅不允许入库。

**第七十三条** 重量验收采用过地磅方式进行。

**第七十四条** 质量验收：入库锰硅的采样、制样、质检以及粒度检测由质检机构负责，按有关国家标准执行，仓库应予协助，质检机构检验费用及相关仓库配合检验费用由货主承担。

**第七十五条** 自完成采样之日起 7 个工作日内，质检机构应当出具检验结果，并及时通知仓库。

**第七十六条** 锰硅包装因取样损坏的，仓库应按相应国家标准重新灌包，所需包装物由客户提供，灌包费用由客户承担。

### 第十二节 棉纱入库

**第七十七条** 境内生产的棉纱入库时，货主应当向仓库提交本批棉纱生产厂家出具的厂检证书。厂检证书须载有生产厂家名称、生产日期、品名规格、净重、适用的质量标准和该批产品的质量检验结果等信息。

**第七十八条** 境外生产的棉纱入库时，应按要求提供以下单证：该批棉纱的《中华人民共和国海关进口货物报关单》；生产厂家或者该批商品出口商开具的《产品质量证明书》、《产地证明书》；商品所有人应当对所提供的单证签署《进口棉纱单证合法、真实、有效保证书》。

**第七十九条** 数量验收：由仓库验收棉纱数量。

**第八十条** 质量检验：入库棉纱的采样、制样、质检由质检机构负责，按国家有关标准执行，仓库应予协助，检验费用由货主承担。

**第八十一条** 自完成采样之日起 10 个工作日内，质检机构应当出具检验结果并通知仓库。

**第八十二条** 棉纱入库过程中和仓单注册前发现有下列情况之一的，交割仓库应当拒绝转存为期货交割商品，并及时通知会员或者货主：

- （一）同一交割单位的生产厂家、生产批次不一致的；
- （二）单包实际回潮率大于 9%的；
- （三）生产日期超过 3 个月的；
- （四）包装不符合交割规定或出现严重污染、水渍，发现火烧、霉变等情况的。

### 第十三节 苹果入库

**第八十三条** 苹果入库时的装果容器采用塑料筐或木（铁）筐的形式。

**第八十四条** 重量验收：采用抽筐检斤方式。

**第八十五条** 质量验收：质量检验由仓库负责。仓库可全部或部分委托质检机构进行检验，检验费用由仓库承担。

检验结果符合以下情况之一的，可以申请注册仓单：

（一）入库苹果符合交割质量标准；

（二）入库苹果未经充分整理，但其中符合交割质量标准的苹果比例不低于交易所公布的折算比例时，货主可按照以下计算方式提供入库货物申请注册仓单， $\text{入库货物数量} = \text{仓单数量} \times \text{交割单位} / \text{交易所规定的折算比例}$ ，仓单数量须为整数。折算比例由交易所另行公布。以折算方式注册的苹果仓单，仅可选择质量容许度 $\leq 10\%$ 的等级进行注册。

采用不同方式注册的仓单货物应当分开存放。

以折算方式注册的苹果仓单，在对应仓单注销前，仓单注册人不得对超出仓单数量的货物进行处置。其中，超出仓单数量的货物按照现货收取仓储费，由仓库与货主自行结算。

**第八十六条** 自每批货物样品抽取结束时起，仓库应于 24 小时内做出检验结果，并及时通知货主。

## 第五章 标准仓单及中转仓单注册

### 第一节 仓库仓单注册

**第八十七条** 自出具或者接到质检机构的检验结果之日起 1 个工作日内，仓库或中转仓库对检验结果进行确认并通知货主。对于质量符合交割规定的货物，货主无异议的，自通知货主之日起 2 个工作日内，仓库或中转仓库应当向交易所申请注册仓库仓单或中转仓单。

中转仓单对应的货物从中转仓库运至仓库，经验收合格后 2 个工作日内，仓库应当向交易所申请将中转仓单转为标准仓单。

每年的 8 月 1 日之前不得申报注册二级白糖仓单。

**第八十八条** 交易所可在自仓库提出仓单注册申请之日起 7 个工作日内予以注册。

**第八十九条** 自交割月最后交易日（强麦、白糖、菜油为第 5 个交易日）下午 3 时起，交易所不再受理仓库提出的用于当月交割的仓库仓单注册申请。该日下午 3 时以后的注册申请所形成的标准仓单可以参与后续月份交割。

交易所规定的可予质量免检的商品用于期货交割的，最迟应当在合约最后交易日前一日申请注册。

**第九十条** 3 月、7 月、11 月第 12 个交易日之后（含该日）注册的菜粕标准仓单，货物生产日期须分别为 3 月 1 日、7 月 1 日、11 月 1 日之后（含该日）。注销后，符合规定的菜粕可以重新注册。

## 第二节 厂库仓单注册

**第九十一条** 非期货公司会员或客户与厂库结清货款等费用后，厂库通过交易所仓单注册注销系统提交仓单注册申请。动力煤厂库仓

单注册时，厂家应提交收到基低位发热量等货物信息，交易所以此信息作为仓单注册标准的依据和货款计算的参考。

**第九十二条** 厂库申请仓单注册时，必须提供交易所认可的银行履约保函、现金或交易所认可的其他支付保证方式。

厂库提交的保证金数额按照最近交割月合约前一交易日结算价计算。

**第九十三条** 厂库最迟应当在合约交割月最后交易日前三个交易日下午 3 时前提交仓单注册申请。厂库提交的支付保证方式符合规定的，交易所可在自厂库提出仓单注册申请之日起 3 个工作日予以注册。

**第九十四条** 单个厂库允许注册仓单的最大数量，由交易所确定和调整。

**第九十五条** 当商品市值发生较大波动时，交易所可根据市场变化情况要求厂库调整银行履约保函、现金或交易所认可的其他支付保证方式的数额。

## **第六章 标准仓单及中转仓单的有效期**

**第九十六条** 各品种标准仓单、中转仓单有效期分别如下：

仓单普麦、强麦：每年 9 月的最后一个工作日。

一号棉：N 年生产的棉花注册的标准仓单、中转仓单，有效期至 N+2 年 3 月的最后一个工作日。

白糖：N 制糖年度（每年的 10 月 1 日至次年的 9 月 30 日）生产的白糖所注册的标准仓单有效期为该制糖年度结束后当年 11 月份的最后一个工作日（含该日）。

菜籽：N年6月1日起接受菜籽标准仓单注册，仓单有效期至N年11月份最后一个工作日（含该日）。

菜粕：每年3月、7月、11月第12个交易日（不含该日）之前注册的标准仓单，应在当月的第15个交易日（含该日）之前全部注销。

菜油：N年6月1日起注册的菜油标准仓单有效期至N+1年5月份最后一个工作日（含该日）。

PTA：每年9月第12个交易日（不含该日）之前注册的PTA标准仓单，在该月第15个交易日（含该日）之前全部注销；该月第16个交易日（含该日）之后开始受理新仓单的注册申请。

早籼稻：N年8月1日起注册的标准仓单，有效期至N+1年7月份最后一个工作日（含该日）。

晚籼稻、粳稻：N年10月1日起注册的标准仓单，有效期至N+1年9月份最后一个工作日（含该日）。

甲醇：每年5月、11月第12个交易日（不含该日）之前注册的标准仓单，应在当月的第15个交易日（含该日）之前全部注销。

玻璃：每年1月、3月、5月、7月、9月、11月第12个交易日（不含该日）之前注册的标准仓单，应在当月的第15个交易日（含该日）之前全部注销。

动力煤：每年5月、11月第7个交易日（不含该日）之前注册的标准仓单，应在当月的第10个交易日（含该日）之前全部注销。

硅铁：每年 2 月、6 月、10 月第 12 个交易日（不含该日）之前注册的厂库和仓库标准仓单，应在当月的第 15 个交易日（含该日）之前全部注销。

锰硅：每年 10 月第 12 个交易日（不含该日）之前注册的厂库和仓库标准仓单，应在当月的第 15 个交易日（含该日）之前全部注销。

棉纱：每年 2 月、6 月、10 月第 12 个交易日（不含该日）之前注册的厂库和仓库标准仓单，应在当月的第 15 个交易日（含该日）之前全部注销。已经注销的棉纱仓库标准仓单，货物尚未出库且生产日期仍符合注册条件的，可重新申请免检注册。

苹果：每年 5 月第 12 个交易日（不含该日）之前注册的仓库标准仓单，应在 5 月的第 15 个交易日（含该日）之前全部注销，每年 5 月第 12 个交易日（含该日）至 9 月最后一个交易日（含该日）不受理苹果仓库标准仓单注册申请；每年 1 月、5 月、7 月第 12 个交易日（不含该日）之前注册的厂库标准仓单，应在当月的第 15 个交易日（含该日）之前全部注销，每年 7 月第 12 个交易日（含该日）至 9 月最后一个交易日（含该日）不受理苹果厂库标准仓单注册申请。

**第九十七条** 标准仓单到期日前未办理注销手续的，交易所可在到期日将其注销，由此造成的一切损失，由标准仓单持有人承担，交易所不保证全部交割商品质量符合规定标准。

## **第七章 标准仓单及中转仓单的流通**

**第九十八条** 标准仓单及中转仓单的流通是指仓单的交割和转让。处于冻结状态和充抵保证金状态的仓单不能流通。

客户仓单的流通应当委托会员办理，以会员名义在交易所进行，流通结果由客户承担。

**第九十九条** 标准仓单交割按《郑州商品交易所期货交割细则》和《郑州商品交易所保税交割实施细则》的有关规定办理。

**第一百条** 标准仓单的转让是指会员自行协商买卖标准仓单的行为。交易所受理标准仓单转让的时间为每个工作日交易时间的下午 2 时 30 分之前。最后交易日，交易所不办理普麦及适用非通用标准仓单的品种标准仓单转让业务。

**第一百零一条** 转让标准仓单应当符合以下规定：

- （一）客户的标准仓单转让须委托会员办理；
- （二）达成转让意向的买卖双方会员应当向交易所提交标准仓单转让申请；
- （三）交易所对标准仓单转让申请审核后，为买卖双方会员办理标准仓单过户和货款结算划转等手续；
- （四）标准仓单转让的货款划转及增值税专用发票的开具、传递参照《郑州商品交易所期货交割细则》执行；
- （五）标准仓单转让手续费标准由交易所公告。
- （六）PTA 保税标准仓单的转让按照《郑州商品交易所保税交割实施细则》等相关规定执行。

## **第八章 标准仓单及中转仓单的注销**

**第一百零二条** 标准仓单、中转仓单的注销是指仓单持有人直接或者委托会员到交易所办理仓单提货手续的过程。

客户注销仓单应当通过会员向交易所提交仓单注销申请。

对于已经注销的 PTA 标准仓单，货物尚未出库但仍符合入库条件的，可重新申请注册。

保税标准仓单的注销，按照本办法与《郑州商品交易所保税交割实施细则》相关规定执行。

**第一百零三条** 动力煤标准仓单注销时，提货人应至少提前 20 个日历日（相对于提货日期）与厂库沟通所提货物质量、重量情况。双方协商一致的，按协商结果提货，涉及升贴水的，由双方自行结算；协商不一致的，提货人按厂库仓单注册时提供的货物信息提取货物，涉及升贴水的，由交易所在货物发运完毕后统一结算。

动力煤提货人和厂库协商不一致的，提货人在指定港口提货时的质量认定、重量溢短按照《郑州商品交易所期货交割细则》“车（船）板交割”相关规定处理，结算价格按最近的交割结算价计价。

动力煤提货人和厂库确认提货事项并提交交易所后，交易所交割部门开具《提货通知单》。

动力煤买卖双方协商在交易所公布的指定交割地点以外的其他地点交货的，相关事项按双方约定办理。

动力煤之外的其他品种标准仓单注销时，交易所结算部门办理仓单升贴水结算，交易所交割部门开具《提货通知单》。

客户办理提货手续前，会员或客户应及时编制《提货通知单》验证密码，《提货通知单》验证密码为提货必备要件。

**第一百零四条** 适用通用标准仓单的商品需要提货的，交易所根据会员申请及仓库或厂库的具体情况，确定《提货通知单》对应的商品。

**第一百零五条** 自交易所开出《提货通知单》之日起 10 个工作日内（硅铁、锰硅厂库交割为 20 个工作日），《提货通知单》持有人应当凭《提货通知单》验证密码、提货人身份证、提货人所在单位证明到仓库或厂库办理提货手续、确认商品质量、确定运输方式、预交各项费用。

玻璃《提货通知单》持有人可在基准交割品和替代交割品厚度范围间选择相应的规格，厂库应予以满足；基准交割品和替代交割品厚度范围以外的厚度、规格和品级等，由双方协商，自行结算。

棉纱《提货通知单》持有人可根据棉纱厂库公告信息选择相应的规格、品级等，在交易所规定升贴水范围内的，厂库予以满足；在交易所规定升贴水范围之外的，由双方协商，自行结算。

《提货通知单》持有人在提货期内向交易所提出商品质量复检申请的，自交易所收到申请之日起，《提货通知单》持有人的提货期间停止计算，待复检结果通知《提货通知单》持有人之日起重新计算。

逾期未办理相关手续的，按现货提货单处理，仓库不再保证全部商品质量符合规定标准；厂库不再保证按期货规定承担日发货速度等责任，具体提货事宜由货主与厂库自行协商。

苹果《提货通知单》对应的货物以折算方式注册的，如提货人逾期未办理相关手续，在接到仓库通知后，仓单注册人有权要求仓库配

合对货物先行整理，并处置超出仓单数量的货物，提货人与注册人协商一致除外。

## 第九章 仓库及中转仓库交割商品出库

**第一百零六条** 期货交割商品出库的重量检验由货主与仓库共同实施，具体办法参照入库规定。

**第一百零七条** 货主提供运输工具的，自货主凭《提货通知单》与仓库联系出库事宜、运输工具到达仓库之日起，仓库开始发货，并停止收取已装运货物的仓储费；货主委托仓库代办运输的，自客户凭《提货通知单》与仓库联系出库事宜、指定运达地点并预交各种费用（包括铁路代办费、港杂费等）之日起，仓库不能在规定时间内（汽车、船舶 10 日，火车 20 日）发出商品的，不得再收取其后的仓储费。

由于货主变更发货方式、提货手续不全、费用未按时交纳、特殊要求等原因，致使商品装运推迟的，不受前款限制。

### 第一节 小麦出库

**第一百零八条** 仓单普麦、强麦出库时，数量发生损耗造成短少的，仓库按实际出库数量补足。不能补足的，交割仓库按《提货通知单》开具之日前（含当日）普麦、强麦期货最近交割月最高交割结算价核算短少商品价款，赔偿买方货主。

**第一百零九条** 强麦出库时，客户与交割仓库发生质量争议的，由入库时或交易所指定的质检机构按入库时规定的检验法检验。复检结果确定的等级高于（包括等于）初检结果确定的等级，或复检结果在初检结果允许误差范围内（以初检结果为基准，湿面筋允许绝对误

差为-1.5%，稳定时间允许相对误差为-15%，拉伸面积允许相对误差为-10%，降落数值允许相对误差-10%），以入库检验结果确定的等级为准，由此产生的化验费和差旅费等由提出争议者负担；复检结果在入库检验结果允许误差范围外，且低于初检结果确定的等级，以复检结果确定的等级为准，由此产生的一切费用和责任由交割仓库负担。

## 第二节 棉花出库

**第一百一十条** 仓库应将与其提棉花相对应的《公证检验证书》随货同行联一份交货主。货主可在商品发运前逐批核对棉花的产地、包装、批次和件数等项目，验收结果应当经货主、仓库双方认可。

**第一百一十一条** 因自然变异导致标准仓单颜色级与注册时相比出现下降的，仍可正常办理出库手续，客户不得拒绝接货。

因自然变异造成颜色级Rd值降低但并未超过3.9%或者+b值增加但并未超过2.7的，由买方客户承担。仓库或中转仓库承担变异超过前述规定部分的颜色级差价，差价的计算根据交易所公告的颜色级之间升贴水标准执行。

中转仓单对应的货物从中转仓库运至仓库出现亏重的，仍可正常办理出库手续，买方客户不得拒绝接货。亏重在1.3%及以内的，由买方客户承担；亏重超过1.3%的，由最初的中转仓单持有人按最近交割月最高交割结算价对买方客户进行补偿，补偿不足部分由注册该中转仓单的中转仓库按最近交割月最高交割结算价补偿。

《公证检验证书》超过有效期的仓单注销时需要重新检验的，由提出重新检验方支付公检及相关费用。

**第一百一十二条** 出库过程中，发现棉花崩包的，仓库应当免费回包。

**第一百一十三条** 处于冻结状态的中转仓单用于转化标准仓单而办理出库的，需提前解除冻结状态，并参照标准仓单注销和出库程序办理出库手续。

### 第三节 白糖出库

**第一百一十四条** 因自然变异导致白糖色值变化在规定范围内的，仍可正常出库，货主不能拒绝接货。

一级白糖的色值小于等于 190IU 的，由货主承担；大于 190IU 小于等于 240IU 的，色值每增加 10IU（不足 10IU 按 10IU 计），仓库给提货方每吨 10 元的补偿。白糖色值大于 240IU 时，仓库承担赔偿责任。

**第一百一十五条** 白糖出库时，出现包装霉变、严重污染，潮包、流包、真结块、异味的，仓库应当承担赔偿责任。

### 第四节 PTA 出库

**第一百一十六条** 仓库正常保管情况下，PTA 水分指标变化不影响使用的，货主不得拒绝接收。

**第一百一十七条** 出库时按照先进先出的原则出库。

### 第五节 菜籽出库

**第一百一十八条** 菜籽出库时，数量发生损耗（水分除外）造成短少的，交割仓库按照实际出库数量补足。不能补足的，交割仓库按照《提货通知单》开具之日前（含当日）菜籽期货最近交割月最高交割结算价核算短少商品价款，赔偿买方货主。

**第一百一十九条** 菜籽出库时，含油量指标低于入库质量指标0.5个百分点以内的，视作合格。

### 第六节 菜油出库

**第一百二十条** 出库数量发生损耗造成短少的，仓库应及时补足。不能及时补足的，仓库按《提货通知单》开具日（含当日）之前菜油期货最近交割月最高交割结算价核算短少商品价款，赔偿货主。

### 第七节 菜粕出库

**第一百二十一条** 交割仓库菜粕出库水分溢短数量由货主承担，非水分减量的货款按照《提货通知单》开具之日前（含当日）菜粕期货最近交割月最高交割结算价核算短少商品价款，由仓库赔偿买方货主。出库水分检验费用由仓库承担。

菜粕出库水分溢短数量的计算方法： $\text{商品水分溢短数量} = \text{提货数量} \times (\text{入库时的实际水分指标} - \text{提货时的实际水分指标}) \div (1 - \text{提货时的实际水分指标})$ 。

菜粕出库应同时符合入库时包装物件数计算的重量。

交割厂库菜粕应足量出库。

菜粕出库时，粗蛋白质低于入库质量指标0.5个百分点以内的，视作合格。

## 第八节 早籼稻、晚籼稻、粳稻出库

**第一百二十二条** 出库数量发生损耗造成短少的，仓库应及时补足。不能及时补足的，仓库按《提货通知单》开具日之前（含当日）该品种期货最近交割月最高交割结算价核算短少商品价款，赔偿货主。

**第一百二十三条** 晚籼稻、粳稻出库时，垩白粒率不高于入库检验结果所在等级 5 个百分点（含）的，视同合格。

## 第九节 甲醇出库

**第一百二十四条** 出库时甲醇不符合交割质量标准的，仓库承担赔偿责任。

**第一百二十五条** 出库数量发生损耗造成短少的，仓库应及时补足。不能及时补足的，仓库按《提货通知单》开具日（含当日）之前甲醇期货最近交割月最高交割结算价核算短少商品价款，赔偿货主。

## 第十节 硅铁出库

**第一百二十六条** 硅铁出库检验时，粒度偏差筛下物高于入库指标 1 个百分点以内的，视作合格；超过 1 个百分点的，超出部分仓库应及时补足。不能及时补足的，仓库按《提货通知单》开具日之前（含当日）硅铁期货最近交割月最高交割结算价核算价款，赔偿货主。

**第一百二十七条** 出库过程中，发现硅铁包装损坏，不适宜再次装卸及运输的，仓库应当免费提供包装物并重新灌包。

## 第十一节 锰硅出库

**第一百二十八条** 出库过程中，发现锰硅包装损坏，不适宜再次装卸及运输的，仓库应当免费提供包装物并重新灌包。

## 第十二节 棉纱出库

**第一百二十九条** 货主可在商品发运前逐批对棉纱的生产厂家、生产日期、批次和数量等项目进行验收，验收结果应当经货主、仓库双方认可。

**第一百三十条** 因自然变异导致标准仓单质量与注册时相比出现下降的，仍可正常办理出库手续，提货人不得拒绝接货。

**第一百三十一条** 棉纱出库时，出现包装损坏的，仓库应予以免费回包。

## 第十三节 苹果出库

**第一百三十二条** 出库数量发生损耗造成短少的，仓库应及时补足。不能及时补足的，仓库按《提货通知单》开具日之前（含当日）苹果期货最近交割月最高交割结算价核算短少商品价款，赔偿货主。

**第一百三十三条** 采用折算方式注册的标准仓单出库时，仓库应提前通知仓单注册人，注册人按照仓单标示的信息进行整理。注册人未到场整理的，仓库代为整理，整理费用由注册人承担，仓库与注册人自行结算。

**第一百三十四条** 采用折算方式注册的标准仓单出库后，整理后余留的苹果由仓单注册人自行处置。注册人未到场的，视为对整理结果没有异议，整理后余留的苹果由仓库转交注册人。注册人未向仓库支付整理费用的，仓库可以依法对余留苹果进行处置并优先受偿。

**第一百三十五条** 苹果出库时，货主与交割仓库发生质量争议的，由质检机构进行检验。其中，复检结果确定的质量容许度的等级高于

（包括等于）仓单标示的等级，以仓单标示的等级为准，由此产生的复检及相关费用由提出争议方承担；复检结果确定的质量容许度的等级低于仓单标示的等级，但在交割标准允许范围内，以复检结果确定的等级为准，货主应当接受，由此产生的一切费用和责任由交割仓库承担。

## 第十章 厂库交割商品交收

**第一百三十六条** 厂库出库时的日发货速度是指厂库在 24 小时内安排期货商品发货的最低数量。厂库日发货速度由交易所确定和调整。

**第一百三十七条** 硅铁、锰硅厂库仓单交货地点为货主在厂库配送范围内选择的交割仓库（各厂库配送范围见交易所公告）。货物运至交割仓库买方车板前的费用（包括交割仓库收取的中转费用）由厂库承担。交割仓库存在升贴水的，货主与厂库可按照交易所规定的升贴水标准自行结算。在其他地点交货的，具体交收事宜及相关费用由双方协商确定。

货主自与厂库联系发货之日起 3 个工作日内，双方应达成发货协议。发货协议包括交货地点、运输方式、费用承担等事宜。在交割仓库交货的，厂库与货主应及时与交割仓库联系，安排交收事宜。货主应在每批货物运达交割仓库后 3 个日历日（不含送达日）内完成验货、提货或存储手续，逾期未提货产生的费用及质量责任由货主承担。

采用汽车运输的，厂库应在达成发货协议之日起 3 个日历日内发货；采用火车、轮船运输的，厂库应在达成发货协议之日起 15 个日

历日内发货。发货后，厂库应将相应单据应及时传递给货主及拟交货的交割仓库。

**第一百三十八条** 硅铁、锰硅之外的其他品种，货主与厂库办妥提货手续之日起，3个日历日内开始发货，货主与厂库自行协商的除外。货主可自行到库提货或委托厂库代为发运。

由于货主变更发货方式、发货时间、提货手续不全、费用未按时交纳、其他特殊要求等原因，致使发货推迟的，不受前款限制。

动力煤厂库仓单在港口提货时，按照《郑州商品交易所期货交割细则》“车（船）板交割”规定流程办理。

**第一百三十九条** 厂库交割商品重量验收按照以下规定执行：

玻璃出库重量按标准厚度折算或过磅检重，由买方选择。

动力煤交收时，重量溢短范围适用《郑州商品交易所期货交割细则》“车（船）板交割”相关规定。

硅铁、锰硅在交割仓库交货，称重由交割仓库负责，费用由厂库承担；在其他地点交货的，称重实施及费用分担由厂库与货主协商确定。

玻璃、动力煤、硅铁、锰硅之外的其他品种重量验收由提货人与厂库共同实施，以厂库检重为准，足量出库。

玻璃每次提货（指一张提货单）的溢短不超过一个包装单位（架），由买方决定，溢短部分由双方自行结算，结算价格参考最近交割月交割结算价。

玻璃、动力煤之外的其他品种出库数量发生短少的，厂库应及时补足。不能补足的，厂库按《提货通知单》开具日（含当日）之前该品种期货最近交割月最高交割结算价核算短少商品价款，赔偿货主。

提货人在货物交收时应到交收地点监发，未到场监发的，视为对货物重量没有异议。

**第一百四十条** 厂库交割商品质量验收按照以下规定执行：

玻璃出库时厂库向货主提供《质量合格证书》。

硅铁、锰硅交货时，厂库向货主提供符合交割标准《产品质量证明书》。

动力煤交收时，质量检验适用《郑州商品交易所期货交割细则》“车（船）板交割”相关规定。

晚籼稻、粳稻出库时，厂库应与货主共同抽取样品，货主对检验结果无异议的，厂库方予发货。货物实际质量指标与仓单标示质量指标不一致但在交易所规定的质量差异允许范围内的，客户应当接受，质量差异升贴水由厂库与客户按照交易所规定的标准自行结算。

棉纱出库时，厂库向货主提供符合交割标准的《产品质量证明书》和《产品出厂检验报告》。提货人对棉纱异性纤维含量保留申请复检权利的，可进行留样，厂库应在提货人监督下在货物装运到买方运输工具前进行抽样，经双方确认后共同封样。样品一式两份，一份由货主保存，一份由厂库保存，厂库应将样品保留至发货后 30 个日历日，作为发生质量争议时的处理依据。

苹果出库时，厂库向货主提供符合交割标准的《产品质量证明书》，货主可到场查验货物质量，厂库应予以配合。

玻璃、动力煤、晚籼稻、粳稻、硅铁、锰硅、棉纱、苹果之外的其他品种出库时，厂库应在提货人监督下在货物装运到买方运输工具前进行抽样，经双方确认后共同封样。样品一式三份，一份由货主保存，两份由厂库保存，厂库应将样品保留至发货后 30 个日历日，作为发生质量争议时的处理依据。

厂库须保证期货商品的质量符合交易所规定的交割标准，双方协商一致的除外。

**第一百四十一条** 货主办理提货手续时，应就发货速度及最后完成出库时间与厂库协商一致，协商不成的，厂库应按照交易所批准的日发货速度发货。

**第一百四十二条** 多个货主同时提货时，厂库可按货主预约时间及办理提货手续的先后顺序等合理安排发货。

**第一百四十三条** 厂库或货主因故不能按照约定的发货计划发货或提货的，双方应及时协商并妥善调整发货速度或发货计划，并且过错方应付滞纳金。动力煤滞纳金由买卖双方协商解决。动力煤之外的其他品种滞纳金=5 元/吨×按日发货计划应发未发或应提未提的商品数量×该批商品的滞留天数。

因厂库原因在约定的最后发货日起 5 个日历日内仍不能完成所有商品发货的，货主可要求厂库终止发货并支付赔偿金。

赔偿金额=该品种期货最近交割月最高交割结算价×按商品总量应发而未发的商品数量×120%。

当厂库发生违约行为时，首先由厂库向货主支付赔偿金。厂库未支付或支付数额不足的，交易所可动用厂库出具的银行履约保函、现金或交易所认可的其他支付保证方式予以清偿。

**第一百四十四条** 因天气原因及其他不可抗力因素导致无法发货或提货时，厂库和货主不需支付赔偿金。

厂库和货主应妥善保管商品发货计划书、协商确认书、发货和提货单据，作为解决纠纷的依据。

## **第十一章 入库和出库复检**

### **第一节 仓库商品入库复检**

**第一百四十五条** 货主或者交割仓库对入库检验结果（强麦除外）有异议的，应当自收到检验结果之日起3个工作日内向交易所书面提出复检申请，并预交复检费用。

复检仅限于复检申请方提出的有异议的项目。

未在规定时间内提出复检申请的，视为同意检验结果。

**第一百四十六条** 白糖、PTA、甲醇、硅铁、锰硅、棉纱复检机构为原质检机构，交易所可调换或增加质检人员。

交易所同意由交割仓库检验的仓单普麦、强麦质量指标，复检机构由交易所指定。

菜籽、菜油、菜粕、早籼稻、晚籼稻、粳稻、苹果复检机构由货主和仓库协商确定，协商不成的，由交易所指定。

**第一百四十七条** 由交易所指定复检机构的品种，复检样品由复检机构重新扦(采)取，仓库应予以配合。复检机构应当自扦(采)样完毕次日起3个工作日内作出复检结果(如样品量较大，可适当延迟)，并将复检结果书面通知交易所，交易所通知异议方。

复检机构为原质检机构的品种，复检机构只对其保留的样品进行复检，不再重新扦(采)样。复检机构自收到交易所复检通知之日起4个工作日内(棉纱品种为10个工作日内)，应当作出复检结果，并将复检结果书面通知交易所，交易所通知异议方。

复检结果为解决争议的依据。

**第一百四十八条** 由交易所指定复检机构的品种，复检结果与仓库原检验结论一致的，由货主承担相关费用(检验费、抽样费、差旅费、交通费等。下同)；复检结果与仓库原检验结论不一致的，相关费用由仓库承担。

复检机构为原质检机构的品种，复检结果与原检验结论一致的，由复检申请方承担相关费用；复检结果与原检验结论不一致的，相关费用由质检机构承担。

**第一百四十九条** 一号棉入库复检按《期货交割棉公证检验实施办法(暂行)》执行。

## 第二节 仓库商品出库复检

**第一百五十条** 自《提货通知单》开具之日起10个工作日内，仓单持有人对商品质量有异议的，可向交易所申请一次复检，并预交复检费用。

未在规定时间内提出异议的，视为确认出库商品质量。

**第一百五十一条** 复检仅限于复检申请方提出的有异议的项目。

由仓库检验的项目，参照入库复检进行；由质检机构检验的项目，由交易所指定的质检机构进行复检。

复检结果为解决争议的依据。

**第一百五十二条** 交易所不受理超出规定时间或者已经出库的交割商品的质量和数量复检，不承担由此产生的一切责任。

**第一百五十三条** 自收到书面异议之日起 2 个工作日内，交易所通知仓库。复检机构在仓库协助下重新扦（采）样，样品经三方共同认可后封样。复检结果由交易所通知会员与仓库。

复检结果符合交易所出库规定的，复检及相关费用由复检申请方承担。复检结果不符合出库规定的，复检及相关费用由过错方承担。

**第一百五十四条** 复检结果不符合出库规定的，在双方约定或者规定的出库时间内，仓库或者标准仓单转让人可以用符合出库规定的商品调换，提货方不得拒收。商品调换不得影响商品及时出库，调换增加的运输、检验等费用由仓库或者标准仓单转让人承担。调换后商品的出库按交割商品的有关规定执行。

**第一百五十五条** 仓库或者标准仓单转让人未能用符合出库规定的其他商品调换，仓库或者标准仓单转让人可以与客户（提货方）协商处理。

协商无法达成一致的，按以下规定执行：

（一）仓库或者标准仓单转让人须及时对不合格的交割商品加工处理以达到出库规定，并承担补偿责任。补偿金额按照该品种期货最近交割月最高交割结算价的 3% 计算。加工处理且补偿后，客户（提货方）不得拒绝接受商品。

（二）无法加工处理或者加工处理后仍不能达到出库规定的，仓库或者标准仓单转让人承担赔偿责任，赔偿金额按照该品种期货最近交割月最高交割结算价的 120% 计算，货物归仓库或标准仓单转让人所有。

**第一百五十六条** 一号棉复检按照棉花国家标准和《期货交割棉公证检验实施办法（暂行）》执行。

**第一百五十七条** 交易所不受理棉纱仓库仓单异性纤维含量指标的出库复检。

### 第三节 厂库商品出库复检

**第一百五十八条** 货主或厂库对交割商品重量、质量有异议的，首先与厂库协商解决。协商不成的，可向交易所申请一次复检，并预交复检及相关费用。

重量异议，应在货物出库前或交货时提出。

质量异议：玻璃、晚籼稻、粳稻、棉纱（异性纤维含量除外）、苹果应在货物出库前提出；对棉纱异性纤维含量有异议的，可以在货物出库前提出，也可以预留样品，保留申请复检的权利，并在货物出库之日起 30 个日历日内提出；动力煤应在收到质检报告之日起 5 个

工作日内提出；其他品种应在货物出库或交货之日起5个工作日内提出。

未在规定时间内提出异议的，视为确认出库商品的重量或质量。棉纱预留在厂库的样品，由厂库寄给货主或由货主取回，邮寄费用及邮寄过程中产生的样品损伤由货主承担，双方协商一致的除外。

**第一百五十九条** 动力煤复检项目适用《郑州商品交易所期货交割细则》“车（船）板交割”相关规定。动力煤之外的其他品种复检仅限于复检申请方提出的有异议的项目。

复检由质检机构进行。复检机构由交易所指定并公告。

甲醇、动力煤复检样品仅限于保留样品。

玻璃、晚籼稻、粳稻复检对象为申请方提出质量异议的对应货物。

复检结果为解决争议的依据。

**第一百六十条** 交易所不受理超出规定时间的交割商品的质量复检，不承担由此产生的一切责任。

复检结果符合交割规定的，复检及相关费用由复检申请方承担。其中，棉纱异性纤维含量复检结果增加贴水的，货主不得拒绝接货，由此造成的损失由厂库与货主协商处理，双方协商无法达成一致的，复检及相关费用由厂库承担，厂库根据交易所相关规定对货主进行补偿，补偿金额=该品种期货最近交割月最高交割结算价×复检增加贴水部分的商品数量×贴水比例；苹果复检结果确定的质量容许度的等级高于（包括等于）仓单标示的等级，以仓单标示的等级为准，复检结果确定的质量容许度的等级低于仓单标示的等级，但在交割标准允

许范围内，以实际质量容许度的等级为准，货主应当接受，由此产生的一切费用和责任由厂库承担。

复检结果不符合交割规定的，复检及相关费用由厂库承担。由此造成的损失由厂库与货主协商处理，双方协商无法达成一致的，厂库应承担赔偿责任，赔偿金额=该品种期货最近交割月最高交割结算价×复检不符合交割规定的商品数量×120%，对应的货物归厂库所有。

## 第十二章 监督、争议和处理

**第一百六十一条** 交易所有权对用于期货交割的商品进行抽查。

对期货交割商品抽查不合格的不予注册。

对已经注册成仓单的商品质量和数量抽查中发现质量不合格或者数量有差额的，责成仓库、厂库或仓单持有人采取限期提供足量、合格商品等补救措施，由此发生的一切费用和损失由仓库或者仓单持有人承担。出现违规行为的，交易所按规定对违规者进行处罚。

**第一百六十二条** 标准仓单转让人与受让人（提货方）之间、客户与仓库或厂库及仓单质量免检承诺人之间产生交割纠纷的，双方可先行协商解决；协商无法达成一致意见的，应当在纠纷发生之日起5个工作日内以书面形式向交易所申请调解。调解不成的，依法向人民法院起诉或者依约向仲裁机构申请仲裁。

**第一百六十三条** 交割商品出库时，对交割商品的质量和数量发生争议的，交易所按本办法规定对责任归属进行确认，最终责任由责任方承担。

**第一百六十四条** 仓库、厂库或标准仓单转让人不能向客户（提货方）交付符合合约出库规定标准的商品，造成客户（提货方）损失的，应当承担赔偿责任。仓库或厂库不能履行其债务时，交易所仅对交割商品的重量和质量承担相应补充赔偿责任。

**第一百六十五条** 厂库发货完毕，经交易所书面确认无数量、质量责任，经厂库申请，交易所退还现金或交易所认可的其他支付保证方式。

### **第十三章 附 则**

**第一百六十六条** 本办法解释权属于郑州商品交易所。

**第一百六十七条** 本办法自 2018 年 11 月 9 日起施行。

# 郑州商品交易所指定商品交割仓库管理办 法修订案

(2018 年 10 月 23 日郑州商品交易所第六届理事会第十二次  
会议审议通过)

对《郑州商品交易所指定商品交割仓库管理办法》作如下修改：

一、第三条第一款修改为：“交易所依据本办法对交割仓库进行管理，交割仓库及其有关工作人员应当遵守本办法。”，同时删除第三条第二款。

二、第四条增加第（十）项：“（十）申请保税交割业务的，应当具有保税仓库经营资质；”

原第四条第（十）项顺序修改为第（十一）项。

# 郑州商品交易所指定商品交割仓库

## 管理办法

（2008年1月7日第五届理事会通讯会议审议通过，2008年1月15日郑商发[2008]8号文件发布，自发布之日起施行；2009年3月28日第五届理事会通讯会议审议通过，2009年4月15日郑商发[2009]51号文件发布，自2009年4月20日起施行；2011年10月17日第五届理事会第七次通讯会议修订，2011年10月24日郑商发[2011]202号发布，自2011年10月28日起施行；2018年10月23日第六届理事会第十二次会议修订，2018年11月9日发布，自2018年11月9日起施行）

### 第一章 总则

**第一条** 为加强郑州商品交易所（以下简称交易所）指定商品交割仓库的管理，规范实物交割行为，保证交割正常进行，根据《中华人民共和国合同法》和《郑州商品交易所交易规则》等有关规定，制定本办法。

**第二条** 指定商品交割仓库（以下简称交割仓库）是指经交易所指定的，为商品期货合约履行实物交割提供仓储等服务的经营组织。

**第三条** 交易所依据本办法对交割仓库进行管理，交割仓库及其有关工作人员应当遵守本办法。

### 第二章 申请和审批

**第四条** 申请交割仓库应当具备以下条件：

- （一）工商行政管理部门颁发的营业执照应载明“仓储”或“储运”业务；
- （二）净资产和注册资本应当达到交易所要求的数额；
- （三）财务状况良好，具有较强的抗风险能力；

（四）具有良好的商业信誉，完善的仓储管理规章制度，未发现严重违法违规行为记录和被取消交割仓库资格记录；

（五）承认并遵守交易所的交易规则、交割细则等规定；

（六）仓库主要管理人员应具有相应交割商品的仓储管理经验；

（七）有储存相应交割商品的条件，库容有一定规模，设备完好、计量符合规定要求；

（八）有相应交割商品所需要的出入库、储存、管理、检化验等制度；

（九）交通便利，具有较强的中转、进出装卸能力；

（十）申请保税交割业务的，应当具有保税仓库经营资质；

（十一）交易所规定的其他条件。

**第五条** 申请成为交割仓库应当提供下列材料：

（一）申请书；

（二）工商行政管理部门颁发的营业执照（复印件）；

（三）会计师事务所出具的近两年审计报告或经交易所认可的相关部门审计的年度财务报表；

（四）申请单位上级主管部门或董事会出具的同意申请交割仓库的批准文件；

（五）交易所要求的担保文件；

（六）租赁场房经营的企业，应提供与场房所有者之间的租赁合同（协议）等文件；

（七）仓库管理制度及简介；

（八）交易所要求提供的其他材料；

交易所可根据具体情况，调整对仓库提供材料的要求。

**第六条** 交易所对交割仓库的审批程序：

- (一) 根据前条所列材料进行初审；
- (二) 根据初审结果对申请仓库进行实地调查和评估；
- (三) 根据实地调查和评估结果择优选用，签订交割仓库协议书。

**第七条** 经交易所审定批准，取得交割仓库资格的应当办理以下事宜：

- (一) 申请标准仓单注册所需印章到交易所备案；
- (二) 确定一名负责人主管期货交割业务，建立交割业务机构，指定专人负责期货交割商品的管理，办理标准仓单业务，并将授权书及授权人签字报交易所备案；
- (三) 缴纳交割担保金；
- (四) 根据本办法，制定符合交易所要求的操作规程或细则；
- (五) 交割仓库期货管理人员接受交易所的交割业务培训；
- (六) 交易所规定的其他事宜。

**第八条** 交割仓库放弃交割仓库资格，应当向交易所递交放弃交割仓库资格申请书，并经交易所审核批准。

**第九条** 交割仓库放弃或被取消资格的，应当办理以下事项：

- (一) 交割商品全部出库或全部变成现货；
- (二) 结清与交易所的债权债务；
- (三) 结清与会员、客户的债权债务；
- (四) 按交易所规定清退交割担保金。

**第十条** 交割仓库资格的确认、取消或同意放弃资格，交易所应当及时通告会员及交割仓库。

### 第三章 权利和义务

**第十一条** 交割仓库的权利：

- (一) 按交易所规定享有向交易所申请标准仓单注册权；

- (二) 按交易所审定的收费项目、标准和方法收取有关费用；
- (三) 对交易所制定的有关实物交割的规定享有建议权；
- (四) 经交易所核准，可以租用库房，存储交割商品；
- (五) 交易所交割细则和交割仓库协议书规定的其他权利。

#### **第十二条 交割仓库的义务：**

- (一) 遵守交易所交割细则及其他有关规定，接受交易所的监管，及时向交易所提供有关情况；
- (二) 按规定保管好交割商品，确保安全；
- (三) 按标准仓单要求及交易所的业务规则提供交割商品，协助货主安排出库；
- (四) 保守与商品交割有关的商业秘密；
- (五) 接受交易所组织的年审；
- (六) 缴纳交割担保金；
- (七) 配合并监督指定质检机构取样；
- (八) 变更单位名称、法定代表人、注册资本、股东或股权结构、仓储场地等，出现可能危及交割商品安全、法律诉讼等问题，及时向交易所通报；发生交割仓库土地或房产质押、对外担保等重大事项，事先向交易所通报；
- (九) 交易所交割细则、标准仓单管理办法和交割仓库协议书等规定的其他义务。

### **第四章 日常业务**

**第十三条** 交割仓库的日常业务分为三个阶段：商品入库、商品保管和商品出库。

**第十四条** 交割仓库应当保证用于期货交割的商品优先办理入库、出库。

**第十五条** 交割商品的存放应符合国家或品种所属行业及交易所提出的技术规范要求。

**第十六条** 交割仓库应当对交割商品实行挂牌管理，挂牌标识应符合交易所规定。

**第十七条** 交割仓库应当按《期货交易管理条例》和交易所的有关规定妥善保存检验结果。商品验收合格、入库完毕起 24 小时内向交易所通报。

**第十八条** 未持有《提货通知单》的客户，不得进入库内查看储存的交割商品。小麦、菜籽油客户可以到交割仓库的样品室查看存储货物对应的样品。

样品室的管理应符合交易所规定及要求。交易所不定期对样品保管情况进行抽查。

**第十九条** 交割仓库对交割商品的存储或堆码方法应符合交易所提出的技术规范要求。未经交易所同意，交割仓库不得擅自改变交割商品的存储或码垛方法。

**第二十条** 存放交割商品的设施应符合规定的条件，保持库区、库内清洁卫生。

**第二十一条** 交割仓库应按照交割商品的存放和养护要求，以及交割仓库协议书的约定做好交割商品的管理，切实保证交割商品质量和商品安全，并做好储存记录。

**第二十二条** 未经交易所同意，交割仓库对交割商品存放仓位或垛位不得移动；擅自移动造成的损失，由交割仓库承担全部责任。

**第二十三条** 货物出库时，交割仓库要及时、认真办理出库手续，做好复核工作：

（一）复核《提货通知单》是否有效；

（二）核对《提货通知单》与之相对应的货物是否完全相符等内容。

核对无误后，尽快办理出库。

交割仓库应及时向交易所通报商品发运的进度、仓号、货位的变动情况及发运方向等。发运结束后，根据要求向交易所报送相关出库手续。

## 第五章 监督管理

**第二十四条** 交割仓库应当对库存交割商品全额投保财产险。

**第二十五条** 交割仓库应当对期货交割商品单独设帐管理。

**第二十六条** 交易所对交割仓库实行抽查和年审制度，并可要求交割仓库自查。

在自查、抽查和年审过程中，发现交割仓库有违规等行为的，交易所可采取限期整改、暂停入库业务、取消交割仓库资格等措施。由此产生的损失由交割仓库承担。

**第二十七条** 禁止交割仓库实施下列行为：

（一）不按交易所要求对交割商品进行管理的；

（二）擅自移动或处理交割商品的；

（三）与会员或客户联手，以虚占库容等方式影响或企图影响期货市场价格的；

（四）在未完成入库、未取得检验结果或未完成规定的检验项目情况下，申请注册仓单的；

（五）交割中滥行收费的；

- (六) 蓄意刁难客户，不配合交割商品出入库的；
- (七) 拒绝、阻挠交易所依法、依规监督检查的；
- (八) 弄虚作假，影响期货交割业务正常进行的；
- (九) 违反交易所规定的其他行为。

**第二十八条** 交割仓库应当向交易所缴纳交割担保金作为交割仓库履行义务的保证。交割担保金数额和缴纳方式在《交割仓库协议书》上明确。交割担保金利息归交割仓库所有，按中国人民银行公布的同期银行活期存款利率每年计息一次。

**第二十九条** 由于交割仓库的原因造成标准仓单持有人不能行使或不能完全行使标准仓单权利的，交割仓库应当承担赔偿责任；赔偿不足的部分由交易所按有关规定补充赔偿，补充赔偿后，交易所所有权对交割仓库进行追偿。

## **第六章 附则**

**第三十条** 违反本办法规定的，交易所按《郑州商品交易所违规处理办法》的有关规定处理。

**第三十一条** 本办法解释权属于郑州商品交易所。

**第三十二条** 本办法自 2018 年 11 月 9 日起施行。

附件 10

## 郑州商品交易所夜盘交易细则修订案

(2018 年 10 月 23 日郑州商品交易所第六届理事会第十二次  
会议审议通过)

对《郑州商品交易所夜盘交易细则》作如下修改：

第三条修改为：“交易所、会员、境外经纪机构和客户必须遵守  
本细则”。

# 郑州商品交易所夜盘交易细则

(2014年6月13日第五届理事会第七次通讯会议审议通过,2014年11月21日发布,自2014年12月12日施行;2018年10月23日第六届理事会第十二次会议修订,2018年11月9日发布,自2018年11月9日起施行)

## 第一章 总 则

**第一条** 为规范期货夜盘交易,保护期货交易当事人的合法权益,根据《郑州商品交易所交易规则》,制定本细则。

**第二条** 参与夜盘交易品种的交易、结算、交割、风险控制等优先适用本细则的规定;本细则没有规定的,适用郑州商品交易所其他业务实施细则。

**第三条** 交易所、会员、境外经纪机构和客户必须遵守本细则。

## 第二章 夜盘交易品种和交易时间

**第四条** 夜盘交易是指除日盘(即:上午9:00至11:30和下午1:30至3:00)之外由交易所规定交易时间的交易,夜盘交易品种为交易所规定的期货品种。

夜盘交易时间由交易所另行通知。

**第五条** 本细则中所称的“交易日”是指从夜盘开市至日盘收市的交易期间。

**第六条** 夜盘交易品种的新合约首日交易从上市交易日的夜盘开始。

新品种上市的首日交易从上市交易日的日盘开始。

**第七条** 夜盘交易通过远程交易席位进行交易。

夜盘交易期间不办理远程交易席位申请业务、开户业务。

**第八条** 出现下列情况时，交易所可以调整夜盘开市、收市时间，或者暂停夜盘交易：

（一）因计算机交易系统、通讯系统等交易设施发生故障，致使10%以上的会员不能交易的；

（二）在夜盘开市前，30%以上会员未能完成结算工作或完成交易系统初始化工作的；

（三）交易所认为必要的其他情况。

### **第三章 交易、结算和风险管理**

**第九条** 夜盘交易合约开盘集合竞价在每一交易日夜盘开市前5分钟内进行，日盘不再集合竞价。集合竞价产生的价格作为该交易日的开盘价。集合竞价未产生成交价格的，开市后第一笔成交价为开盘价。若夜盘不交易，则集合竞价顺延至日盘开市前5分钟进行。

开盘集合竞价中的未成交申报单自动参与夜盘开市后竞价交易。

**第十条** 会员必须在夜盘开市前补足结算准备金至最低余额。未补足的，结算准备金余额大于零而低于结算准备金最低余额时，夜盘开市后禁止开新仓；结算准备金余额小于零时，交易所将按《郑州商品交易所期货交易风险控制管理办法》的规定进行处理。

**第十一条** 会员对上一交易日结算结果有异议的，应当在夜盘开市前30分钟以书面形式通知交易所。如遇特殊情况，会员可在夜盘开市后2小时内以书面形式通知交易所。在规定时间内，会员没有对结算结果提出异议的，视作已认可结算结果的正确性。

**第十二条** 夜盘交易期间，不办理出金、有价证券提取及交割相关业务。

**第十三条** 强行平仓的执行原则：强行平仓前先由会员自行平仓，除交易所特别规定的时限外，一律为夜盘开市后至日盘 10:15 之前。会员未在规定时限内平仓完毕的，交易所强制执行。

#### **第四章 附 则**

**第十四条** 违反本细则规定的，交易所按《郑州商品交易所违规处理办法》有关规定处理。

**第十五条** 本细则解释权属于郑州商品交易所。

**第十六条** 本细则自 2018 年 11 月 9 日起施行。

# 郑州商品交易所期货交易风险控制管理办 法修订案

(2018年10月23日郑州商品交易所第六届理事会第十二次  
会议审议通过)

对《郑州商品交易所期货交易风险控制管理办法》作如下修改：

一、将第三条修改为：“交易所、会员、境外经纪机构和客户应当遵守本办法。境外经纪机构应当辅助其委托交易结算的期货公司会员做好境外客户的强行平仓、大户报告、风险提示等工作。期货公司会员应当将涉及境外经纪机构客户的《强行平仓通知书》、强行平仓结果、风险提示函等及时通知境外经纪机构。”

二、将第二十条第二款修改为：“强制减仓前，同一客户在该期货合约的双向持仓首先自动对冲。强制减仓造成的经济损失由会员、境外经纪机构及客户承担。”

三、将第三十三条修改为“期货交易实行大户报告制度。

“非期货公司会员或者客户持有某期货合约数量达到交易所对其规定的持仓限量80%以上（含本数）或者交易所要求报告的，应当向交易所报告其资金、持仓等情况。根据市场风险状况，交易所可调整持仓报告水平。客户应当通过期货公司会员报告；委托境外经纪机构从事期货交易的客户，应当委托其境外经纪机构报告，境外经纪机构再委托期货公司会员报告。

“非期货公司会员、客户应当保证所提供的大户持仓报告和其他材料的真实性、准确性和完整性。”

四、删除第三十六条第一款。

第三十六条第二款修改为：“期货公司会员、境外经纪机构应当对客户所提供的有关材料进行初审并保证报告材料的真实性和准确性。”

五、第四十四条修改为：“除第三十八条第（四）项外，强行平仓产生的盈利或者亏损均归持仓人。持仓人是客户的，强行平仓发生的亏损，客户所在会员先行承担后，自行向该客户追偿；持仓人是境外经纪机构客户的，境外经纪机构应辅助其委托交易结算的期货公司会员强行平仓，强行平仓后发生的亏损，由为该境外经纪机构交易结算的期货公司会员先行承担后，自行向该境外经纪机构追索；境外经纪机构承担损失后，自行向该客户追索。”

“本办法第三十八条第（四）项实施的强行平仓，亏损由持仓人承担，盈利按国家有关规定执行。”

六、四十六条修改为：“出现下列情形之一的，交易所可以对指定的会员、境外经纪机构高管人员或者客户谈话提醒风险，或者要求会员、境外经纪机构、客户报告情况：

“（一）会员、境外经纪机构或者客户交易异常；

“（二）会员、境外经纪机构或者客户持仓异常；

“（三）会员资金异常；

“（四）会员、境外经纪机构或者客户涉嫌违规、违约；

“（五）交易所接到涉及会员、境外经纪机构或者客户的投诉；

“（六）会员、境外经纪机构涉及执法调查；

“（七）交易所认定的其他情况。”

“交易所通过电话提醒的，应当保留电话录音；通过当面谈话的，应当保存谈话记录。

“交易所要求会员、境外经纪机构或者客户报告情况的，报告方式和报告内容参照大户报告制度执行。”

七、第四十七条修改为：“会员、境外经纪机构或者客户有违规嫌疑、交易头寸有较大风险的，交易所可以对会员、境外经纪机构或者客户发出书面的风险提示函。”

八、第四十八条修改为：“发生下列情形之一的，交易所可以向全体或者部分会员、境外经纪机构和客户发出风险提示函：

“（一）期货价格出现异常；

“（二）期货价格和现货价格出现较大差距；

“（三）国内期货价格和国际市场价格出现较大差距；

“（四）交易所认定的其他异常情况。”

# 郑州商品交易所期货交易风险控制

## 管理办法

(2008年1月7日第五届理事会通讯会议修改,2008年1月15日发布,自发布之日起施行;2009年3月28日第五届理事会通讯会议审议通过,2009年4月15日发布,自2009年4月20日施行;2011年10月17日第五届理事会第七次通讯会议修改,2011年10月24日发布,自2011年10月28日施行;2012年7月12日第五届理事会第六次通讯会议修改,2012年11月28日发布,自2012年12月3日施行;2012年12月17日第五届理事会第八次通讯会议修改,2012年12月25日发布,自2012年12月28日施行;2013年6月14日第五届理事会第四次通讯会议修改,2013年7月9日发布,自2013年9月16日起施行;2013年9月5日第五届理事会第九次通讯会议修订,2013年9月16日发布,自2013年9月26日起施行;2013年10月28日第五届理事会第十一次通讯会议修改,2013年11月11日发布,自2013年11月18日施行;2014年6月16日第五届理事会第八次通讯会议修改,2014年7月4日发布,自2014年7月8日施行;2014年7月4日第五届理事会第十一次通讯会议修改,2014年8月1日发布,自2014年8月8日施行;2014年6月13日第五届理事会第七次通讯会议修改,2014年11月21日发布,自2014年12月12日起施行;2015年5月11日第五届理事会第四次通讯会议修改,2015年5月27日发布,自2015年6月10日施行;2017年2月10日第五届理事会第二次通讯会议修改,2017年2月21日发布,自2017年2月21日施行;2017年7月31日第六届理事会第三次会议修改,2017年8月14日发布,自2017年8月18日施行;2017年6月12日第六届理事会第二次会议修改,2017年11月10日发布,自2017年11月22日施行;2017年12月7日第六届理事会第六次会议修订,2017年12月19日发布,自2017年12月22日施行;2017年12月7日第六届理事会第六次会议修订,2018年1月5日发布,自2018年1月18日施行;2018年8月20日第六届理事会第九次会议修改,2018年8月24日发布,自2018年9月17日施行;2018年10月16日第六届理事会第十一次会议修改,2018年10月17日发布,修改部分自苹果1910合约起施行;2018年10月23日第六届理事会第十二次会议修订,2018年11月9日发布,修改部分自2018年11月9日起施行)

### 第一章 总则

**第一条** 为加强期货交易风险管理,维护期货交易当事人的合法权益,保证郑州商品交易所(以下简称交易所)期货交易的正常进行,根据《郑州商品交易所交易规则》,制定本办法。

**第二条** 期货交易风险管理实行保证金制度、涨跌停板制度、限仓制度、交易限额制度、大户报告制度、强行平仓制度、风险警示制度。

**第三条** 交易所、会员、境外经纪机构和客户应当遵守本办法。境外经纪机构应当辅助其委托交易结算的期货公司会员做好境外客户的强行平仓、大户报告、风险提示等工作。期货公司会员应当将涉及境外经纪机构客户的《强行平仓通知书》、强行平仓结果、风险提示函等及时通知境外经纪机构。

## 第二章 保证金制度

**第四条** 期货交易实行保证金制度。

各品种<sup>4</sup>期货合约的最低交易保证金标准见下表：

品种	最低交易保证金标准
普麦、强麦、一号棉、菜油、菜籽、菜粕、动力煤、早籼稻、晚籼稻、粳稻、甲醇、硅铁、锰硅、白糖、PTA、玻璃、棉纱	5%
苹果	7%

**第五条** 期货合约的交易保证金标准按照该期货合约上市交易的时间分期间依次管理，各期间交易保证金标准见下表：

交易时间段	交易保证金标准
苹果期货合约自挂牌至交割月前一个月第15个日历日期间的交易日	7%
除苹果外，其他品种期货合约自挂牌至交割月前一个月第15个日历日期间的交易日	5%
交割月前一个月第16个日历日至交割月前一个月最后一个日历日期间的交易日	10%
交割月份	20%

**第六条** 交易过程中，当日开仓按照该期货合约前一交易日结算价收取相应标准的交易保证金。当日结算时，该期货合约的所有持仓

<sup>4</sup>各品种中，普通小麦简称“普麦”，优质强筋小麦简称“强麦”，一号棉花简称“一号棉”，精对苯二甲酸统称“PTA”，菜籽油简称“菜油”，油菜籽简称“菜籽”，菜籽粕简称“菜粕”，鲜苹果简称“苹果”。

按照当日结算价收取相应标准的交易保证金。

**第七条** 某期货合约所处期间符合调整交易保证金要求的，自该期间首日的前一交易日闭市起，该期货合约的所有持仓按照新的交易保证金标准收取相应的交易保证金。

**第八条** 某期货合约按结算价计算的价格变化，连续四个交易日（即 D1、D2、D3、D4 交易日）累计涨(跌)幅（N）达到期货合约规定涨(跌)幅的 3 倍或者连续五个交易日（即 D1、D2、D3、D4、D5 交易日）累计涨(跌)幅（N）达到期货合约规定涨(跌)幅的 3.5 倍的，交易所提高交易保证金标准；提高交易保证金标准的幅度不高于期货合约当时适用的交易保证金标准的 3 倍。

N 的计算公式如下：

$$N = (P_t - P_0) / P_0 \times 100\% \quad t=4, 5$$

$P_0$  为 D1 交易日前一交易日结算价

$P_t$  为 t 交易日结算价，t=4, 5

**第九条** 遇法定节假日休市时间较长的，交易所可以在休市前调整期货合约交易保证金标准和涨跌停板幅度。

**第十条** 某期货合约交易行情特殊致使市场风险明显增大时，交易所可根据某期货合约市场风险情况采取下列措施：

- （一）限制出入金；
- （二）限制开、平仓；
- （三）调整该期货合约交易保证金标准；
- （四）调整该期货合约涨跌停板幅度。

当某期货合约市场行情趋于平缓时，交易所可以将上述措施恢复到正常水平。

交易所调整交易保证金标准或者涨跌停板幅度的，应予公告，并报中国证监会备案。

**第十一条** 同时适用本办法规定的两种或者两种以上有关调整交易保证金标准的期货合约，其交易保证金标准按照最高值收取。

**第十二条** 会员未能按时足额交纳交易保证金的，交易所所有权对其相关期货合约持仓执行强行平仓，直至保证金能够维持其持仓水平为止。

### 第三章 涨跌停板制度

**第十三条** 期货交易实行价格涨跌停板制度，由交易所规定各上市期货合约的每日最大价格波动幅度。

对同时满足本办法有关调整涨跌停板幅度规定的合约，其涨跌停板幅度按照规定涨跌停板幅度数值中的较大值确定。

**第十四条** 苹果期货合约每日涨跌停板幅度为前一交易日结算价的±5%。

除苹果外，其他品种期货合约每日涨跌停板幅度为前一交易日结算价的±4%。

**第十五条** 新期货合约上市当日至成交首日，涨跌停板幅度为期货合约实际执行的涨跌停板幅度的2倍。

新期货合约成交首日的下一交易日，涨跌停板幅度恢复为期货合约实际执行的涨跌停板幅度。

**第十六条** 某期货合约以涨跌停板价格成交的，成交撮合原则为

平仓优先和时间优先。

**第十七条** 某期货合约在某一交易日收盘前 5 分钟内出现只有停板价位的买入(卖出)申报、没有停板价位的卖出(买入)申报,或者一有卖出(买入)申报就成交、但未打开停板价位的情况,称为涨(跌)停板单方无报价(以下简称单边市)。

**第十八条** 某期货合约在某一交易日(该交易日称为 D1 交易日,以下几个交易日分别称为 D2、D3、D4、D5 交易日)出现单边市的, D2 交易日该期货合约的涨跌停板幅度为在 D1 交易日涨跌停板幅度的基础上增加 3 个百分点; D1 交易日结算时和 D2 交易日该期货合约交易保证金标准为在 D2 交易日涨跌停板幅度的基础上增加 2 个百分点。若该合约调整后的交易保证金标准低于 D1 交易日执行的交易保证金标准,则按 D1 交易日该合约执行的交易保证金标准收取。

D2 交易日该期货合约未出现同方向单边市的,当日结算时交易保证金标准恢复到正常水平; D3 交易日涨跌停板幅度恢复到正常水平。D2 交易日出现同方向单边市的, D3 交易日该期货合约的涨跌停板幅度为在 D2 交易日涨跌停板幅度的基础上增加 3 个百分点; D2 交易日结算时和 D3 交易日该期货合约交易保证金标准为在 D3 交易日涨跌停板幅度的基础上增加 2 个百分点。若该合约调整后的交易保证金标准低于 D2 交易日执行的交易保证金标准,则按 D2 交易日该合约执行的交易保证金标准收取。

D3 交易日该期货合约未出现同方向单边市的,当日结算时交易保证金标准恢复到正常水平; D4 交易日涨跌停板幅度恢复到正常水平。D3 交易日该期货合约仍出现同方向单边市的(即连续三个交易

日出现同方向单边市)，交易所可根据市场情况决定并公告，对该合约实施下列三种措施中的任意一种：

措施一：D4 交易日继续交易，交易所可以采取调整交易保证金标准、调整涨跌停板幅度、暂停开仓、暂停平仓、限制出金、限期平仓及其他风险控制措施。

措施二：D4 交易日暂停交易一天，交易所在 D5 交易日可以采取调整交易保证金标准、调整涨跌停板幅度、暂停开仓、暂停平仓、限制出金、限期平仓及其他风险控制措施。

措施三：D4 交易日暂停交易一天，交易所在 D4 交易日强制减仓。强制减仓后，从下一交易日（含该日）开始，该期货合约交易保证金标准和涨跌停板幅度按照 D3 交易日的标准执行，直至该期货合约不再出现同方向单边市。

**第十九条** 当 D2 及以后交易日出现与前一交易日反方向涨跌停板单边市，则视作新一轮单边市开始，该日即视为 D1 交易日，下一交易日涨跌停板幅度和交易保证金标准参照第十八条执行。

**第二十条** 强制减仓是指 D4 交易日结算时，交易所将 D3 交易日闭市时以涨跌停板价申报的未成交平仓报单，且该客户（包括非期货公司会员，下同）该期货合约单位持仓亏损大于或者等于 D3 交易日结算价一定比例（该期货合约规定的最低交易保证金标准）的所有持仓，以 D3 交易日涨跌停板价，与该期货合约盈利持仓按规定方式和方法自动撮合成交。

强制减仓前，同一客户在该期货合约的双向持仓首先自动对冲。  
强制减仓造成的经济损失由会员、境外经纪机构及客户承担。

## 第二十一条 强制减仓的方法和程序：

### （一）申报数量的确定

D3 交易日收市后，已在计算机系统中以涨（跌）停板价申报但没有成交的，且该客户该期货合约的单位持仓亏损大于或者等于 D3 交易日结算价一定比例（该期货合约规定的最低交易保证金标准）的所有申报平仓数量的总和。因自动对冲客户双向持仓造成客户持仓少于平仓单所报数量时，系统自动将平仓数量进行调整。客户不愿按上述方法平仓的，可在收市前撤单，不作为申报的平仓报单。

客户单位持仓盈亏的计算方法：

$$\text{客户该期货合约单位持仓盈亏} = \frac{\text{客户该期货合约持仓盈亏的总和(元)}}{\text{客户该期货合约的持仓量(手)}}$$

客户该期货合约持仓盈亏总和，是指客户该期货合约的持仓按其实际成交价与当日结算价之差计算的盈亏总和。

### （二）持仓盈利客户平仓范围的确定

根据上述方法计算的客户单位持仓盈利的投机持仓（包括套利持仓）以及客户单位持仓盈利大于或等于期货合约规定价幅 2 倍的保值持仓都列入平仓范围。

### （三）平仓数量的分配原则及方法

#### 1. 平仓数量的分配原则

（1）在平仓范围内按盈利的大小和投机与保值的不同分成四级，逐级进行分配。

首先分配给属平仓范围内单位持仓盈利大于或者等于期货合约规定价幅（以 D3 交易日结算价计算，下同）2 倍的投机持仓（以下简称盈利 2 倍的投机持仓）。

其次分配给单位持仓盈利大于或者等于期货合约规定价幅 1 倍的投机持仓（以下简称盈利 1 倍的投机持仓）。

再次分配给单位持仓盈利大于或者等于期货合约规定价幅 1 倍以下的投机持仓（以下简称盈利 1 倍以下的投机持仓）。

最后分配给单位持仓盈利大于或等于合约规定价幅 2 倍的保值持仓（以下简称盈利 2 倍的保值持仓）。

（2）以上各级分配比例均按申报平仓数量（剩余申报平仓数量）与各级可平仓的盈利持仓数量之比进行分配。

## 2. 平仓数量的分配方法及步骤

若盈利 2 倍的投机持仓数量大于或者等于申报平仓数量，根据申报平仓数量与盈利 2 倍的投机持仓数量的比例，将申报平仓数量向盈利 2 倍的投机客户等比例分配实际平仓数量。

盈利 2 倍的投机持仓数量小于申报平仓数量，则根据盈利 2 倍的投机持仓数量与申报平仓数量的比例，将盈利 2 倍的投机持仓数量向申报平仓客户分配实际平仓数量；再把剩余的申报平仓数量按上述的分配方法向盈利 1 倍的投机持仓分配；还有剩余的，再向盈利 1 倍以下的投机持仓分配；若还有剩余，再向盈利 2 倍的保值持仓分配；仍有剩余的，不再分配。具体方法与步骤见本办法附件。

分配平仓数量以“手”为单位，不足一手的按如下方法计算。首先对每个交易编码所分配到的平仓数量的整数部分进行分配，然后按小数部分由大到小的顺序“进位取整”进行分配。

**第二十二条** 采取上述措施后该期货合约风险仍未释放的，交易所宣布进入异常情况，并按有关规定采取风险控制措施。

**第二十三条** 新期货合约成交首日以前(含该日)出现单边市的，该期货合约的涨跌停板幅度和交易保证金标准不受本章第十八条限制。

某期货合约在交割月的最后交易日出现第三个连续同方向单边市的，则当日闭市后，交易所根据市场情况，决定对该期货合约先执行强制减仓之后配对交割或者直接配对交割。

## **第四章 限仓制度**

**第二十四条** 期货交易实行限仓制度。

限仓是指交易所规定会员或者客户按单边计算的、可以持有某一期货合约投机持仓的最大数量。

**第二十五条** 各品种期货合约对期货公司会员不限仓。

**第二十六条** 一号棉、白糖、PTA、菜油、甲醇、玻璃、菜粕和动力煤期货合约自合约挂牌至交割月前一个月第 15 个日历日期间的交易日，当合约的单边持仓量大于或等于一定规模时，非期货公司会员和客户按单边持仓量的 10%确定限仓数额；当合约的单边持仓量小于一定规模时，非期货公司会员和客户按绝对量方式确定限仓数额。具体限仓标准见下表：

品 种	期货合约单边持仓量	非期货公司会员及客户最大单边持仓
一号棉	单边持仓量<15 万	15000
	单边持仓量≥15 万	单边持仓量×10%
白糖	单边持仓量<25 万	25000
	单边持仓量≥25 万	单边持仓量×10%
PTA	单边持仓量<25 万	25000
	单边持仓量≥25 万	单边持仓量×10%
菜油	单边持仓量<10 万	10000
	单边持仓量≥10 万	单边持仓量×10%
甲醇	单边持仓量<10 万	10000
	单边持仓量≥10 万	单边持仓量×10%
玻璃	单边持仓量<20 万	20000
	单边持仓量≥20 万	单边持仓量×10%
菜粕	单边持仓量<20 万	20000
	单边持仓量≥20 万	单边持仓量×10%
动力煤	单边持仓量<60 万	60000
	单边持仓量≥60 万	单边持仓量×10%

注：单位，手。

普麦、强麦、早籼稻、菜籽、粳稻、晚籼稻、硅铁、锰硅、棉纱和苹果期货合约自合约挂牌至交割月前一个月第 15 个日历日期间的交易日限仓标准见下表：

品 种	非期货公司会员及客户最大单边持仓（手）
普麦	2000
强麦	2500
早籼稻	7500
菜籽	10000
粳稻	20000
晚籼稻	20000
硅铁	8000
锰硅	30000
棉纱	10000
苹果（非 7 月合约）	500
苹果（7 月合约）	100

各品种期货合约自交割月前一个月第 16 个日历日至交割月限仓标准见下表：

品 种	非期货公司会员及客户最大单边持仓（手）
-----	---------------------

	交割月前一个月第 16 个日历日至交割月前一个月最后一个日历日期间的交易日	交割月份 (自然人客户限仓为 0)
普麦	600	200
强麦	1000	300
一号棉	3000	400
白糖	5000	1000
PTA	10000	5000
菜油	3000	1000
早籼稻	2000	400
甲醇	2000	1000
玻璃	5000	1000
菜籽	1000	500
菜粕	2000	1000
动力煤	20000	4000
粳稻	3000	500
晚籼稻	3000	500
硅铁	2000	500
锰硅	10000	2000
棉纱	1000	200
苹果 (非 7 月合约)	100	10
苹果 (7 月合约)	20	6

不得交割的客户具体见《郑州商品交易所期货交割细则》相关规定。

**第二十七条** 交割月前一个月的最后一个交易日收盘前，会员及客户应当将其期货合约持仓调整为最小交割单位的整倍数；自进入交割月起，会员及客户的持仓应当是最小交割单位的整倍数。

**第二十八条** 同一客户在不同期货公司会员处开有多个交易编码，各交易编码上所有持仓的合计数，不得超出一个客户的限仓数额。

**第二十九条** 非期货公司会员或者客户的持仓数量不得超过交易所规定的持仓限额。

非期货公司会员或客户超过持仓限额的，交易所按有关规定实行强行平仓。

## 第五章 交易限额制度

**第三十条** 交易所实行交易限额制度。交易限额是指交易所规定会员或者客户对某一合约在某一期限内开仓交易的最大数量。交易所可以根据市场情况，对不同的上市品种、合约，对部分或者全部的会员、客户，制定交易限额，具体标准由交易所另行公布。

套期保值交易的开仓数量不受本条前款限制。

**第三十一条** 同一客户在不同期货公司会员处开有多个交易编码，各交易编码上所有开仓交易数量的合计数，不得超过一个客户的交易限额。

**第三十二条** 非期货公司会员或者客户的开仓数量不得超过交易所规定的交易限额。对超过交易限额的非期货公司会员或者客户，交易所可以采取电话提示、要求报告情况、要求提交书面承诺、列入重点监管名单、暂停开仓交易等措施。

## 第六章 大户报告制度

**第三十三条** 期货交易实行大户报告制度。

非期货公司会员或者客户持有某期货合约数量达到交易所对其规定的持仓限量80%以上（含本数）或者交易所要求报告的，应当向交易所报告其资金、持仓等情况。根据市场风险状况，交易所可调整持仓报告水平。客户应当通过期货公司会员报告；委托境外经纪机构从事期货交易的客户，应当委托其境外经纪机构报告，境外经纪机构再委托期货公司会员报告。

非期货公司会员、客户应当保证所提供的大户持仓报告和其他材料的真实性、准确性和完整性。

**第三十四条** 交易过程中，非期货公司会员或者客户符合大户报告条件的，应当主动于下一交易日向交易所报告。非期货公司会员或者客户履行首次报告义务后，需再次报告或者补充报告的，交易所通知有关会员。

**第三十五条** 符合大户报告条件的非期货公司会员或客户应当向交易所提供下列材料：

- （一）《郑州商品交易所大户报告表》；
- （二）开户资料及当日结算单据；
- （三）交易所要求提供的其他材料。

**第三十六条** 期货公司会员、境外经纪机构应当对客户所提供的有关材料进行初审并保证报告材料的真实性和准确性。

## **第七章 强行平仓制度**

**第三十七条** 期货交易实行强行平仓制度。

强行平仓是指当会员、客户违反交易所相关业务规定时，交易所对其违规持有的相关期货合约持仓予以平仓的强制措施。

**第三十八条** 会员或者客户有下列情形之一的，交易所所有权进行强行平仓：

- （一）结算准备金余额小于零并未能在规定时间内补足的；
- （二）持仓量超出其限仓规定的；
- （三）进入交割月份的自然人持仓；
- （四）因违规受到交易所强行平仓处罚的；

(五) 根据交易所的紧急措施应予强行平仓的；

(六) 其他应予强行平仓的。

### **第三十九条 强行平仓的原则和程序：**

强行平仓先由会员自行实施，除交易所特别规定的时限外，会员未在 10 时 15 分之前平仓完毕的，交易所强制执行。

由会员自行平仓的，属前条第（一）、（二）、（三）项情形的，由会员自行确定，平仓结果符合交易所规定即可；属前条第（四）、（五）、（六）项情形的，由交易所确定。

由交易所强行平仓的，按以下程序实施：

（一）交易所按照会员提供的平仓名单进行强行平仓。

（二）会员没有提供平仓名单，属前条第（一）项的，按照上一交易日闭市后期货合约总持仓量由大到小顺序，先选择持仓量大的期货合约作为强行平仓的期货合约，再按照该会员客户该期货合约的净持仓亏损由大到小确定。多个会员均需要强行平仓的，按追加保证金由大到小的顺序，先强平需要追加保证金大的会员。

（三）属前条第（二）项的，按照超仓量由大到小的顺序，对非期货公司会员或客户进行强行平仓。

（四）会员没有提供平仓名单，属前条第（三）项的，按照上一交易日闭市后自然人期货合约持仓由大到小顺序进行强行平仓。

（五）会员没有提供平仓名单，属前条第（四）、（五）、（六）项的，强行平仓头寸由交易所根据涉及的会员和客户具体情况确定。

（六）会员同时满足属前条第（一）、（二）、（三）项情况，交易所先按第（二）、（三）项情况确定强行平仓头寸，再按第（一）项情况确定强行平仓头寸。

由于市场原因无法满足上述原则和程序的，交易所所有权择机强行平仓。

**第四十条** 交易所实施强行平仓，应当通知会员，会员应当通知客户。

属第三十八条第（一）、（二）、（三）项情况的，以交易所提供的结算结果为通知依据；属第三十八条第（四）、（五）、（六）项情况的，交易所向有关会员下达《强行平仓通知书》。

**第四十一条** 会员未在规定时间内自行平仓完毕的，剩余部分由交易所按第三十九条所确定的原则以市场价对会员直接执行强行平仓。

交易所强行平仓完毕后，应当将强行平仓结果随当日成交记录向会员发送，并将强行平仓记录予以存档。

强行平仓的价格通过市场交易形成。

**第四十二条** 由于涨跌停板或者其他市场原因无法在当日完成全部强行平仓的，剩余持仓可以顺延至下一交易日继续执行强行平仓，直至平仓完毕。

**第四十三条** 由于涨跌停板或者其他市场原因有关持仓的强行平仓只能延时完成的，因此发生的亏损仍由会员或者客户承担；未能完成平仓的，该持仓持有者须继续对此承担持仓责任或者交割义务。

**第四十四条** 除第三十八条第（四）项外，强行平仓产生的盈利

或者亏损均归持仓人。持仓人是客户的，强行平仓发生的亏损，客户所在会员先行承担后，自行向该客户追偿；持仓人是境外经纪机构客户的，境外经纪机构应辅助其委托交易结算的期货公司会员强行平仓，强行平仓后发生的亏损，由为该境外经纪机构交易结算的期货公司会员先行承担后，自行向该境外经纪机构追索；境外经纪机构承担损失后，自行向该客户追索。

本办法第三十八条第（四）项实施的强行平仓，亏损由持仓人承担，盈利按国家有关规定执行。

## 第八章 风险警示制度

**第四十五条** 期货交易实行风险警示制度。

交易所认为必要时，可以分别或者同时采取要求报告情况、谈话提醒、发布风险提示函等措施，以警示和化解风险。

**第四十六条** 出现下列情形之一的，交易所可以对指定的会员、境外经纪机构高管人员或者客户谈话提醒风险，或者要求会员、境外经纪机构、客户报告情况：

- （一）会员、境外经纪机构或者客户交易异常；
- （二）会员、境外经纪机构或者客户持仓异常；
- （三）会员资金异常；
- （四）会员、境外经纪机构或者客户涉嫌违规、违约；
- （五）交易所接到涉及会员、境外经纪机构或者客户的投诉；
- （六）会员、境外经纪机构涉及执法调查；
- （七）交易所认定的其他情况。

交易所通过电话提醒的，应当保留电话录音；通过当面谈话的，应当保存谈话记录。

交易所要求会员、境外经纪机构或者客户报告情况的，报告方式和报告内容参照大户报告制度执行。

**第四十七条** 会员、境外经纪机构或者客户有违规嫌疑、交易头寸有较大风险的，交易所可以对会员、境外经纪机构或者客户发出书面的风险提示函。

**第四十八条** 发生下列情形之一的，交易所可以向全体或者部分会员、境外经纪机构和客户发出风险提示函：

- （一）期货价格出现异常；
- （二）期货价格和现货价格出现较大差距；
- （三）国内期货价格和国际市场价格出现较大差距；
- （四）交易所认定的其他异常情况。

## **第九章 附 则**

**第四十九条** 违反本办法规定的，交易所按《郑州商品交易所违规处理办法》有关规定处理。

**第五十条** 有关夜盘交易相关的风险控制业务，《郑州商品交易所夜盘交易细则》有特殊规定的，从其规定。

**第五十一条** 本办法解释权属郑州商品交易所。

**第五十二条** 本办法自 2018 年 11 月 9 日起施行。

附件:平仓数量的分配方法及步骤

步骤	分配条件	分配数	分配比例	分配对象	结果
1	盈利 2 倍的投机持仓数量 $\geq$ 申报平仓数量	申报平仓数量	申报平仓数量 $\div$ 盈利 2 倍的投机持仓数量	盈利 2 倍的投机客户	分配完毕
2	盈利 2 倍的投机持仓数量 $<$ 申报平仓数量	盈利 2 倍的投机持仓数量	盈利 2 倍的投机持仓数量 $\div$ 申报平仓数量	申报平仓客户	有剩余再按步骤 3, 4 分配
3	盈利 1 倍的投机持仓数量 $\geq$ 剩余申报平仓数量 1	剩余申报平仓数量 1	剩余申报平仓数量 1 $\div$ 盈利 1 倍的投机持仓数量	盈利 1 倍的投机客户	分配完毕
4	盈利 1 倍的投机持仓数量 $<$ 剩余申报平仓数量 1	盈利 1 倍的投机持仓数量	盈利 1 倍的投机持仓数量 $\div$ 剩余申报平仓数量 1	剩余申报平仓客户	有剩余再按步骤 5, 6 分配
5	盈利 1 倍以下的投机持仓数量 $\geq$ 剩余申报平仓数量 2	剩余申报平仓数量 2	剩余申报平仓数量 2 $\div$ 盈利 1 倍以下的投机持仓数量	盈利 1 倍以下的投机客户	分配完毕
6	盈利 1 倍以下的投机持仓数量 $<$ 剩余申报平仓数量 2	盈利 1 倍以下的投机持仓数量	盈利 1 倍以下的投机持仓数量 $\div$ 剩余申报平仓数量 2	剩余申报平仓客户	有剩余再按步骤 7, 8 分配
7	盈利 2 倍的保值持仓数量 $\geq$ 剩余申报平仓数量 3	剩余申报平仓数量 3	剩余申报平仓数量 3 $\div$ 盈利 2 倍的保值持仓数量	盈利 2 倍的保值客户	分配完毕
8	盈利 2 倍的保值持仓数量 $<$ 剩余申报平仓数量 3	盈利 2 倍的保值持仓数量	盈利 2 倍的保值持仓数量 $\div$ 剩余申报平仓数量 3	剩余申报平仓客户	有剩余不再分配

注：1. 剩余申报平仓数量 1=申报平仓数量-盈利 2 倍的投机持仓数量；

2. 剩余申报平仓数量 2=剩余申报平仓数量 1-盈利 1 倍的投机持仓数量；

3. 剩余申报平仓数量 3=剩余申报平仓数量 2-盈利 1 倍以下的投机持仓数量；

4. 投机持仓数量和保值持仓数量是指在平仓范围内盈利客户的持仓数量。

## 郑州商品交易所套期保值管理办法修订案

(2018年10月23日郑州商品交易所第六届理事会第十二次会议审议通过)

对《郑州商品交易所套期保值管理办法》作如下修改：

一、新增第三条“需进行套期保值交易的客户应向其开户的期货公司会员申报，由期货公司会员进行审核后，按本办法向交易所办理申报手续；非期货公司会员直接向交易所办理申报手续。委托境外经纪机构从事期货交易的客户进行套期保值，应当委托其境外经纪机构办理，境外经纪机构再委托期货公司会员办理。”

二、原第四条修改为：“申请套期保值交易的非期货公司会员或者客户必须具备与套期保值交易品种相关的经营资格。”

三、原第五条修改为：“会员、境外经纪机构和客户在交易所从事套期保值业务，应当遵守本办法。”

四、删除原第六条。

五、原第七条修改为：“申请一般月份套期保值持仓额度的非期货公司会员或客户，应当填写《郑州商品交易所一般月份套期保值持仓额度申请（审批）表》，并向交易所提交下列证明材料：

“（一）企业营业执照副本或者公司注册证书等能够证明经营范围的文件；

“（二）企业近两年的现货经营业绩；

“（三）企业套期保值交易方案（主要内容包括风险来源分析、保值目标、预期交割或平仓的数量）；

“（四）交易所要求的其他证明材料。”

六、删除原第十一条。

七、原第十二条第一款修改为：“申请临近交割月份套期保值持仓额度的非期货公司会员或客户，应当填写《郑州商品交易所临近交割月份套期保值持仓额度申请（审批）表》，提交企业营业执照副本或者公司注册证书等能够证明经营范围的文件，并根据企业性质向交易所提交相关证明材料。”

作上述修订后，原条款顺序相应调整。

# 郑州商品交易所套期保值管理办法

(2008年1月7日第五届理事会通讯会议修改,2008年1月15日发布,自发布之日起施行;2009年3月28日第五届理事会通讯会议修改,2009年4月15日发布,自2009年4月20日施行;2011年10月17日第五届理事会第七次通讯会议修改,2011年10月24日发布,自2011年10月28日施行;2013年6月14日第五届理事会第四次通讯会议修改,2013年7月9日发布,自2013年9月16日起施行;2015年5月22日第五届理事会第四次通讯会议修改,2016年1月19日发布,自2016年1月28日施行;2017年2月6日第五届理事会第二次通讯会议修订,2017年3月7日发布,自发布之日起施行;2018年10月23日第六届理事会第十二次会议修订,2018年11月9日发布,自2018年11月9日起施行)

## 第一章 总则

**第一条** 为促进套期保值业务规范发展,充分发挥套期保值功能,根据《郑州商品交易所交易规则》等有关规定,制定本办法。

**第二条** 郑州商品交易所(以下简称交易所)套期保值持仓额度实行审批制。

按套期保值持仓额度使用阶段,套期保值持仓额度分为一般月份(本办法指期货合约挂牌至交割月前一个月第15个日历日)套期保值持仓额度和临近交割月份(本办法指交割月前一个月第16个日历日至合约最后交易日)套期保值持仓额度。

按套期保值持仓额度审批方向,套期保值持仓额度分为买入套期保值持仓额度和卖出套期保值持仓额度。买入套期保值持仓额度可以用于建立期货合约买方向、看涨期权合约买方向、看跌期权合约卖方向的套期保值持仓;卖出套期保值持仓额度可以用于建立期货合约卖方向、看涨期权合约卖方向、看跌期权合约买方向的套期保值持仓。

**第三条** 需进行套期保值交易的客户应向其开户的期货公司会员申报,由期货公司会员进行审核后,按本办法向交易所办理申报手续;非期货公司会员直接向交易所办理申报手续。委托境外经纪机构从事期货交易的客户进行套期保值,应当委托其境外经纪机构办理,境外经纪机构再委托期货公司会员办理。

**第四条** 期货公司会员和非期货公司会员可以电子方式或纸质方式向交易所提交套期保值申请及相关材料。

以电子方式提交套期保值申请的,期货公司会员应根据客户申报的材料,通过会员服务系统向交易所提交相关申请信息,非期货公司会员直接通过会员服务系统向交易所提交相关申请信息。客户和非期货公司会员的纸质套期保值申请材料应由会员保存完整,以备交易所抽查审核。

**第五条** 申请套期保值交易的非期货公司会员或者客户必须具备与套期保值交易品种相关的经营资格。

**第六条** 会员、境外经纪机构和客户在交易所从事套期保值业务,应当遵守本办法。

## **第二章 一般月份套期保值持仓额度的申请与审批**

**第七条** 申请一般月份套期保值持仓额度的非期货公司会员或客户,应当填写《郑州商品交易所一般月份套期保值持仓额度申请(审批)表》,并向交易所提交下列证明材料:

(一)企业营业执照副本或者公司注册证书等能够证明经营范围的文件;

(二)企业近两年的现货经营业绩;

(三)企业套期保值交易方案(主要内容包括风险来源分析、保值目标、预期交割或平仓的数量);

（四）交易所要求的其他证明材料。

**第八条** 一般月份套期保值持仓额度的申请应当在套期保值期货合约交割月前一个月的第5个日历日之前的交易日提出，逾期交易所不再受理该合约套期保值持仓额度的申请。会员和客户可以一次申请多个合约的一般月份套期保值持仓额度。

**第九条** 交易所对一般月份套期保值持仓额度的申请，按主体资格是否符合，套期保值品种、交易部位、买卖数量、套期保值时间与其生产经营规模、历史经营状况、资金等情况是否相适应进行审核，确定其一般月份套期保值持仓额度。一般月份套期保值持仓额度不超过其所提供的一般月份套期保值证明材料中所申报的数量。

**第十条** 交易所自收到一般月份套期保值持仓额度申请之日起5个交易日内进行审核，并按下列情况分别处理：

- （一）对符合套期保值条件的，通知其准予办理；
- （二）对不符合套期保值条件的，通知其不予办理；
- （三）对相关证明材料不足的，通知申请人补充相关证明材料。

### 第三章 临近交割月份套期保值持仓额度的申请与审批

**第十一条** 申请临近交割月份套期保值持仓额度的非期货公司会员或客户，应当填写《郑州商品交易所临近交割月份套期保值持仓额度申请（审批）表》，提交企业营业执照副本或者公司注册证书等能够证明经营范围的文件，并根据企业性质向交易所提交相关证明材料。

生产企业应提交的证明材料：

- （一）上一年度生产计划书；
- （二）卖出套保需提供本次保值额度所对应的现货仓单或拥有实物的其他凭证（购销合同或发票）。

加工企业应提交的证明材料：

(一) 上一年度生产计划书、本次保值额度所对应的加工订单；  
(二) 卖出套保需提供本次保值额度所对应的现货仓单或拥有实物的其他凭证（购销合同或发票）；  
(三) 买入套保需提供本次保值额度所对应的购销计划（合同）。  
贸易及其他企业应提交的证明材料：

(一) 卖出套保需提供本次保值额度所对应的现货仓单或拥有实物的其他凭证（购销合同或发票）；  
(二) 买入套保需提供本次保值额度所对应的购销计划（合同）。

除上述证明材料外，交易所认为有必要的还可以要求会员或客户提供其他证明材料。

**第十二条** 临近交割月份套期保值持仓额度的申请应当在套期保值期货合约交割月前二个月第 20 个日历日至交割月前一个月第 5 个日历日之间的交易日提出，逾期交易所不再受理该合约套期保值持仓额度的申请。

交易所在申请截止日后的 5 个交易日内集中审批，并按下列情况分别处理：

- (一) 对符合套期保值条件的，通知其准予办理；
- (二) 对不符合套期保值条件的，通知其不予办理；
- (三) 对相关证明材料不足的，通知申请人补充相关证明材料。

**第十三条** 对临近交割月份套期保值持仓额度的申请，交易所将按照会员或客户的交易部位和数量、现货经营状况、对应期货及期权合约整体持仓情况、可供交割商品在交易所指定交割仓库库存数量以及期现价格是否背离等，确定其临近交割月份套期保值持仓额度。临近交割月份套期保值持仓额度不超过其所提供的相关套期保值证明材料中所申报的数量。

全年各合约月份临近交割月份套期保值持仓额度累计不超过其当年生产能力、当年生产计划或上一年度该商品经营数量。

## 第四章 套期保值交易

**第十四条** 获批套期保值持仓额度的会员和客户，可通过交易指令直接建立套期保值持仓，也可通过对历史投机持仓确认的方式建立套期保值持仓。

**第十五条** 期权行权时，期权套期保值持仓转化为相应的期货套期保值持仓。

**第十六条** 套期保值持仓额度自交割月第一个交易日起(含该日)不得重复使用。

**第十七条** 交易所可以对套期保值的保证金、手续费采取优惠措施。

## 第五章 套期保值监督与管理

**第十八条** 交易所对会员或客户获批套期保值持仓额度的使用情况进行监督管理。

**第十九条** 交易所对会员及客户提供的有关生产经营状况、资信情况及期货、现货市场交易行为可随时进行监督和调查，会员及相关客户应予协助和配合。

交易所所有权要求获批套期保值持仓额度的会员或客户报告现货、期货及期权交易情况。

**第二十条** 会员或客户在获批套期保值持仓额度期间，企业情况发生重大变化时，应及时向交易所报告。交易所所有权根据市场情况和套期保值企业的生产经营状况对会员或客户套期保值持仓额度进行调整。

**第二十一条** 会员或客户需要调整套期保值持仓额度时，应当及时向交易所提出书面变更申请。

**第二十二条** 获批套期保值持仓额度的会员或客户利用套期保值额度，频繁进行开平仓交易、影响或者企图影响市场价格的，交易所所有权对其采取谈话提醒、书面警示、调整或者取消其套期保值持仓额度、限制开仓、限期平仓、强行平仓等措施。

**第二十三条** 交易所强制减仓的，按先投机后套期保值的顺序进行减仓。

**第二十四条** 会员及客户在进行套期保值申请和交易时，存在欺诈或者违反交易所规定行为的，交易所所有权不受理其套期保值申请、调整或者取消其套期保值持仓额度，并按照《郑州商品交易所违规处理办法》的有关规定处理。

## 第六章 附 则

**第二十五条** 本办法解释权属于郑州商品交易所。

**第二十六条** 本办法自 2018 年 11 月 9 日起施行。

# 郑州商品交易所异常交易行为管理办法修 订案

(2018年10月23日郑州商品交易所第六届理事会第十二次  
会议审议通过)

对《郑州商品交易所异常交易行为管理办法》作如下修改：

一、第二条修改为：“郑州商品交易所（以下简称交易所）对期货交易行为进行监管，发现异常情况的，可以启动异常交易行为处理程序，对有关会员、境外经纪机构或者客户采取相应自律监管措施。”

二、第三条修改为：“期货公司会员、境外经纪机构应当切实履行客户交易行为管理职责，及时发现、及时报告、及时制止客户的异常交易行为，不得纵容、诱导、怂恿、支持客户进行异常交易。”

三、第四条修改为：“非期货公司会员、客户参与期货交易应当遵守法律、法规、规章和交易所业务规则，接受交易所自律监管，自觉规范交易行为。客户应当接受期货公司会员、境外经纪机构对其交易行为的合法合规性管理。”

四、第二十二条修改为：“期货公司会员、境外经纪机构应当密切关注客户的交易行为，积极防范客户在交易中可能出现的异常交易行为，引导客户理性、合规参与交易。”

“期货公司会员、境外经纪机构发现客户出现本办法第五条规定的异常交易行为之一的，应当及时予以提醒、劝阻和制止。”

五、第二十三条修改为：“交易所对存在异常交易行为的客户采取自律监管措施的，期货公司会员、境外经纪机构应当及时通知客户，并采取有效措施规范客户交易行为。”

“客户出现本办法第五条所列异常交易行为之一的，交易所视情节轻重，可以对期货公司会员、境外经纪机构采取提示、约见谈话、发出监管警示函、发出监管意见函等自律监管措施。”

六、第二十四条第一款修改为：“期货公司会员、境外经纪机构具有下列情形之一的，交易所可以责令其改正，并采取提示、约见谈话、发出监管警示函、发出监管意见函等自律监管措施；情节严重的，依据《郑州商品交易所违规处理办法》有关规定进行处理”。

七、第二十五条修改为：“期货公司会员、境外经纪机构未尽到相关义务，交易所已向同一期货公司会员发出两次监管警示函的，第三次向该期货公司会员发出监管意见函。”

# 郑州商品交易所异常交易行为管理办法

(2018年8月20日第六届理事会第九次会议审议通过,2018年8月24日发布,自2018年9月17日起施行;2018年10月23日第六届理事会第十二次会议修订,2018年11月9日发布,自2018年11月9日起施行)

## 第一章 总 则

**第一条** 为加强期货市场管理,规范期货交易行为,保障期货市场参与者合法权益,根据《郑州商品交易所交易规则》,制定本办法。

**第二条** 郑州商品交易所(以下简称交易所)对期货交易行为进行监管,发现异常情况的,可以启动异常交易行为处理程序,对有关会员、境外经纪机构或者客户采取相应自律监管措施。

**第三条** 期货公司会员、境外经纪机构应当切实履行客户交易行为管理职责,及时发现、及时报告、及时制止客户的异常交易行为,不得纵容、诱导、怂恿、支持客户进行异常交易。

**第四条** 非期货公司会员、客户参与期货交易应当遵守法律、法规、规章和交易所业务规则,接受交易所自律监管,自觉规范交易行为。客户应当接受期货公司会员、境外经纪机构对其交易行为的合法合规性管理。

## 第二章 异常交易行为认定

**第五条** 期货交易出现以下情形之一的,交易所认定为异常交易行为:

- (一) 自成交行为,即以自己为交易对象进行自买自卖的行为;
- (二) 频繁报撤单行为,即频繁申报并撤销定单的行为;

(三) 大额报撤单行为，即多次申报并撤销大额定单的行为；

(四) 实际控制关系账户合并持仓超限行为，即被交易所认定为具有实际控制关系的一组账户持仓合并计算后超出交易所规定持仓限额的行为；

(五) 程序化交易扰乱交易秩序行为，即采取程序化交易方式下达交易指令，可能影响交易所系统安全或者正常交易秩序的行为；

(六) 中国证监会规定或者交易所认定的其他行为。

**第六条** 客户或者一组实际控制关系账户合并计算后出现以下情形之一的，即达到自成交、频繁报撤单、大额报撤单、实际控制关系账户合并持仓超限等异常交易行为处理标准：

(一) 单个交易日在某一合约自成交 5 次以上；

(二) 单个交易日在某一合约撤销定单次数 500 次以上；或者当某个交易日某一合约出现涨（跌）停板后，当日在该合约涨（跌）停板价位买（卖）单撤销定单次数 100 次以上；

(三) 单个交易日在某一合约撤销定单次数 50 次以上且每次撤销定单量 800 手以上；

(四) 一组实际控制关系账户持仓合并计算后超出交易所规定的持仓限额。

**第七条** 一组实际控制关系账户内的客户之间相互成交视为自成交。

**第八条** 套期保值交易产生的自成交、频繁报撤单、大额报撤单行为不构成异常交易行为。

**第九条** 市价指令、套利指令产生的自成交、频繁报撤单、大额报撤单行为不构成异常交易行为。

附加立即成交剩余指令自动撤销（FAK）、立即全部成交否则自动撤销（FOK）指令属性的交易指令产生的自成交、频繁报撤单、大额报撤单行为不构成异常交易行为。

**第十条** 做市交易产生的频繁报撤单行为不构成异常交易行为。

**第十一条** 客户或者一组实际控制关系账户单个交易日在两个以上合约因自成交、频繁报撤单、大额报撤单或者实际控制关系账户合并持仓超限达到异常交易行为处理标准的，同一种异常交易行为按照发生一次认定。

### 第三章 异常交易行为处理

**第十二条** 客户自成交、频繁报撤单、大额报撤单行为达到处理标准的，交易所按照以下程序进行处理：

（一）第一次达到处理标准的，交易所于当日对客户所在期货公司会员进行提示，要求其及时将交易所提示转达客户，对客户进行教育、引导、劝阻及制止；

（二）第二次达到处理标准的，交易所将该客户列入重点监管名单；

（三）第三次达到处理标准的，交易所于当日闭市后对该客户采取限制开仓的自律监管措施，限制开仓时间不少于 1 个月。

**第十三条** 当某个交易日某一合约出现涨（跌）停板后，客户当日在涨（跌）停板价位买（卖）单撤销定单次数 100 次以上且撤销定

单手数合计 10000 手以上的，视为频繁报撤单情节严重的行为，交易所于当日闭市后对该客户采取限制开仓的自律监管措施，限制开仓时间不少于 1 个月。

**第十四条** 同一客户异常交易行为发生在两个以上期货公司会员的，交易所对自成交、频繁报撤单、大额报撤单发生次数最多的期货公司会员进行提示。

**第十五条** 非期货公司会员参与交易，自成交、频繁报撤单、大额报撤单行为达到处理标准的，交易所按照以下程序进行处理：

（一）第一次达到处理标准的，交易所对该非期货公司会员进行提示；

（二）第二次达到处理标准的，交易所约见该非期货公司会员高级管理人员谈话；

（三）第三次达到处理标准的，交易所对该非期货公司会员采取限制开仓的自律监管措施，限制开仓时间不少于 3 个月。

**第十六条** 一组实际控制关系账户出现自成交、频繁报撤单和大额报撤单行为，达到异常交易处理标准的，交易所按照本办法第十二条至第十五条的规定进行处理。

**第十七条** 一组实际控制关系账户发生合并持仓超限行为，交易所于当日闭市后通知客户所在期货公司会员，要求客户自行平仓。该组实际控制关系账户持仓分布在不同期货公司会员的，交易所通知持仓最大客户所在的期货公司会员。

客户在规定时限内未自行平仓完毕的，由交易所执行强行平仓。

由交易所执行强行平仓的，当日闭市后对该组实际控制关系账户采取限制开仓的自律监管措施，限制开仓时间不少于1个月。

**第十八条** 一组实际控制关系账户合并持仓超限，交易所除按照本办法第十七条处理外，还应当按照以下程序进行处理：

（一）第一次达到处理标准的，交易所将该组实际控制关系账户列入重点监管名单；

（二）第二次达到处理标准的，交易所于下一交易日对该组实际控制关系账户采取限制开仓的自律监管措施，限制开仓时间不少于10个交易日；

（三）第三次达到处理标准的，交易所于下一交易日对该组实际控制关系账户采取限制开仓的自律监管措施，限制开仓时间不少于6个月。

**第十九条** 一组实际控制关系账户当日结算时在某合约发生合并持仓超限行为，但其在该合约的持仓未超过上一交易日结算时交易所持仓限额，可以豁免本办法第十八条的自律监管措施。

一组实际控制关系账户当日结算时在某合约发生合并持仓超限行为，因为市场原因在下一交易日无法平仓且结算时继续持仓超限的，下一交易日可以豁免本办法第十八条的自律监管措施。

前两款豁免本办法第十八条自律监管措施的合并持仓超限行为，其超过持仓限额的部分仍应当按照本办法第十七条有关规定执行。

**第二十条** 客户采取程序化交易方式下达交易指令，可能影响交易所系统安全或者正常交易秩序的，交易所可以采取约见谈话、限制

开仓等自律监管措施。

**第二十一条** 客户出现异常交易行为的，除按照本办法规定的程序处理外，交易所视情节轻重还可以采取要求提交书面说明、书面警示、约见谈话、限制出金、限期平仓、限制开仓、强行平仓等自律监管措施；情节严重的，依据《郑州商品交易所违规处理办法》有关规定进行处理。

## 第四章 监督责任

**第二十二条** 期货公司会员、境外经纪机构应当密切关注客户的交易行为，积极防范客户在交易中可能出现的异常交易行为，引导客户理性、合规参与交易。

期货公司会员、境外经纪机构发现客户出现本办法第五条规定的异常交易行为之一的，应当及时予以提醒、劝阻和制止。

**第二十三条** 交易所对存在异常交易行为的客户采取自律监管措施的，期货公司会员、境外经纪机构应当及时通知客户，并采取有效措施规范客户交易行为。

客户出现本办法第五条所列异常交易行为之一的，交易所视情节轻重，可以对期货公司会员、境外经纪机构采取提示、约见谈话、发出监管警示函、发出监管意见函等自律监管措施。

**第二十四条** 期货公司会员、境外经纪机构具有下列情形之一的，交易所可以责令其改正，并采取提示、约见谈话、发出监管警示函、发出监管意见函等自律监管措施；情节严重的，依据《郑州商品交易所违规处理办法》有关规定进行处理：

（一）未及时、准确地向客户传达、送达交易所有关自律监管措施；

（二）未采取有效措施制止客户异常交易行为；

（三）纵容、诱导、怂恿、支持客户进行异常交易；

（四）未按照交易所要求尽责对涉嫌违法违规行为协助调查或者存在拖延、隐瞒和故意遗漏等行为；

（五）交易所认定的其他情形。

**第二十五条** 期货公司会员、境外经纪机构未尽到相关义务，交易所已向同一期货公司会员发出两次监管警示函的，第三次向该期货公司会员发出监管意见函。

## 第五章 附 则

**第二十六条** 除本办法另有规定外，非期货公司会员按照客户的有关规定执行。

**第二十七条** 本办法所称期货交易包括以期货合约和期权合约为交易标的的交易活动。

**第二十八条** 本办法规定的异常交易行为次数、监管措施次数以一个自然年度为期间进行统计。

**第二十九条** 本办法所称“以上”、“以下”包含本数。

**第三十条** 本办法解释权属于郑州商品交易所。

**第三十一条** 本办法自 2018 年 11 月 9 日起施行。

# 郑州商品交易所实际控制关系账户管理办 法修订案

(2018年10月23日郑州商品交易所第六届理事会第十二次  
会议审议通过)

对《郑州商品交易所实际控制关系账户管理办法》作如下修改：

一、第二条修改为：“期货公司会员、境外经纪机构应当告知客户具有报备实际控制关系账户的义务，切实履行对客户实际控制关系账户的管理职责，对实际控制关系账户的报备、管理等相关材料登记存档、妥善保管，并对客户报备内容保密。”

二、第三条修改为：“非期货公司会员、客户参与期货交易应当遵守法律、法规、规章和交易所业务规则，接受交易所对其实际控制关系账户的管理。客户还应当接受期货公司会员、境外经纪机构对其实际控制关系账户的管理。”

三、第十条修改为：“交易所在日常自律监管中发现具有疑似实际控制关系但尚未报备的账户，开户人为客户的，交易所可以通过期货公司会员进行询问，期货公司会员应当及时将交易所询问向客户进行转达；开户人为非期货公司会员的，交易所可以直接询问。客户委托境外经纪机构从事期货交易的，期货公司会员应及时将交易所询问向境外经纪机构进行转达，境外经纪机构应及时将相关询问向客户进行转达。

“对于交易所的询问，非期货公司会员、客户应当以书面形式及时回复，并提供相关材料；相关期货公司会员、境外经纪机构应及时将客户的回复及相关说明材料报送交易所。”

四、第十三条第一款修改为：“期货公司会员、境外经纪机构具有下列情形之一的，交易所责令改正，并采取电话提示、约见谈话、发出监管警示函、发出监管意见函等自律监管措施；情节严重的，交易所将依据《郑州商品交易所违规处理办法》有关规定进行处理”。

# 郑州商品交易所实际控制关系账户

## 管理办法

(2018年8月20日第六届理事会第九次会议审议通过,2018年8月24日发布,自2018年9月17日起施行;2018年10月23日第六届理事会第十二次会议修订,2018年11月9日发布,自2018年11月9日起施行)

### 第一章 总 则

**第一条** 为加强郑州商品交易所(以下简称交易所)实际控制关系账户管理,维护市场秩序,促进期货市场健康发展,依据《郑州商品交易所交易规则》,制定本办法。

**第二条** 期货公司会员、境外经纪机构应当告知客户具有报备实际控制关系账户的义务,切实履行对客户实际控制关系账户的管理职责,对实际控制关系账户的报备、管理等相关材料登记存档、妥善保存,并对客户报备内容保密。

**第三条** 非期货公司会员、客户参与期货交易应当遵守法律、法规、规章和交易所业务规则,接受交易所对其实际控制关系账户的管理。客户还应当接受期货公司会员、境外经纪机构对其实际控制关系账户的管理。

### 第二章 实际控制关系账户的认定

**第四条** 实际控制是指行为人(包括个人、单位)对他人(包括个人、单位)期货账户具有管理、使用、收益或者处分等权限,从而对他人交易决策拥有决定权或者重大影响的行为或者事实。

**第五条** 根据实质重于形式的原则,具有下列情形之一的,应当

认定为行为人对他人期货账户的交易具有实际控制关系：

（一）行为人作为他人的控股股东，即行为人的出资额占他人资本总额 50%以上或者其持有的股份占他人股本总额 50%以上的股东，出资额或者持有股份的比例虽然不足 50%，但依其出资额或者持有的股份所享有的表决权已足以对股东会、股东大会的决议产生重大影响的股东；

（二）行为人作为他人的开户授权人、指定下单人、资金调拨人、结算单确认人或者其他形式的委托代理人；

（三）行为人作为他人的法定代表人、主要合伙人、董事、监事、高级管理人员等，或者行为人与他人的法定代表人、主要合伙人、董事、监事、高级管理人员等一致的；

（四）行为人与他人之间存在配偶关系；

（五）行为人与他人之间存在父母、子女、兄弟姐妹等关系，且对他人期货账户的日常交易决策具有决定权或者重大影响；

（六）行为人通过投资关系、协议、融资安排或者其他安排，能够对他人期货账户的日常交易决策具有决定权或者重大影响；

（七）行为人与他人交易行为具有一致性且存在一方向另一方提供期货交易资金的，或者行为人与他人交易行为具有一致性且双方交易终端信息一致的；

（八）行为人对两个或者多个他人期货账户的日常交易决策具有决定权或者重大影响；

（九）中国证监会规定或者交易所认定的其他情形。

### 第三章 实际控制关系账户的报备

**第六条** 客户应当按照中国期货市场监控中心（以下简称监控中心）相关规定履行实际控制关系账户的报备、变更和解除程序。交易所与监控中心建立实际控制关系账户信息共享机制，按照规定使用实际控制关系账户信息。

**第七条** 符合实际控制关系账户认定标准的非期货公司会员应当在成为交易所会员后 10 个交易日内直接向交易所进行报备。

**第八条** 非期货公司会员实际控制关系发生变更的，应当在发生变更之日起 10 个交易日内主动向交易所报备变更情况。

**第九条** 申请解除实际控制关系的客户应当按照规定向监控中心提出申请，由监控中心将解除申请转交易所审核，客户应当按照交易所要求提交相关说明材料。

申请解除实际控制关系的非期货公司会员可以直接向交易所提出申请，并应当按照交易所要求提交相关说明材料。

**第十条** 交易所在日常自律监管中发现具有疑似实际控制关系但尚未报备的账户，开户人为客户的，交易所可以通过期货公司会员进行询问，期货公司会员应当及时将交易所询问向客户进行转达；开户人为非期货公司会员的，交易所可以直接询问。客户委托境外经纪机构从事期货交易的，期货公司会员应及时将交易所询问向境外经纪机构进行转达，境外经纪机构应及时将相关询问向客户进行转达。

对于交易所的询问，非期货公司会员、客户应当以书面形式及时回复，并提供相关材料；相关期货公司会员、境外经纪机构应及时将

客户的回复及相关说明材料报送交易所。

**第十一条** 经交易所询问，非期货公司会员、客户承认存在实际控制关系的，应当按照规定的报备流程进行报备；非期货公司会员、客户否认存在实际控制关系的，应当签署《合规声明及承诺书》，交易所将对相关说明材料进行审核，分别作出以下处理：

（一）非期货公司会员、客户提交的说明材料事实理由不充分，经交易所调查认为符合实际控制关系认定标准的，交易所要求其报备，非期货公司会员、客户未在规定时间内完成报备的，交易所可以依据规则认定为具有实际控制关系；若经调查暂无法认定是否符合实际控制关系认定标准的，交易所可将其列入重点监控名单；

（二）非期货公司会员、客户提交的说明材料事实理由充分，确不属于实际控制关系的，交易所不认定为具有实际控制关系。

**第十二条** 在交易所询问、调查及认定过程中对于存在以下情形的非期货公司会员、客户，根据情况分别作出以下自律监管措施；情节严重的，交易所将依据《郑州商品交易所违规处理办法》有关规定进行处理：

（一）不回复或不如实回复交易所询问、隐瞒事实真相、或者故意回避的，交易所可以采取约见谈话、书面警示、限制出金、限制开仓等措施；

（二）不如实报备实际控制关系，经交易所询问后报备的非期货公司会员、客户，交易所可以采取口头警示、要求提交书面说明等措施；

（三）不如实报备实际控制关系、不回复或不如实回复交易所询问，经交易所调查认定为具有实际控制关系的非期货公司会员、客户，交易所可以采取约见谈话、书面警示、限制出金、限制开仓等措施。

**第十三条** 期货公司会员、境外经纪机构具有下列情形之一的，交易所责令改正，并采取电话提示、约见谈话、发出监管警示函、发出监管意见函等自律监管措施；情节严重的，交易所将依据《郑州商品交易所违规处理办法》有关规定进行处理：

（一）未及时、准确、完整地向客户传达交易所有关实际控制关系账户的规定；

（二）未及时、准确、完整地实际完成实际控制关系账户相关信息录入、更新；

（三）纵容、诱导、怂恿、协助客户进行虚假申报、隐瞒事实真相；

（四）未按照规定妥善保存客户资料；

（五）未按照交易所要求协助询问客户实际控制关系账户情况的或者存在拖延、隐瞒和故意遗漏等行为；

（六）交易所认定的其他情形。

#### **第四章 实际控制关系账户的管理**

**第十四条** 交易所在执行持仓限额、交易限额、异常交易行为管理等制度和规定时，对一组实际控制关系账户的交易、持仓等合并计算。

**第十五条** 一组实际控制关系账户内均为客户的，其合并计算的

持仓量不得超过单个客户的持仓限额。

一组实际控制关系账户内包含非期货公司会员的，其合并计算的持仓量不得超过单个非期货公司会员的持仓限额。

**第十六条** 一组实际控制关系账户在某一期限内开仓交易量合并计算超过交易所规定单个客户交易限额的，交易所可以依据《郑州商品交易所风险控制管理办法》有关规定进行处理。

**第十七条** 一组实际控制关系账户自成交、频繁报撤单、大额报撤单和持仓合并计算后达到《郑州商品交易所异常交易行为管理办法》异常交易行为处理标准的，交易所对该组实际控制关系账户按照异常交易行为采取自律监管措施。

## 第五章 附 则

**第十八条** 除本办法另有规定外，非期货公司会员按照客户的相关规定执行。

**第十九条** 本办法解释权属于郑州商品交易所。

**第二十条** 本办法自 2018 年 11 月 9 日起施行。

## 郑州商品交易所违规处理办法修订案

(2018年10月23日郑州商品交易所第六届理事会第十二次会议审议通过)

对《郑州商品交易所违规处理办法》作如下修改：

一、第二条修改为：“本办法所称违规行为是指会员、境外经纪机构、做市商、客户、交割仓库（交割厂库）、期货保证金指定存管银行（以下简称存管银行）、质量检验机构、信息服务机构、期货市场其他参与者及其工作人员违反郑州商品交易所（以下简称交易所）章程、交易规则及其他有关规定的行为”。

二、第四条修改为：“会员、境外经纪机构、做市商、客户、交割仓库、存管银行及期货市场其他参与者违规行为已受到中国证监会处罚的，交易所在决定纪律处分时可免除或减轻纪律处分”。

三、第六条第一款修改为：“稽查是指交易所根据交易所的各项规章制度，对会员、境外经纪机构、做市商、客户、交割仓库、存管银行、质量检验机构、信息服务机构及期货市场其他参与者的业务活动进行的监督和检查。稽查包括常规稽查和立案调查。稽查方式包括约谈、书面调查、现场检查等”。

增加第六条第二款：“交易所可以根据其各项规章制度，对会员、境外经纪机构、做市商、客户、交割仓库、存管银行、质量检验机构、信息服务机构及期货市场其他参与者的业务活动进行定期和不定期

的常规稽查”。

四、第七条增加第（二）项：“（二）要求会员、境外经纪机构、做市商、客户、交割仓库、存管银行、质量检验机构、信息服务机构及期货市场其他参与者提供年报、第三方审计报告等”。

第七条原第（二）项修改为：“（三）对会员、境外经纪机构、做市商、客户、交割仓库、存管银行、质量检验机构、信息服务机构等期货市场参与者进行调查、取证、约谈等”。

第七条原第（三）项修改为：“（四）要求会员、境外经纪机构、做市商、客户、交割仓库、存管银行、质量检验机构、信息服务机构等被调查者申报、陈述、解释、说明有关情况”。

第七条增加第（五）项：“（五）查询会员、境外经纪机构、做市商、客户期货业务相关的银行账户”。

第七条增加第（六）项：“（六）检查会员、境外经纪机构、做市商、客户期货业务相关的交易、结算及财务等电脑技术系统”。

五、第八条修改为：“会员、境外经纪机构、做市商、客户、交割仓库、存管银行、质量检验机构、信息服务机构及期货市场其他参与者应自觉接受交易所的监督检查，配合交易所履行监督管理职责”。

六、第九条修改为：“交易所设立投诉、举报机制。投诉、举报人应身份真实、明确；投诉、举报人不愿公开其身份的，交易所为其保密”。

七、第十四条第二款修改为：“书证、物证的提取应当制作提取笔录，注明提取的时间和地点，并由被调查人签名。被调查人拒绝或

者无法签名的，调查人员应当注明原因，并由见证人签名”。

八、第十五条修改为：“调查人员在常规稽查和立案调查过程中应严格遵守保密制度，不得滥用职权。期货市场参与者在接受交易所常规稽查和立案调查过程中，应当严格遵守保密义务。对违反规定的，交易所根据不同情节给予相应的处理”。

九、第十六条修改为：“会员、境外经纪机构、做市商、客户、交割仓库、存管银行、质量检验机构、信息服务机构及期货市场其他参与者涉嫌重大违规，经交易所立案调查的，在确认违规行为之前，为防止违规行为后果进一步扩大，确保违规案件处理决定的执行，交易所可对其采取下列限制性措施：

“（一）限期说明情况；

“（二）暂停登录新的客户编码；

“（三）限制出入金；

“（四）限制开、平仓；

“（五）限制交割仓库的交割业务、存管银行的存管业务或者信息服务机构的信息业务；

“（六）降低持仓限量或标准仓单持有限量；

“（七）调高保证金比例；

“（八）限期平仓、暂停平仓、强行平仓。”

十、第十九条第一款第（四）项修改为“（四）未按规定履行交易者适当性管理义务，违反交易者适当性制度规定的”。

第十九条增加第四款：“期货公司接受境外经纪机构委托从事期

货交易，对境外经纪机构有本条第一款第（一）至（十八）项所列行为的，按本条第一款规定处理”。

十一、第二十条增加第（十）项：“（十）未按规定履行境外经纪机构备案义务的”。

十二、第二十一条增加第二款：“境外经纪机构被所在国（地区）期货监管部门吊销期货经纪业务许可证或被中国证监会宣布为“市场禁止进入者”的，或存在前款第（三）、（四）和（六）项规定的情形的，取消其境外经纪机构备案”。

十三、第二十三条第（三）项修改为：“（三）对境外经纪机构、客户保证金未进行分账管理的”。

第二十三条第（四）项修改为：“（四）未对境外经纪机构、客户实行每日结算的”。

第二十三条增加第（七）项：“（七）其他违反交易所结算管理规定的行为”。

十四、增加第二十四条：“境外经纪机构具有下列情形之一的，交易所可以采取要求报告情况、谈话提醒、书面警示、责令改正及取消境外经纪机构备案等监管措施；逾期未改正，其行为可能危及期货市场稳健运行、损害客户合法权益的，可以要求期货公司会员暂停或者终止与该境外经纪机构的委托业务：

“（一）拒不配合交易所对客户违规调查的；

“（二）涉嫌违法违规或者出现重大风险的；

“（三）违反适当性管理规定；

“（四）违反交易所关于境外经纪机构的其他规定。

“境外经纪机构被暂停或者终止与期货公司会员的委托代理业务后，不得代理新增客户或者开新仓；客户要求移仓至其他机构的，应当配合完成”。

十五、原第二十四条修改为：“交易所对会员、境外经纪机构或者客户套期保值申报过程中协助提供或出具虚假材料以及违反交易所其他规定的，除取消其套期保值申请资格外，可并处不超过其持有的虚假套期保值持仓总金额 5%的罚款，并视情节轻重，给予警告、通报批评、公开谴责、暂停部分期货或期权业务、强行平仓、没收违规所得、取消会员资格、宣布为“市场禁止进入者”的纪律处分。”

十六、原第二十六条第一款第（四）项修改为：“（四）通过标准仓单管理系统非法窃取其他会员、境外经纪机构或客户仓单信息等商业秘密或破坏标准仓单管理系统的。”

原第二十六条第三款修改为：“境外经纪机构、客户有本条第一款第（四）项行为的，责令改正，给予警告、赔偿经济损失、公开谴责的纪律处分；情节严重的，给予通报批评、公开谴责，取消境外经纪机构备案，可以并处暂停交易 1 至 12 个月，直至宣布为“市场禁止进入者”的纪律处分”。

十七、原第二十七条修改为：“会员、境外经纪机构、客户从事标准仓单交易时，违反交易所规定的，交易所将对其处以警告、罚款 1 至 10 万元、暂停其从事标准仓单交易的纪律处分，情节严重的，给予通报批评、公开谴责，直至取消其会员资格、取消境外经纪机构

备案的纪律处分”。

十八、原第二十八条第一款修改为：“期货市场参与者具有下列违反期货业务管理规定行为之一的, 责令改正, 没收违规所得。根据情节轻重, 给予警告、强行平仓、暂停开仓交易 1 至 12 个月、取消会员资格、取消境外经纪机构备案、宣布为“市场禁止进入者”的纪律处分; 没有违规所得或者违规所得 10 万元以下的, 可并处 1 至 10 万元的罚款; 违规所得 10 万元以上的, 可并处违规所得一倍以上三倍以下的罚款: ……”。

十九、原第三十四条修改为:“会员、境外经纪机构、客户及期货市场其他参与者在实物交割环节上蓄意违约, 影响或企图影响实物交割的正常进行, 牟取非法利益的, 交易所视情节轻重可给予警告、通报批评、公开谴责、暂停开仓交易 1 至 12 个月的纪律处分, 有违约所得的, 没收违约所得, 可并处违约部分合约价值 10%至 30%的罚款”。

二十、原第三十五条修改为:“存管银行未履行《郑州商品交易所期货结算细则》《郑州商品交易所指定存管银行管理办法》等自律规则中有关存管银行义务的, 交易所对其处以责令改正、警告、通报批评、公开谴责、暂停部分期货或期权业务直至取消其存管银行资格”。

二十一、原第三十六条修改为:“会员、境外经纪机构、做市商、客户及期货市场其他参与者以各种手段扰乱交易管理秩序的, 给予警告、暂停开仓交易 1 个月以内的纪律处分, 对直接责任人员给予暂停从事本交易所期货、期权业务 1 个月以内的纪律处分; 情节严重的,

给予通报批评、公开谴责、暂停开仓交易 1 至 12 个月、取消会员资格、取消境外经纪机构备案、宣布为“市场禁止进入者”，对直接责任人暂停从事本交易所期货、期权业务 1 至 6 个月、宣布为“市场禁止进入者”的纪律处分”。

二十二、原第三十八条修改为：“会员、境外经纪机构、做市商、客户及期货市场其他参与者有下列行为之一的，责令改正，给予通报批评、暂停开仓交易 12 个月以内的纪律处分，可并处 1 至 20 万元的罚款：……”

二十三、原第三十九条修改为：“会员、境外经纪机构、客户或者期货市场其他参与者违反期转现规定，弄虚作假的，比照本办法第二十八条给予纪律处分”。

二十四、原第四十条修改为：“会员、境外经纪机构、做市商、客户及期货市场其他参与者具有重大违规违约行为嫌疑或者违规违约行为可能或已经产生相应影响的，交易所可以对其采取以下自律监管措施：……”。

二十五、原第四十六条第一款修改为：“交易所应将处理决定书送达当事人。当事人为会员的，处理决定书送至交易席位视为送达；当事人为非会员的，可邮寄送达。邮件寄出后，市内 2 日、市外 5 日、境外 10 日视为送达。邮寄地址以交易所留存地址为准。处理决定书同时分送有关协助执行部门”。

二十六、原第四十九条修改为：“经交易所作出处理决定承担履行义务的会员、境外经纪机构、做市商、客户、交割仓库、存管银行、

质量检验机构、信息服务机构及期货市场其他参与者拒绝履行义务的，由交易所强制执行”。

原第四十九条增加第二款“有关期货市场参与者应当配合交易所执行相关违规处理决定”。

二十七、原第五十条第二款修改为：“会员、境外经纪机构应当配合执行交易所对客户、做市商的纪律处分，划拨客户、做市商在该会员处的资金”。

二十八、原第五十二条修改为：“会员、境外经纪机构、做市商、客户、交割仓库等期货市场参与者之间发生的期货交易纠纷可自行协商解决，也可提请交易所调解”。

二十九、原第六十九条修改为：“本办法所称“以上”、“以下”、“以内”均含本数”。

原第六十九条增加第二款“本办法中的货币单位为人民币元，涉及外币资金的，按照行为发生时的汇率折算人民币核定金额”。

此外，本次修订还对部分文字表述、条文顺序、标点符号等作了技术性调整。

# 郑州商品交易所违规处理办法

（2008年1月7日第五届理事会通讯会议审议通过，2008年1月15日发布，自发布之日起施行；2009年3月28日第五届理事会通讯会议审议通过，2009年4月15日发布，自2009年4月20日施行；2012年8月14日第五届理事会第七次通讯会议修改，2012年9月3日发布，自发布之日起施行；2017年2月6日郑州商品交易所第五届理事会第二次通讯会议修订，2017年3月7日发布，自发布之日起施行；2018年10月23日第六届理事会第十二次会议修订，2018年11月9日发布，自2018年11月9日起施行）

## 第一章 总 则

**第一条** 为加强期货市场管理，规范期货交易行为，保障期货市场参与者的合法权益，根据《郑州商品交易所章程》、《郑州商品交易所交易规则》的有关规定，制定本办法。

**第二条** 本办法所称违规行为是指会员、境外经纪机构、做市商、客户、交割仓库（交割厂库）、期货保证金指定存管银行（以下简称存管银行）、质量检验机构、信息服务机构、期货市场其他参与者及其工作人员违反郑州商品交易所（以下简称交易所）章程、交易规则及其他有关规定的行为。

**第三条** 交易所根据公平、公正的原则，以事实为依据，对违规行为进行调查、认定和纪律处分。违规行为构成犯罪的，移交司法机关，依法追究刑事责任。

**第四条** 会员、境外经纪机构、做市商、客户、交割仓库、存管银行及期货市场其他参与者违规行为已受到中国证监会处罚的，交易所决定纪律处分时可免除或减轻纪律处分。

**第五条** 从事交易所期货交易相关业务活动适用本办法。

## **第二章 稽 查**

**第六条** 稽查是指交易所根据交易所的各项规章制度，对会员、境外经纪机构、做市商、客户、交割仓库、存管银行、质量检验机构、信息服务机构及期货市场其他参与者的业务活动进行的监督和检查。稽查包括常规稽查和立案调查。稽查方式包括约谈、书面调查、现场检查等。

交易所可以根据其各项规章制度，对会员、境外经纪机构、做市商、客户、交割仓库、存管银行、质量检验机构、信息服务机构及期货市场其他参与者的业务活动进行定期和不定期的常规稽查。

**第七条** 交易所履行监管职责时，可行使下列职权：

（一）查阅、复制与期货交易有关的信息、资料；

（二）要求会员、境外经纪机构、做市商、客户、交割仓库、存管银行、质量检验机构、信息服务机构及期货市场其他参与者提供年报、第三方审计报告等；

（三）对会员、境外经纪机构、做市商、客户、交割仓库、存管银行、质量检验机构、信息服务机构等期货市场参与者进行调查、取证、约谈等；

（四）要求会员、境外经纪机构、做市商、客户、交割仓库、存管银行、质量检验机构、信息服务机构等被调查者申报、陈述、解释、说明有关情况；

（五）查询会员、境外经纪机构、做市商、客户期货业务相关的

银行账户；

（六）检查会员、境外经纪机构、做市商、客户期货业务相关的交易、结算及财务等电脑技术系统；

（七）制止、纠正、处理违规行为；

（八）交易所履行监管职责所必须的其他职权。

**第八条** 会员、境外经纪机构、做市商、客户、交割仓库、存管银行、质量检验机构、信息服务机构及期货市场其他参与者应自觉接受交易所的监督检查，配合交易所履行监督管理职责。

**第九条** 交易所设立投诉、举报机制。投诉、举报人应身份真实、明确；投诉、举报人不愿公开其身份的，交易所为其保密。

**第十条** 对日常稽查工作中发现的、投诉举报的、期货监管部门和司法机关等单位移交的或其他途径获得的线索进行审查后，认为有违规行为发生的，交易所应予以立案调查。

**第十一条** 对已立案的期货违规案件，交易所应指定专人负责调查。调查取证应当由两名以上调查人员参加，并出示本人工作证或交易所的证明文件。

**第十二条** 调查人员认为自己与本案有利害关系或者其他可能影响案件公正处理的，应当申请回避。

被调查人员认为调查人员与本案有关、可能影响公正办案的，有权申请有关人员回避。

交易所认为调查人员应当回避的，指令其回避。

调查人员的回避由交易所主办部门负责人决定。主办部门负责人

的回避由交易所总经理决定。

**第十三条** 证据包括书证、物证、当事人陈述、证人证言、调查笔录、鉴定结论、视听材料、电子记录等能够证明案件真实情况的一切材料。证据应当调查核实才能作为定案的根据。

**第十四条** 询问被调查人应当制作调查笔录。调查笔录应当交被调查人核对，核对无误后，被调查人和调查人员应当在笔录上签名。被调查人拒绝签名的，调查人员应当注明原因。

书证、物证的提取应当制作提取笔录，注明提取的时间和地点，并由被调查人签名。被调查人拒绝或者无法签名的，调查人员应当注明原因，并由见证人签名。

视听资料、电子记录的收集应当注明收集或制作的时间、地点、方式、使用的设备及保存的条件，并由被调查人或见证人签名。

鉴定结论应当由中国证监会或交易所认定的有权鉴定单位做出，并由鉴定单位和鉴定人盖章签字。

**第十五条** 调查人员在常规稽查和立案调查过程中应严格遵守保密制度，不得滥用职权。期货市场参与者在接受交易所常规稽查和立案调查过程中，应当严格遵守保密义务。对违反规定的，交易所根据不同情节给予相应的处理。

**第十六条** 会员、境外经纪机构、做市商、客户、交割仓库、存管银行、质量检验机构、信息服务机构及期货市场其他参与者涉嫌重大违规，经交易所立案调查的，在确认违规行为之前，为防止违规行为后果进一步扩大，确保违规案件处理决定的执行，交易所可对其采

取下列限制性措施：

- （一）限期说明情况；
- （二）暂停登录新的客户编码；
- （三）限制出入金；
- （四）限制开、平仓；
- （五）限制交割仓库的交割业务、存管银行的存管业务或者信息服务机构的信息业务；
- （六）降低持仓限量或标准仓单持有限量；
- （七）调高保证金比例；
- （八）限期平仓、暂停平仓、强行平仓。

### 第三章 违规处理

**第十七条** 有多种违规行为的，分别定性，数罚并用。多次违规的，从重或加重纪律处分。

**第十八条** 期货公司会员具有下列违反经纪业务资格管理规定行为之一的，责令改正，没收违规所得。根据情节轻重给予警告、通报批评、公开谴责、强行平仓、暂停开仓交易 1 至 12 个月、取消会员资格的纪律处分；没有违规所得或者违规所得 5 万元以下的，可并处 5 至 25 万元的罚款；违规所得 5 万元以上的，可并处违规所得一倍以上五倍以下的罚款：

- （一）以欺诈手段获取从事期货经纪业务资格的；
- （二）擅自设立从事期货经纪业务分支机构的；
- （三）聘用未取得期货从业人员资格和未经交易所培训合格的人

员从事经纪业务的；

（四）其他违反中国证监会及交易所对交易所会员经纪业务资格管理规定的行为。

**第十九条** 期货公司会员具有下列违反经纪业务管理规定行为之一的，责令改正，没收违规所得。情节较轻的，给予警告，可并处1至10万元的罚款；情节严重的，给予通报批评、公开谴责、强行平仓、暂停开仓交易1至12个月、取消会员资格、宣布为“市场禁止进入者”；没有违规所得或违规所得10万元以下的，可并处10至50万元的罚款；违规所得10万元以上的，可并处违规所得一倍以上五倍以下的罚款：

（一）为未履行开户手续或未按规定履行开户手续的客户进行期货交易的；

（二）违反交易编码管理制度的；

（三）未按规定履行审核义务，为不符合开户条件的客户办理开户手续的；

（四）未按规定履行交易者适当性管理义务，违反交易者适当性制度规定的；

（五）未如实向客户说明期货交易的风险或不签署风险声明书的；

（六）向客户作获利保证或与客户私下约定分享赢利或共担风险损失的；

（七）利用客户账户名义为自己或他人交易的；

（八）未按客户的委托事项进行交易，故意阻止、延误或改变客

户下单指令，诱导、强制客户按自己的意志进行交易的；

（九）场外交易、私下对冲的；

（十）未将自有资金与客户资金分户存放的；

（十一）无正当理由拖延客户出金的；

（十二）允许客户在保证金不足时开仓交易或在期权买方客户资金不足时接受客户行权申请的；

（十三）挪用或擅自允许他人挪用客户资金或套用不同账户资金的；

（十四）故意制造和散布虚假的或容易使人误解的信息进行误导的；

（十五）泄露客户委托事项或其他交易秘密的；

（十六）入市代表接受本单位以外的其他单位和个人的委托指令进行交易的；

（十七）未按规定向客户提供有关成交结果、资金结算报表的；

（十八）其他违反中国证监会和交易所对经纪业务管理规定的行为。

交易所可给予责任人暂停从事交易所期货、期权业务 1 个月以内的纪律处分，情节严重的，给予责任人通报批评、公开谴责、暂停从事交易所期货或期权业务 1 至 6 个月、取消其从事交易所期货或期权业务资格的纪律处分。

做市商违反交易编码管理相关规定的，按照上述对期货公司会员的有关规定给予相应纪律处分。

期货公司接受境外经纪机构委托从事期货交易，对境外经纪机构有本条第一款第（一）至（十八）项所列行为的，按本条第一款规定处理。

**第二十条** 会员有下列行为之一的，责令改正，给予警告、暂停开仓交易 1 至 12 个月的纪律处分；情节严重的，给予通报批评、公开谴责、取消会员资格的纪律处分：

（一）会员法定代表人、经营范围、注册地等变更后未履行报告义务的；

（二）未按规定的期限要求向交易所报送财务报表等有关材料的；

（三）未按大户报告制度向交易所履行申报义务，或作虚假报告、隐瞒不报的；

（四）未协助交易所对其客户采取限制性措施或其他监管措施的；

（五）未按交易所规定及时缴纳年会费等有关费用的；

（六）不按规定保管有关交易、结算、财务、会计等资料的；

（七）伪造、变造、买卖各种凭证或审批文件的；

（八）非经纪会员从事经纪业务或经纪会员从事自营业务的；

（九）假借期货交易之名从事非法活动的；

（十）未按规定履行境外经纪机构备案义务的。

**第二十一条** 会员有下列情况之一的，取消会员资格：

（一）被中国证监会吊销期货经纪业务许可证或被中国证监会宣布为“市场禁止进入者”的；

（二）私下转让会员席位，将席位委托给他人管理或承包给他人

经营的；

（三）资金、人员和设备严重不足，管理混乱，经整顿无效的；

（四）拒不执行会员大会或理事会决议的；

（五）无正当理由连续三个月不做交易的；

（六）其他违反国家法律、法规、规章和严重违反交易所章程及有关规定的。

境外经纪机构被所在国（地区）期货监管部门吊销期货经纪业务许可证或被中国证监会宣布为“市场禁止进入者”的，或存在前款第（三）、（四）和（六）项规定的情形的，取消其境外经纪机构备案。

**第二十二条** 会员无正当理由未在规定期限内执行强行平仓的，给予警告、通报批评、公开谴责、暂停部分期货或期权业务、暂停开仓交易 1 至 12 个月的纪律处分，可并处 5 万元以下的罚款。

**第二十三条** 会员具有下列违反交易所结算管理规定行为之一的，责令改正，可给予警告；情节严重的，给予通报批评、公开谴责、暂停部分期货或期权业务、暂停开仓交易 1 至 12 个月的纪律处分，可并处 1 至 20 万元的罚款：

（一）会员未按时足额缴纳保证金的；

（二）结算报告书、交易月报表和其他结算文件资料作不真实记载的；

（三）对境外经纪机构、客户保证金未进行分账管理的；

（四）未对境外经纪机构、客户实行每日结算的；

（五）伪造、变造交易记录、会计报表、账册的；

(六) 开具空头支票、虚开增值税发票及其他伪造票证的；

(七) 其他违反交易所结算管理规定的行为。

**第二十四条** 境外经纪机构具有下列情形之一的，交易所可以采取要求报告情况、谈话提醒、书面警示、责令改正及取消境外经纪机构备案等监管措施；逾期未改正，其行为可能危及期货市场稳健运行、损害客户合法权益的，可以要求期货公司会员暂停或者终止与该境外经纪机构的委托业务：

(一) 拒不配合交易所对客户违规调查的；

(二) 涉嫌违法违规或者出现重大风险的；

(三) 违反适当性管理规定；

(四) 违反交易所关于境外经纪机构的其他规定。

境外经纪机构被暂停或者终止与期货公司会员的委托代理业务后，不得代理新增客户或者开新仓；客户要求移仓至其他机构的，应当配合完成。

**第二十五条** 交易所对会员、境外经纪机构或者客户套期保值申报过程中协助提供或出具虚假材料以及违反交易所其他规定的，除取消其套期保值申请资格外，可并处不超过其持有的虚假套期保值持仓总金额 5% 的罚款，并视情节轻重，给予警告、通报批评、公开谴责、暂停部分期货或期权业务、强行平仓、没收违规所得、取消会员资格、宣布为“市场禁止进入者”的纪律处分。

**第二十六条** 会员、做市商或客户违反交易所持仓管理规定的，给予强行平仓、警告、通报批评、公开谴责、暂停部分期货或期权业

务的纪律处分。

**第二十七条** 会员具有下列违反交易所信息和计算机通讯等设备管理规定行为之一的，责令改正，赔偿经济损失。情节较轻的，给予警告、暂停开仓交易 1 个月以内的纪律处分，可并处 1 至 5 万元的罚款；情节严重的，给予通报批评、公开谴责、暂停开仓交易 1 至 12 个月、取消会员资格的纪律处分，可并处 5 至 20 万元的罚款：

（一）未经交易所许可，擅自发布交易所信息的；

（二）擅自动用其他会员席位上的计算机或通讯设备的；

（三）通过交易席位非法窃取其他会员的成交、结算资金等商业秘密或破坏交易系统的；

（四）通过标准仓单管理系统非法窃取其他会员、境外经纪机构或客户仓单信息等商业秘密或破坏标准仓单管理系统的。

交易所可给予责任人暂停从事交易所期货、期权业务 1 个月以内的纪律处分；情节严重的，给予责任人通报批评、公开谴责、暂停从事交易所期货或期权业务 1 至 6 个月、取消其从事交易所期货或期权业务资格的纪律处分。

境外经纪机构、客户有本条第一款第（四）项行为的，责令改正，给予警告、赔偿经济损失、公开谴责的纪律处分；情节严重的，给予通报批评、公开谴责，取消境外经纪机构备案，可以并处暂停交易 1 至 12 个月，直至宣布为“市场禁止进入者”的纪律处分。

**第二十八条** 会员、境外经纪机构、客户从事标准仓单交易时，违反交易所规定的，交易所将对其处以警告、罚款 1 至 10 万元、暂

停其从事标准仓单交易的纪律处分，情节严重的，给予通报批评、公开谴责，直至取消其会员资格、取消境外经纪机构备案的纪律处分。

**第二十九条** 期货市场参与者具有下列违反期货业务管理规定行为之一的，责令改正，没收违规所得。根据情节轻重，给予警告、强行平仓、暂停开仓交易 1 至 12 个月、取消会员资格、取消境外经纪机构备案、宣布为“市场禁止进入者”的纪律处分；没有违规所得或者违规所得 10 万元以下的，可并处 1 至 10 万元的罚款；违规所得 10 万元以上的，可并处违规所得一倍以上三倍以下的罚款：

（一）单独或者合谋，集中资金优势、持仓优势或者利用信息优势，连续或者联合买卖合约，影响期货交易价格或者期货交易量的；

（二）利用移仓、分仓、对敲等手段，规避交易所的持仓限制，超量持仓，控制或企图控制市场价格，影响市场秩序的；

（三）利用移仓、分仓、对敲等手段，影响期货交易价格、转移资金或者牟取不当利益的；

（四）不以成交为目的或明知申报的指令不能成交，仍恶意或连续输入交易指令影响或者企图影响期货交易价格，扰乱市场秩序或转移资金的；

（五）以自己为交易对象，连续买卖或者自我买卖，影响或者企图影响期货交易价格或者期货交易量的；

（六）期货交易内幕信息的知情人或者非法获取期货交易内幕信息的人，在对期货交易价格有重大影响的信息尚未公开前，利用内幕信息或国家机密进行期货交易或者向他人泄露内幕信息，使他人利用

内幕信息进行期货交易的；

（七）以垄断、囤积标的物和不当集中持仓量的方式，控制交易所大量交割仓库标准仓单，以及通过各种手段虚占交割仓库库容的；

（八）以操纵市场为目的，用直接或间接的方法操纵或扰乱交易秩序，妨碍或有损于公正交易，有损于国家利益和社会公众利益的；

（九）以非善意的期货转现货行为，影响期货市场秩序的；

（十）未按要求使用交易所标准仓单管理系统，影响系统正常运作的；

（十一）未遵守交易所风险警示有关要求或整改要求的；

（十二）其他违反中国证监会和交易所有关交易管理规定的。

本条所称对敲是指单独或者蓄意串通、按照事先约定的时间、价格和方式进行相互交易的行为。

**第三十条** 期货市场参与者有下列行为之一的，交易所可以调整当日结算价：

（一）期货市场参与者以自己为交易对象，自买自卖期货合约，影响期货交易价格的；

（二）其他违规行为导致交易价格异常波动或者瞬间大幅度偏离市场价格的。

**第三十一条** 经交易所立案调查，发现期货市场参与者有下列行为之一的，及时报告中国证监会，提请立案稽查：

（一）操纵市场等违法行为，情节严重的；

（二）利用自成交、对敲交易影响交割结算价，情节严重的；

(三) 盗取他人交易密码进行期货交易的;

(四) 其他涉嫌违法犯罪的行为。

报告中国证监会后,不影响交易所对上述违规行为采取暂停开仓交易等限制性措施。

**第三十二条** 出市代表具有下列行为之一的,给予警告纪律处分;情节严重的,给予通报批评、公开谴责、暂停出市交易 1 至 12 个月或取消出市代表资格的纪律处分,可并处 1 千元至 1 万元的罚款:

(一) 违反交易所有关交易大厅管理规定的;

(二) 未按规定程序操作,给交易系统造成损害的;

(三) 随意拆卸、搬动交易厅内各种设备或私接电话和其他设备的;

(四) 采取虚假、欺骗和不正当手段骗取出市代表资格的;

(五) 伪造、涂改、借用出市代表证件的。

具有本条第(二)、(三)项行为之一造成损害的,由其委派会员承担赔偿责任。

**第三十三条** 结算交割员具有下列行为之一的,给予警告纪律处分;情节严重的,给予通报批评、公开谴责、暂停结算交割员资格 1 个月以内或取消结算交割员资格的纪律处分,可并处 1 千元至 1 万元的罚款:

(一) 采取虚假、欺骗和不正当手段骗取结算交割员资格的;

(二) 伪造、变造、借用《结算交割员证》的。

**第三十四条** 交割仓库及其直接负责的主管人员和其他直接责任

人员有下列行为之一的，责令改正，没收违规所得。情节较轻的，给予警告，可并处 1 至 10 万元的罚款，对直接负责的主管人员和其他直接责任人员给予通报批评、暂停从事本交易所期货业务 1 个月以内的纪律处分，可并处 1 至 5 万元的罚款；情节严重的，给予通报批评、公开谴责、暂停交割业务、取消其交割仓库资格、宣布为“市场禁止进入者”的纪律处分，没有违规所得或违规所得 10 万元以下的，可并处 10 至 50 万元的罚款；违规所得 10 万元以上的，可并处违规所得一倍以上五倍以下的罚款，对直接负责的主管人员和其他直接责任人员给予暂停从事本交易所期货业务 1 至 6 个月、宣布为“市场禁止进入者”的纪律处分，可并处 5 至 20 万元的罚款：

- （一）违反国家有关规定参与期货交易的；
- （二）出具虚假仓单的；
- （三）盗卖交割商品的；
- （四）泄露与期货有关不宜公开的仓储信息或散布虚假信息误导市场的；
- （五）与会员或客户联手，影响或企图影响期货市场价格的；
- （六）标准仓单所示商品中有牌号、商标、规格、质量等混杂的；
- （七）交割商品与单证不符的；
- （八）交割商品没有或缺少规定证明文件的；
- （九）交割商品的捆数、块数、包装要求和交易所规定不符的；
- （十）未完成规定的检验项目而开具仓单的；
- （十一）错收错发的；

- (十二) 因保管不当, 引起储存商品变质、灭失的;
- (十三) 在搬运、装卸、堆码等作业过程中造成包装和商品损坏的;
- (十四) 商品交割中滥行收费的;
- (十五) 蓄意刁难, 造成卖方或买方违约的;
- (十六) 违反期货交割业务规则, 限制、故意拖延交割商品的入库、出库的;
- (十七) 拒绝、阻挠交易所依法监督检查的;
- (十八) 其他违反中国证监会和交易所规定的行为。

**第三十五条** 会员、境外经纪机构、客户及期货市场其他参与者在实物交割环节上蓄意违约, 影响或企图影响实物交割的正常进行, 牟取非法利益的, 交易所视情节轻重可给予警告、通报批评、公开谴责、暂停开仓交易 1 至 12 个月的纪律处分, 有违约所得的, 没收违约所得, 可并处违约部分合约价值 10%至 30%的罚款。

**第三十六条** 存管银行未履行《郑州商品交易所期货结算细则》《郑州商品交易所指定存管银行管理办法》等自律规则中有关存管银行义务的, 交易所对其处以责令改正、警告、通报批评、公开谴责、暂停部分期货或期权业务直至取消其存管银行资格。

**第三十七条** 会员、境外经纪机构、做市商、客户及期货市场其他参与者以各种手段扰乱交易管理秩序的, 给予警告、暂停开仓交易 1 个月以内的纪律处分, 对直接责任人员给予暂停从事本交易所期货、期权业务 1 个月以内的纪律处分; 情节严重的, 给予通报批评、公开

谴责、暂停开仓交易 1 至 12 个月、取消会员资格、取消境外经纪机构备案、宣布为“市场禁止进入者”，对直接责任人暂停从事本交易所期货、期权业务 1 至 6 个月、宣布为“市场禁止进入者”的纪律处分。

**第三十八条** 被交易所宣布为“市场禁止进入者”的，自宣布生效之日起 20 个交易日内清理原有持仓，了结交易业务，结清债权债务。

被中国证监会或其他期货交易所宣布为“市场禁止进入者”的，在市场禁入期限内不得从事本交易所期货、期权业务。

**第三十九条** 会员、境外经纪机构、做市商、客户及期货市场其他参与者有下列行为之一的，责令改正，给予通报批评、暂停开仓交易 12 个月以内的纪律处分，可并处 1 至 20 万元的罚款：

- （一）拒不配合交易所常规检查、立案调查的；
- （二）拒不执行交易所处理决定的；
- （三）进行虚假性、误导性或者遗漏重要事实的申报、陈述、解释或者说明的；
- （四）提供虚假的文件、资料或者信息的；
- （五）不执行交易所限制性措施或者其他监管措施的。

**第四十条** 会员、境外经纪机构、客户或者期货市场其他参与者违反期转现规定，弄虚作假的，比照本办法第二十八条给予纪律处分。

**第四十一条** 会员、境外经纪机构、做市商、客户及期货市场其他参与者具有重大违规违约行为嫌疑或者违规违约行为可能或已经产生相应影响的，交易所可以对其采取以下自律监管措施：

- (一) 口头警示；
- (二) 出具警示函；
- (三) 监管谈话；
- (四) 要求公开说明；
- (五) 要求参加培训；
- (六) 要求定期报告；
- (七) 要求提交书面承诺；
- (八) 要求增加内部合规检查的次数；
- (九) 要求聘请中介机构核查并发表意见；
- (十) 要求处分有关人员；
- (十一) 上报中国证监会；
- (十二) 交易所交易规则及其实施细则规定的其他自律监管措施。

**第四十二条** 交易所工作人员违反有关规定的，按国家法律、法规和交易所人事管理制度及有关廉政规定处理。

**第四十三条** 司法机关、行政执法机关根据生效法律文书要求交易所协助冻结、划拨非期货公司会员在交易所专用结算账户资金的，非期货公司会员结算准备金超过现有持仓合约三个停板以外部分的，交易所根据生效法律文书予以协助；无法冻结、划拨期货公司会员在交易所专用结算账户资金的，交易所应当向司法机关、行政执法机关说明无法协助执行的原因。

## 第四章 裁决与执行

**第四十四条** 交易所作出取消会员资格、宣布为“市场禁止进入

者”的纪律处分应当由交易所理事会决定。

**第四十五条** 交易所对违规行为核查后,事实清楚、证据确凿的,依照交易所章程、交易规则及本办法规定予以裁决。

**第四十六条** 交易所作出裁决应制作处理决定书。处理决定书主要包括以下内容:

- (一) 当事人的姓名或者名称、住所;
- (二) 违规事实和证据;
- (三) 纪律处分种类和依据;
- (四) 纪律处分的履行方式和期限;
- (五) 不服纪律处分决定申请复议途径和期限;
- (六) 作出处理决定的日期。

**第四十七条** 交易所应将处理决定书送达当事人。当事人为会员的,处理决定书送至交易席位视为送达;当事人为非会员的,可邮寄送达。邮件寄出后,市内 2 日、市外 5 日、境外 10 日视为送达。邮寄地址以交易所留存地址为准。处理决定书同时分送有关协助执行部门。

按照中国证监会的规定需要抄报违规处理情况的,同时抄报中国证监会。

**第四十八条** 交易所作出的处理决定书自送达之日起生效。当事人对处理决定书不服的,可于决定书生效之日起 10 日内向交易所书面申请复议一次,复议期间不停止决定的执行。

**第四十九条** 交易所应于收到复议申请书之日起一个月内作出复

议决定，复议决定为终局决定。

**第五十条** 经交易所作出处理决定承担履行义务的会员、境外经纪机构、做市商、客户、交割仓库、存管银行、质量检验机构、信息服务机构及期货市场其他参与者拒绝履行义务的，由交易所强制执行。

有关期货市场参与者应当配合交易所执行相关违规处理决定。

**第五十一条** 违规处理决定中，具有罚没款项的，当事人应在处理决定书生效之日起 5 日内将罚没款项如数缴纳至交易所指定账户。逾期不付罚没款项的，交易所从会员专用资金账户中划付。对会员工作人员的罚没款项，由会员代缴。

会员、境外经纪机构应当配合执行交易所对客户、做市商的纪律处分，划拨客户、做市商在该会员处的资金。

**第五十二条** 违规处理决定中，具有罚没款项的，受纪律处分的交割仓库应在处理决定书生效之日起 5 日内将罚没款项缴纳至交易所指定账户；对交割仓库工作人员的罚没款项，由交割仓库代缴。逾期不缴的，交易所从该交割仓库交割担保金中划转。

## 第五章 纠纷调解

**第五十三条** 会员、境外经纪机构、做市商、客户、交割仓库等期货市场参与者之间发生的期货交易纠纷可自行协商解决，也可提请交易所调解。

**第五十四条** 交易所的调解机构是交易所理事会下设的调解委员会，其常设办事机构设在交易所法律事务部。

**第五十五条** 调解应在事实清楚、责任明确的基础上依据国家有

关期货交易的法律、法规和交易所的规章制度进行。

**第五十六条** 当事人向调解委员会提出调解申请，应当从其知道或应当知道其合法权益被侵害之日起 30 日内提出。

**第五十七条** 当事人申请调解应当符合下列条件：

- （一）有调解申请书；
- （二）有具体的事实、理由和请求；
- （三）属于调解委员会的受理范围。

**第五十八条** 当事人向调解委员会申请调解，必须提交书面申请和有关材料。调解申请书应当写明以下事项：

- （一）当事人的姓名、性别、年龄、职业、工作单位和住所，或单位名称、住所和法定代表人或者负责人的姓名、职务；
- （二）请求调解的事实、理由及要求；
- （三）有关证据。

**第五十九条** 交易所调解委员会收到调解申请后，应当认真审查有关材料是否符合要求，并于 5 个工作日内以书面方式通知当事人是否受理。

**第六十条** 有下列情形之一的，交易所调解委员会不予受理：

- （一）当事人已向人民法院起诉的；
- （二）当事人已向仲裁机构申请仲裁的；
- （三）当事人一方要求调解，另一方不愿意调解的；
- （四）交易所调解委员会认定不予受理的其他情形。

**第六十一条** 交易所调解委员会应当自受理调解申请之日起 30

日内完成调解。情况复杂，不能在规定期限内完成调解的，经双方当事人同意后，可以继续调解；双方当事人未达成继续调解事宜的，终止调解。

**第六十二条** 当事人根据有关规定负有举证的责任。调解委员会认为必要时，可调查收集证据。

**第六十三条** 调解委员会调解纠纷，应当在查明事实，分清是非和自愿的基础上调解，促使当事人相互谅解，达成协议。

**第六十四条** 经调解达成的协议应记录在案，并制作调解书，由双方当事人签字，调解员署名，加盖调解委员会印章后生效。

**第六十五条** 调解书应当写明以下内容：

- （一）双方当事人的名称、住所、法定代表人或者负责人的姓名及职务；
- （二）争议的事项和请求；
- （三）协议结果。

**第六十六条** 调解委员会应当在受理调解后 30 天内结案，到期未结案的调解委员会应当向当事人说明理由。双方当事人要求继续调解的，调解委员会应继续调解。有一方要求终止调解的，应当终止调解。

**第六十七条** 调解不成的，当事人可以依法提请仲裁机构仲裁或向人民法院起诉。

## 第六章 附 则

**第六十八条** 本办法所称期货交易包括以期货合约和期权合约为交易标的的交易活动。

**第六十九条** 本办法解释权属于郑州商品交易所。

**第七十条** 本办法所称“以上”、“以下”、“以内”均含本数。

本办法中的货币单位为人民币元，涉及外币资金的，按照行为发生时的汇率折算人民币核定金额。

**第七十一条** 本办法自 2018 年 11 月 9 日起施行。