

关于发布《郑州商品交易所章程》、 《郑州商品交易所交易规则》的通知

郑商发〔2017〕147号

各会员单位：

《郑州商品交易所章程（修改草案）》与《郑州商品交易所交易规则（修改草案）》已由郑州商品交易所第六次会员大会审议通过，并经中国证监会批准。现将修改后的《郑州商品交易所章程》与《郑州商品交易所交易规则》予以发布，自发布之日起施行。

特此通知。

附件 1. 《郑州商品交易所章程》

附件 2. 《郑州商品交易所交易规则》

郑州商品交易所

2017年5月19日

附件 1

郑州商品交易所章程

（郑州商品交易所第六次会员大会：2017 年 4 月 20 日修改，自 2017 年 5 月 19 日施行）

第一章 总则

第一条 为维护郑州商品交易所（以下简称交易所）、会员和期货市场其他参与者的合法权益和社会公众的利益，规范交易所的组织和行为，根据国家有关法律、法规和规章，制定本章程。

第二条 交易所是经中国证券监督管理委员会（以下简称中国证监会）审批，依照中华人民共和国法律、法规和规章规定设立的，提供期货交易场所、设施和服务，组织和监督期货交易，实行自律管理的会员制非营利性法人。

第三条 交易所根据中国共产党章程的规定设立中国共产党的组织，开展党的活动，并为党组织的活动提供必要条件，保障党委发挥政治领导核心作用、纪委发挥监督作用和各级基层党组织发挥战斗堡垒作用。

第四条 交易所中文名称为：郑州商品交易所；英文名称为 Zhengzhou Commodity Exchange，英文缩写为 ZCE。

第五条 交易所住所为河南省郑州市郑东新区商务外环路 30 号。

第六条 交易所注册资本为人民币 9060 万元，由会员出资认缴。

第七条 交易所营业期限为永久存续。

第八条 总经理为交易所法定代表人。

第九条 交易所履行下列职责：

- （一）提供交易的场所、设施及服务；
- （二）制定并实施交易所的业务规则；
- （三）设计合约、安排合约上市；
- （四）组织并监督期货交易、结算和交割；
- （五）制定并实施风险管理制度，控制交易活动中的风险；
- （六）为期货交易提供集中履约担保；
- （七）发布市场信息；
- （八）监管会员期货业务；
- （九）督促会员加强对客户交易行为的管理，监管境外交易者和境外经纪机构的期货业务；
- （十）查处违规行为；
- （十一）及时向中国证监会报送期货违法违规线索，配合中国证监会进行检查和调查取证；
- （十二）为期货相关的其他业务提供交易、清算、交割等服务；
- （十三）中国证监会规定的其他职责。

第十条 交易所名称、注册资本、住所、法定代表人的变更，按有关规定办理变更手续。

第十一条 交易所因下列情况之一终止：

- (一) 会员大会决定解散；
- (二) 合并或者分立需要解散；
- (三) 中国证监会决定关闭。

交易所终止，应当成立清算组，进行清算。

第十二条 本章程适用于交易所内一切业务活动，交易所、交易所会员及其工作人员应当遵守本章程。

第二章 会员

第十三条 会员是指根据期货交易有关法律、法规和本章程的有关规定，经交易所审查批准，在本交易所进行期货交易及相关活动的企业法人或者其他经济组织。

第十四条 会员分为期货公司会员和非期货公司会员。

第十五条 申请成为交易所会员应当具备下列条件：

(一) 中华人民共和国境内登记注册的企业法人或者交易所认可的其他经济组织；

(二) 承认并遵守交易所的章程和业务规则；

(三) 拥有规定限额以上的注册资本、净资产；

(四) 具有良好的信誉和经营历史，最近三年内无严重违法记录或被期货交易所除名的记录；

(五) 有健全的组织机构和财务管理制度及完善的期货

业务管理制度；

（六）有具备期货从业资格的人员，固定的经营场所和必要设施；

（七）申请期货公司会员的，应当持有中国证监会核准的期货业务许可证；

（八）中国证监会和交易所规定的其他条件。

第十六条 交易所接纳会员，应当经理事会批准，并报告中国证监会，同时制发会员证书，并予以公布。

第十七条 会员享有下列权利：

（一）参加会员大会，行使选举权、被选举权和表决权；
（二）在交易所进行规定品种的期货交易；
（三）使用交易所提供的交易设施，获得有关期货交易的信息和服务；

（四）按规定转让会员资格；

（五）联名提议召开临时会员大会；

（六）按照本章程和业务规则行使申诉权；

（七）本章程规定的其他权利。

第十八条 会员应当履行下列义务：

（一）遵守国家有关法律、法规、规章和政策；

（二）遵守本章程、业务规则及有关决定；

（三）按规定缴纳各种费用；

（四）出席会员大会，执行会员大会、理事会的决议；

(五) 接受交易所监督管理；

(六) 本章程规定的其他义务。

第十九条 会员取得会员资格，应当向交易所缴纳 40 万元，同时至少取得一个交易席位。

会员因业务需要可以增加交易席位。增加交易席位的，按交易所有关规定办理手续。

第二十条 会员资格应当按照交易所规定的条件和程序转让；受让方应当符合本章程第十五条规定。受让方向交易所提出入会申请并提交相关文件、资料，经交易所理事会审查批准后方可履行转让手续。

第二十一条 会员被取消会员资格或者放弃会员资格的，按照有关规定办理手续。

第二十二条 吸收合并会员的法人或者与会员合并后新设立的法人需要承继会员资格的，应当符合本章程第十五条规定，并向交易所提出申请，经交易所理事会审查批准后，方可承继会员资格。

吸收合并会员的法人或与会员合并后新设立的法人，有优先取得会员资格的权利。

第二十三条 会员被取消资格或者会员资格发生变更时，交易所应当向中国证监会报告。

第二十四条 交易所应当按照本章程制定会员管理的规定，对会员进行自律管理。

第二十五条 交易所可以根据交易、结算、交割等业务的需要，设立特别会员。特别会员的种类、资格条件以及权利、义务由交易所相关业务制度进行规定。

第三章 会员大会

第二十六条 交易所设会员大会。会员大会由全体会员组成。

会员大会行使下列职权：

- (一) 审议通过交易所章程和交易规则及其修改草案；
- (二) 选举和更换会员理事单位、会员监事单位；
- (三) 审议批准理事会、监事会和总经理的工作报告；
- (四) 审议批准交易所的财务预算方案、决算报告；
- (五) 审议交易所风险准备金使用情况；
- (六) 决定增加或者减少交易所注册资本；
- (七) 决定交易所的合并、分立、变更组织形式、解散和清算事项；
- (八) 决定交易所理事会、监事会提交的其他重大事项。

第二十七条 会员大会分为年度会员大会和临时会员大会，由理事会负责召集。

有下列情形之一的，应当在 2 个月内召开临时会员大会：

- (一) 会员理事单位不足本章程规定数量的 2/3；
- (二) 1/3 以上会员联名提议；

(三) 理事会认为必要时;

(四) 监事会提议。

会员大会可以现场会议方式召开，也可以通过视频会议或者传真、邮件等通讯方式召开。会员通过上述方式参加会员大会的，视为出席。

理事会换届时，会员大会应当召开现场会议。

第二十八条 会员大会由理事长主持。理事长因特殊原因不能履行职权时，由理事长委托的副理事长或者其他理事主持。召开会员大会，应当将会议审议的事项于会议召开 10 日前通知会员。会员大会不得对通知中未列明的事项作出决议。

第二十九条 会员大会应当有 2/3 以上会员参加方为有效。每一会员享有一票表决权。

会员大会对交易所合并、分立、变更组织形式、解散和清算、增加或者减少交易所注册资本形成决议，应当经全体会员 2/3 以上通过，会员大会形成的其他决议应当经全体会员 1/2 以上通过。

第三十条 会员参加会员大会，应当由其法定代表人出席。法定代表人因故不能出席会员大会的，会员可以委托代理人出席会员大会，代理人应当向交易所提交会员授权委托书，并在授权范围内行使表决权。

会员大会可以传真、邮件等通讯方式作出决议，决议文件由全体会员加盖公章。

第三十一条 除通讯方式召开的会员大会外，会员大会应当对表决事项制作会议纪要，由出席会议的理事签名。

会员大会结束之日起 10 日内，交易所应当将会员大会全部文件报送中国证监会。

第四章 理事会

第三十二条 交易所设理事会，每届任期 3 年。

理事会行使下列职权：

- （一）召集会员大会，并向会员大会报告工作；
- （二）拟订交易所章程、交易规则及其修改草案，提交会员大会审议通过；
- （三）审议总经理提出的财务预算方案、决算报告，提交会员大会通过；
- （四）审议交易所合并、分立、变更组织形式、增加或者减少注册资本、解散和清算的方案，提交会员大会通过；
- （五）决定专门委员会及咨询顾问委员会的设置和人员组成；
- （六）决定会员、直接入场交易的境外交易者和境外经纪机构的接纳和退出；
- （七）决定对违规行为的纪律处分；
- （八）决定交易所变更名称、住所或者营业场所；
- （九）审议批准根据本章程和交易规则制定的实施细则和办法；

(十) 审议批准风险准备金及特定用途的专项（风险）准备金的使用方案；

(十一) 审议批准总经理提出的交易所发展规划和年度工作计划；

(十二) 审议批准交易所对外投资计划；

(十三) 决定会计师事务所的聘用和变更事项；

(十四) 决定召开会员大会的方式；

(十五) 法律、法规、规章、本章程和会员大会授予的其他职权。

第三十三条 理事会由 17 名理事组成。其中会员理事单位为 10 名、非会员理事为 7 名。

理事会或者 1/5 以上会员联合提名，由会员大会选举产生会员理事单位。当选会员理事单位法定代表人或者其指派的其他高级管理人员作为会员理事单位代表参加理事会会议。

非会员理事由中国证监会委派。交易所总经理为当然理事。

第三十四条 理事会设理事长 1 人，副理事长 1 至 2 人。理事长、副理事长的任免，由中国证监会提名，理事会通过。理事长不得兼任总经理。

理事长的任期应当符合中国证监会相关规定。

第三十五条 理事长行使下列职权：

(一) 召集理事会会议，主持会员大会、理事会会议和

理事会的日常工作；

- (二) 组织协调专门委员会及咨询顾问委员会的工作；
- (三) 督促、检查理事会决议的实施情况；
- (四) 提名专门委员会及咨询顾问委员会的成员；
- (五) 本章程规定和理事会授予的其他职权。

副理事长协助理事长工作。理事长因故临时不能履行职权时，由理事长指定的副理事长或者理事代其履行职权。

第三十六条 理事长的任期经济责任审计按照中国证监会的有关规定执行。

第三十七条 理事会会议至少每半年召开一次。每次会议应当于会议召开 10 日前通知全体理事。

有下列情形之一的，应当召开理事会临时会议：

- (一) 中国证监会提议；
- (二) 1/3 以上理事联名提议；
- (三) 本章程规定的其他情形。

召开临时会议的，可以另定召集理事会临时会议的通知方式和通知时限。

理事会会议可以现场会议方式召开，也可以通过视频、电话会议或者传真、邮件等通讯方式召开。理事通过上述方式参加理事会的，视为出席。

第三十八条 理事会会议应当有 2/3 以上理事出席方为有效，其决议应当经全体理事 1/2 以上表决通过。理事会会

议可以通过传真、邮件等通讯表决方式作出决议，表决文件由理事分别进行签字。

理事会会议结束之日起 10 日内，理事会应当将会议决议及其他会议文件报送中国证监会。

第三十九条 理事会会议应当由理事本人出席。理事因故不能出席的，应当以书面形式委托其他理事代为出席，委托书中应当载明授权范围。

会员理事单位更换法定代表人，或者其指派的高级管理人员不适宜继续担任理事职务时，会员理事单位应当及时通知交易所，由新任法定代表人或者指派其他高级管理人员参加理事会会议。非会员理事在任期内提出辞职的，由理事会受理并提请中国证监会决定。

理事会应当对会议表决事项作成会议记录，由出席会议的理事和记录员在会议记录上签名。

第四十条 理事会可以根据需要设立若干专门委员会。专门委员会协助理事会开展工作，对理事会负责，其职责由理事会规定。

理事会可以根据需要设立咨询顾问委员会。

第四十一条 专门委员会和咨询顾问委员会成员由理事会任命，每届任期 3 年。

第四十二条 各专门委员会分别设主任 1 人，副主任若干人，主任原则上应由会员代表担任，1 名副主任由交易所

工作人员担任，负责处理日常工作。主任、副主任均由理事会任命。

咨询顾问委员会由行业及领域专家和大专院校、研究机构学者组成。

根据理事会工作需要，有关专门委员会及咨询顾问委员会负责人可以列席理事会会议。

第五章 高级管理人员

第四十三条 交易所设总经理 1 人，负责交易所日常管理工作。设副总经理若干人，协助总经理工作。总经理和副总经理由中国证监会任免。

交易所可聘任专业技术高级管理人员若干人，协助总经理或副总经理工作。

总经理的任期应当符合中国证监会相关规定。

第四十四条 总经理行使下列职权：

- （一）组织实施会员大会、理事会通过的制度和决议；
- （二）主持交易所日常工作；
- （三）根据章程和交易规则拟订有关细则和办法；
- （四）拟订风险准备金和特定用途的专项（风险）准备金的使用方案；
- （五）拟订并实施经批准的交易所发展规划、年度工作计划；
- （六）拟订并实施经批准的交易所对外投资计划；

(七) 拟订交易所财务预算方案、决算报告；

(八) 拟订交易所合并、分立、变更组织形式、解散和清算的方案；

(九) 拟订交易所变更名称、住所或者营业场所的方案；

(十) 决定交易所机构设置方案，聘任和解聘工作人员；

(十一) 决定交易所员工的工资和奖惩；

(十二) 本章程规定或者理事会授予的其他职权。

总经理因故临时不能履行职权时，由总经理指定的副总经理代其履行职权。

第四十五条 总经理的任期经济责任审计按照中国证监会的有关规定执行。

第六章 监事会

第四十六条 交易所设监事会，每届任期 3 年。

监事会行使下列职权：

(一) 检查交易所财务；

(二) 监督交易所理事、高级管理人员执行职务行为。当理事、高级管理人员的行为损害交易所利益时，要求理事、高级管理人员予以纠正；

(三) 向会员大会提出提案；

(四) 法律、法规、规章和本章程授予的其他职权。

监事可以列席会员大会、理事会、总经理办公会，并对会议决议事项提出质询或者建议。

监事会开展监督工作中，必要时可以与交易所纪委、审计部门协同进行。

第四十七条 监事会由不少于 5 名监事组成。其中专职监事 1 至 2 名，会员监事单位 1 至 3 名，职工监事的占比不低于监事会人数的 1/3，至少 2 名。

专职监事由中国证监会委派。

监事会或者 1/5 以上会员联合提名，由会员大会选举产生会员监事单位。当选会员监事单位的法定代表人或者其指派的其他高级管理人员作为会员监事单位代表参加监事会会议。

职工监事由交易所职工大会民主选举产生。

第四十八条 监事会设监事长 1 人。监事长的任免，由中国证监会提名，监事会通过。

监事长的任期应当符合中国证监会相关规定。

理事、高级管理人员不得兼任监事。

第四十九条 监事长行使下列职权：

（一）召集监事会会议，主持监事会会议和监事会的日常工作；

（二）督促、检查监事会决议的实施情况；

（三）本章程规定和监事会授予的其他职权。

监事长因故临时不能履行职权时，由监事长指定的监事代其履行职权。

第五十条 监事会会议至少每半年召开 1 次。每次会议应当于会议召开 5 日以前通知全体监事。

有下列情形之一的，应当召开监事会临时会议：

- （一）中国证监会提议；
- （二）1/3 以上的监事提议。

监事会召开临时会议，可以另定召集监事会临时会议的通知方式和通知时限。

监事会会议应当有半数以上监事出席方为有效。监事会会议方式、议事方式、表决方式、工作规则等有关事项，参照本章程第四章理事会有关规定执行。本章程未规定的，参照《公司法》的规定执行。

第七章 业务管理

第五十一条 交易所遵循公开、公平、公正和诚实信用的原则组织期货交易。

第五十二条 期货交易应当按规定通过交易所进行。

交易所应当制定业务规则等管理规定，对交易、结算、交割等业务事项作出明确规范，对违反交易所业务规则的行为制定查处办法，并报中国证监会批准。

第五十三条 交易所通过收取和调整保证金、风险准备金、手续费，实行交易编码、持仓限额、交易限额、套期保值管理、套利交易管理、大户持仓报告、当日无负债结算、

涨跌停板、信息披露、强行平仓、风险警示等制度，对期货交易进行管理和风险控制。

期货交易按规定实行投资者适当性制度。

交易所可以根据业务需要，实行做市商制度。

第五十四条 交易所可设立独立结算机构，为期货合约、期权合约交易提供结算服务，并根据中国证监会规定、章程和业务规则实行自律管理。

第五十五条 交易所根据规定对标准仓单、中转仓单等提货及货权凭证进行注册登记。

第八章 财务管理

第五十六条 交易所财务实行独立核算、自负盈亏，按国家有关财务制度的规定进行管理。

第五十七条 交易所按照国家有关规定，在每一年度结束后4个月内向中国证监会报送经具有证券、期货相关业务资格的会计师事务所审计的年度财务报告。

第五十八条 交易所按照国家规定制定财务管理制度和内部审计制度。

第五十九条 交易所向会员收取有关交易、结算、交割等手续费，年会费和其他费用，并根据情况予以调整。

第六十条 经理事会批准，交易所以其收入抵补各项费用开支，实现的税后净利润，根据有关财务规定转作盈余公积金用于弥补以后年度亏损。

第六十一条 交易所可以根据市场发展、服务实体经济等需要，按照交易所有关规定为市场参与者提供相应的优惠、扶持措施。

第六十二条 为保证交易所正常运行，交易所按规定提取风险准备金，可以根据需要提取特定用途的专项（风险）准备金。

风险准备金应当按国家有关规定管理和使用。

第九章 自律管理与争议处理

第六十三条 交易所可以根据本章程和业务规则，对期货市场参与者的违规、违约行为进行处理。

第六十四条 交易所对违规行为，视情节轻重和后果大小，可以按照业务规则规定采取相应的纪律处分措施、临时处置措施或者其他自律监管措施。

第六十五条 交易所对违约行为，可以按照业务规则规定划付违约方的违约金、赔偿金等。

第六十六条 交易所工作人员的配偶及直系亲属不得参与期货交易。交易所工作人员的配偶及直系亲属违反本规定的，给予该工作人员纪律处分。

第六十七条 交易所设立调解机构，根据自愿原则对会员、客户、交割仓库、期货保证金存管银行等之间因期货交易发生争议进行调解。

会员与交易所之间发生争议，协商无效的，可以依法向中华人民共和国境内的仲裁机构申请仲裁或者人民法院提起诉讼，并适用中华人民共和国法律。

第十章 附则

第六十八条 交易所可以依据本章程制订有关业务规则。本章程中所称业务规则包括交易所交易规则、实施细则、办法等业务管理规范。

第六十九条 本章程中所称“以上、以下”均包括本数。

第七十条 本章程的解释权属于交易所理事会。

第七十一条 本章程的制定和修改经会员大会通过，报中国证监会批准后生效。

第七十二条 本章程生效前经会员大会选举和更换的会员理事和会员监事，其所在单位在本章程生效后自动成为本章程所规定的会员理事单位和会员监事单位，有关会员理事和会员监事自动成为本章程所规定的会员理事单位代表和会员监事单位代表。

第七十三条 本章程自 2017 年 5 月 19 日起实施。

附件 2

郑州商品交易所交易规则

（郑州商品交易所第六次会员大会：2017 年 4 月 20 日修改，自 2017 年 5 月 19 日施行）

第一章 总则

第一条 为规范期货交易行为，保护期货交易各方的合法权益和社会公众利益，根据国家有关法律、法规、规章和《郑州商品交易所章程》，制定本规则。

第二条 郑州商品交易所（以下简称交易所）组织的期货交易及其相关活动，适用本规则。

期货交易是指采用公开的集中交易方式或者中国证券监督管理委员会（以下简称中国证监会）批准的其他方式进行的以期货合约或者期权合约为交易标的的交易活动。

交易所为期货相关的其他业务提供交易、清算、交割等服务的，适用交易所其他有关规定。

第三条 交易所根据公开、公平、公正和诚实信用的原则，组织期货交易及其相关活动，履行自律监管职责。

第四条 会员、客户、交割仓库、境外交易者、境外经纪机构、期货保证金存管银行、做市商及期货市场其他参与者从事期货交易及其相关活动应当遵守法律、法规、规章以及交易所业务规则，遵循诚实信用的原则。

第五条 交易所组织期货交易及其相关活动接受中国证监会的监督管理。

第二章 交易业务

第一节 交易场所及设施

第六条 交易所为期货交易提供交易场所及设施。交易场所及设施包括交易撮合系统、交易席位、应急交易场所及相关的通信系统等。

第七条 交易所在住所地同城设立应急交易场所，保障在紧急情况下会员能够正常进行交易。

会员因通信系统故障及系统升级、变更等原因导致交易系统无法正常运行的，可以申请使用应急交易场所。

第八条 交易所建立住所地同城及异地数据备份，保证交易数据的安全。

第二节 交易主体

第九条 在交易所进行期货交易的，应当是交易所会员和符合法律法规规定的其他机构。

会员和符合法律法规规定的其他机构接入与交易有关的技术系统，应当符合交易所有关规定，接受交易所管理。

第十条 交易所会员分为期货公司会员和非期货公司会员。

交易所可以根据交易、结算、交割等业务的需要设立特别会员。

第十一条 客户应当委托期货公司会员进行期货交易，并事先在期货公司会员处办理开户登记。

客户分为自然人客户和非自然人客户，后者包括一般单位客户和特殊单位客户。

第十二条 境外交易者和境外经纪机构参与境内特定品种期货交易的方式由交易所另行规定。

境内特定品种由中国证监会批准。

境外交易者是指从事期货交易并承担交易结果，在中华人民共和国境外依法成立的法人、其他经济组织，或者依法拥有境外公民身份的自然人。

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客户资金和交易指令并以自己名义为客户进行期货交易资质的金融机构。

第十三条 期货公司会员在接受客户开户申请时，应当向客户提供期货交易风险说明书，确认客户承诺遵守交易所业务规则，并与客户签署期货经纪合同。

第十四条 期货公司会员应当按规定将客户有效身份证明等开户信息通过中国期货市场监控中心有限责任公司报交易所备案。

第十五条 交易所实行客户交易编码制度。期货公司会员应当为每一客户单独开立专门账户、申请交易编码，不得混码交易。

根据法律、法规、规章有关规定需要对资产进行分户管理的特殊单位客户，可以为其分户管理的资产申请交易编码。

第十六条 期货公司会员接受客户委托交易，可以通过书面、电话、自助终端、互联网及中国证监会规定的其他方式进行。

期货公司会员在接受客户委托时，应依序编号，并标记时间。

第十七条 期货公司会员受理其客户的指令后，应当对客户的交易指令进行资金和持仓验证，并及时将指令下达至交易所交易撮合系统。

期货公司会员收到成交回报信息时应当及时通知客户。

第十八条 每个交易日结束，会员可以通过交易所会员服务系统获得成交记录。会员对成交记录有异议的，应当在当日以书面或者其他可以记载的形式向交易所提出。

第十九条 期货公司会员在每日交易闭市后应当为客户提供交易结算报告。

第二十条 期货公司会员对其名下的期货交易先行承担责任，客户对自己委托的期货交易承担最终责任。

第二十一条 期货公司会员应当履行对客户的诚信义务，保守客户交易秘密，防范利益冲突。

第二十二条 期货公司会员应当如实向客户提供本公司的资信和业务情况及信息、咨询等相关服务。

期货公司会员应当充分、持续了解客户信息，加强客户

管理及对客户异常交易行为的监控。

第二十三条 交易所对期货交易、结算、交割资料的保存期限应当不少于 20 年。

期货公司会员对客户有关开户、变更、销户的客户资料档案应当自双方合同终止之日起至少保存 20 年；对客户的交易指令记录、交易结算记录、错单记录、投诉档案以及其他业务记录应当至少保存 20 年。

第三节 上市品种与合约

第二十四条 交易所上市品种为农业、能源、化工、建材和冶金等各个领域的大宗商品及相关指数。

第二十五条 期货合约是指由交易所统一制定的、规定在将来某一特定的时间和地点交割一定数量标的物的标准化合约。

期权合约是指交易所统一制定的、规定买方有权在将来某一时间以特定价格买入或者卖出约定标的物（包括期货合约）的标准化合约。

第二十六条 期货合约的主要条款包括：交易品种、交易单位、报价单位、最小变动价位、每日价格波动限制（涨跌停板幅度）、最低交易保证金、合约交割月份、交易时间、最后交易日、最后交割日、交割品级、交割地点、交割方式、交易代码等。

期权合约的主要条款包括：合约标的物、合约类型、交易单位、报价单位、最小变动价位、涨跌停板幅度、合约月

份、交易时间、最后交易日、到期日、行权价格、行权方式、交易代码等。

期货合约与期权合约（以下统称合约）的附件与合约具有同等法律效力。

第二十七条 最小变动价位是指合约的单位价格涨跌变动的最小值。

第二十八条 期货合约交割月份是指该合约规定进行交割的月份。

期权合约月份是指期权合约对应的标的物的到期月份。

第二十九条 最后交易日是指按照合约规定进行交易的最后一个交易日。

第三十条 合约的交易单位为“手”，期货交易必须以“一手”的整数倍进行，不同交易品种每手合约的标的物数量，在该品种的合约中载明。

第三十一条 合约以人民币或者交易所规定的其他货币计价。采用人民币计价时，计价单位为元。

第三十二条 交易日为每周一至周五（国家法定假日除外）。每一交易日各品种的交易时间安排，由交易所在合约及相关实施细则中予以规定。

第四节 基本交易制度

第三十三条 期货交易实行保证金制度。保证金是指期货交易者按照规定交纳的资金或者提交的价值稳定、流动性强的标准仓单、国债等有价值证券，用于结算和保证履约。

第三十四条 保证金分为结算准备金和交易保证金。结算准备金是指未被合约占用的保证金；交易保证金是指已被合约占用的保证金。

当买卖双方成交后，交易所按持仓合约价值的一定比率或者交易所规定的其他方式收取交易保证金。

交易所可调整交易保证金水平，具体由实施细则另行规定。

第三十五条 期货交易实行涨跌停板制度。合约在一个交易日中的交易价格不得高于或者低于规定的涨跌幅度，超过该涨跌幅度的报价视为无效，不能成交。

第三十六条 期货交易实行持仓限额制度。持仓限额是指交易所对会员或者客户的持仓量规定的最高数额。

第三十七条 交易所实行套期保值管理制度。交易所对套期保值申请者的经营范围和以前年度经营业绩资料、现货购销合同等能够表明其现货经营情况的资料进行审核，确定其套期保值额度。

套期保值额度按交易所有关规定使用。

第三十八条 交易所实行套利交易管理制度。交易所根据套利交易的类型确定相应的保证金标准和限仓标准。

第三十九条 期货持仓可以通过期货转现货的方式了结。持有同一交割月份期货合约的双方，可以在达成现货买卖协议后，共同向交易所提出申请，将各自持仓按双方达成、符

合有关实施细则规定的平仓价格由交易所代为平仓。同时双方按达成的现货买卖协议进行现货交换。

第四十条 期货交易实行投资者适当性制度。期货公司会员根据有关法律法规和交易所相关业务规则，评估客户的认知水平和风险承受能力，选择适当的客户审慎参与期货交易。

交易所对期货公司会员投资者适当性制度的执行情况进行监督检查。

第四十一条 期货交易可以实行做市商制度。经交易所认可的做市商，根据交易所相关业务规则和做市商协议，为指定品种的期货或期权合约提供双边报价等服务。

第四十二条 会员进行期货交易应当按规定向交易所交纳交易手续费、交割手续费等相关费用。费用标准由交易所另行制定。

期货公司会员向客户收取手续费，应当代收国家规定由客户上缴的税费。

第五节 申报、成交与价格

第四十三条 交易指令的种类包括限价指令、市价指令、取消指令、套利指令以及交易所规定的其他指令。

第四十四条 委托指令在交易日当日有效。

在集合竞价申报时间及连续竞价时间内，交易所接受会员提交的买、卖申报指令。

第四十五条 在涨跌停板幅度以内的申报为有效申报，超过涨跌停板幅度的申报为无效申报。

会员结算准备金低于交易所规定的结算准备金最低余额的，开仓申报无效。

第四十六条 集合竞价撮合时间内，交易所不接受取消申报。其他接受交易申报的时间内，未成交申报可以取消。

第四十七条 集合竞价阶段，按照最大成交量原则进行撮合，成交价格为可实现最大成交量的价格。集合竞价的所有交易以同一价格成交。

第四十八条 连续竞价阶段，交易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。

价格优先是指，较高价格买入申报优先于较低价格买入申报，较低价格卖出申报优先于较高价格卖出申报。

时间优先是指，买卖方向、价格相同的，先申报的优先于后申报的。先后顺序按交易所系统接受申报的时间确定。

某一合约以涨跌停板价格成交的，撮合成交原则为平仓优先和时间优先。

第四十九条 买卖申报经交易系统撮合成交即为生效。某一合约交易时间内的即时成交价格即为该合约的最新价。

第五十条 期货合约的交易价格是指该期货合约的交割标准品在基准交割仓库或基准交割地点交货的含税价格，交易所另有规定的除外。

第五十一条 某一合约开市前五分钟内经集合竞价产生的成交价格即为该合约的开盘价。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。

第五十二条 某一合约当日交易的最后一笔成交价格即为该合约的收盘价。

第五十三条 期货、期权合约当日结算价由交易所在实施细则中规定。

第五十四条 新上市合约的挂牌基准价由交易所确定。

第三章 结算业务

第五十五条 结算业务是指交易所根据公布的结算价格和交易所有关规定对期货交易双方的交易、交割结果等进行资金清算和划转的业务活动。

第五十六条 交易所作为中央对手方统一组织期货交易的结算。

第五十七条 交易所对会员进行结算，期货公司会员对其受托的客户进行结算。

期货公司会员对客户的期货交易承担履约责任，客户无法履约时，期货公司会员应当代为履约，并取得对违约客户的相应追偿权。

第五十八条 期货公司会员向客户收取的保证金不得低于交易所规定的保证金标准。期货公司会员可以根据市场运行情况和客户的资信状况调整对其收取保证金的标准。

第五十九条 交易所应当制定期货保证金存管银行管理办法，规定期货保证金存管银行资格的取得与终止的条件和程序、期货保证金存管银行的权利和义务，对期货保证金存管银行进行监督管理。

第六十条 交易所在期货保证金存管银行开设专用结算账户，用于存放会员的保证金及相关款项。

会员应当在期货保证金存管银行开设专用资金账户存放客户保证金，以备随时交付保证金及有关款项。会员专用资金账户只能用于会员与客户、会员与交易所之间期货业务的资金往来结算。

期货公司会员不得挪用客户资金。

第六十一条 交易所实行当日无负债结算制度。

第六十二条 当日交易结束后，交易所对每一会员的盈亏、交易保证金、税金、交易手续费等款项进行结算。会员可以通过会员服务系统获取相关的结算数据。

第六十三条 会员结算准备金低于交易所规定的结算准备金最低余额的，应当追加保证金。

第六十四条 会员应当在下一个交易日开市前补足至结算准备金最低余额。结算准备金余额大于零而低于结算准备金最低余额的，不得开仓；结算准备金余额小于零的，交易所对该会员强行平仓。

第六十五条 期货公司会员应当详细记载交易业务，按日序时登记客户买卖合约的开仓、平仓、持仓、交割情况，

及时准确地反映客户盈亏、费用以及资金、收付等财务状况，控制客户的交易风险。

第六十六条 交易所应当按照有关规定提取、管理和使用风险准备金和专项（风险）准备金。风险准备金用于为维护期货市场正常运转提供财务担保和弥补交易所因风险事件带来的亏损。

专项（风险）准备金是在税后利润中提取的任意盈余公积，用于处置交易所运作发展中的各类风险。

第四章 交割业务

第六十七条 期货交割的方式为实物交割以及交易所规定的其他方式。

第六十八条 实物交割包括标准仓单交割和车（船）板交割等方式。

标准仓单交割是指，卖方通过将交割仓库开具的相关商品标准仓单转移给买方，以完成实物交割。

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，以完成货物交收。

第六十九条 交易所可以实行保税交割制度。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。保税交割制度由交易所在相关实施细则中规定。

第七十条 期货合约最后交易日后未平仓合约应当进行交割。

第七十一条 到期合约的交割只能以会员的名义进行。客户交割应当通过会员办理。

第七十二条 期货合约的交割标准品、替代品及升贴水由交易所在期货合约或者实施细则中载明。

第七十三条 交割配对的原则及交割流程由交易所在相应的实施细则中予以规定。

第七十四条 会员办理交割时有异议的，应当在交易所规定的时间内提出复议或者申请复检。

第七十五条 交割结算价为该期货合约交割结算的基准价。

第七十六条 交割商品发生允许范围内的数量溢短时，按照交易所规定计算溢短货款。

第七十七条 非基准交割地点交割与基准交割地点交割的升贴水标准由交易所另行规定。

第七十八条 实物交割时，卖方未能在规定时间内如数交付标准仓单或者实物的，或者车（船）板交割卖方的货物质量不符合交割质量规定的；买方未能在规定时间内如数交付货款的，即为交割违约。

第七十九条 买卖双方发生交割违约行为的，交易所可采用违约金、赔偿金或者交易所规定的其他方式处理违约事宜，具体按交易所有关规定处理。

第八十条 会员不得因其客户违约而不履行合约交割责任，对不履行交割责任的，交易所有权强制执行。

第五章 交割仓库与标准仓单

第八十一条 交割仓库是指交易所指定的，为商品期货合约履行实物交割提供服务的经营组织。

交割仓库包括仓库、厂库和中转仓库。

第八十二条 交割仓库由交易所确定后公告市场。

第八十三条 交割仓库应遵守交易所的业务管理规定，服从交易所的监督管理。

第八十四条 交割仓库有下列行为之一的，交易所有权责成其整改或赔偿经济损失，情节严重的，取消其交割仓库资格，追究其法律责任：

- (一) 出具虚假仓单；
- (二) 违反交易所业务规则，限制交割商品的入库、出库；
- (三) 泄露与期货交易有关的商业秘密；
- (四) 违反规定参与期货交易；
- (五) 其他违反交易所有关规定的行为。

第八十五条 标准仓单是指仓库或者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。

标准仓单包括仓库标准仓单和厂库标准仓单。

第八十六条 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。

第八十七条 交割仓库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 信息管理

第八十八条 交易所对期货交易形成的各类基础行情信息和加工产生的信息产品享有权益。未经交易所许可，任何单位和个人不得进行商业目的传播、经营和使用。

第八十九条 交易所对当日交易的价格行情以及必要的统计资料等其他有关信息予以发布。

第九十条 交易所发布的信息包括：合约名称、合约交割月份、开盘价、最新价、涨跌、收盘价、结算价、最高价、最低价、成交量、持仓量及其持仓变化、会员成交量和持仓量排名、各交割仓库经交易所核准的协议库容量、标准仓单数量及其增减量等其他需要公布的信息。

信息发布应当根据不同内容按实时、每日、每周、每月、每年等方式定期发布。

第九十一条 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。

第九十二条 交易所的行情发布正常，但因公共媒体转发发生故障，影响会员和客户交易，交易所不承担责任。

第九十三条 任何单位或者个人不得发布虚假的或者带有误导性质的信息。

第九十四条 交易所、会员、交割仓库、期货保证金存管银行、其他为期货交易提供服务的相关组织，以及上述机构的工作人员不得泄露业务中获取的商业秘密。

交易所向司法机关或者其他相关机关提供信息，应当履行法定程序，并执行相应的保密规定。

第九十五条 交易所可以基于期货、期权等交易行情或者现货数据编制相关指数，向市场发布，也可以开发或者授权外部机构开发指数产品。

未经交易所许可，任何单位和个人不得擅自利用交易所信息编制指数或者上市与交易所发布指数相关的产品。

第七章 风险控制

第九十六条 交易所可以根据市场风险状况以及合约价格出现同方向连续涨跌停板的情况，采取调整涨跌停板幅度、调整交易保证金、调整交易限额、调整交易手续费、强行平仓、强制减仓等措施管理控制风险。

采取风险控制措施后仍然无法释放风险时，交易所应当宣布进入异常情况，由交易所理事会决定采取进一步的风险控制措施。

第九十七条 交易所可以建立期货交易持续监测指标体系，对期货交易进行科学监测。

第九十八条 会员或者客户存在超仓、未按规定及时追加交易保证金等违规行为或者交易所规定的其他情形的，交易所所有权对其采取强行平仓措施。

强行平仓的具体方式由相关实施细则另行规定。

第九十九条 强行平仓盈利按照有关规定处理。发生的费用及损失由违规者承担。因市场原因无法强行平仓造成的损失扩大部分也由违规者承担。

第一百条 会员无法履约时，交易所所有权采取下列保障措施：

（一）暂停开仓；

（二）按照规定强行平仓，并用平仓后释放的保证金履约赔偿；

（三）依法处置标准仓单、有价证券等担保资产；

（四）用该会员的会员资格转让所得款项和其他资金履约赔偿；

（五）交易所使用风险准备金，代违约会员履约；

（六）交易所使用自有资金，代违约会员履约。

交易所代违约会员履约后，依法取得相应追偿权。

第八章 异常情况处理

第一百零一条 期货交易过程中，出现以下情形之一的，交易所可以宣布进入异常情况，采取紧急措施化解风险：

（一）地震、水灾、火灾等不可抗力或者计算机系统故障、意外事件等不可归责于交易所的原因导致交易无法正常进行；

（二）会员出现结算、交割危机，对市场正在产生或者将产生重大影响；

（三）出现本规则第九十六条情况并采取相应措施后仍未化解风险；

（四）交易所规定的其他情形。

出现前款第一项异常情形时，交易所总经理可以采取调整开市收市时间、暂停交易的紧急措施；出现前款第二、三、四项异常情况时，理事会可以决定采取调整开市收市时间、暂停交易、调整涨跌停板幅度、提高交易保证金、暂停开仓、限期平仓、强行平仓、限制出金、强制减仓等紧急措施。

第一百零二条 交易所宣布异常情况并决定采取紧急措施前应当报告中国证监会。

第一百零三条 交易所宣布进入异常情况并决定暂停交易的，暂停交易的期限不得超过3个交易日，经中国证监会批准延长的除外。

第九章 自律管理

第一百零四条 交易所依据有关法律、法规、规章、交易所章程、本规则及有关规定，对涉及交易所期货交易的业务活动实施自律管理。

第一百零五条 交易所监督管理的主要内容是：

（一）监督、检查期货市场法律、法规、规章及业务规则的落实执行情况，控制市场风险；

（二）监督、检查会员、境外经纪机构业务行为及内部管理情况；

（三）监督、检查会员、境外经纪机构的财务、资信状况；

（四）监督、检查客户、境外交易者、交割仓库和期货保证金存管银行及期货市场其他参与者与期货有关的业务活动；

（五）调查处理各种违规案件，调解、处理期货交易纠纷；

（六）对其他违背公开、公平、公正原则、引发市场风险的行为进行监督管理。

第一百零六条 交易所每年应当对会员遵守交易所业务规则的情况进行抽样检查或者全面检查，并将年度检查计划和检查结果及时上报中国证监会。

第一百零七条 交易所对实际控制关系账户进行管理。存在实际控制关系的非期货公司会员和客户应当按照交易所规定如实报备相关信息。

具有实际控制关系的账户投机持仓、异常交易行为次数合并进行计算。

第一百零八条 交易所实行大户报告制度。当会员或者客户某合约的持仓量达到交易所规定的标准时，会员或者客户应当向交易所报告其资金、持仓等情况。

交易所可以根据市场风险状况，调整持仓报告标准。

第一百零九条 交易所实行异常交易管理制度，对异常交易行为进行监管。发现涉嫌违法违规的，按照相关规定报告中国证监会进行查处。

第一百一十条 交易所对程序化交易进行监管，进行程序化交易的非期货公司会员和客户应当按照交易所规定报备相关信息。

第一百一十一条 交易所发现涉嫌违规行为的，应当立案调查。

第一百一十二条 交易所履行自律管理职责时，可以按有关规定行使调查、取证等职权，会员、客户、境外交易者、境外经纪机构、交割仓库、期货保证金存管银行及期货市场其他参与者应当配合。

第一百一十三条 会员、客户、境外交易者、境外经纪机构、交割仓库和期货保证金存管银行及期货市场其他参与者应当接受交易所对其期货业务的监督管理。对于不如实提供资料、隐瞒事实真相、故意回避等不协助或妨碍交易所工

作人员行使职权的，交易所按有关规定采取必要的限制性措施、给予纪律处分。

第一百一十四条 有根据认为会员、客户、境外交易者或者境外经纪机构违反交易所业务规则并且对市场正在产生或者即将产生重大影响，为防止违规行为后果进一步扩大，交易所可以对其采取下列临时处置措施：

- （一）限制入金；
- （二）限制出金；
- （三）限制开仓；
- （四）提高保证金标准；
- （五）限期平仓；
- （六）强行平仓。

前款临时处置措施由交易所总经理决定，采取前款第四、五、六项临时处置措施后应当及时报告中国证监会。

交易所采取临时处置措施的，应当以书面、录音电话等可记录的方式通知处置对象，并说明采取临时处置措施的依据。

第一百一十五条 会员、客户、境外交易者、境外经纪机构、交割仓库、期货保证金存管银行及期货市场其他参与者在从事期货相关业务时涉嫌重大违规，交易所立案调查的，为防止违规行为后果进一步扩大，交易所可采取相应措施。

第一百一十六条 对期货交易过程中发生的重大问题，经理事会决定，可以由会员代表、交易所工作人员及有关人

士组成特别调查委员会进行调查。特别调查委员会存续期间，按本规则行使监督管理权。特别调查委员会实行回避制度。

第一百一十七条 交易所工作人员不能正确履行监督管理职责的，会员、客户、境外交易者、境外经纪机构、交割仓库、期货保证金存管银行及期货市场其他参与者有权向交易所或者中国证监会投诉、举报。经查证属实的，应当严肃处理。

第一百一十八条 交易所应当制定违规行为查处办法对违规行为进行处理。

第十章 争议处理

第一百一十九条 会员、客户、境外交易者、境外经纪机构、交割仓库、期货保证金存管银行及期货市场其他参与者之间发生有关期货业务纠纷的，可以自行协商解决，也可以自愿提请交易所调解。

第一百二十条 提请交易所调解的当事人，应提出书面调解申请。交易所的调解意见应当经当事人确认。调解意见书经当事人签章后生效。

第一百二十一条 会员、客户、境外交易者、境外经纪机构、交割仓库、期货保证金存管银行及期货市场其他参与者与交易所之间发生争议，协商无效的，应当向中华人民共和国境内的仲裁机构申请仲裁或者向人民法院提起诉讼，并适用中华人民共和国法律。

第一百二十二条 交易所在履行法律、法规、规章及业务规则规定的职责时，对非因交易所故意或者重大过失造成的损失，不承担责任。

第十一章 附则

第一百二十三条 交易所可以根据本规则制定实施细则或者办法。

第一百二十四条 本规则的制定和修改应当由会员大会通过，报中国证监会批准。

第一百二十五条 本规则由交易所理事会负责解释。

第一百二十六条 本规则自 2017 年 5 月 19 日起实施。