

# 郑州商品交易所 2018 年自律管理工作报告

郑商发〔2019〕11 号

2018 年，郑州商品交易所(以下简称郑商所)深入学习贯彻习近平新时代中国特色社会主义思想 and 党的十九大精神，认真落实中国证监会期货监管工作部署，以提高市场运行质量为主线，积极推进规则完善、业务创新、市场监管、对外开放等各项工作，切实履行一线监管职责，防范和化解市场风险，不断提升服务实体经济、服务国家战略的能力。

## 一、推进业务创新，提高服务实体经济能力

(一) 推进产品业务创新和对外开放，拓展服务的广度和深度

2018 年，郑商所稳步推进红枣、咖啡、尿素、短纤、纯碱等期货和棉花、PTA 期权的研发工作，持续做好商品指数期货等新型产品研发工作，进一步拓展服务实体经济的广度和深度。顺利上线综合业务平台，平稳推出仓单交易、基差贸易业务。有序推进对外开放工作，创新引入出口服务商制度和仓单竞卖方式，实行适当性互认机制，设立 PTA 保税交割仓库，稳步实施 PTA 引入境外交易者工作。

(二) 完善业务规则体系，做深做细上市品种

2018 年，郑商所发布实施《郑州商品交易所异常交易行为管理办法》与《郑州商品交易所实际控制关系账户管理办

法》，修订完善《郑州商品交易所期货交易风险控制管理办法》《郑州商品交易所期货交易细则》等业务规则，完善 PTA 引入境外交易者涉及的各项规则及业务细则，修订白糖、苹果等品种合约规则，优化白糖、菜油等品种交割仓库布局与升贴水，优化白糖期权合约的到期日及挂牌方式。

### （三）优化套保审核机制，便利产业客户套保

持续完善套保审核委员会工作机制及工作流程，创新主要品种一般月份套保审批方式，提高套保审批的规范化、透明度，方便产业客户套期保值。2018 年，郑商所共受理 231 个客户的 1052 份套保申请，申请量 969 万手，审批量 715 万手。

### （四）推进技术系统建设，保障系统安全运行

2018 年，郑商所制定了信息技术系统发展规划，引入机器学习、图计算等人工智能新技术，进一步提升技术系统的高效性、安全性和稳定性。优化交易系统期权做市商双边报价，并支持期货做市商双边报价。利用全新架构完成结算系统新版本开发上线工作，大幅提高结算效率。持续推进六期交易系统、交割、电子仓单、会员服务、金融监管科技应用等技术系统开发建设。

## 二、加强市场监管，查处违法违规行为

（一）贯彻落实依法全面从严监管要求，切实履行一线监管职责

2018年，郑商所持续加强市场监管，严格依据规则查处违法违规行为，切实履行一线监管职责。全年共处理异常交易及违规交易线索423起，向证监会稽查局移送涉嫌违法违规线索3起，处理违规交易案件60起，对涉案的66个自然人客户、18个法人客户给予警告、暂停开仓等纪律处分。全年共认定实际控制关系账户552组，涉及1471个客户，对于具有实际控制关系但不如实申报相关信息的7组共37个客户，依规采取限制开仓的监管措施。

## （二）强化交割仓库管理，完善交割仓库管理机制

2018年，郑商所持续做好交割仓库管理工作。通过集中检查、日常巡查、重点抽查、会员单位协助交易所检查和远程视频监控等形式加强对交割仓库和交割商品的日常监管，持续实施标准仓单统一保险，确保交割商品安全，防范和化解交割风险。全年共组织仓库现场检查243次，对4家交割仓库开展监管谈话，暂停或取消交割仓厂库29家，处理7个品种31起交割纠纷。

## （三）加大现场检查、培训力度，促进会员合规运作

2018年，郑商所对北京、上海、广州、深圳等8个地区的23家期货公司会员和1家自营会员开展年度合规运作检查，配合证监会对20家期货公司会员开展合规运作检查，及时发现、纠正存在的问题，促进会员合规运作。郑商所积极搭建行业合规交流平台，2018年联合“五位一体”监管机

构举办 5 期期货公司合规培训班，不断提高会员合规意识，推动期货市场各项业务合规开展。

#### **（四）加强监管协作，提升监管效力**

充分发挥“五位一体”监管协作体系优势，以监管合力提升监管效率。2018 年，郑商所持续强化市场监控，深入排查涉嫌市场操纵、编造传播虚假信息等违法违规行为线索，积极配合稽查执法部门开展调查工作，切实维护公开、公平、公正的市场秩序。

### **三、防范市场风险隐患，保障市场平稳健康运行**

2018 年，郑商所加强风险研判，及时分析市场运行情况和潜在风险隐患，研究风险防范和处置措施。针对少数品种出现的价格大幅波动、阶段性交易过热等情况，密切关注国内外经济形势，跟踪期现货市场动态和仓单注册进度，采取加强实时监控、调查实际控制关系、调整交易保证金标准、调整涨跌停板幅度、调整交易手续费、开展风险警示谈话等措施，有效防范化解市场风险隐患，守住不发生系统性风险的底线。

### **四、加强市场培育，推进投资者教育工作**

2018 年，郑商所通过多种形式加强市场培育，积极推进投资者教育工作。全年共举办“三业活动”533 场，参与人数约 3.2 万人次；组织视频讲座 104 场，累计培训人员约 1.7 万人次；举办会员中层业务人员培训班 9 场，累计培训会员

高管、中层及业务骨干人员约 1400 人次；持续开展“点基地”建设，新建“点基地”14 家，首次评出 3 家白糖期权“点基地”；举办 11 期“理性投资 从我做起”苹果期货知识巡讲专项活动，通过普及期货知识、揭示市场风险，传递理性投资理念，提升投资者风险防范意识，引导投资者合规交易。

2019 年，郑商所将以习近平新时代中国特色社会主义思想为指导，坚持稳中求进总基调，积极推进产品业务创新，做精做深做细现有品种，加强信息技术系统建设，持续推进对外开放工作，加强市场监管和风险防范，守住不发生系统性风险的底线，不断提升市场运行质量和效率，进一步提高服务实体经济、服务国家战略的能力。

郑州商品交易所

2019 年 1 月 10 日