

# 关于红枣期货合约和规则制度征求意见的公告

〔2019〕23 号

为保证红枣期货合约和规则制度设计合理，满足市场各参与主体需求，郑州商品交易所现就红枣期货合约和规则制度（征求意见稿）征求市场意见。其中，规则条文中带删除线部分为本次删除内容，带阴影部分为本次新增内容。

请于 2019 年 4 月 10 日前通过以下方式将意见反馈至郑州商品交易所。

联系人：吴克钦、孙元瑞

电话：0371-65610961、0371-65613871

电子邮箱：kqw@czce.com.cn、yrsun@czce.com.cn

特此公告。

- 附件：1. 郑州商品交易所干制红枣期货合约（征求意见稿）
2. 《郑州商品交易所交割细则（修订草案征求意见稿）》
3. 《郑州商品交易所标准仓单及中转仓单管理办法（修订草案征求意见稿）》
4. 《郑州商品交易所期货交易风险控制管理办法

(修订草案征求意见稿)》

郑州商品交易所

2019 年 4 月 2 日

## 附件 1

### 郑州商品交易所干制红枣期货合约（征求意见稿）

|          |                                                                                        |
|----------|----------------------------------------------------------------------------------------|
| 交易品种     | 干制红枣（简称“红枣”）                                                                           |
| 交易单位     | 5 吨/手                                                                                  |
| 报价单位     | 元（人民币）/吨                                                                               |
| 最小变动价位   | 5 元/吨                                                                                  |
| 每日价格波动限制 | 上一交易日结算价±5%及《郑州商品交易所期货交易风险控制管理办法》相关规定                                                  |
| 最低交易保证金  | 合约价值的 7%                                                                               |
| 合约交割月份   | 1、3、5、7、9、12 月                                                                         |
| 交易时间     | 每周一至周五（北京时间 法定节假日除外）<br>上午 9：00-11：30，下午 1：30-3：00 及交易所规定的其他交易时间<br>最后交易日上午 9：00-11：30 |
| 最后交易日    | 合约交割月份的第 10 个交易日                                                                       |
| 最后交割日    | 合约交割月份的第 12 个交易日                                                                       |
| 交割品级     | 见《郑州商品交易所期货交割细则》                                                                       |
| 交割地点     | 交易所指定交割仓库                                                                              |
| 交割方式     | 实物交割                                                                                   |
| 交易代码     | CJ                                                                                     |
| 上市交易所    | 郑州商品交易所                                                                                |

## 附件 2

# 郑州商品交易所交割细则（修订草案征求意见稿）

## 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、**红枣**：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、红枣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 $\leq 2.0\%$ ，300s $\leq$ 降落数值 $\leq 550\text{s}$ ；内在品质指标稳定时间 $\geq 8$ 分钟、湿面筋 $\geq 30\%$ 、拉伸面积（135min） $\geq 90\text{cm}^2$ 。

替代品质量差异及升贴水：

（一）内在品质指标稳定时间 $\geq 6$ 分钟、湿面筋 $\geq 28\%$ 、拉伸面积（135min） $\geq 75\text{cm}^2$ 、容重 $\geq 750\text{g/L}$ ，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 $\geq 12$ 分钟、湿面筋 $\geq 30\%$ 、拉伸面积（135min） $\geq 100\text{cm}^2$ 的，升水 80 元/吨；稳定时间 $\geq 16$ 分钟、湿面筋 $\geq 30\%$ 、拉伸面积（135min） $\geq 120\text{cm}^2$ 的，升水 120 元/吨。

（二）强麦入库时，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。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。

（三）当贴水的替代品交割时， $1.0\% < \text{杂质} \leq 1.5\%$ 的，以 1.0%为基准，杂质每超 0.5%，入库扣量（出库补量）1.0%；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， $8.0\% < \text{不完善粒} \leq 12.0\%$ 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%。

**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 $\pm$ 5 包（227 $\pm$ 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%， $34.5\% \leq \text{粗蛋白质} < 35.0\%$ ，贴水 35 元/吨； $34.0\% \leq \text{粗蛋白质} < 34.5\%$ ，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)  $< \text{脂肪酸值} \leq 25\text{mg}/100\text{g}$ (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

≤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%<杂质≤1.5%的，入库扣量（出库补量）0.5%；1.5%<杂质≤2.0%的，入库扣量（出库补量）1.0%。

（三）30%<垩白粒率≤40%且粒型（长宽比）≥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 19mg/100g（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 22mg/100g（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 22mg/100g（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 25mg/100g（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  $2\text{m} \times 2.44\text{m}$ ）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 $\pm 500$  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） $\times 2$ 。

**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 $\leq 0.6\%$ ， $30\% \leq$ 干燥无灰基挥发分 $\leq 42\%$ ，干燥基灰分 $\leq 30\%$ ，全水 $\leq 20\%$ 的动力煤。

替代品及升贴水：收到基低位发热量 $\geq 4800$  千卡/千克，干燥基全硫 $\leq 1\%$ ， $30\% \leq$ 干燥无灰基挥发分 $\leq 42\%$ ，干燥基灰分 $\leq 30\%$ 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 $\leq$ 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 $\times$ 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）。

**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）。

**第五十五条** 锰硅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 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 32 英支普梳棉本色筒子单纱（环锭纺）：线密度 18.2tex（允许偏差 $\pm 2\%$ ）、棉纤维含量 100%、 $14.0 \text{ cN/tex} \leq \text{单纱断裂强度} < 14.7 \text{ cN/tex}$ 、 $8.5\% \leq \text{单纱断裂强力变异系数} \leq 9.0\%$ 、条干均匀度变异系数 $\leq 15.5\%$ 、-50%千米细节 $\leq 10$  个/ $10^3 \text{ m}$ 、+50%千米粗节 $\leq 220$  个/ $10^3 \text{ m}$ 、+200%千米棉结 $\leq 450$  个/ $10^3 \text{ m}$ 、百米重量变异系数 $\leq 2.2\%$ 、实际捻系数 360–420、38 处/20kg $<$ 异性纤维含量 $\leq 81$  处/20kg（对应折算 7 处/200km $<$ 异性纤维含量 $\leq 15$  处/200km）。

**第五十九条** 替代品及升贴水：棉纱单纱断裂强度、单纱断裂强力变异系数和异性纤维含量指标符合以下规定，且其他指标符合基准品要求的，可以替代交割。

（一） $12.0 \text{ cN/tex} \leq \text{单纱断裂强度} < 14.0 \text{ cN/tex}$  及  $14.7 \text{ cN/tex} \leq \text{单纱断裂强度} \leq 16.2 \text{ cN/tex}$ ；

（二） $7.5\% < \text{单纱断裂强力变异系数} < 8.5\%$  及  $9.0\% < \text{单纱断裂强力变异系数} \leq 10.5\%$ ；

（三）异性纤维含量  $\leq 38 \text{ 处/20kg}$  及  $81 \text{ 处/20kg} < \text{异性纤维含量} \leq 200 \text{ 处/20kg}$ （对应折算异性纤维含量  $\leq 7 \text{ 处/200km}$  及  $15 \text{ 处/200km} < \text{异性纤维含量} \leq 37 \text{ 处/200km}$ ）。

替代交割品升贴水由交易所另行制定并公告。

**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《纺织品 纱线异性纤维分级与检验方法》（DB41/T 1662-2018）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/T 398-2008）执行。

《纺织品 纱线异性纤维分级与检验方法》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、-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，并标明生产日期。

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 $\pm 0.2\%$ 。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  $75\text{mm}\leq$ 果径 $<80\text{mm}$ 的红富士苹果,其中果径容许度 $\leq 5\%$ , $10\%<$ 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 $\times$ 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。

### **第十九节 红枣**

**第六十六条** 交割单位：10 吨。同一交割单位内的交割商品应满足同一生产厂家要求。

**第六十七条** 红枣交割适用国家标准、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 干制红枣》（GB/T 5835-2009）（以下简称《红枣国标》）一等等级规格且均匀度允差 $\leq 60\%$ 、180 个/千克 $<$ 每千克果粒数 $\leq 230$  个/千克的灰枣，干基总糖含量 $\geq 75\%$ ， $15\% \leq$ 含水率 $\leq 25\%$ ，一般杂质 $\leq 0.1\%$ ，表面清洁，容许度、总糖含量及浆头果、不熟果、病虫果、破头果、油头果单项占比不作要求。

$$\text{干基总糖含量} = \frac{\text{总糖含量}}{(1 - \text{含水率})} \times 100\%, \quad \text{均匀度允差} = \frac{\text{Max}\{(\text{最大单果重} - \text{平均单果重}), (\text{平均单果重} - \text{最小单果重})\}}{\text{平均单果重}} \times 100\%$$

替代品及升贴水：

（一）每千克果粒数 $\leq 180$  个/千克或 230 个/千克 $<$ 每千克果粒数 $\leq 280$  个/千克的可替代交割，升贴水以交易所公告为准。

（二）入库时： $15\% \leq$ 含水率 $\leq 25\%$ 的，足量入库； $25\% <$ 含水率 $\leq 26\%$ 的，以 25%为基准，含水率每超 0.1%，扣量 0.2%。出库时： $15\% \leq$ 含水率 $\leq 25\%$ 的，足量出库； $25\% <$ 含水率 $\leq 26\%$ 的，以 25%为基准，含水率每超 0.1%，补量 0.2%，由仓库承担。

**第六十八条** 红枣包装及标志应符合《红枣国标》的规定。

包装要求：外包装使用彩色覆膜纸箱，纸箱应具有较强的抗压强度，防雨防潮，满足运输及存储要求。内包装使用塑料衬膜（袋）。每箱净含量  $10\text{kg} \pm 0.15\text{kg}$ 。

标志要求：外包装上应标明品名、品种、产地、净含量（kg）、生产日期，印刷符合《包装储运图示标志》（GB/T 191-2008）规定的防雨、防压等相关储运图示，标志字迹应清晰无误。

### 第三章 交割基准价与升贴水

**第六十九条** 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、红枣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）。

**第七十条** 仓库、厂库、指定交割计价点及升贴水由交易所确定并公告。

**第七十一条** 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

**第七十二条** 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、**红枣**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>1</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

---

<sup>1</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。

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、红枣品种当日闭市后，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予以配对（配对日）。~~—后苹果由~~计算机按先车（船）板后仓单的原则予以配对（配对日）。

**第七十三条** 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、红枣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。

**第七十四条** 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）。

**第七十五条** 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。

**第七十六条** 交割关系一经确定，买卖双方不得擅自调整或者变更。

**第七十七条** 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。

**第七十八条 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。

**第七十九条 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。

#### **第八十条 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。

**第八十一条** 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**

**第八十二条** 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。

**第八十三条** 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。

**第八十四条** 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。

**第八十五条** 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。

**第八十六条** 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。

**第八十七条** 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。

**第八十八条** 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。

**第八十九条** 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。

**第九十条** 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。

**第九十一条** 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。

**第九十二条** 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×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×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×实测发热量×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 $\times 20\%$ |
| 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 $\times 80\%$     |

**第九十三条** 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**

**第九十四条** 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、红枣开具增值税专用发票或农产品销售发票。

**第九十五条** 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发票（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发票（普通）发票的，视为拒绝提供增值税专用发票（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发票（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发票（普通）发票两个工作日内（含该日），对增值税专用发票（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。

**第九十六条** 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**

**第九十七条** 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。

**第九十八条** 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。

### **第九十九条 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。

**第一百条** 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。

**第一百零一条** 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

**第一百零二条** 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、红枣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。

**第一百零三条** 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。

**第一百零四条** 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、**红枣**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。

**第一百零五条** 普麦、强麦、早粳稻、晚粳稻、粳稻、苹果无包装物。棉花、白糖、PTA、菜籽、菜粕、硅铁、锰硅、棉纱、红枣包装物不另行计价。

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。

**第一百零六条** 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

**第一百零七条** 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。

**第一百零八条** 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。

**第一百零九条** 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

**第一百一十条** 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。

**第一百一十一条** 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。

**第一百一十二条** 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

**第一百一十三条** 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。

**第一百一十四条** 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。

**第一百一十五条** 本细则解释权属于郑州商品交易所。

**第一百一十六条** 本细则自 2019 年 3 月 4 日起施行。

## 附件 3

# 郑州商品交易所标准仓单及中转仓单管理办法（修订草案征求意见稿）

## 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、红枣。

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、红枣为 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，由仓库妥善保存。

**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** 重量验收：由仓库验收棉纱重量。

**第七十九条** 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。

**第八十一条** 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 180 天的；
- （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

**第八十二条** 苹果入库时的装果容器采用塑料筐或木（铁）筐的形式。

**第八十三条** 重量验收：采用抽筐检斤方式。

**第八十四条** 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。

### 第十四节 红枣入库

**第八十六条** 重量验收可采用过地磅同时抽箱检斤方式，或单独抽

箱检斤方式。

**第八十七条** 质量验收由仓库负责，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。

**第八十八条** 红枣抽样检验按每 90 吨一个样品抽取；不足 90 吨的按 90 吨计。取样件数不低于总件数的 0.5%，取样量不少于 1kg。不同厂家生产的红枣须分开抽样。

**第八十九条** 检验结果不符合交割质量标准的，经双方协商，仓库可提供整理等服务。整理后，仍不符合交割质量标准的，不允许注册仓单。

**第九十条** 货物入库后，仓库应于 7 个工作日内做出质量检验结果，并及时通知货主。如遇不可抗力除外。

## 第五章 标准仓单及中转仓单注册

### 第一节 仓库仓单注册

**第九十一条** 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。

生产日期在 11 月 1 日之前的红枣不得在当年 11 月 1 日(含该日)之后注册。

**第九十二条** 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。

**第九十三条** 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。

**第九十四条** 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**

**第九十五条** 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。

**第九十六条** 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。

**第九十七条** 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。

**第九十八条** 单个厂库允许注册仓单的最大数量，由交易所确定和调整。

**第九十九条** 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**

**第一百条** 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、4 月、6 月、8 月、10 月、12 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。

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。

红枣：N 年 11 月 1 日起接受红枣标准仓单注册，仓单有效期至 N+1 年 9 月份最后一个交易日（含该日）。

**第一百零一条** 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

**第一百零二条** 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。

**第一百零三条** 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。

**第一百零四条** 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。

**第一百零五条** 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**

**第一百零六条** 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。

**第一百零七条** 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。

**第一百零八条** 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。

**第一百零九条** 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之内的，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的除外。

## **第九章 仓库及中转仓库交割商品出库**

**第一百一十条** 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。

**第一百一十一条** 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**

**第一百一十二条** 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。

**第一百一十三条** 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

**第一百一十四条** 仓库应将与所提棉花相对应的《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。

**第一百一十五条** 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。

**第一百一十六条** 出库过程中，发现棉花崩包的，仓库应当免费回包。

**第一百一十七条** 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**

**第一百一十八条** 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。

**第一百一十九条** 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**

**第一百二十条** 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。

**第一百二十一条** 出库时按照先进先出的原则出库。

### **第五节 菜籽出库**

**第一百二十二条** 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。

**第一百二十三条** 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**

**第一百二十四条** 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**

**第一百二十五条** 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**

**第一百二十六条** 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。

**第一百二十七条** 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**

**第一百二十八条** 出库时甲醇不符合交割质量标准的，仓库承担赔偿责任。

**第一百二十九条** 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**

**第一百三十条** 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。

**第一百三十一条** 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**

**第一百三十二条** 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

**第一百三十三条** 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。

**第一百三十四条** 出库棉纱质量与注册时相比，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、百米重量变异系数发生变化但未超过 5%的，-50%千米细节、+50%千米粗节、+200%千米棉结发生变化但未超过 5 个/10<sup>3</sup> m 的，异性纤维含量发生变化但未超过 10%的，仍可正常办理出库手续，提货人不得拒绝接货。条干均匀度变异系数、百米重量变异系数、-50%千米细节、+50%千米粗节、+200%千米棉结发生变化超过上述标准但符合交割质量要求的，仓库对提货方进行 300 元/吨的补偿；单纱断裂强度、单纱断裂强力变异系数、异性纤维含量发生变化超过上述标准但符合交割质量要求的，由仓库按照交易所公告的贴水标准进行补偿。

**第一百三十五条** 棉纱出库时，出现包装损坏、霉变、水渍、虫蛀的，仓库应予以免费更换包装。

## 第十三节 苹果出库

**第一百三十六条** 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。

**第一百三十七条** 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。

**第一百三十八条** 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。

**第一百三十九条** 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。

#### **第十四节 红枣出库**

**第一百四十条** 出库数量因损耗造成短少的，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）红枣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。

**第一百四十一条** 红枣出库时，出现包装霉变、严重污染、明显异味的，仓库应当承担赔偿责任；出现包装损坏的，仓库应当免费提供包装物并重新装箱。

**第一百四十二条** 红枣出库时，千克果粒数发生复检且结果在允许误差范围内的（误差为 5 个/千克），以入库检验结果为准，由

此产生的费用由提出争议者承担；复检结果在允许误差范围之外且低于入库检验结果的，由此产生的检验费用由交割仓库承担，以复检结果为准，复检结果在交割等级内的，交割仓库赔偿等级贴水，复检结果在交割等级外的，交割仓库承担违约责任。

**第一百四十三条** 由于水分变化导致每箱净含量发生变化的，可正常出库，仓库仍应补足数量。

## 第十章 厂库交割商品交收

**第一百四十四条** 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。

**第一百四十五条** 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。

**第一百四十六条** 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。

**第一百四十七条** 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。

**第一百四十八条** 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》。

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。

**第一百四十九条** 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。

**第一百五十条** 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。

**第一百五十一条** 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，交易所可动用厂库交存的银行履约保函、现金或交易所认可的其他支付保证方式予以清偿。

**第一百五十二条** 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**

**第一百五十三条** 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。

**第一百五十四条** 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、**红枣**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。

**第一百五十五条** 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（红枣为 5 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。

**第一百五十六条** 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。

**第一百五十七条** 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**

**第一百五十八条** 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。

**第一百五十九条** 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。

**第一百六十条** 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。

**第一百六十一条** 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。

**第一百六十二条** 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。

**第一百六十三条** 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。

**第一百六十四条** 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。

### **第三节 厂库商品出库复检**

**第一百六十五条** 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、苹果应在货物出库前提出；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。

**第一百六十六条** 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。

**第一百六十七条** 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**

**第一百六十八条** 交易所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。

**第一百六十九条** 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。

**第一百七十条** 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。

**第一百七十一条** 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。

**第一百七十二条** 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**

**第一百七十三条** 本办法解释权属于郑州商品交易所。

**第一百七十四条** 本办法自2019年3月4日起施行。

附件 4

郑州商品交易所期货交易风险控制管理办法（修订草案征求意见稿）

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>2</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、红枣                                                   | 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

<sup>2</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”，干制红枣简称“红枣”。

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、红枣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、红枣外，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，交易所有权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、红枣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、红枣外，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（以下简称为单边市）。

**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、棉纱和苹果和红枣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          | 5000  |
| 苹果（非 7 月合约） | 500   |
| 苹果（7 月合约）   | 100   |
| 红枣          | 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<br>（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              | 500                                   | 100                  |
| 苹果<br>（非 7 月合约） | 100                                   | 10                   |
| 苹果<br>（7 月合约）   | 20                                    | 6                    |
| 红枣              | 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检查；

（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 2019 年 3 月 4 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。