附件3

**郑州商品交易所期货交割细则修订案**

（2019年 11月28日郑州商品交易所第六届理事会第二十五次会议审议通过）

对《郑州商品交易所期货交割细则》作如下修改：

一、将第六条第一款修订为：“不能交付或者接收增值税专用（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；中转仓单不得用于集中交割。”

将第六条第四款修订为：“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，交易所对其处以按交割结算价计算的合约价值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。”

删去第六条第五款。

二、增加第七十九条：“期货实物交割在交割月的连续三个交易日完成，分别称为第一交割日、第二交割日、第三交割日，可以适用的流程包括滚动交割和集中交割。

“滚动交割是指交割月第一个交易日至最后交易日的前一交易日，由卖方提出交割申请，并由交易所组织配对双方在规定时间内完成的交割。

“集中交割是指在合约最后交易日闭市后，交易所组织所有未平仓合约持有者进行的交割。”

三、将第七十九条修订为第八十条:“滚动交割流程如下：

“（一）第一交割日（配对日）

“1.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[[1]](#footnote-2)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；强麦车（船）板信息参照《强麦入库确认书》。

“（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。

“2.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、红枣品种除外。

“3.当日闭市后，交易所按以下原则进行配对：

“对于得到买方会员响应的交割申请，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。

“对于苹果、红枣品种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）。苹果由计算机系统按先车（船）板后仓单的原则予以配对（配对日）。

“（二）第二交割日

“买卖双方通过交易所会员服务系统收取《交割通知单》。

“（三）第三交割日

“交易所对买卖双方进行交割结算。具体流程见本章关于交割结算流程的有关规定。”

四、将第八十条第一款修订为第八十一条：“最后交易日闭市前，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，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。

“最后交易日闭市前，卖方将拟进行集中交割的仓单数量提交至交易所，交易所按照卖方提交的拟集中交割的仓单数量释放卖方保证金。卖方未在规定时间内提交仓单数量的，不释放卖方保证金。”

五、将第八十条第二款至第四款及第八十一条合并为第八十二条，修订为：“集中交割的交割流程如下：

“（一）第一交割日

“最后交易日后的第一个交易日，卖方公布交割信息。当日闭市前，普麦及非通用标准仓单或者车（船）板交割的卖方，应当公布用于交割的仓单信息或者车（船）板交割货物信息。强麦卖方应依据《强麦入库确认书》信息公布车（船）板交割信息。未主动公布的，交易所于当日闭市时公布卖方相应品种所有可流通标准仓单信息供买方挑选。强麦之外的其他品种，卖方未公布车（船）板交割货物信息的，交易所按标准仓单交割对待。强麦卖方未公布车（船）板交割货物信息的，按交割违约处理。

“（二）第二交割日（配对日）

“1.买方挑选卖方公布的交割信息。当日闭市前，普麦及非通用标准仓单或车（船）板品种交割的买方，根据卖方公布的仓单信息或者车（船）板交割的货物信息，自主选择并确认。买方挑选卖方标准仓单及车（船）板交割的总数量不超过卖方该合约的持仓量。卖方公布的、但未被买方选中的车（船）板交割，仍按照车（船）板交割方式进行配对。

“2.当日结算时，普麦及非通用标准仓单或者车（船）板交割的，交易所按照买卖双方确认结果进行配对；其他仍未配对的未平仓持仓，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。

“通用标准仓单（普麦除外）交割的买卖双方，由计算机系统按数量取整、最少配对数原则予以配对。

“3.PTA期货合约在集中交割配对时，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系统按数量取整、最少配对数原则予以配对。

“4.中转仓单及厂库非标准仓单棉纱不得用于集中交割。

“5.当日结算后，买卖双方通过交易所会员服务系统收取《交割通知单》。

“（三）第三交割日

“交易所对买卖双方进行交割结算。具体流程见本章关于交割结算流程的有关规定。”

六、将第八十二条修订为第八十三条：“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，卖方保证金不予释放”

七、将第八十四条修订为第八十五条：“会员对《交割通知单》有异议的，应在第三交割日上午9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。”

八、将第八十五条、第八十六条、第八十七条合并为一条，修订为第八十六条：“交割结算流程规定如下：

“（一）标准仓单交割结算流程

“1.第三交割日上午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。

“2.交易所收取买方会员全额货款后，于第三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，卖方会员应在第三交割日向交易所开具增值税普通发票，第三交割日后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。

“3.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。

“(二)车（船）板交割结算流程

“1.第三交割日上午9时之前，买方会员应当将100％货款（不含买方保证金）划入交易所账户。

“2.买卖双方自第三交割日后规定时间，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。

“3.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。

“委托交易所结算的，全部货物交收完毕后，买方或者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，对方应在当日内进行确认，若有异议，应在提交信息之日起（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，系统将按照发起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（普通）发票的流转”一章有关规定执行。

“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。

“（三）厂库非标准仓单棉纱交割结算流程

“1.第三交割日上午9时之前，买方会员应当将100%货款（不含买方保证金）划入交易所账户。

“2.自第三交割日起（含该日）三个交易日内，买卖双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。

“3.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。具体流程参照本条车（船）板交割结算流程有关规定执行。

“4.在最后交货日仍没有交割完毕的，参照本细则第一百条有关规定执行。”

九、将第八十八条修订为第八十七条：“滚动交割的交割结算价为期货合约配对日（含该日）前10个交易日交易结算价的算术平均价。

“集中交割的交割结算价为期货合约最后交易日（含该日）前10个交易日交易结算价的算术平均价。”

十、将第九十一条修订为第九十条：“自第三交割日起（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》。……”

十一、将第九十四条修订为第九十三条：“动力煤买方使用车辆运输时，应自第三交割日起（含该日）6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第三交割日起（含该日）6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。……”

十二、将第一百零三条修订为第一百零二条，第五款中“交割日”修订为“第三交割日”。

十三、将第一百零七条修订为第一百零六条，第（一）项中删除“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”

1. 指向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。 [↑](#footnote-ref-2)