

# 郑州商品交易所期货交割细则

(2020年6月30日郑州商品交易所第七届理事会第三次会议审议通过,2020年7月14日(2020)51号公告发布,修订部分自苹果期货2110合约起施行;2020年6月30日郑州商品交易所第七届理事会第三次会议审议通过,2020年7月28日(2020)55号公告发布,修订部分自2021年9月1日起施行;2020年8月21日郑州商品交易所第七届理事会第四次会议审议通过,2020年9月22日(2020)72号公告发布,修订部分自硅铁、锰硅期货2110合约起施行;2020年9月22日郑州商品交易所第七届理事会第六次会议修订,2020年9月28日(2020)76号公告发布,修订部分自2020年10月12日起施行;2021年1月15日郑州商品交易所第七届理事会第九次会议修订,2021年1月25日(2021)8号公告发布,修订部分自2021年2月1日起施行;2021年1月28日郑州商品交易所第七届理事会第十次会议修订,2021年3月30日(2021)21号公告发布,自玻璃期货2204合约起施行;2021年4月22日郑州商品交易所第七届理事会第十一次会议审议通过,2021年6月9日(2021)43号公告发布,自2021年6月23日起施行)

## 第一章 总则

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

交易所交割业务按本细则进行,交易所、会员、客户、境外经纪机构、交割仓库(以下简称仓库)、交割厂库(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、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。

厂库交割是指卖方通过将指定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：车（船）板交割。

棉花、早籼稻、红枣：仓库交割。

甲醇、菜粕、晚籼稻、粳稻、白糖、PTA、菜油、硅铁、锰硅、棉纱、尿素、纯碱：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、短纤：厂库交割。

动力煤、花生：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。

菜粕交付增值税普通发票。

苹果、红枣、花生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。

## **第二章 期货交割标准**

### **第一节 普通小麦**

**第七条** 交割单位：50 吨。

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

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

替代品质量差异及升贴水：

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

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

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

**第九条** 普麦接收、储存、发运采用散粮方式。

## 第二节 优质强筋小麦

**第十条** 交割单位：20吨。

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

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

≤2.0%，300s≤降落数值≤550s，纯度≥80%；内在品质指标稳定时间≥12分钟、湿面筋≥31%、拉伸面积（135min）≥110 cm<sup>2</sup>。

替代品质量差异及升贴水：

（一）内在品质指标稳定时间≥8分钟、湿面筋≥29%、拉伸面积（135min）≥90cm<sup>2</sup>，但不满足基准交割品及以上等级要求的，可替代交割，升贴水以交易所公告为准；稳定时间≥16分钟、湿面筋≥32%、拉伸面积（135min）≥140cm<sup>2</sup>的，可替代交割，升贴水以交易所公告为准。

（二）强麦交货时，12.5%<水分≤13.5%的，水分每超0.5%，补量1.0%；不足0.5%的，不补量。

**第十二条** 强麦质量指标中，纯度是指小麦品种在特征特性方面典型一致的程度。纯度检验由强麦品种纯度鉴定工作小组检验判定，检验方法由交易所另行公告。

**第十三条** 强麦接收、储存、发运采用散粮方式。

### 第三节 棉花

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

**第十五条** 棉花交割适用国家标准。

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

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

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

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

**第十六条** N 年产锯齿细绒白棉从 N+1 年 8 月 1 日起每日历日贴水 4 元/吨，至 N+1 年 11 月的第 15 个交易日（含该日）止。

**第十七条** 棉花包装及包装物应符合国家有关棉花包装规定。

#### 第四节 白糖

**第十八条** 交割单位：10 吨。

**第十九条** 白糖交割适用国家标准及本细则规定。

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

替代品及升贴水：

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

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

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

**第二十一条** 白糖包装应符合《白糖国标》的规定。

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

白糖包装有霉变、严重污染或者出现潮包、流包、真结块、有异味的，不得入库。

## 第五节 精对苯二甲酸

**第二十二条** 交割单位：5 吨。

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

基准交割品：符合 GB/T32685-2016 质量标准的优等品 PTA。

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

交易所所有权调整交割品生产厂家。

**第二十四条** 出现破包、潮包、结块、严重污染等情况的，不得入库。

## 第六节 菜籽

**第二十五条** 交割单位：10 吨。

**第二十六条** 菜籽交割适用国家标准及本细则规定。

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

替代品及升贴水：

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

（二）杂质以 3.0%为基准，每低（高）0.5 个百分点升水（贴水）30 元/吨，不足 0.5 个百分点的无升贴水，低于 2.0%的按照 2.0%升水。采用标准仓单交割的，杂质高于 3.0%的不允许交割。采用车板方式交割的，杂质高于 4.0%的不允许交割。

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



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

## 第七节 菜油

**第二十八条** 交割单位：10 吨。

**第二十九条** 菜油交割适用国家标准及本细则规定。

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

替代品及升贴水：

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

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

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

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

菜油出库时，其过氧化值不得超过 5.5mmol/kg。

## 第八节 菜粕

**第三十一条** 交割单位：10 吨。

**第三十二条** 菜粕交割标准适用国家标准及本细则规定。

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

替代品及升贴水：

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

（二）95 型菜粕、进口菜粕不允许交割。

**第三十三条** 菜粕包装应符合以下规定：包装物为新编织袋，编织袋要求不破、不漏。对包装物的卫生要求为无毒害物质污染，无油污，无霉变，无严重的煤灰、石灰、铁锈、泥土、水渍等污染。出现潮包、流包、真结块、有异味，不得入库。

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

同一客户同一批次交割的菜粕包装要求规格统一。

## 第九节 早籼稻

**第三十四条** 交割单位：20 吨。

**第三十五条** 早籼稻交割适用国家标准、国家相关规定及本细则规定。

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

替代品及升贴水：

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

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

**第三十六条** 入出库脂肪酸值及黄粒米指标规定如下：

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

（二）入库时， $19\text{mg}/100\text{g}$ （干基） $< \text{脂肪酸值} \leq 25\text{mg}/100\text{g}$ （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，整精米率 $\geq 52\%$ ，水分含量 $\leq 14.5\%$ ，谷外糙米含量 $\leq 4\%$ ，垩白度 $\leq 2\%$ ，长宽比 $\geq 3.1$ ，粒长 $\geq 5.6\text{mm}$ 且异品种率 $\leq 7\%$ 。

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：水分含量 $\leq 14.5\%$ 的，足量入库。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，水分含量不得超过 15.5%； $14.5\% < \text{水分含量} \leq 15.5\%$ 的，以 14.5%为基准，水分含量每超 0.1%，扣量 0.2%。其他时间入库的晚籼稻，水分含量不得超过 14.5%。晚籼稻出库时：水分含量 $\leq 14.5\%$ 的，足量出库；水分含量 $> 14.5\%$ 的，以 14.5%为基准，水分含量每超 0.1%，补量 0.2%，由仓库承担。（本款仅适用于江西、湖南、湖北、安徽等主产区）

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

（三） $2.8 \leq \text{长宽比} < 3.1$ ，其他指标符合基准交割品要求的，可替代交割。升贴水由交易所另行公告。

**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17mg/100g（干基），黄粒米含量不得高于0.3%；其他时间入库的晚籼稻，脂肪酸值不得高于19mg/100g（干基），黄粒米含量不得高于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20mg/100g（干基），黄粒米含量不得高于0.5%；其他时间出库的晚籼稻，脂肪酸值不得高于24mg/100g（干基），黄粒米含量不得高于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** 垩白度、异品种率的检验按照《中华人民共和国国家标准 优质稻谷》（GB/T 17891-2017）执行。粒长、长宽比的检验按照《中华人民共和国粮食行业标准 大米粒型分类判定》（LS/T 6116-2017）执行。脂肪酸值的检验按照《中华人民共和国国家标准 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≤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（规格为 3.66m×2.44m）一等品。

替代品及升贴水：符合国标规定的 6mm 无色透明平板玻璃（规格为 3.66m×2.44m）一等品，无升贴水。

## 第十四节 动力煤

**第四十九条** 交割单位：20000 吨。

以船舶接货时，单船重量溢短范围为±500 吨（含）以内。在重量溢短规定范围内，交易所依据实际重量进行结算。溢货超出规定范

围的，买卖双方对超出部分协商解决并自行结算。短货超出规定范围的，卖方需及时补装至规定范围以内；无法补装的，在计算货款时，交易所对短货超出规定范围的部分双倍扣减；双方协商一致的除外。

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

**第五十条** 动力煤交割检验指标检测方法适用国家相关标准。

基准交割品：收到基低位发热量为 5500 千卡/千克，干燥基全硫 $\leq 0.6\%$ ， $30\% \leq$ 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×实测发热量；收到基低位发热量 $\geq 5300$  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 $\leq 1\%$ 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 2272-2020）规定牌号为PG FeSi72A12.5（硅含量 $\geq 72.0\%$ 、磷含量 $\leq 0.04\%$ 、硫含量 $\leq 0.02\%$ 、碳含量 $\leq 0.2\%$ ）、粒度为 $10-60\text{mm}$ 的硅铁，其中：锰、铬、铝、钛含量不作要求；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。在质检批次内，平均单包净重为 $1000\pm 10$ 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。在质检批次内，平均单包净重为  $1000 \pm 10$  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  $18.2\text{tex}$ （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  $\leq 38$  处/20kg 及  $81$  处/20kg  $<$  异性纤维含量  $\leq 200$  处/20kg (对应折算异性纤维含量  $\leq 7$  处/200km 及  $15$  处/200km  $<$  异性纤维含量  $\leq 37$  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±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：10 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 $\leq 20\%$ （虫伤计入质量容许度，磨伤、碰压伤、刺伤不合格果之和占比不做要求），可溶性固形物 $\geq 12.5\%$ 。

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 $\leq 5\%$ ， $20\% < \text{质量容许度} \leq 25\%$ （虫伤计入质量容许度，磨伤、碰压伤、刺伤不合格果之和占比不做要求），可溶性固形物 $\geq 12.5\%$ ，贴水 500 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 $\leq 20\%$ （虫

伤计入质量容许度，磨伤、碰压伤、刺伤不合格果之和占比不做要求），可溶性固形物 $\geq 12.5\%$ ，贴水 1500 元/吨。

（三）符合《苹果国标》一等及以上等级质量指标且  $75\text{mm} \leq \text{果径} < 80\text{mm}$  的红富士苹果，其中果径容许度 $\leq 5\%$ ， $20\% < \text{质量容许度} \leq 25\%$ （虫伤计入质量容许度，磨伤、碰压伤、刺伤不合格果之和占比不做要求），可溶性固形物 $\geq 12.5\%$ ，贴水 2000 元/吨。

未发生褐变的水心病苹果不计入不合格果。

**第六十四条** 入出库硬度指标规定如下：

（一）苹果入库硬度不得低于  $7\text{kgf}/\text{cm}^2$ ；

（二）每年 10 月 1 日至次年 2 月 10 日（含该日）出库的苹果，硬度不得低于  $6.2\text{kgf}/\text{cm}^2$ ；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：5 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。

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

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。

## 第二十章 尿素

**第六十九条** 交割单位：20 吨（净重）。

**第七十条** 尿素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 尿素》（GB/T 2440-2017）规定的农业用优等品中小颗粒尿素（总氮含量 $\geq 46\%$ ，缩二脲含量 $\leq 0.9\%$ ，水分含量 $\leq 0.5\%$ ，亚甲基二脲 $\leq 0.6\%$ ，粒度：d  $0.85\text{mm}-3.35\text{mm} \geq 93\%$ ）。

替代交割品：符合《中华人民共和国国家标准 尿素》（GB/T 2440-2017）规定的农业用合格品中小颗粒尿素（总氮含量 $\geq 45\%$ ，缩二脲含量 $\leq 1.5\%$ ，水分含量 $\leq 1\%$ ，亚甲基二脲 $\leq 0.6\%$ ，粒度：d  $0.85\text{mm}-3.35\text{mm} \geq 90\%$ ）。贴水 20 元/吨。

**第七十一条** 尿素交割品包装应符合《中华人民共和国国家标准 固体化学肥料包装》（GB/T 8569）的规定，外袋为塑料编织袋、内袋为聚乙烯薄膜袋组成的双层袋或复合塑料编织袋。包装袋上应标明生产企业名称、地址、产品名称、净含量、等级、粒径范围。采用 25.0kg、40.0kg、50.0kg 包装的每批产品单包净重不得小于 25.0kg、

40.0kg、50.0kg。同一批次尿素的生产厂家和包装规格须保持一致。

## 第二十一节 纯碱

**第七十二条** 交割单位：20 吨。

**第七十三条** 纯碱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 工业碳酸钠及其实验方法第 1 部分：工业碳酸钠》（GB/T 210.1-2004）（以下简称《纯碱国标》）II 类优等品的重质纯碱，且氯化钠含量（以干基的 NaCl 的质量分数计） $\leq 0.6\%$ 。

**第七十四条** 纯碱交割品的包装应符合《纯碱国标》规定。纯碱单包净重为 1 吨以及交易所公告的其他规格。

## 第二十二节 短纤

**第七十五条** 交割单位：5 吨。

**第七十六条** 短纤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 涤纶短纤维》（GB/T 14464-2017）棉型优等品质量指标的原生纺纱用 1.56dtex $\times$ 38mm、圆形截面半消光本色涤纶短纤，且  $0.10\% \leq \text{含油率} \leq 0.20\%$ ， $0.30\% \leq \text{回潮率} \leq 0.60\%$ 。

基准交割品必须是经交易所认定的短纤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。

**第七十七条** 短纤期货交割品包装及标志应符合《中华人民共和国国家标准 涤纶短纤维》（GB/T 14464-2017）相关要求，外包装采



用覆膜的聚丙烯编织布，并用包装带紧固。短纤每袋包装上要标明产品名称、规格、等级、批号、净质量、生产日期、商标、产品标准编号、生产企业名称、地址以及产品防护、搬运的警示标志，包装规格采用净质量 350kg/包、380kg/包及交易所公告的其他包装规格。

## 第二十三节 花生

**第七十八条** 交割单位：5 吨。

**第七十九条** 花生交割适用国家标准、国家相关规定及本细则规定。

基准交割品： $45.0\% \leq \text{含油率（以湿基计，下同）} < 46.0\%$ ，酸价（以脂肪计，下同） $\leq 1.5\text{mgKOH/g}$ ，杂质 $\leq 1.0\%$ ，水分 $\leq 9.0\%$ ，霉变粒 $\leq 1.0\%$ ，7mm 上层筛（长圆孔筛板）筛上比例 $\geq 60.0\%$ ，5.5mm 下层筛（长圆孔筛板）筛下比例 $\leq 20.0\%$ ，色泽气味正常的花生仁。

花生术语和定义、卫生要求及检验方法等按照《中华人民共和国国家标准花生》（GB/T 1532-2008）、《中华人民共和国农业行业标准油用花生》（NY/T 1068-2006）、《中华人民共和国国家标准长圆孔、长方孔和圆孔筛板》（GB/T 12620-2008）及相关规范性引用文件执行。

替代品及升贴水：

$43.0\% \leq \text{含油率} < 44.0\%$ 的，贴水 200 元/吨； $44.0\% \leq \text{含油率} < 45.0\%$ 的，贴水 100 元/吨； $46.0\% \leq \text{含油率} < 47.0\%$ 的，升水 100 元/吨；含油率 $\geq 47.0\%$ 的，升水 200 元/吨。

1.5mgKOH/g < 酸价 ≤ 2.0mgKOH/g, 贴水 200 元/吨; 2.0mgKOH/g < 酸价 ≤ 2.5mgKOH/g, 贴水 500 元/吨。

1.0% < 霉变粒 ≤ 1.5%, 扣量 0.5%; 1.5% < 霉变粒 ≤ 2.0%, 扣量 1.5%。

**第八十条** 花生包装采用塑料编织袋。编织袋应当坚固、清洁、干燥,使用缝包机封口,不得产生撒漏或对花生造成污染。单包装载花生重量 50kg ± 2kg,且单个包装物重量不得超过 125g。同一客户同一批次交割的花生包装要求规格统一。

### 第三章 交割基准价与升贴水

**第八十一条** 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所在地交割服务机构交货的含税价格。

棉花、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、尿素、纯碱、短纤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仓库散果出库时汽车板交货的含税价格（不含包装物）。

花生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汽车板交货的含税价格（含包装）。

**第八十二条** 仓库、厂库、指定交割计价点及升贴水由交易所确定并公告。

**第八十三条** 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（花生除外）、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

**第八十四条** 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。

**第八十五条** 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<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

---

<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。

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》。花生车（船）板信息包括：含油率、酸价、霉变粒、车（船）板交割服务机构、货物数量等。

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

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、花生品种除外。

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、花生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、花生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。

**第八十六条** 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。

**第八十七条** 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、花生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、花生除外）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. 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。

**第八十八条** 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。

**第八十九条** 交割关系一经确定，买卖双方不得擅自调整或者变更。

**第九十条** 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。

**第九十一条** 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“增值税专用发票(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。

买卖双方应在货物发运前，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，参照本细则第一百零二条有关规定执行。

**第九十二条** 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。

## 第五章 车（船）板交割

**第九十三条** 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。

**第九十四条** 强麦车（船）板交割必须进行交割预报。

客户或者非期货公司会员向交割计价点所在地交割服务机构（以下简称服务机构）发货前，应当由会员填写《强麦车（船）板交割预报单》，并以书面形式或者交易所认可的其他形式向服务机构预报。

《强麦车（船）板交割预报单》信息包括：品种、产地、等级、数量、生产年度等。

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。

自接到会员《强麦车（船）板交割预报单》之日起 2 个工作日内，服务机构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。自接到服务机构同意入库的回复之日起 2 个工作日

之内，会员应当向服务机构缴纳 30 元/吨的交割预报定金。服务机构在收到交割预报定金的当日（工作日），开具《强麦车（船）板接收通知单》。对已存放在服务机构的商品申请车（船）板交割的，仍应提交交割预报，无须交付交割预报定金。

《强麦车（船）板接收通知单》自开具之日起生效，有效期为 40 个日历日。交易所可视情况，调整《强麦车（船）板接收通知单》的有效期。

强麦交割货物全部到库的，自货物入库完毕之日起 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。

强麦交割货物到库后，由服务机构开具《强麦入库确认书》，N 年 10 月 1 日起生成的《强麦入库确认书》，有效期至 N+1 年 9 月份最后一个工作日（含该日）。

《强麦入库确认书》作为卖方参与交割配对的依据。

交易所公告暂停服务机构入库业务的，自公告之日（含该日）下午闭市起，该服务机构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车（船）板交割申请。

货主应当按交易所有关规定向服务机构交纳各项费用。

办理完交割预报的货主发货前，须将运输方式、车（船）号、数量、到货时间等通知服务机构。

**第九十五条** 花生车（船）板交割应当进行交割预报。

参与车（船）板交割的卖方客户或者非期货公司会员的交割预报应当委托会员办理。会员填写《花生车（船）板交割预报单》，并通过会员服务系统向交易所指定的车（船）板交割服务机构提出预报。

《花生车（船）板交割预报单》信息包括：交割服务机构、货物数量等。

预报数量较大的，交易所可以要求货主提供拥有货物的相关证明。

交割服务机构自交割月前一个月第 13 个交易日开始接受交割预报，自接到会员《花生车（船）板交割预报单》之日（含该日）起 2 个工作日内，交割服务机构应当通过会员服务系统回复会员能够接收的货物数量。自接到交割服务机构同意接收的回复之日（含该日）起 2 个工作日之内，会员应当向交割服务机构缴纳 30 元/吨的交割预报定金。交割服务机构应当在收到交割预报定金之日（含该日）起的第 1 个工作日，向卖方会员开具《花生车（船）板接收通知单》，视为交割预报完成。会员应当及时将交割预报结果通知客户。对已存放在车（船）板交割服务机构的货物申请车（船）板交割的，仍应完成交割预报，无须缴纳交割预报定金。参与滚动交割的卖方，须于提出交割申请前在对应的交割服务机构完成交割预报；参与集中交割的卖方，须于最后交易日（含该日）前在对应的交割服务机构完成交割预报。单一客户在单个交割服务机构的车（船）板交割数量不得超过该客户在该交割服务机构交割预报的数量。

交割预报自《花生车（船）板接收通知单》开具之日（含该日）起生效，有效期至最近交割月的第 11 个交易日。

委托交易所结算且货物到达接受交割预报的交割服务机构的，自货物全部到达之日起2个工作日内，交割预报定金予以返还；部分到达的，按实际到达量返还；未到达的，不予返还。不委托交易所结算的，自签订《车（船）板交割协议书》之日起2个工作日内，交割预报定金予以返还。

货主应当按交易所有关规定向交割服务机构交纳各项费用，并在发货前将运输方式、车（船）号、货物数量、到货时间等通知交割服务机构。

**第九十六条** 除苹果之外的其他品种，自第三交割日起（含该日）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。

苹果品种，第三交割日下午3时前，买卖双方通过会员在会员服务系统确认《车（船）板交货事项确认单》，逾期未确认的，视同对确认单内容无异议。

**第九十七条** 苹果、强麦在交割计价点交割。花生委托交易所结算的，应当在交割服务机构交割。除苹果、强麦、花生外，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。

**第九十八条** 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。

苹果品种，买卖双方应在第三交割日后（不含该日）第4个日历日（10月合约为第三交割日后第6个日历日）进行货物交收。卖方未在货物交收日下午1时30分前将货物运达交割服务机构或买方未按时到场监收的，视为未按规定时间交收货物，新的交收时间由交割服务机构根据自身服务能力重新确定并通知买卖双方。当日交收量或交收客户数超过交割服务机构每日最大可交割数量或每日最大服务客户数时，交割服务机构可以根据自身服务能力延后交收时间，并通知买卖双方。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。

苹果各交割服务机构的每日最大可交割数量、每日最大服务客户数由交易所另行公布。



花生买卖双方应当在《车（船）板交割协议书》签订之日（不含该日）起 3 个日历日内进行货物交收。卖方未在第 3 个日历日下午 1 时 30 分前将货物运达交割服务机构或买方未按时到场监收的，视为未按规定时间交收货物，新的交收时间由交割服务机构根据自身服务能力重新确定并通知买卖双方。当日交收量超过交割服务机构服务能力的，交割服务机构可以延后交收时间，并通知买卖双方。买方应当在卖方货物到达之日（不含该日）起 3 个日历日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。用于质量验收的样品应由买卖双方按照国家相关标准及交易所有关规定共同扦取，就地分为二份，任选一份供买方使用；另一份由双方共同签字封样，由交割服务机构保管，作为发生质量争议时的复检样品。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。

动力煤、强麦、苹果、花生之外的其他品种，在交割计价点交割的，买卖双方应当在互相确认《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。

**第九十九条** 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。

强麦买方在提交《车（船）板交货事项确认单》后5个工作日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。

动力煤、强麦、苹果、花生之外的其他品种，买卖双方应当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仓库或指定地点。买方应当在卖方货物到达后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（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。

**第一百条** 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。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，并应当在复检结果出具日（不含该日）起2个工作日内通过交割服务机构支付。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。

苹果买卖双方确认货物质量、数量后，在货款划转时，通过会员服务系统选择结算方式。

强麦买卖双方发生质量争议时，应当协商解决。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质检申请，并说明需要检验的质量指标，争议提出方预交相关费用（检验费和差旅费等）。强麦纯度检验由品种纯度鉴定工作小组检验判定。除纯度外，其他质量指标由质检机构负责检验。质检机构由买卖双方在交易所指定质检机构中协商选取，协商不一致的由交易所确定。质检机构自收到交易所检验通知之日（不含该日）起7个工作日内应当做出检验结果，检验结果为解决争议的依据。检验费用由过错方承担。

花生买卖双方发生质量争议时，应当协商解决。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。复检机构由买卖双方在交易所指定质检机构中协商选取，协商不一致的由交易所确定。复检样品仅限于保留样品。复检机构应当自收到样品之日（不含该日）起3个工作日内做出复检结果，复检结果为解决争议的依据。寄送样品及复检费用由过错方承担，并应当在复检结果出具之日（不含该日）起2个工

作日内通过交割服务机构支付。复检结果确定的酸价或霉变粒指标所在升贴水区间低于或等于车（船）板信息标示的升贴水区间的，或含油率指标所在升贴水区间高于或等于车（船）板信息标示的升贴水区间的，分别以车（船）板信息标示的酸价、霉变粒、含油率为准，由此产生的复检及相关费用由争议提出方承担；复检结果确定的酸价或霉变粒指标所在升贴水区间高于车（船）板信息标示的升贴水区间的，或含油率指标所在升贴水区间低于车（船）板信息标示的升贴水区间的，分别以复检结果确定的升贴水区间为准。复检结果仍在交割标准允许范围内的，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、强麦、花生之外的其他品种发生质量争议时，应当及时通知交易所。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。寄送样品及复检费用由双方共同承担。

**第一百零一条** 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。

**第一百零二条** 普麦、强麦、菜籽、花生未发运货物质量达不到交割标准的，卖方应当及时更换货物，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。普麦、强麦、菜籽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，花生最终货物质量按每次检验结果单独核定。

普麦、强麦、菜籽、苹果、花生验收完成后，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。

**第一百零三条** 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、强麦、菜籽、花生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。

**第一百零四条** 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 [2（元/吨）×延误天数×应发（收）而未发（收）商品数量]。

苹果交割时，买卖双方未按规定时间交收货物，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 [120（元/吨）×延误天数×应发（收）而未发（收）商品数量]。滞纳金扣罚总额不超过合约价值（按交割结算价计算）的 20%。

花生交割时，买卖双方未按规定时间交收货物，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 [30（元/吨）×延误天数×应发（收）而未发（收）商品数量]。滞纳金扣罚总额不超过合约价值（按交割结算价计算）的 20%。

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

由于不可抗力导致商品装运推迟的，可以顺延。

**第一百零五条** 已经发货的动力煤，按实际检验结果计算货款，计算结果保留小数点后两位。

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

收到基低位发热量为 5000 千卡/千克时，货款结算价=交割结算价-90

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

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

收到基低位发热量检验结果低于卖方配对环节公布的收到基低位发热量，且差值超过 300 千卡/千克（不含）的，在上述货款计算



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

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

指标范围	计算方法
1% < 干燥基全硫 ≤ 1.5%	依据实测发热量和干燥基全硫为 1% 时的计算值 × 80%
1.5% < 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 × 50%
干燥基全硫 > 2%	依据实测发热量和干燥基全硫为 1% 时的计算值 × 20%
干燥无灰基挥发分或干燥基灰分超出交割品范围	依据实测发热量和实测干燥基全硫的计算值 × 80%

**第一百零六条** 在最后交货日之前交割完毕的，交易所根据买卖双方会员在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付的，可以延期交付，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付的，另一方可以申请终止交付。守约方通过会员服务系统提交《终止交付申请书》

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**

**第一百零七条** 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、花生开具增值税专用发票或农产品销售发票。

**第一百零八条** 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，自第三交割日（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，参考前款规定处理。

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。

自第三交割日（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。

**第一百零九条** 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

**第一百一十条** 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。

**第一百一十一条** 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。

### **第一百一十二条 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；

（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。

**第一百一十三条** 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。

**第一百一十四条** 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

**第一百一十五条** 棉花、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、尿素、纯碱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、车板花生交割时，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。车(船)板强麦质量确定之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。

玻璃、棉纱、短纤、仓单花生用汽车提货的,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。

**第一百一十六条** 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。

**第一百一十七条** 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、红枣入库检验费用由仓库承担,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。

**第一百一十八条** 普麦、强麦、早籼稻、晚籼稻、粳稻、苹果无包装物。棉花、白糖、PTA、菜籽、菜粕、硅铁、锰硅、棉纱、红枣、尿素、纯碱、短纤、花生包装物不另行计价。

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。

**第一百一十九条** 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

**第一百二十条** 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。

**第一百二十一条** 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。

**第一百二十二条** 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

**第一百二十三条** 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。

**第一百二十四条** 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。

**第一百二十五条** 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

**第一百二十六条** 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。

**第一百二十七条** 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。

**第一百二十八条** 本细则解释权属于郑州商品交易所。

**第一百二十九条** 本细则自 2021 年 6 月 23 日起施行。