

# 郑州商品交易所期货交割细则

（郑州商品交易所第五届理事会：2009年3月28日修订，自2009年4月20日施行；2011年10月17日修订，自2011年10月28日施行；2012年8月6日修订，自2012年12月3日施行；2012年12月17日修订，自2012年12月28日施行；2013年9月5日修订，自2013年9月26日施行；2013年10月28日修订，自2013年11月18日施行；2014年6月16日修订，自2014年7月8日施行；2014年7月4日修订，自2014年8月8日施行；2015年12月23日修订，自2016年1月11日施行。郑州商品交易所第六届理事会：2017年7月31日修订，自2017年8月18日施行；2017年10月23日修订，自2017年11月1日施行。郑州商品交易所第五届理事会：2015年5月11日修订，2017年11月22日施行）

## 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、指定商品交割仓库（以下简称仓库）、指定商品交割中转仓库（以下简称中转仓库）、指定商品交割厂库（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：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。

**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。

**第六条** 不能交付或者接收增值税专用发票（普通）发票的客户不得交割；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。

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 $\leq 2.0\%$ ， $300\text{s} \leq \text{降落数值} \leq 550\text{s}$ ；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±5 包（227±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+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》（GB317—2006）（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（PTA）》（GB/T 32685-2016）。

基准交割品：符合GB/T 32685-2016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） $0.5\%$ 。

**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） $<$ 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 $\leq 13.5\%$ 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） $1.0\% < \text{杂质} \leq 1.5\%$ 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%。

（三） $30\% < \text{垩白粒率} \leq 40\%$ 且粒型（长宽比） $\geq 2.8$ 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% $<$ 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% $<$ 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% $<$ 杂质 $\leq$ 1.5%的，入库扣量（出库补量）0.5%；1.5% $<$ 杂质 $\leq$ 2.0%的，入库扣量（出库补量）1.0%。

（四）30% $<$ 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% $<$ 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2m×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≤0.6%，30%≤干燥无灰基挥发分≤42%，干燥基灰分≤30%，全水≤20%的动力煤。

替代品及升贴水：收到基低位发热量≥4800 千卡/千克，干燥基全硫≤1%，30%≤干燥无灰基挥发分≤42%，干燥基灰分≤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≤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≥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）<sup>1</sup>。

**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）<sup>2</sup>。

**第五十五条** 锰硅交割适用国家标准及本细则规定。

---

<sup>1</sup> 自 SF1901 合约开始执行。

<sup>2</sup> 自 SM1901 合约开始执行。

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及同一生产批次要求。

**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18.5tex(32英支)普梳棉本色筒子单纱（环锭纺）：线密度18.5tex、棉纤维含量100%、单纱断裂强度 $\geq 15.0\text{cN/tex}$ 、单纱断裂强力变异系数 $\leq 9.0\%$ 、条干均匀度变异系数 $\leq 16.0\%$ 、-50%千米细节 $\leq 25$ 个/ $10^3\text{m}$ 、+50%千米粗节 $\leq 340$ 个/ $10^3\text{m}$ 、+200%千米棉结 $\leq 520$ 个/ $10^3\text{m}$ 、十万米纱疵 $\leq 10$ 个/ $10^5\text{m}$ 、百米重量偏差 $\pm 2.0\%$ 、百米重量变异系数 $\leq 2.2\%$ 、实际捻系数300–420、异性纤维含量 $\leq 80$ 处/20kg。

**第五十九条** 替代品及升贴水：棉纱异性纤维含量符合以下规定的，可以通过贴水替代交割。

80处/20kg<异性纤维含量≤100处/20kg的，每吨贴水交割结算价的2%；100处/20kg<异性纤维含量≤120处/20kg的，每吨贴水交割结算价的3%；异性纤维含量>120处/20kg的，每增加10处/20kg, 每吨增加贴水交割结算价的1%，增加不足10处/20kg的，按增加10处/20kg计。异性纤维含量不得高于200处/20kg。

**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《棉纱期货异性纤维检验规范》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/T398-2008)执行。

《棉纱期货异性纤维检验规范》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、十万里纱疵、-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。

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。

### 第三章 交割基准价与升贴水

**第六十二条** 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）。

**第六十三条** 仓库、厂库、指定交割计价点及升贴水由交易所确定并公告。

**第六十四条** 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

**第六十五条** 普麦及适用非通用标准仓单的品种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>3</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；

---

<sup>3</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。

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。

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。

（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。

（三）当日闭市后，交易所按确认结果进行配对（即配对日）。

**第六十六条** 普麦及适用非通用标准仓单的品种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有效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。

**第六十七条** 普麦及适用非通用标准仓单的品种期货合约之外的其他品种期货合约配对原则：

（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）。

**第六十八条** 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。

**第六十九条** 交割关系一经确定，买卖双方不得擅自调整或者变更。

**第七十条** 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。

**第七十一条** 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。

（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。对发票的传递、余款的结算，会员均应按本细则规定办理。

**第七十二条** 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。

**第七十三条** 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。

（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第七十二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，参照本细则第八十六条有关规定执行。

**第七十四条** 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

**第七十五条** 卖方拟在交割计价点开展车（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。

**第七十六条** 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。

**第七十七条** 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。

**第七十八条** 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。

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。

**第七十九条** 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（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。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。

动力煤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。

**第八十二条** 普麦、菜籽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。

**第八十三条** 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。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。

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，包装物及灌包费用由买方支付。

**第八十四条** 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= $\Sigma [1 (\text{元/吨}) \times \text{延误天数} \times \text{应发 (收) 而未发 (收) 商品数量}]$ 。

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= $\Sigma [5 (\text{元/吨}) \times \text{延误天数} \times \text{应发 (收) 而未发 (收) 商品数量}]$ 。

由于不可抗力导致商品装运推迟的，可以顺延。

**第八十五条** 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
$1\% < \text{干燥基全硫} \leq 1.5\%$	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 $\times 80\%$

**第八十六条** 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**

**第八十七条** 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。

菜粕开具增值税普通发票。

**第八十八条** 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。普麦、强麦、菜籽、菜油、菜粕、棉花、早籼稻、晚籼稻、粳稻的违约金比例为13%；白糖、PTA、甲醇、玻璃、动力煤、硅铁、锰硅、棉纱的违约金比例为17%。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。

**第八十九条** 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

**第九十条** 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。

**第九十一条** 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。

**第九十二条** 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，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。

**第九十三条** 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。

**第九十四条** 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

**第九十五条** 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。

**第九十六条** 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。

**第九十七条** 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。

**第九十八条** 普麦、强麦、早籼稻、晚籼稻、粳稻无包装物。棉花、白糖、PTA、菜籽、菜粕、硅铁、锰硅、棉纱包装物不另行计价。

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。

**第九十九条** 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。

**第一百零二条** 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。

计算买、卖方交割违约合约数量的公式为：

（一）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

（二）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

**第一百零三条** 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。



**第一百零四条** 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。

**第一百零五条** 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。

## 附 则

**第一百零六条** 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。

**第一百零七条** 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。

**第一百零八条** 本细则解释权属于郑州商品交易所。

**第一百零九条** 本细则自 2017 年 11 月 22 日起施行。