

郑州商品交易所 2017 年自律管理工作报告

郑商发〔2018〕3号

2017年，郑州商品交易所(以下简称郑商所)深入学习贯彻党的十九大和全国金融工作会议精神，认真落实依法全面从严监管要求，紧紧围绕服务实体经济发展目标，推进产品与业务创新，做精做细做实现有品种，切实履行一线监管职责，防范和化解市场风险，不断增强服务实体经济能力。

一、推进业务创新，提高服务实体经济能力

(一) 稳步推进产品创新，拓展服务实体经济的领域

2017年，郑商所围绕服务实体经济、服务“三农”和国家发展战略，研发上市白糖期权、棉纱期货、苹果期货，进一步拓展服务实体经济的领域。制定并完善白糖期权交易管理、套保套利、异常交易、做市商管理、投资者适当性管理等规则制度，促进期权市场平稳起步和健康发展。

(二) 修订完善业务规则，做精做细做实现有品种

2017年，郑商所修订完善了风险控制管理办法、结算细则、交割细则等业务规则。增加交易限额制度；完善涨跌停板制度；完善差异化手续费制度；缩短玻璃期货仓单有效期，增加出库过磅检重，增设贸易商厂库；调整硅铁、锰硅期货交割单位、厂库仓单有效期、入库生产时限；出台PTA、动力煤合约连续活跃方案，采取降低目标合约交易与交割成本、

引入做市商等措施，使相关合约初步呈现活跃态势，为产业客户管理风险创造良好条件。

（三）优化套保审核机制，便利产业客户套保

郑商所完善套保审核委员会工作机制及工作流程，提高套保审批的规范化、透明度，方便产业客户套期保值。2017年，郑商所共受理 245 个客户的 1009 份套保申请，申请量 1401 万手，审批量 955 万手。

（四）推进技术系统建设，保障系统安全运行

郑商所着力优化技术系统，提高技术系统的稳定性、健壮性和安全性。2017年，郑商所优化五期交易系统，推进六期交易系统、新一代结算平台等技术系统开发建设；上线异构前置机系统，建设运维自动化系统，提高运维管理能力；开展信息安全管理体系建设，优化完善技术管理制度和工作流程；及时处置各种网络安全威胁，做好技术系统安全运行保障。

二、加强市场监管，查处违法违规行为

（一）贯彻落实依法全面从严监管要求，切实履行一线监管职责

郑商所加强市场监管，完善纪律处分委员会工作机制，严格依据规则查处违法违规行为，切实履行一线监管职责。2017年，郑商所共处理异常交易及违规交易线索 386 起，向证监会稽查局移送涉嫌违法违规行为线索 2 起，处理违规交

易案件 66 起，对涉案的 83 个自然人客户、17 个法人客户给予警告、暂停开仓等纪律处分。发布实施听证规则，首次举行纪律处分听证会。2017 年，共认定实际控制关系账户 207 组，涉及 644 个客户，其中经询问调查认定实际控制关系账户 61 组 238 个客户。

（二）强化交割仓库管理，创新交割仓库管理机制

2017 年，郑商所继续做好交割仓库检查工作。通过集中检查、日常巡查、重点抽查、会员单位协助交易所检查和远程视频监控等形式加强对交割仓库和交割商品的日常监管，确保交割商品安全，防范和化解交割风险。全年组织仓库现场检查共计 227 次，处理强麦、甲醇、棉花、白糖、动力煤等 5 个品种 7 起交割纠纷，对 1 家交割仓库进行监管谈话，对 1 家交割仓库暂停入库业务。实施标准仓单统一保险，增加仓单安全风险管理手段。

（三）加强现场检查，促进会员合规运作

2017 年，郑商所制定了会员检查工作办法，规范会员检查工作程序，完善对会员合规运作的监督管理。对北京、上海、广州、深圳等 10 个地区的 20 家期货公司会员进行年度合规运作检查，及时发现、纠正存在的问题，促进会员合规运作。

（四）加强监管协作，提升监管效力

郑商所持续加强与证监会稽查局、各地证监局、期货市

场监控中心的监管协作。2017年，郑商所与全国36家证监局签署期货监管协作备忘录，在违法违规案件调查、期货公司现场检查、投资者适当性管理、期货市场培育等方面进行合作，实现自律监管与行政监管的有效衔接，提升监管合力和监管效率。

三、防范市场风险隐患，保障市场平稳健康运行

2017年，郑商所加强风险分析、会商工作机制，及时分析市场运行情况，研判潜在风险隐患，研究风险防范和处置措施。针对白糖、硅铁等品种出现的阶段性风险隐患，密切关注政策信息及影响，跟踪期现货市场动态，采取加强实时监控、调查实际控制关系、调整交易保证金标准、调整涨跌停板幅度、开展风险警示谈话等措施，有效化解市场风险隐患，守住不发生系统性风险的底线。

同时，根据节假日情况，在节假日休市期间调整部分期货品种交易保证金标准和涨跌停板幅度4次，向市场发布风险提示函2次。根据品种运行情况，适时调整部分品种合约交易保证金标准和涨跌停板幅度9次，向市场发布风险提示函1次。

四、加强市场培育，推进投资者教育工作

2017年，郑商所通过多种形式加强市场培育，积极推进投资者教育工作。全年共举办“三业活动”504场，参与人数约2.9万人次；共组织视频讲座100场，累计培训人数约

1.6 万人次；举办会员中层业务人员培训班 11 场，累计培训会员高管、中层及业务骨干人数 2000 余人次。持续开展“点”“面”基地建设，新建点基地 18 家。举办“明规则，识风险”系列投资者教育活动，解析违规案例，定期披露每月异常交易情况，引导投资者合规交易。

2018 年，郑商所将进一步推进产品与业务创新，做精做细做实现有品种，加强一线监管和风险控制，加强信息技术系统建设，有序推进对外开放工作，守住不发生系统性风险底线，不断提升市场运行质量和效率，提高服务实体经济、服务国家战略的能力。

郑州商品交易所

2018 年 1 月 10 日