

郑州商品交易所

结算数据文件格式说明

2025 年 9 月

©郑州商品交易所. 版权所有

目 录

1	保证金参数表	4
1.1	文件命名	4
1.2	文件格式	4
2	仓单变动表	4
2.1	文件命名	4
2.2	文件格式	4
3	成交表	5
3.1	文件命名	5
3.2	文件格式	5
4	单腿持仓表	6
4.1	文件命名	6
4.2	文件格式	6
5	非平仓了结表	6
5.1	文件命名	6
5.2	文件格式	6
6	汇率参数表	7
6.1	文件命名	7
6.2	文件格式	7
7	平仓表	7
7.1	文件命名	7
7.2	文件格式	8
8	手续费情况表	8
8.1	文件命名	8
8.2	文件格式	8
9	折抵资金表	8
9.1	文件命名	8
9.2	文件格式	9
10	资金表	9
10.1	文件命名	9
10.2	文件格式	9
11	组合持仓表	10
11.1	文件命名	10
11.2	文件格式	10
12	客户每日资金变动表	11
12.1	文件命名	11
12.2	文件格式	11
13	分项资金表	13
13.1	文件命名	13
13.2	文件格式	13
14	组合保证金套餐对应品种表	14
14.1	文件命名	14
14.2	文件格式	15

15	组合保证金套餐选择表	15
15.1	文件命名	15
15.2	文件格式	15
16	组合保证金表	15
16.1	文件命名	15
16.2	文件格式	15
17	移仓转移持仓变动明细表	16
17.1	文件命名	16
17.2	文件格式	16
18	成交表_10	16
18.1	文件命名	16
18.2	文件格式	17
19	单腿持仓表_10	17
19.1	文件命名	17
19.2	文件格式	17
20	非平仓了结表_10	18
20.1	文件命名	18
20.2	文件格式	18
21	平仓表_10	19
21.1	文件命名	19
21.2	文件格式	19
22	组合持仓表_10	19
22.1	文件命名	19
22.2	文件格式	19
23	移仓转移持仓变动明细表_10	20
23.1	文件命名	20
23.2	文件格式	20
附：	结算文件样例	21

1 保证金参数表

1.1 文件命名

结算日期保证金参数表.txt

例如： 20190313 保证金参数表.txt

1.2 文件格式

序号	字段名	数据类型	宽度	备注
1	期货/期权	Char(10)	10	宽度为该字段在结算文件中所占总字符数
2	合约代码	Char(20)	20	
3	结算价	Number(9,2)	20	
4	投机买保证金率	Number(9,2)	20	
5	投机卖保证金率	Number(9,2)	20	
6	套保买保证金率	Number(9,2)	20	
7	套保卖保证金率	Number(9,2)	20	
8	期权卖保证金额	Number(9,2)	20	
9	隐含波动率	Number(9,4)	20	

2 仓单变动表

2.1 文件命名

结算日期仓单变动表.txt

例如： 20190313 仓单变动表.txt

2.2 文件格式

序号	字段名	数据类型	宽度	备注
1	客户编号	Char(8)	8	宽度为该字段在结算文件中所占总字符数
2	类型	Char(14)	14	类型为仓单变化类型
3	数量	Number(7)	8	
4	品种	Char(2)	6	

5	产期	Char(6)	6	格式: YYYYMMDD
6	等级	Char(10)	10	
7	类别	Char(6)	6	
8	仓库	Char(8)	8	
9	货位	Char(16)	16	
10	产地	Char(8)	8	
11	仓单编号	Char(16)	16	
12	公定重量	Char(8)	8	
13	备注	Char(40)	40	

3 成交表

3.1 文件命名

结算日期成交表.txt

例如: 20190313 成交表.txt

3.2 文件格式

序号	字段名	数据类型	宽度	备注
1	合约编号	Char(20)	20	宽度为该字段在结算文件中所占总字符数
2	客户编码	Char(10)	10	
3	合约代码	Char(15)	15	
4	成交量	Number(8)	8	
5	买/卖	Char(1)	8	
6	成交价	Number(9,2)	12	
7	成交额	Number(12,2)	15	
8	权利金	Number(9,2)	12	
9	交易手续费	Number(12,2)	15	
10	成交时间	Char(8)	12	格式: HH:MM:SS
11	开/平	Char(1)	8	
12	套期保值	Char(1)	10	套期保值开仓定单为“Y”, 其余情况为“N”
13	定单类型	Char(1)	10	
14	成交方式	Char(1)	10	

4 单腿持仓表

4.1 文件命名

结算日期单腿持仓表.txt

例如： 20190313 单腿持仓表.txt

4.2 文件格式

序号	字段名	数据类型	宽度	备注
1	客户编码	Char(12)	12	宽度为该字段在结算文件中所占总字符数
2	合约编号	Char(20)	20	
3	合约代码	Char(15)	15	
4	投机持仓量	Number(9)	10	
5	套保量	Number(9)	10	
6	期货/期权	Char(1)	10	
7	买/卖	Char(1)	8	
8	成交价	Number(9,2)	11	
9	昨结算价	Number(8,2)	10	
10	今结算价	Number(8,2)	10	
11	交易保证金	Number(13,2)	15	
12	本日盈亏	Number(13,2)	15	
13	持仓总盈亏	Number(13,2)	15	

5 非平仓了结表

5.1 文件命名

结算日期非平仓了结表.txt

例如： 20190313 非平仓了结表.txt

5.2 文件格式

序号	字段名	数据类型	宽度	备注
1	客户编码	Char(12)	12	宽度为该字段在结算文

				件中所占总字符数
2	合约编号	Char(20)	20	
3	合约代码	Char(20)	20	
4	买/卖	Char(1)	10	
5	数量	Number(8)	10	
6	成交价	Number(12,2)	14	
7	昨结算价	Number(12,2)	14	
8	交割结算价	Number(12,2)	14	
9	交易保证金	Number(13,2)	15	
10	本日盈亏	Number(13,2)	15	
11	期权行使手续费	Number(13,2)	15	
12	备注	Char(15)	15	

6 汇率参数表

6.1 文件命名

结算日期汇率参数表.txt

例如： 20190313 汇率参数表.txt

6.2 文件格式

序号	字段名	数据类型	宽度	备注
1	序号	Number	20	宽度为该字段在结算文件中所占总字符数
2	币种	Char(20)	20	
3	交易单位	Number	20	
4	汇率	Number(15,4)	20	
5	折算比例	Number(19,2)	20	

7 平仓表

7.1 文件命名

结算日期平仓表.txt

例如： 20190313 平仓表.txt

7.2 文件格式

序号	字段名	数据类型	宽度	备注
1	客户编码	Char(15)	15	宽度为该字段在结算文件中所占总字符数
2	合约代码	Char(15)	15	
3	平仓量	Number(8)	10	
4	买合约编号	Char(20)	20	
5	买价	Number(9,2)	12	
6	昨结算价	Number(9,2)	12	
7	卖价	Number(9,2)	12	
8	卖合约编号	Char(20)	20	
9	盈亏	Number(14,2)	15	

8 手续费情况表

8.1 文件命名

结算日期手续费情况表.txt

例如： 20190313 手续费情况表.txt

8.2 文件格式

序号	字段名	数据类型	宽度	备注
1	应收手续费	Number(9,2)	25	宽度为该字段在结算文件中所占总字符数
2	每日减收	Number(9,2)	25	
3	额度减收	Number(9,2)	25	
4	实收手续费	Number(9,2)	25	

9 折抵资金表

9.1 文件命名

结算日期折抵资金表.txt

例如： 20190313 折抵资金表.txt

9.2 文件格式

序号	字段名	数据类型	宽度	备注
1	会员编号	Char(10)	10	宽度为该字段在结算文件中所占总字符数
2	客户编码	Char(12)	12	
3	合约代码	Char(15)	27	
4	品种代码	Char(10)	10	
5	仓单折抵量(总)	Number(8)	8	
6	折抵持仓量	Number(8)	18	
7	折抵交易保证金	Number(15,2)	16	

10 资金表

10.1 文件命名

结算日期资金表.txt

例如： 20190313 资金表.txt

10.2 文件格式

序号	字段名	数据类型	宽度	备注
1	项目	Char(30)	30	资金表中所含具体内容见下表
2	金额	Char(20)	20	
3	备注	Char(30)	30	

各项目名称及数据格式：

序号	项目名称	数据类型	宽度	备注
1	期初保证金	Number(19,2)	20	
2	结算准备金	Number(19,2)	20	
3	交易保证金	Number(19,2)	20	
4	交割资金	Number(19,2)	20	
5	本日增加	Number(19,2)	20	
6	本日减少	Number(19,2)	20	
7	期末保证金	Number(19,2)	20	期末保证金=期初保证

				金+本日增加-本日减少
8	其中前期配对交易保证金	Number(19,2)	20	
9	资产作为保证金	Number(17,2)	53	该项是否出现，以实际文件为准
10	应增加资产作为保证金配比资金	Number(17,2)	53	该项是否出现，以实际文件为准
11	资产作为保证金可用资金	Number(17,2)	53	该项是否出现，以实际文件为准
12	折抵资金	Number(17,2)	53	该项是否出现，以实际文件为准
13	冻结资金	Number(17,2)	53	该项是否出现，以实际文件为准

新增美元情况：

序号	字段名	数据类型	宽度	备注
1	上日余额	Double(保留两位有效数字)	以实际长度为准	
2	入金	Double(保留两位有效数字)	以实际长度为准	
3	利息	Double(保留两位有效数字)	以实际长度为准	
4	出金	Double(保留两位有效数字)	以实际长度为准	
5	当日余额	Double(保留两位有效数字)	以实际长度为准	
6	美元作为保证金	Number(17,2)	18	

11 组合持仓表

11.1 文件命名

结算日期组合持仓表.txt

例如： 20190313 组合持仓表.txt

11.2 文件格式

序号	字段名	数据类型	宽度	备注
1	客户编码	Char(12)	12	宽度为该字段在结算文件中所占总字符数
2	组合编号	Char(20)	20	

3	组合类型	Char(8)	8	
4	合约编号	Char(20)	20	
5	合约代码	Char(20)	20	
6	数量	Number(9)	10	
7	买/卖	Char(1)	8	
8	成交价	Number(10,2)	12	
9	昨结算价	Number(10,2)	12	
10	今结算价	Number(10,2)	12	
11	交易保证金	Number(13,2)	15	
12	本日盈亏	Number(13,2)	15	
13	持仓总盈亏	Number(13,2)	15	

12 客户每日资金变动表

12.1 文件命名

结算日期_zz_会员编号.txt

例如： 20190313_zz_0055.txt.

12.2 文件格式

第一行：

序号	字段名	数据类型	宽度	备注
1	日期	Char(6)	6	格式：YYYYMMDD
2	zz	Char(22)	2	郑商所缩写
3	会员号	Char(4)	4	
4	分客户记录数	Number	N	记录该文件客户记录条数

例如： 20190313@zz@0001@7

第二行至文件末尾：

序号	字段名	数据类型	宽度	备注
1	项目资金编号	Char(4)	4	各编号含义见下表
2	客户编码	Char(8)	8	郑商所缩写
3	资金金额	Number(15,3)	N	宽度以资金实际长度为准，+表示期货公司收入，-表示支出
4	合约编号	Char(20)	20	

分会员分客户的各个资金项目及其编号统一定义如下：

（其中：A 开头编号的资金项目是分到客户的，B 开头编号的资金项目部分到客户，与整个会员有关）

客户盈亏	A000
交易手续费	A001
交割货款	A002
交割手续费	A003
非货币充抵变动额（今日非货币充抵余额-上日非货币充抵余额）	A004
非货币充抵手续费	A005
期转现手续费	A006
仓储费/仓租费	A007
交割差价/配对盈亏	A008
仓单升贴水	A009
仓单转让手续费	A010
交割定金/定金	A011
定金罚没	A012
交割违约罚款	A013
仓单抵押手续费	A014
强平盈利罚没	A015
冻结款	A016
结算手续费	A017
仓单转让货款	A018
卖方交割保证金	A019
买方交割补偿金	A020
卖方交割补偿金	A021
过户费	A022
转托管费	A023
行权手续费	A024
权利金	A025
报撤单手续费	A034
移仓手续费	A035
移仓划转资金	A036
其他与客户有关资金	A999
年会费	B001
席位费	B002
利息	B003
手续费返还	B004
奖励	B005
补助	B006
经纪和自营账户结算准备金内转	B008
经纪和结算担保金账户内转	B009

其他与会员有关资金

B999

例如： A004@10000001@-123456

13 分项资金表

13.1 文件命名

结算日期_分项资金表.txt

例如： 20190313_分项资金表.txt.

13.2 文件格式

第一行：

序号	字段名	数据类型	宽度	备注
1	日期	Char(6)	6	格式：YYYYMMDD
2	zz	Char(22)	2	郑商所缩写
3	会员号	Char(4)	4	
4	分客户记录数	Number	N	记录该文件客户记录条数

例如： 20190313@zz@0001@7

第二行至文件末尾：

序号	字段名	数据类型	宽度	备注
1	项目资金编号	Char(4)	4	各编号含义见下表
2	客户编码	Char(8)	8	郑商所缩写
3	资金金额	Number(15,3)	N	宽度以资金实际长度为准，+表示期货公司收入，-表示支出
4	合约编号	Char(20)	20	

分会员分客户的各个资金项目及其编号统一定义如下：

（其中：A 开头编号的资金项目是分到客户的，B 开头编号的资金项目部分到客户，与整个会员有关）

客户盈亏	A000
交易手续费	A001
交割货款	A002
交割手续费	A003
非货币充抵变动额（今日非货币充抵余额-上日非货币充抵余额）	A004

非货币充抵手续费	A005
期转现手续费	A006
仓储费/仓租费	A007
交割差价/配对盈亏	A008
仓单升贴水	A009
仓单转让手续费	A010
交割定金/定金	A011
定金罚没	A012
交割违约罚款	A013
仓单抵押手续费	A014
强平盈利罚没	A015
冻结款	A016
结算手续费	A017
仓单转让货款	A018
卖方交割保证金	A019
买方交割补偿金	A020
卖方交割补偿金	A021
过户费	A022
转托管费	A023
行权手续费	A024
权利金	A025
报撤单手续费	A034
移仓手续费	A035
移仓划转资金	A036
其他与客户有关资金	A999
年会费	B001
席位费	B002
利息	B003
手续费返还	B004
奖励	B005
补助	B006
经纪和自营账户结算准备金内转	B008
经纪和结算担保金账户内转	B009
其他与会员有关资金	B999

例如： A004@10000001@-123456

14 组合保证金套餐对应品种表

14.1 文件命名

结算日期组合保证金套餐对应品种表.txt

例如： 20210504组合保证金套餐对应品种表.txt

14.2 文件格式

序号	字段名	数据类型	宽度	备注
1	套餐	Number(10)	10	宽度为该字段在结算文件中所占总字符数
2	组合保证金品种	Char(90)	90	
3	简化组合保证金品种	Char(90)	90	

15 组合保证金套餐选择表

15.1 文件命名

结算日期组合保证金套餐选择表.txt

例如： 20210504组合保证金套餐选择表.txt

15.2 文件格式

序号	字段名	数据类型	宽度	备注
1	会员编号	Char(25)	25	宽度为该字段在结算文件中所占总字符数
2	客户编号	Char(25)	25	
3	组合保证金套餐	Number(25)	25	

16 组合保证金表

16.1 文件命名

结算日期组合保证金表.txt

例如： 20210504组合保证金表.txt

16.2 文件格式

序号	字段名	数据类型	宽度	备注
----	-----	------	----	----

1	会员编号	Char(25)	25	宽度为该字段在结算文件中所占总字符数
2	客户编号	Char(25)	25	
3	组合保证金	Number(25)	25	
4	简化组合保证金	Number(25)	25	

17 移仓转移持仓变动明细表

17.1 文件命名

结算日期移仓转移持仓变动明细表.txt

例如： 20231219移仓转移持仓变动明细表.txt

17.2 文件格式

序号	字段名	数据类型	宽度	备注
1	移仓业务办理流水号	Char(23)	23	宽度为该字段在结算文件中所占总字符数
2	客户编码	Char(13)	13	
3	合约编号	Char(23)	23	
4	合约代码	Char(18)	18	
5	买/卖	Char(10)	10	
6	期货期权	Number(14)	14	
7	投机量	Number(11)	11	
8	套保量	Number(11)	11	
9	套利量	Number(11)	11	
10	成交价	Number(12, 2)	13	
11	移仓方向	Char(8)	8	

18 成交表_10

18.1 文件命名

结算日期成交表_10.txt

例如： 20190313 成交表_10.txt

18.2 文件格式

序号	字段名	数据类型	宽度	备注
1	合约编号	Char(20)	20	宽度为该字段在结算文件中所占总字符数
2	客户编码	Char(10)	10	
3	合约代码	Char(15)	15	
4	成交量	Number(8)	8	
5	买/卖	Char(1)	8	
6	成交价	Number(9,2)	12	
7	成交额	Number(12,2)	15	
8	权利金	Number(9,2)	12	
9	交易手续费	Number(12,2)	15	
10	成交时间	Char(8)	12	格式：HH:MM:SS
11	开/平	Char(1)	8	
12	套期保值	Char(1)	10	套期保值开仓定单为“Y”，其余情况为“N”
13	定单类型	Char(1)	10	
14	成交方式	Char(1)	10	

19 单腿持仓表_10

19.1 文件命名

结算日期单腿持仓表_10.txt

例如： 20190313 单腿持仓表_10.txt

19.2 文件格式

序号	字段名	数据类型	宽度	备注
1	客户编码	Char(12)	12	宽度为该字段在结算文件中所占总字符数
2	合约编号	Char(20)	20	
3	合约代码	Char(15)	15	
4	投机持仓量	Number(9)	10	

5	套保量	Number(9)	10	
6	期货/期权	Char(1)	10	
7	买/卖	Char(1)	8	
8	成交价	Number(9,2)	11	
9	昨结算价	Number(8,2)	10	
10	今结算价	Number(8,2)	10	
11	交易保证金	Number(13,2)	15	
12	本日盈亏	Number(13,2)	15	
13	持仓总盈亏	Number(13,2)	15	

20 非平仓了结表_10

20.1 文件命名

结算日期非平仓了结表_10.txt

例如： 20190313 非平仓了结表_10.txt

20.2 文件格式

序号	字段名	数据类型	宽度	备注
1	客户编码	Char(12)	12	宽度为该字段在结算文件中所占总字符数
2	合约编号	Char(20)	20	
3	合约代码	Char(20)	20	
4	买/卖	Char(1)	10	
5	数量	Number(8)	10	
6	成交价	Number(12,2)	14	
7	昨结算价	Number(12,2)	14	
8	交割结算价	Number(12,2)	14	
9	交易保证金	Number(13,2)	15	
10	本日盈亏	Number(13,2)	15	
11	期权行使手续费	Number(13,2)	15	
12	备注	Char(15)	15	

21 平仓表_10

21.1 文件命名

结算日期平仓表_10.txt

例如： 20190313 平仓表_10.txt

21.2 文件格式

序号	字段名	数据类型	宽度	备注
1	客户编码	Char(15)	15	宽度为该字段在结算文件中所占总字符数
2	合约代码	Char(15)	15	
3	平仓量	Number(8)	10	
4	买合约编号	Char(20)	20	
5	买价	Number(9,2)	12	
6	昨结算价	Number(9,2)	12	
7	卖价	Number(9,2)	12	
8	卖合约编号	Char(20)	20	
9	盈亏	Number(14,2)	15	

22 组合持仓表_10

22.1 文件命名

结算日期组合持仓表_10.txt

例如： 20190313 组合持仓表_10.txt

22.2 文件格式

序号	字段名	数据类型	宽度	备注
1	客户编码	Char(12)	12	宽度为该字段在结算文件中所占总字符数
2	组合编号	Char(20)	20	
3	组合类型	Char(8)	8	

4	合约编号	Char(20)	20	
5	合约代码	Char(20)	20	
6	数量	Number(9)	10	
7	买/卖	Char(1)	8	
8	成交价	Number(10,2)	12	
9	昨结算价	Number(10,2)	12	
10	今结算价	Number(10,2)	12	
11	交易保证金	Number(13,2)	15	
12	本日盈亏	Number(13,2)	15	
13	持仓总盈亏	Number(13,2)	15	

23 移仓转移持仓变动明细表_10

23.1 文件命名

结算日期移仓转移持仓变动明细表_10.txt

例如： 20231219移仓转移持仓变动明细表_10.txt

23.2 文件格式

序号	字段名	数据类型	宽度	备注
1	移仓业务办理流水号	Char(23)	23	宽度为该字段在结算文件中 所占总字符数
2	客户编码	Char(13)	13	
3	合约编号	Char(23)	23	
4	合约代码	Char(18)	18	
5	买/卖	Char(10)	10	
6	期货期权	Number(14)	14	
7	投机量	Number(11)	11	
8	套保量	Number(11)	11	
9	套利量	Number(11)	11	
10	成交价	Number(12, 2)	13	
11	移仓方向	Char(8)	8	

附： 结算文件样例

注意： 以下样例文件仅提供格式上的参考， 文件内容不是真实数据

1. 保证金参数表

郑州商品交易所保证金参数表								
会员编号: 0400			交易日期:2019/03/13					
期货/期权	合约代码	结算价	投机买保证金率	投机卖保证金率	套保买保证金率	套保卖保证金率	期权卖保证金额	隐含波动率
期货	AP001	8064.00	8.00	8.00	0.00	0.00	0.00	0.0000
期权	CF001C14800	1547.00	7.00	7.00	0.00	0.00	13375.25	14.2608
							郑州商品交易所结算部	
							制表日期:2019/03/13	

2. 仓单变动表

郑州商品交易所会员当日标准仓单变动单												
会员编号: 0400				交易日期:2019/05/27								
客户编号类型		数量	品种	产期	等级	类别	仓库	货位	产地	仓单编号	公定重量	备注
06901062 撤抵		1	CF	1819	2129B	S3U	0323	***	新疆	CF2018111600301	26950	
06901062 注销		1	CF	1819	1129B	S3U	0323	***	新疆	CF2018122000174	43.161	
06901062 转让转入		1	CF	1819	4129B	S2U	0322	***	新疆	CF2018110600176	43.739	
06901062 转让转入		1	CF	1819	3129B	S2U	0328	***	新疆	CF2018110800053	42.681	
30887661 撤质		28	SR	1819	1	ALL	0428	***	***	SR2019051000046		
30887661 充抵		6	SR	1819	1	ALL	0428	***	***	SR2019051000046		
30887661 注销		22	SR	1819	1	ALL	0428	***	***	SR2019051000046	0	
34468206 注销		102	TA	ALL	优等	ALL	0534	***	***	ALL		
34468206 转让转入		102	TA	ALL	优等	ALL	***	***	***	ALL		
郑州商品交易所结算部												
制表日期:2019/05/27												

3. 成交表

郑州商品交易所会员当日成交合约表

会员编号: 0400

2019/03/13

合约编号	客户编码	合约代码	成交量	买/卖	成交价	成交额	权利金	交易手续费	成交时间	开/平	套期保值	定单类型	成交方式
2019031300003029	04001173	TA905	4	S	6510.00	128100.00	0.00	12.00	20:59:00	O	N	N	N
2019031300003886	30813955	SR905P5100	1	B	35.00	350.00	-350.00	1.50	21:00:00	L	N	N	N
合计			5			128450.00	-350.00	13.50					

注释: 成交方式: N-正常 C-强平 O-期权行权 Q-期转现 P-最后交易日对冲 R-做市商响应
定单类型: N- 正常单 C- 组合单 Q- 做市商响应
开 / 平: O- 开仓 L- 平仓
套期保值: Y- 是 N-非

郑州商品交易所结算部
制表日期:2019/03/13

4. 单腿持仓表

郑州商品交易所会员当日单腿持仓合约表												
会员编号: 0400				2019/03/13								
客户编码	合约编号	合约代码	投机持仓量	套保量	期货/期权	买/卖	成交价	昨结算价	今结算价	交易保证金	本日盈亏	持仓总盈亏
00400086	2019031803152078	MA905	1	0	0	S	2460.00	2550.00	2499.00	1749.30	-390.00	-390.00
小计			1	0						1749.30	-390.00	-390.00
30838955	2013111901685943	SR905P4300	1	0	1	S	19.50	0.50	0.50	1291.25	0.00	0.00
小计			1	0						1291.25	0.00	0.00
合计			1	0						3040.55	-390.00	-390.00
注释: 1.期货/期权: 0 - 期货 1 - 期权												
2.本表中的投机持仓量: 甲醇品种为投机持仓量与套保持仓量之和, 其他品种套保持仓量按照额度管理。												
											郑州商品交易所结算部	
											制表日期:2019/03/13	

5. 非平仓了结表

郑州商品交易所会员当日非平仓了结持仓合约表											
会员编号: 0400				2019/03/13							
客户编码	合约编号	合约代码	买 / 卖	数量	成交价	昨结算价	交割结算价	交易保证金	本日盈亏	期权行使手续费	备注
00400086	2019031303152078	MA905	1	0	2460.00	2550.00	2499.00	1749.30	-390.00	-390.00	
合计			1	0				1749.30	-390.00	-390.00	
										郑州商品交易所结算部	
										制表日期:2019/03/13	

6. 汇率参数表

郑州商品交易所汇率参数表				
会员编号: 0400		交易日期: 2019/03/13		
序号	币种	交易单位	汇率	折算比例
1	美元	1	6.7088	0.95
				郑州商品交易所结算部
				制表日期:2019/03/13

7. 平仓表

郑州商品交易所会员当日平仓盈亏表								
会员编号: 0400			2019/03/13					
客户编码	合约代码	平仓量	买合约编号	买价	昨结算价	卖价	卖合约编号	盈亏
00200416	RM909	1	2019031801477337	2227.00	2197.00	2219.00	2019031801974732	-80.00
小计		20						-80.00
合计		20						-80.00
郑州商品交易所结算部 制表日期:2019/03/13								

8. 手续费情况表

郑州商品交易所会员当日手续费情况表			
会员编号: 0400		交易日期: 2019/03/13	
应收手续费	每日减收	额度减收	实收手续费
10000.80	585.79	0.00	9415.01
郑州商品交易所结算部 制表日期:2019/03/13			

9. 折抵资金表

郑州商品交易所当日折抵仓单释放保证金表						
会员编号: 0400					2019/03/13	
会员编号	客户编码	合约代码	品种代码	仓单折抵量(总)	折抵持仓量	折抵交易保证金
0400	33977152	SR905	SR	100	100	257250.00
合计				100	100	257250.00
					郑州商品交易所结算部	
					制表日期:2019/03/13	

10. 资金表

郑州商品交易所会员当日资金结算表		
会员编号:0400	2019/03/13	单位:元
项 目	金 额	备 注
期初保证金	1300207677.07	
结算准备金	327367118.09	
交易保证金	964840558.98	
交割资金	8000000.00	
本日增加	612075.00	权利金收付
小 计	612075.00	
本日减少	310.00	仓单转让手续费
小 计	310.00	
期末保证金	1290160873.75	
结算准备金	317715351.48	
交易保证金	972445522.27	
其中前期配对交易保证金	0.00	
交割资金	0.00	
美元 上日余额: 0.00 入金: 0.00 利息: 0.00 出金: 0.00 当日余额: 0.00		
美元充抵保证金: 0.00 元		
仓单充抵资金: 171692064.00 元		
仓单可用充抵资金: 171692064.00 元		
折抵资金: 257250.00 元		
郑州商品交易所结算部		
制表日期:2019/03/13		

11.组合持仓表

郑州商品交易所会员当日组合持仓合约表												
会员编号: 0400			2019/03/13									
客户编码	组合编号	组合类型	合约编号	合约代码	数量	买/卖	成交价	昨结算价	今结算价	交易保证金	本日盈亏	持仓总盈亏
00400553	2019031300187926	SPD	2019031302246780	OI909	2	B	7073.00	6937.00	6989.00	9784.60	160.00	-120.00
			2019031302246784	OI001	2		7060.00	6938.00	6982.00	0.00		
小计					4					9784.60	160.00	-120.00
小计					4					9784.60	160.00	-120.00
注: SPD-跨期套利 (B 组合:第一腿为 B, 第二腿为 S; S 组合:第一腿为 S, 第二腿为 B)												
IPS-跨品种套利 (B 组合:第一腿为 B, 第二腿为 S; S 组合:第一腿为 S, 第二腿为 B)												
STD-跨式套利 (B 组合:第一腿为 B, 第二腿为 B; S 组合:第一腿为 S, 第二腿为 S)												
STG-宽跨式套利 (B 组合:第一腿为 B, 第二腿为 B; S 组合:第一腿为 S, 第二腿为 S)												
PRT-备兑套利 (B 组合:第一腿为 B, 第二腿为 S; S 组合:第一腿为 S, 第二腿为 S)												
											郑州商品交易所结算部	
											制表日期:2019/03/13	

12.客户每日资金变动表

20190313@zz@0400@3
A025@34788406@+87190
A025@34466998@-2920
A025@34818955@+139290

13.分项资金表

20190313@zz@0400@3
A025@34788406@+87190
A025@34466998@-2920
A025@34818955@+139290

14.组合保证金套餐对应品种表

郑州商品交易所组合保证金套餐品种列表文件		
会员编号: 0400		交易日期: 2021/05/04
套餐	组合保证金品种	简化组合保证金品种
5	AP,CJ,JR,LR,FG,MA,SA	CF,CY
6		AP,CY,CJ,CF
7	AP,WH	CF,ZC,CY,CJ
		郑州商品交易所结算部
		制表日期:2021/05/04

15.组合保证金套餐选择表

郑州商品交易所客户组合保证金套餐选择文件		
会员编号: 0400		交易日期:2021/05/04
会员编号	客户编号	组合保证金套餐
0400	00300134	7
0400	00301130	7
0400	01703010	7
注释: 本文件中仅展示选择组合保证金套餐的客户		
郑州商品交易所结算部		
制表日期:2021/05/04		

16.组合保证金表

郑州商品交易所会员当日组合保证金表			
会员编号: 0400		交易日期:2021/05/04	
会员编号	客户编号	组合保证金	简化组合保证金
0400	00300134	0.00	10116345.62
0400	00301130	0.00	9965964.04
0400	00704220	0.00	123000.00
0400	00800180	173820.00	0.00
0400	00900275	0.00	273650.00
合计		173820.00	32326739.02
郑州商品交易所结算部 制表日期:2021/05/04			

17.移仓转移持仓变动明细表

郑州商品交易所会员当日移仓转移持仓变动明细表

会员编号: 0400

2023/12/19

移仓业务办理流水号	客户编码	合约编号	合约代码	买 / 卖	期货期权	投机量	套保量	套利量	成交价	移仓方向
2023121900000001	05100111	2023011100000025	TA402C6900	B	1	2	0	0	800.00	MO
2023121900000001	05100111	2023011100000026	TA402C6900	S	1	0	0	2	800.00	MO
2023121900000001	05100111	2023011600000005	TA402	B	0	3	0	2	6006.00	MO
2023121900000001	05100111	2023020200000002	TA402	S	0	1	0	0	7760.00	MO
2023121900000001	05100111	2023020600000005	TA402	B	0	1	0	0	9100.00	MO
2023121900000001	05100111	2023020600000006	TA402	S	0	1	0	0	9100.00	MO

注释: 期货/期权: 0 - 期货 1 - 期权
移仓方向: MI - 移入 MO - 移出

郑州商品交易所结算部
制表日期:2023/12/19

18. 成交表_10

郑州商品交易所会员当日成交合约表_10

会员编号： 0400			2019/09/24										
合约编号	客户编码	合约代码	成交量	买/卖	成交价	成交额	权利金	交易手续费	成交时间	开/平	套期保值	定单类型	成交方式
2022042600000000195	18900648	SR209MSC6100	13	B	1407.00	182910.00	-182910.00	19.50	09:10:02	O	N	N	N
2022042600000000196	18900648	SR209MSC6100	13	S	1407.00	182910.00	182910.00	19.50	09:10:02	O	N	N	N
2022042600000000197	18900648	SR209MSC6000	13	B	1503.00	195390.00	-195390.00	19.50	09:10:02	O	N	N	N
2022042600000000198	18900648	SR209MSC6000	13	S	1503.00	195390.00	195390.00	19.50	09:10:02	O	N	N	N
2022050400000000007	00100650	ZC205	10	B	351.60	351600.00	0.00	300.00	10:14:07	O	N	C	N
2022050400000000008	00500198	ZC206	11	S	351.70	351600.00	0.00	300.00	10:14:07	O	N	N	C
2022050400000000009	59900001	ZC207	12	B	295.80	295600.00	0.00	300.00	10:14:07	O	N	N	O
2022050400000000012	99822064	ZC210	15	S	297.60	295600.00	0.00	300.00	10:14:07	O	N	C	M
2022050400000000014	00100650	SR207C5000	10	B	11.90	11900.00	-11900.00	15.00	09:56:59	L	N	N	N
2022050400000000019	99822064	SR207P4600	40	S	11.10	8100.00	8100.00	15.00	09:56:59	L	N	C	M
2022050400000000020	30480465	SR207P4700	50	S	12.10	8100.00	8100.00	15.00	09:56:59	O	N	C	Q
合计			200			2079100.00	4300.00	1323.00					
注释： 成交方式：N-正常 C-强平 O-期权行权 Q-期转现 P-最后交易日对冲 R-做市商响应 M-指定编码对冲 定单类型：N- 正常单 C- 组合单 Q- 做市商响应 开 / 平：O- 开仓 L- 平仓 套期保值：Y- 是 N-非													
郑州商品交易所结算部 制表日期:2019/09/24													

19. 单腿持仓表_10

郑州商品交易所会员当日单腿持仓合约表_10												
会员编号： 0400			2019/09/24									
客户编码	合约编号	合约代码	投机持仓量	套保量	期货/期权	买/卖	成交价	昨结算价	今结算价	交易保证金	本日盈亏	持仓总盈亏
01203414	201909240000000003	CF209	1	0	0	B	11170.00	18630.00	18590.00	0.00	0.00	37100.00
01203414	201909240000000004	CF211	2	0	0	B	11178.00	19315.00	19380.00	0.00	0.00	82020.00
小计			3	0						0.00	0.00	119120.00
35603188	202206170000000002	CF209	1	0	0	S	8130.00	18630.00	18590.00	0.00	0.00	-52300.00
小计			1	0						0.00	0.00	-52300.00
合计			4	0						0.00	0.00	66820.00
注释： 期货/期权： 0 - 期货 1 - 期权											郑州商品交易所结算部 制表日期:2019/09/24	

20. 非平仓了结表_10

郑州商品交易所会员当日非平仓了结持仓合约表_10											
会员编号： 0400			2019/09/24								
客户编码	合约编号	合约代码	买 / 卖	数量	成交价	昨结算价	交割结算价	交易保证金	本日盈亏	期权行使手续费	备注
30521969	202205100010000005	CF209	B	6	120.00	18630.00	18675.00	100.20	80105.00	10.50	期权执行
30521969	202205100010000006	CF209	S	7	120.00	18630.00	18675.00	101.20	8010.00	10.50	交割配对
小计				13				201.40	88115.00	21.00	
合计				13				201.40	88115.00	21.00	
											郑州商品交易所结算部 制表日期:2019/09/24

21. 平仓表_10

会员编号： 0400		2019/09/24						
客户编码	合约代码	平仓量	买合约编号	买价	昨结算价	卖价	卖合约编号	盈亏
00100650	SR207C5000	10	202205040000000014	11.90	26.90	0.00	2019092400000000001	0.00
小计		20						0.00
99822064	SR207P4600	40	2019092400000000003	0.00	16.30	11.10	2022050400000000019	0.00
小计		80						0.00
合计		100						0.00
郑州商品交易所结算部 制表日期:2019/09/24								

郑州商品交易所会员当日组合持仓合约表_10												
会员编号: 0400		2019/09/24										
客户编码	组合编号	组合类型	合约编号	合约代码	数量	买/卖	成交价	昨结算价	今结算价	交易保证金	本日盈亏	持仓总盈亏
30170631	2019092400000000001	SPD	2019092400000000003	CF209	2	B	11170.00	18630.00	18590.00	0.00	0.00	156220.00
			2019092400000000004	CF211	2		11178.00	19315.00	19380.00	0.00		
小计					4					0.00	0.00	156220.00
33794420	2022051000000000006	SPD	2022061700000000001	CF209	1	B	8130.00	18630.00	18590.00	0.00	0.00	-8150.00
			2022061600000000002	CF211	1		7290.00	19315.00	19380.00	0.00		
小计					2					0.00	0.00	-8150.00
合计					6					0.00	0.00	148070.00
备注: SPD-跨期套利 (B组合:第一腿为B, 第二腿为S; S组合:第一腿为S, 第二腿为B) IPS-跨品种套利 (B组合:第一腿为B, 第二腿为S; S组合:第一腿为S, 第二腿为B) STD-跨式套利 (B组合:第一腿为B, 第二腿为B; S组合:第一腿为S, 第二腿为S) STG-宽跨式套利 (B组合:第一腿为B, 第二腿为B; S组合:第一腿为S, 第二腿为S) FRT-备兑套利 (B组合:第一腿为B, 第二腿为S; S组合:第一腿为S, 第二腿为S)												

郑州商品交易所结算部
 制表日期: 2019/09/24

郑州商品交易所会员当日移仓转移持仓变动明细表_10										
会员编号: 0400		2019/09/24								
移仓业务办理流水号	客户编码	合约编号	合约代码	买 / 卖	期货期权	投机量	套保量	套利量	成交价	移仓方向
20190924000000000001	37687529	202312070013376916	CF405P13800	B	1	10	0	0	180.00	MO
20231020000000000001	35902169	202309080002453077	FG312	B	0	1	0	0	1812.00	MO
20231020000000000001	35902169	202309080002453081	FG312	B	0	1	0	0	1812.00	MO
20240117000000000001	37687529	202312070013244139	CF405P13800	B	1	10	0	0	180.00	MI
20240117000000000001	37687529	202312070013376915	CF405P13800	B	1	10	0	0	180.00	MI

注释: 期货/期权: 0 - 期货 1 - 期权

移仓方向: MI - 移入 MO - 移出

郑州商品交易所结算部
制表日期:2019/09/24