

关于发布《郑州商品交易所作为保证金的资产处置业务规定》的公告

(2023) 83 号

为进一步规范作为保证金的资产违约处置工作，完善规则制度体系，郑州商品交易所制定了《郑州商品交易所作为保证金的资产处置业务规定》，现予以发布，自发布之日起施行。

特此公告。

附件：郑州商品交易所作为保证金的资产处置业务规定

郑州商品交易所

2023 年 9 月 6 日

附 件

郑州商品交易所作为保证金的资产处置 业务规定

第一章 总则

第一条 为了加强郑州商品交易所（以下简称交易所）资产作为保证金业务管理，规范违约处置流程，根据《中华人民共和国期货和衍生品法》《郑州商品交易所交易规则》《郑州商品交易所期货结算管理办法》《郑州商品交易所期货交易风险控制管理办法》等相关规定，制定本规定。

第二条 本规定所称作为保证金的资产包括外汇、国债、标准仓单以及交易所认可的其他可作为保证金的资产。

第三条 会员出现以下情形的，交易所可以对其提交的作为保证金的资产进行处置：

- (一) 会员不能履行或者不能完全履行交易保证金债务和相关债务时；
- (二) 交易所规定的其他情形。

第四条 作为保证金的资产为外汇的，以换汇方式进行处置。作为保证金的资产为有价证券的，以拍卖、变卖、协议折价或者其他符合法律规定的方式进行处置，具体处置方式由交易所视情况确定。

第二章 一般规定

第五条 交易所实施资产处置，应当通知会员。交易所向会员发送《作为保证金的资产处置通知书》（附件1），告知会员预计处置金额。《作为保证金的资产处置通知书》发送日为通知日。

第六条 交易所综合考虑会员的债务和资产状况，处置前可以允许会员申报所需处置的资产，也可以直接由交易所按照资产的市场流动性、有效期限、处置效率等选择。

会员申报时，应当按照交易所通知时间向交易所提交《作为保证金的资产处置申报表》（附件2）。会员申报数量能够满足交易所预计处置金额的，交易所按照会员申报情况进行处置。会员申报不能满足交易所预计处置金额或者会员未在规定时间内向交易所申报的，以及交易所认定会员申报资产处置变现存在困难的，交易所有权根据市场情况选择或者调整需要处置的资产。

第七条 交易所处置各类资产时一般按照外汇、国债、标准仓单的顺序进行，会员申报所需处置资产时应当遵照此原则。交易所可以根据市场情况对上述处置顺序进行调整。

交易所处置资产的数量一般至会员能够履行相关债务时为止。出于风险控制需要，交易所可以适当增加处置资产的数量。

第八条 交易所将资产处置所得款项作为会员的入金处

理。

第九条 因资产处置产生的相关费用，由被处置方会员承担。交易所垫付相关费用的，可以依法对被处置方会员进行追偿。

第十条 如遇政策调整、市场大幅波动或者交易所认为必要的其他情况，交易所可以中止资产处置。

第三章 外汇处置

第十一条 当会员结算准备金最低余额不满足规则要求时，以交易所提供的当日结算结果作为外汇处置通知。当日结算后，交易所可以根据存管银行外汇资金专用账户的余额情况选择换汇银行，将会员的全部或者部分外汇按照银行实时汇率兑换成人民币。

第四章 国债处置

第十二条 交易所按照以下原则选择需要处置的国债：

(一) 依据市场流动性，依次按照周转率从高到低、待偿期由短到长、发行时间由近到远的顺序选择待处置的国债；

(二) 同一类型国债超过所需处置数量的，依次按照客户质押金额由大到小、质押时间由先到后的顺序选择。

第十三条 国债采取拍卖或者变卖方式处置的，交易所于通知日向国债登记机构提交拍卖或者变卖申请。具体拍卖或者变卖程序由国债登记机构按照相关规定执行。国债登记

机构将拍卖或者变卖结果告知交易所后，交易所将相应结果告知会员。

第十四条 国债采取协议折价方式处置的，交易所与会员、国债持有人协商一致后，共同向国债登记机构提交申请。具体办理程序按照国债登记机构有关规定执行。

第五章 标准仓单处置

第十五条 采用拍卖、变卖等方式处置标准仓单时，交易所可以公布相关会员所有用于担保的标准仓单，由市场参与者根据公布的标准仓单信息提交申购意向。

第十六条 标准仓单采取拍卖方式处置的，交易所按照《中华人民共和国拍卖法》有关规定委托具有从事拍卖业务许可资格的企业进行拍卖，拍卖保留价的计算参照变卖保留价执行。

第十七条 标准仓单采取变卖方式处置的，按照以下流程进行：

（一）发布变卖公告。交易所于通知日发布标准仓单变卖公告，公布待处置的标准仓单信息、变卖时间、参与方式等事项。

（二）确定变卖保留价。变卖保留价 =通知日标的的标准仓单对应品种最近交割月份期货合约结算价×折扣比率。

（三）交纳竞买保证金。竞买人需交纳一定金额的保证金至交易所指定账户方可参与竞买，交纳方式以变卖公告为

准。

（四）竞买。

1. 申请：竞买人通过交易所指定计算机竞价系统或者交易所认可的其他方式，在变卖公告规定时间内向交易所提交竞买申请。低于单笔最低竞买量或者变卖保留价的申请无效。

2. 结果确定：竞价结束后，判定竞买结果，若全部买申报总量小于或者等于需处置的标准仓单数量，则买申报全部成功；若全部买申报总量大于需处置的标准仓单数量，按照“价格优先、时间优先”原则募入，募满为止。

3. 结果通知：竞买结果确定后，交易所通过指定计算机竞价系统或者交易所认可的其他方式向竞买成功方发送结果通知，并告知余款交纳时间、金额等事项。对竞买未成功的竞买人，交易所退还竞买保证金。

（五）交纳余款。竞买成功方应当在交易所规定时间内将余款划入交易所指定账户。

（六）仓单交付。交易所收到足额货款后，将标准仓单所有权登记至竞买成功方名下。

（七）违约处置。若竞买成功方未按时足额交纳货款，交易所判定违约，竞买保证金不予退还。

（八）重新组织竞买。如果无人参与竞买或者预计处置金额未募满，交易所有权公告延长竞价时间，或者按照市场行情对变卖保留价进行调整后重新组织竞买。

第十八条 标准仓单采取协议折价方式处置的，交易所与会员、标准仓单持有人协商一致后，参照交易所标准仓单转让相关规定办理。

第十九条 原标准仓单持有人应当向买受人开具增值税专用（普通）发票（以下简称发票），相关发票开具按照国家税务机关有关规定办理。买受人应当在交纳货款后1个交易日内，将开具发票所需信息通知原标准仓单持有人。原标准仓单持有人应当在标准仓单交付日（不含该日）起5个交易日内，向买受人开具发票。

原标准仓单持有人未在规定时间开具发票的，按照国家税务部门公布的增值税税率补偿买受人，补偿金额从货款中扣付。交易所可以继续对该会员剩余的标准仓单进行处置。

第二十条 买受人已开立期货交易账户的，交易所将标准仓单过户至买受人名下；买受人未开立期货交易账户的，交易所将标准仓单注销后，由买受人办理提货。

第二十一条 标准仓单有效期在处置期间到期的，交易所有权继续处置该标准仓单对应的货物或者提货权。

第六章 附则

第二十二条 本规定由郑州商品交易所负责解释。

第二十三条 本规定自发布之日起施行。

附件：1. 作为保证金的资产处置通知书

2. 作为保证金的资产处置申报表

附件 1

作为保证金的资产处置通知书

_____ (会员) :

_____ 年 _____ 月 _____ 日结算后, 你公司存在资金缺口, 且未在规定时间内补足, 目前仍存在人民币资金缺口 _____ 元。根据郑州商品交易所有关规定, 决定对你公司提交的作为保证金的资产按照下面第 _____ 条进行处置。

1. 按照《郑州商品交易所作为保证金的资产处置业务规定》第五条、第六条第一款, 郑州商品交易所将按规定流程对你公司提交的资产直接进行处置。
2. 按照《郑州商品交易所作为保证金的资产处置业务规定》第六条第二款, 请你公司于 _____ 年 _____ 月 _____ 日 _____ 时前申报所需处置的资产。

特此通知。

郑州商品交易所

年 月 日

附件 2

作为保证金的资产处置申报表

郑州商品交易所：

我公司申请依据本表对相关资产进行处置。

会员号		会员名称			
外汇					
序号	换汇银行			换汇金额	
1					
2					
国债					
序号	国债名称	国债代码	国债面额 (万元)	交易编码	国债持有人 债券账号
1					
2					
标准仓单					
序号	仓单品种	仓单数量	交易编码	仓单编号	
1					
2					
申请方联系方式及签章					
联系人 1		办公电话		手机	
联系人 2		办公电话		手机	
<p>我方承诺已知悉并遵守资产作为保证金业务有关法律法规和郑州商品交易所业务规则及相关规定，承诺所填写的信息真实、准确、有效。因上述信息、陈述或承诺不实、错误或无效所导致的对客户、申请方、交易所或第三人的责任及损失由我公司承担，交易所不承担任何责任。</p>					
单位公章					
年 月 日					