

郑州商品交易所晚籼稻期货业务细则

(2024年1月4日郑州商品交易所第八届理事会第十次会议审议通过，2024年2月6日(2024)16号公告发布，自2024年2月6日起施行)

第一章 总 则

第一条 为了规范郑州商品交易所（以下简称交易所）晚籼稻期货相关业务，根据《郑州商品交易所交易规则》及晚籼稻期货合约，制定本细则。

第二条 交易所、会员、客户、交割仓库（以下简称仓库）、交割厂库（以下简称厂库）、指定质检机构及期货市场其他参与者应当遵守本细则。

第二章 交易业务

第三条 晚籼稻期货合约交易单位为20吨/手。

第四条 晚籼稻期货合约报价单位为元（人民币）/吨。

第五条 晚籼稻期货合约最小变动价位为1元/吨。

第六条 晚籼稻期货合约交割月份为1、3、5、7、9、11月。

第七条 晚籼稻期货合约交易指令每次最小下单量为1手，限价指令每次最大下单量为1000手，市价指令每次最大下单量为200手。

交易所可以根据市场情况，对晚籼稻期货合约交易指令每次最小下单量、每次最大下单量进行调整，具体标准由交易所另行公布。

第八条 晚籼稻期货合约交易时间为上午9:00—11:30，下午13:30—15:00；其中，上午10:15—10:30为休息时间。

交易所另行公告晚籼稻期货合约开展夜盘交易的，以交易所公告为准。交易所可以根据市场情况，暂停、取消晚籼稻期货合约夜盘交

易或者对夜盘交易时间进行调整，具体由交易所另行公告。

第九条 晚籼稻期货合约最后交易日为合约交割月份的第10个交易日。

第十条 晚籼稻期货合约交易代码为LR。

第三章 交割业务

第一节 一般规定

第十一条 晚籼稻期货适用期货转现货、仓库标准仓单交割和厂库标准仓单交割。

晚籼稻期货滚动交割的配对方式为响应配对。

具体交割流程按照《郑州商品交易所期货交割管理办法》及本细则相关规定执行。

第十二条 晚籼稻期货的交割单位为20吨。

第十三条 晚籼稻期货合约的最后交割日为合约交割月份的第13个交易日。

第十四条 晚籼稻期货标准仓单可以分为仓库标准仓单和厂库标准仓单。

晚籼稻期货标准仓单为通用标准仓单。

第十五条 N年10月1日起注册的晚籼稻期货标准仓单，有效期至N+1年9月份的最后一个工作日（含该日）。

第十六条 晚籼稻期货交割开具增值税专用发票。

第十七条 晚籼稻期货仓库、厂库及相关升贴水由交易所确定并公布，交易所可以视情况对晚籼稻期货仓库、厂库及相关升贴水进行

调整。

第十八条 晚籼稻期货替代交割品升贴水、仓库或者厂库升贴水在标准仓单注册、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，仓库或者厂库负责监督。仓库或者厂库按照增值税适用税率收取押金，增值税专用发票开具后押金应予退还。

第十九条 晚籼稻期货的交割基准价为基准交割品在基准仓库的散粮交货含税价格（不含包装）。

第二十条 晚籼稻运达仓库指定货位前的一切费用由标准仓单注册人承担，从指定货位装上汽车、火车或者轮船板的费用由提货人承担。

晚籼稻期货交割手续费、仓储费、出入库费、检验费等交割相关费用标准由交易所另行公布。

第二十一条 晚籼稻接收、储存、发运采用散粮方式。买方需要包装物的，包装物由买方自理或者委托他人代办，包装物及包装费用由买方另行支付。

第二十二条 晚籼稻期货标准仓单生成、流通、注销等相关业务，本细则未规定的，适用《郑州商品交易所标准仓单管理办法》相关规定。

第二节 交割标准

第二十三条 晚籼稻（含中籼稻，下同）期货交割适用国家标准、国家相关规定及本细则规定。

第二十四条 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 $\geqslant 52\%$ ，

水分含量 \leqslant 14.5%，谷外糙米含量 \leqslant 4%，垩白度 \leqslant 2%，长宽比 \geqslant 3.1，粒长 \geqslant 5.6mm且异品种率 \leqslant 7%。

第二十五条 替代交割品及升贴水：

(一) 入库时：水分含量 \leqslant 14.5%的，足量入库。每年10月1日（含该日）至次年3月31日（含该日）入库的晚籼稻，水分含量不得超过15.5%；14.5% $<$ 水分含量 \leqslant 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%。出库时：水分含量 \leqslant 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%，由仓库承担补量责任。本项仅适用于江西、湖南、湖北、安徽等主产区的仓库和厂库交割。

(二) 1.0% $<$ 杂质含量 \leqslant 1.5%的，入库时扣量0.5%，出库时补量0.5%；1.5% $<$ 杂质含量 \leqslant 2.0%的，入库时扣量1.0%，出库时补量1.0%。

(三) 2.8 \leqslant 长宽比 $<$ 3.1的，可以替代交割，相关升贴水由交易所另行公告。

第二十六条 晚籼稻出入库脂肪酸值及黄粒米含量指标规定如下：

(一) 每年10月1日（含该日）至次年3月31日（含该日）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%。

(二) 每年10月1日（含该日）至次年3月31日（含该日）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%。

（三）厂库晚籼稻出库时，脂肪酸值和黄粒米含量指标按照对应期间入库规定执行。

第二十七条 垒白度、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。

第三节 仓库标准仓单交割

第二十八条 晚籼稻期货交割预报时，应当按 30 元/吨向仓库交纳交割预报定金。

第二十九条 晚籼稻仓库开具的《入库通知单》有效期为 40 个日历日。

第三十条 晚籼稻入库时，仓库对入库商品进行重量验收。晚籼稻重量验收采取在仓库内整车过地磅方式进行。

第三十一条 晚籼稻入库质量检验由仓库负责。入库检验样品由仓库在卸货前抽取，检验结果不符合交割质量标准的不允许注册标准仓单。仓库可以全部或者部分委托指定质检机构进行检验，检验费用由仓库承担。

仓库应当在每批货物样品抽取结束之时起 24 小时内出具检验结

果，并及时通知标准仓单注册人。

标准仓单注册人对入库质量检验结果有异议的，可以向交易所提出复检申请。具体流程按照《郑州商品交易所标准仓单管理办法》“仓库商品入库复检”有关规定办理。

第三十二条 晚籼稻卫生检验按照国家有关标准和规定执行，检验费用由标准仓单注册人承担。

第三十三条 晚籼稻入库时，对于达不到交割质量标准的商品，经双方协商，仓库可以提供整理等服务。

第三十四条 晚籼稻重量验收及入库采样时，标准仓单注册人应当到场监督。仓库和标准仓单注册人应当对验收结果签章确认，并共同对入库商品的真实性负责；入库商品未经仓库、标准仓单注册人签章确认的，不得用于期货交割。

晚籼稻入库后，仓库应当对标准仓单注册人的名称、联系人及联系方式、商品数量、存放库房及垛位等事项登记造册，并由标准仓单注册人签字确认。

第三十五条 晚籼稻仓库标准仓单注销后，提货人应当在交易所开具《提货通知单》之日起 10 个工作日内，凭提货人身份证、提货人所在单位证明及《提货通知单》验证密码到仓库办理提货手续，确认商品质量、运输方式，并预交各项费用。

提货人提供运输工具的，自提货人凭《提货通知单》与仓库联系出库事宜、运输工具到达仓库之日起，仓库开始发货，并停止收取已装运货物的仓储费。

提货人委托仓库代办运输的，自提货人凭《提货通知单》与仓库联系确认出库事宜、指定运达地点并预交相关费用(包括铁路代办费、港杂费等)之日起，采用汽车、船舶运输的，仓库在 10 个日历日内发货；采用火车运输的，仓库在 20 个日历日内发货。仓库不能在规定时间内发出货物的，不得收取规定时间后产生的仓储费。

由于提货人变更发货方式或者发货时间、提货手续不全、费用未按时交纳、特殊要求等原因，致使商品装运推迟的，仓库发货时间不受前款规定限制。

第三十六条 晚籼稻出库重量验收由仓库和提货人共同实施，具体办法参照入库重量验收规定。

晚籼稻出库数量发生损耗造成短少的，仓库应当及时补足；不能及时补足的，仓库应当按照《提货通知单》开具日之前（含当日）晚籼稻期货最近交割月最高交割结算价核算短少商品价款，赔偿提货人。

第三十七条 晚籼稻出库时，提货人对商品质量有异议的，可以向交易所申请一次复检，并预交复检费用。质量异议应当在《提货通知单》开具之日起 10 个工作日内提出。具体流程按照《郑州商品交易所标准仓单管理办法》“仓库商品出库复检”有关规定办理。

第四节 厂库标准仓单交割

第三十八条 晚籼稻厂库允许注册标准仓单的最大数量由交易所确定，交易所可以根据情况予以调整。

晚籼稻厂库申请注册标准仓单前，按照交易所规定提供标准仓单注册担保。

第三十九条 晚籼稻厂库标准仓单注销后，提货人应当在交易所开具《提货通知单》之日起 10 个工作日内，凭提货人身份证件、提货人所在单位证明及《提货通知单》验证密码到厂库办理提货手续，确认商品质量、运输方式，并预交各项费用。

提货人办理提货手续时，应当就发货速度及最后完成出库时间与厂库协商一致，协商不成的，厂库应当按照交易所批准的日发货速度发货。

本细则所称厂库日发货速度，是指厂库在 24 小时内安排期货商品发货的最低数量。厂库日发货速度由交易所确定和调整。

第四十条 厂库应当在提货手续办妥之日起 3 个日历日内开始发货，提货人与厂库协商一致的除外。提货人可以自行到库提货或者委托厂库代为发运。

由于提货人变更发货方式或者发货时间、提货手续不全、未按时交纳费用及其他特殊要求等原因，致使发货推迟的，厂库发货时间不受前款规定限制。

第四十一条 厂库晚籼稻出库重量验收由提货人与厂库共同实施，以厂库检重为准，足量出库。

晚籼稻出库重量发生短少的，厂库应当及时补足。不能补足的，厂库应当按照《提货通知单》开具日之前（含该日）晚籼稻期货最近交割月最高交割结算价核算短少商品价款，赔偿提货人。

提货人在货物交收时应当到交收地点监发，未到场监发的，视为对货物重量没有异议。

第四十二条 厂库应当保证交割商品的质量符合交易所规定的交割标准，双方协商一致的除外。

晚籼稻出库时，厂库应当与提货人共同抽取样品，提货人对检验结果无异议的，厂库方予发货。货物实际质量指标与标准仓单标示质量指标不一致，但在交易所规定的质量差异允许范围内的，提货人应当接受，质量差异升贴水由厂库与提货人按照交易所规定的标准自行结算。

第四十三条 提货人或者厂库对晚籼稻重量、质量有异议的，由提货人和厂库协商解决；协商不成的，可以向交易所申请一次复检，并由申请方预交复检及相关费用。复检申请应当在晚籼稻出库前提出。晚籼稻复检对象为申请方提出质量异议的对应货物。具体流程按照《郑州商品交易所标准仓单管理办法》“厂库商品出库复检”有关规定办理。

第四十四条 厂库或者提货人因故不能按照约定计划发货或者提货的，双方应当及时协商并妥善调整发货速度或者发货计划，并且过错方应当支付滞纳金。滞纳金额 = $\Sigma [5 \text{ (元/吨}\cdot\text{天)} \times \text{延误天数} \times \text{应发(收)而未发(收)商品数量}]$ 。

因厂库原因在约定的最后发货日起 5 个日历日内仍不能完成所有商品发货的，提货人可以要求厂库终止发货并支付赔偿金。赔偿金额=晚籼稻期货最近交割月最高交割结算价×应发未发的商品数量×120%。

因天气原因及其他不可抗力因素导致无法按计划发货或者提货

的，厂库或者提货人不需支付滞纳金或者赔偿金。

厂库和提货人应当妥善保管商品发货计划、协商确认材料以及发货和提货单据等，作为纠纷解决的依据。

第四十五条 多名提货人同时提货的，厂库可以根据提货人预约时间及办理提货手续的先后顺序等因素合理安排发货。

第四十六条 厂库发生违约行为，且厂库未赔偿或者赔偿金额不足的，交易所可以动用厂库提供的担保对提货人进行赔偿。

第四十七条 厂库发货完毕后，交易所书面确认无质量、数量责任的，经厂库申请，交易所退还厂库提交的担保财产或者担保凭证。

第四章 风险管理

第四十八条 晚籼稻期货合约最低交易保证金标准为合约价值的5%。

晚籼稻期货合约交易保证金标准见下表：

交易时间段	交易保证金标准
自合约挂牌至交割月前一个月第15个日历日期间的交易日	合约价值的5%
自交割月前一个月第16个日历日至交割月前一个月最后一个日历日期间的交易日	合约价值的10%
交割月份	合约价值的20%

第四十九条 晚籼稻期货合约每日涨跌停板幅度为前一交易日结算价的±4%。

第五十条 晚籼稻期货合约限仓标准见下表：

交易时间段	非期货公司会员和客户的最大单边持仓量（手）
-------	-----------------------

自合约挂牌至交割月前一个月第15个日历日期间的交易日	20000
自交割月前一个月第16个日历日至交割月前一个月最后一个日历日期间的交易日	3000
交割月份	500 (自然人客户最大单边持仓量为0)

本条所称限仓是指交易所规定会员或者客户按单边计算的、可以持有某一期货合约投机持仓的最大数量。

第五十一条 根据《郑州商品交易所期货交易风险控制管理办法》等有关规定，交易所对晚籼稻期货合约交易保证金标准、涨跌停板幅度进行调整的，按照相关标准执行。

第五章 附 则

第五十二条 违反本细则规定的，交易所按照《郑州商品交易所违规处理办法》和其他业务规则的有关规定处理。

第五十三条 本细则未规定的，按照交易所相关业务规则的规定执行。

第五十四条 本细则解释权属于郑州商品交易所。

第五十五条 本细则自 2024 年 2 月 6 日起施行。