

附件 1

郑州商品交易所铁合金期货合约（草案）

一、硅铁期货合约

交易品种	硅铁
交易单位	5 吨/手
报价单位	元（人民币）/吨
最小变动价位	2 元/吨
每日价格波动限制	上一交易日结算价 $\pm 4\%$ 及《郑州商品交易所期货交易风险控制管理办法》相关规定
最低交易保证金	合约价值的 5%
合约交割月份	1-12 月
交易时间	每周一至周五（北京时间法定节假日除外） 上午 9:00-11:30 下午 1:30-3:00 最后交易日上午 9:00-11:30
最后交易日	合约交割月份的第 10 个交易日
最后交割日	合约交割月份的第 12 个交易日
交割品级	见《郑州商品交易所期货交割细则》
交割地点	交易所指定交割地点
交割方式	实物交割
交易代码	SF
上市交易所	郑州商品交易所

二、锰硅期货合约

交易品种	锰硅*
交易单位	5 吨/手
报价单位	元（人民币）/吨
最小变动价位	2 元/吨
每日价格波动限制	上一交易日结算价 \pm 4%及《郑州商品交易所期货交易风险控制管理办法》相关规定
最低交易保证金	合约价值的 5%
合约交割月份	1-12 月
交易时间	每周一至周五（北京时间法定节假日除外） 上午 9:00-11:30 下午 1:30-3:00 最后交易日上午 9:00-11:30
最后交易日	合约交割月份的第 10 个交易日
最后交割日	合约交割月份的第 12 个交易日
交割品级	见《郑州商品交易所期货交割细则》
交割地点	交易所指定交割地点
交割方式	实物交割
交易代码	SM
上市交易所	郑州商品交易所

*锰硅即为现货市场上通称之“硅锰”。

附件 2

郑州商品交易所期货交割细则（草案）

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 期货交割指期货合约到期时，按照交易所的规则和程序，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、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。

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。

交割计价点是指在车（船）板交割、采取送货制的厂库交割等方式下，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。

【说明】采取送货制的厂库仓单交付现货时与车（船）板交割类似，也需要一些地点用来计算买卖双方各自应承担费用。

第四条 各品种采用的交割方式如下：

强麦、早籼稻、白糖、棉花、菜油、PTA：仓库交割。

甲醇、菜粕、粳稻、硅铁、锰硅：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。

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。

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，水分减量由提货人承担； $12.5\% < \text{水分} \leq 13.5\%$ 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，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¹

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，不完善粒中霉变粒 $\leq 2.0\%$ ，300s \leq 降落数值 ≤ 550 s；内在品质指标稳定时间 ≥ 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 ≥ 6 分钟、湿面筋 $\geq 28\%$ 、拉伸面积（135min） $\geq 75\text{cm}^2$ 时的，贴水80元/吨；稳定时间 ≥ 12 分钟、湿面筋 $\geq 30\%$ 、拉伸面积（135min） $\geq 90\text{cm}^2$ 的，升水20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，水分减量由提货人承担； $12.5\% < \text{水分} \leq 13.5\%$ 的，水分每超0.5%，补量1.0%；不足0.5%的，不补量。

（三） $1.0\% < \text{杂质} \leq 1.5\%$ 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，不扣量（出库不补量）。

（四） $8.0\% < \text{不完善粒} \leq 12.0\%$ 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。

¹自 2013 年 7 月合约执行

第三节 棉花²

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。

² 自2013年11月合约执行

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》（SH/T 1612.1-2005）。

基准交割品：符合SH/T 1612.1-2005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³

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。

³ 自2013年7月合约执行

(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%, $34.5\% \leq \text{粗蛋白质} < 35.0\%$,贴水35元/吨; $34.0\% \leq \text{粗蛋白质} < 34.5\%$,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⁴

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%（仅适用于江西、湖南、湖北等主产区）。

⁴ 自 2013 年 7 月合约执行

(二)早籼稻出库时,水分<13.5%的,水分减量部分由提货人承担。水分>13.5%的,以13.5%为基准,水分每超0.1%,补量0.1%,由仓库承担(仅适用于江西、湖南、湖北等主产区)。

(三)早籼稻杂质超过1.0%但不超过1.5%的,扣量0.5%。超过1.5%但不超过2.0%的,扣量1.0%。

第三十六条 早籼稻生产年度为每年的8月1日至次年的7月31日(以下同)。

入库早籼稻的脂肪酸值不得超过以下规定:本生产年度产早籼稻脂肪酸值不得高于21mg/100g(干基),高于21mg/100g(干基)的,视为非本生产年度产早籼稻。非本生产年度产早籼稻脂肪酸值不得高于25mg/100g(干基)。

本生产年度产早籼稻入库时,黄粒米不得超过0.5%;非本生产年度产早籼稻入库时,黄粒米不得超过0.7%。出库早籼稻的黄粒米不得超过1.0%。

第三十七条 非本生产年度产早籼稻交割时贴水由交易所另行公告。

第十节 粳稻

第三十八条 交割单位:1000吨。

第三十九条 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≤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) $14.5\% < \text{水分} \leq 15.0\%$ 的, 升贴水为零。

(三) $1.0\% < \text{杂质} \leq 1.5\%$ 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%。

(四) $30\% < \text{垩白粒率} \leq 40\%$ 的, 贴水50元/吨; 垩白粒率 $> 40\%$ 的, 贴水100元/吨。

(五) $2.0\% < \text{谷外糙米} \leq 4.0\%$ 的, 升贴水为零(仅适用于黑龙江、吉林、辽宁三省)。

第四十条 粳稻入库时, 黄粒米不得高于 0.4%; 出库时, 黄粒米不得高于 0.6%。

每年 10 月 1 日起入库的粳稻, 脂肪酸值不得高于 19mg/100g (干基); 次年 4 月 1 日起入库的粳稻, 脂肪酸值不得高于 21mg/100g (干基)。出库时脂肪酸值不得高于 24mg/100g (干基)。

厂库仓单出库时, 黄粒米和脂肪酸值指标按对应期间的入库标准执行。

第四十一条 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。

第十一节 甲醇

第四十二条 交割单位: 50 吨。

第四十三条 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。

第十二节 玻璃

第四十四条 交割单位：20 吨。

第四十五条 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。

第十三节 动力煤

第四十六条 交割单位：5000 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。

第四十七条 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，且干燥基全硫≤1%，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，且干燥基全硫≤1%。其中，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。

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%)。

第十四节 硅铁

第四十八条 交割单位: 35 吨(净重)。

第四十九条 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、粒度为 10-50mm 的硅铁, 其中: $72.0\% \leq \text{硅含量} < 75.0\%$, 锰及铬含量不作要求。

【说明】 见“铁合金期货合约及设计说明”。

第五十条 硅铁交割品包装物采用装载能力不小于 1 吨的塑料编织袋, 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。

【说明】 根据铁合金现货贸易习惯, 吨袋包装, 包装上有简要信息, 且价格为含包装价格, 结算时按净重结算。

第十五节 锰硅

第五十一条 交割单位: 35 吨(净重)。

第五十二条 锰硅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 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 \leq 1.8%、磷含量 \leq 0.25%、硫 \leq 0.04%)、粒度为10-50mm的锰硅。

【说明】见“铁合金期货合约及设计说明”。

第五十三条 锰硅交割品包装物采用装载能力不小于1吨的塑料编织袋，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。

【说明】同第五十条说明。

第三章 交割基准价与升贴水

第五十四条 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、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）。

【说明】见“铁合金期货业务规则制定说明”。

早籼稻、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。

第五十五条 仓库、厂库、指定交割计价点及升贴水由交易所确定并公告。

第五十六条 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

第五十七条 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、标准仓单或车（船）板交割货物的卖方会员可在每个交易日下午 2 时 30 分之前，通过会员服务系统提出交割申请。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；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。

（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）。

第五十八条 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。闭市后，同一会员同一交易编码客户所持有的该交割月买卖持仓相对应部分由计算机自动平仓，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）。

第五十九条 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）最后交易日闭市后，同一会员同一交易编码客户所持有的该交割月买卖持仓相对应部分由计算机自动平仓，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）板交割的，卖方交易保证金不予释放。

第六十一条 交割关系一经确定，买卖双方不得擅自调整或者变更。

第六十二条 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。

第六十三条 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。

第六十四条 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，买方在规定时间内进行确认。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（普通）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。

第六十五条 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

第六十六条 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。

第六十七条 自通知日起（含该日）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》，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。

第六十八条 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。

第六十九条 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，收到基低位发热量 <4500 千卡/千克，或干燥基全硫 $>1\%$ 的，按卖方违约处理，双方协商一致的除外；正式质检报告显示收到基低位发热量 ≥ 4500 千卡/千克且干燥基全硫 $\leq 1\%$ ，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，买卖双方应须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。

第七十一条 动力煤车(船)板交割检验在装车(船)过程中进行，由买方通知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。买卖双方各自留存一份；质检机构留存两份，一份进行检验，一份复检备用。质检机构自采样结束之日（不含该日）起 3 个工作日内出具质检报告。质检机构采样、制样时，买卖双方应到场监督；未到场监督的，视为对采样、制样无异议。

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。买卖双方按照货物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和干燥基全硫，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。

第七十二条 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。

第七十三条 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。

第七十四条 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；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。

第七十五条 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），或卖方拟交割货物未按照约定或规定的时间在指定港口备妥，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=Σ [1（元/吨）×延误天数×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，守约方可以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。

第七十六条 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 ≥ 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。

4500 千卡/千克 \leq 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 4800- (交割结算价-90) /5000 \times (4800-实测发热量) $\times 4$ 。

收到基低位发热量 < 4500 千卡/千克，货款结算价=[(交割结算价-90) /5000 \times 4800- (交割结算价-90) /5000 \times (4800-实测发热量) $\times 4$] $\times 90\%$ 。

干燥基全硫 $> 1\%$ ，货款结算价=根据所交割动力煤实测发热量计算所得价格 $\times 90\%$ 。

收到基低位发热量 < 4500 千卡/千克且干燥基全硫 $> 1\%$ ，货款结算价=[(交割结算价-90) /5000 \times 4800- (交割结算价-90) /5000 \times (4800-实测发热量) $\times 4$] $\times 80\%$ 。

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。

第七十七条 在最后交货日之前交割完毕的，交易所根据买卖双方在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收的，可以延期交收，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收的，另一方可以申请终止交收。守约方通过会员服务系统提交《终止交收申请书》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

第七十八条 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）发票由双方会员转交、领取并协助核实。

菜粕开具增值税普通发票。

第七十九条 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、粳稻的违约金比例为 13%；白糖、PTA、甲醇、玻璃、动力煤、硅铁、锰硅的违约金比例为 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。

【说明】硅铁、锰硅属工业品，增值税税率为 17%，因此和其他工业品一样，未提供增值税发票的违约金比例定为 17%。

车（船）板交割的，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。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两个工作日内（含该日），对增值税专用发票进行确认。

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

第八十一条 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。

第八十二条 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。

第八十三条 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仓单过户。货款的划转参照本细则有关规定执行。

3. 增值税专用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。

第八十四条 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。

第八十五条 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

第八十六条 强麦、一号棉、白糖、早籼稻、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、菜粕和、甲醇、硅铁、锰硅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。硅铁、锰硅厂库仓单采取送货制，送货地点由厂库与买方协商确定，或由买方指定交易所公布的交割计价点。厂库把货物运至买方指定货位或交割计价点买方车板前的费用由厂库承担。

【说明】硅铁、锰硅的基准价为车板价。与此相对应，采用硅铁、锰硅卖方客户承担货物装到买方车板前的一切费用。

硅铁、锰硅现货贸易中实行送货制，生产企业负责把货物送至钢厂指定地点，为了和现货保持一致，故厂库仓单采取送货制。若采取提货制，则钢厂由于没有负责过长途运输环节而会有顾虑。送货时，买方根据需要可选择装到车板上或者送到指定货位。这样设计，尽可能贴近现货，能够最大程度的吸引产业客户进入期货市场，进一步为实体经济服务。

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。

第八十七条 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。

第八十八条 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、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。

第八十九条 普麦、强麦、早籼稻、粳稻无包装物。棉花、白糖、PTA、菜籽、菜粕、硅铁、锰硅包装物不另行计价。

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。

【说明】硅铁、锰硅的基准价为含包装的价格，因此包装物不另行计价。

第九十条 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

第九十一条 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的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。

第九十二条 普麦、菜籽、动力煤[含仓单和车（船）板]、粳稻、硅铁、锰硅交割违约的，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。

【说明】硅铁、锰硅和普麦、菜籽一样，违约发生时违约方支付 20%的违约金给守约方，终止交割，这样做的理由是：（1）20%的违约成本保持了对企图违约方的威慑，能减少故意违约。

（2）罚违约金终止交割的处理方式简单易行，有利于迅速处理违约事件，减少违约事件的不良影响。（3）有利于降低交割月份的保证金，提高交割月市场流动性并降低产业客户参与交割的成本。

第九十三条 计算一号棉、菜粕的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 30%的违约金和赔偿金。

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）=[$\text{应交标准仓单数量（张）} - \text{已交标准仓单数量（张）}$]×交割单位÷交易单位

（二）买方交割违约合约数量（手）= $\frac{\text{应交货款} - \text{已交货款}}{\text{（1-30\%）} \div \left(\text{交割结算价} + \text{包装物单价} \right) \div \text{交易单位}}$

计算普麦、菜籽、动力煤、一号棉、菜粕、粳稻、硅铁、锰硅之外品种的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%的违约金和赔偿金。

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）=[$\text{应交标准仓单数量（张）} - \text{已交标准仓单数量（张）}$]×交割单位÷交易单位

（二）买方交割违约合约数量（手）= $\frac{\text{应交货款} - \text{已交货款}}{\text{（1-20\%）} \div \left(\text{交割结算价} + \text{包装物单价} \right) \div \text{交易单位}}$

第九十四条 普麦、菜籽、动力煤、粳稻、硅铁、锰硅之外品种发生交割违约的，交易所于违约发生当日上午 9 时 30 分以前通知违约方和对应的守约方。

守约方应当在当日上午 10 时 30 分以前将终止交割或者继续交割的选择意向书面递交交易所。逾期未递交选择意向的，交易所按终止交割处理。

第九十五条 普麦、菜籽、动力煤、粳稻、硅铁、锰硅之外品种构成交割违约的,由违约方支付违约部分合约价值（按交割结算价计算）10%的违约金。违约金支付后，根据违约主体的不同另行处理。

第九十六条 普麦、菜籽、动力煤、粳稻、硅铁、锰硅之外品种卖方交割违约的,买方可作如下一项选择:

（一）终止交割:交易所退还买方货款;

（二）继续交割:交易所在认定卖方违约的下一交易日发布标准仓单征购公告，并在 7 个交易日内组织征购。征购成功，交易所支付给买方标准仓单；征购失败，卖方支付给买方违约部分（此处指征购失败部分）合约价值 10%的赔偿金，交易所退还买方交割货款后终止交割。卖方承担因征购产生的一切经济损失和费用。

第九十七条 普麦、菜籽、动力煤、粳稻、硅铁、锰硅之外品种买方违约的,卖方可作如下的一项选择:

（一）终止交割:交易所退还卖方标准仓单;

（二）继续交割:交易所在认定买方违约的下一交易日发布标准仓单竞卖公告，并在 7 个交易日内组织竞卖。竞卖成功，交易所支付给卖方交割货款；竞卖失败，买方支付给卖方违约部分（此处指竞卖失败部分）合约价值 10%的赔偿金，交易所退还卖方标准仓单后终止交割。买方承担因竞卖产生的一切经济损失和费用。

第九十八条 一号棉、菜粕征购价格不高于交割结算价的 120%，竞卖价格不低于交割结算价的 80%。

普麦、菜籽、动力煤、一号棉、菜粕、粳稻、硅铁、锰硅之外品种征购价格不高于交割结算价的110%,竞卖价格不低于交割结算价的90%。

第九十九条 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。

第一百〇一条 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

第一百〇二条 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。

第一百〇三条 本细则解释权属于郑州商品交易所。

第一百〇四条 本细则自 年 月 日起施行。

附件 3

郑州商品交易所标准仓单管理办法（草案）

第一章 总则

第一条 为保障郑州商品交易所（以下简称交易所）商品期货交割业务的正常进行，规范标准仓单的管理，根据《郑州商品交易所交易规则》，制定本办法。

第二条 标准仓单的注册、流通和注销等业务，按本办法执行。

第三条 交易所、会员、客户、指定商品交割仓库（以下简称仓库）、指定商品交割厂库（以下简称厂库）及指定质检机构（以下简称质检机构）办理与标准仓单有关的各项业务，应当遵守本办法。

第二章 标准仓单

第四条 标准仓单是指仓库或厂库按照交易所规定的程序提交仓单注册申请后，经交易所注册，可用于证明货主拥有实物或者可予提货的财产凭证。

根据申请注册的主体不同，标准仓单分为仓库标准仓单（以下简称仓库仓单）和厂库标准仓单（以下简称厂库仓单）两种。

第五条 交易所通过计算机系统办理标准仓单的注册、交割、转让、充抵保证金和注销等业务。

会员或客户使用标准仓单向商业银行等第三方提供担保的，须向交易所办理标准仓单质权登记手续。未经交易所办理质权登记的，不得约束其他会员或客户等第三人。

会员或客户在开通质权登记及质权行使通道的商业银行将标准仓单质押后，经交易所批准，可在该银行的质权登记及质权行使通道

下，建立不超过质押标准仓单数量的空头头寸。该头寸只能进行实物交割，不得平仓，但因交易所监管需要专项批准的除外。

在交易所开通标准仓单质权登记及质权行使通道的商业银行，出现会员或客户到期未归还仓单质押贷款时，可通过转让仓单或建立对应期货空头头寸以交割等方式处置质押仓单；增值税专用发票的流转按照《郑州商品交易所期货交割细则》相关规定处理。

第六条 仓库标准仓单的生成包括交割预报、入库验收、质量检验、仓库申请注册及交易所办理注册等环节。

厂库标准仓单的生成包括厂库申请注册及交易所办理注册等环节。

经交易所注册的标准仓单，方可适用于与期货相关的业务。

第七条 标准仓单根据流通性质不同，分为通用标准仓单和非通用标准仓单两种。

仓库或厂库向标准仓单持有人承担质量及数量责任。标准仓单流通转让的，其载明货物的权利及风险相应转移。

第八条 通用标准仓单是指标准仓单持有人按照交易所的规定和程序可以到仓单载明品种所在的交易所任一仓库或厂库选择提货的财产凭证。

适用通用标准仓单的品种包括小麦、白糖、PTA、菜油、菜粕、早籼稻、甲醇、玻璃。

通用标准仓单载明的内容包括：会员号、会员名称、客户交易编码、品种、标准仓单数量、冻结数量、充抵数量等。

第九条 非通用标准仓单是指仓单持有人按照交易所的规定和程序只能到仓单载明的仓库或厂库提取所对应货物的财产凭证。

适用非通用标准仓单的品种为棉花、菜籽、动力煤、粳稻、硅铁、锰硅。

非通用标准仓单载明的内容包括：会员号、会员名称、客户交易编码、品种、标准仓单数量、仓库或厂库、检验时间、标准仓单编号、冻结数量、充抵数量等。

【说明】见“铁合金期货业务规则制定说明”。

第三章 仓库仓单的交割预报

第十条 客户或者非期货公司会员向仓库发货前，应当由会员填写《交割预报单》，并以书面形式或者交易所认可的其他形式向仓库预报。

预报数量较大的，交易所可以要求货主提供拥有商品的相关证明。特殊情况下，交易所可以要求仓库优先批准有近期月份持仓的交割预报。

第十一条 自接到会员《交割预报单》之日起2个工作日内，仓库应当以书面形式或者交易所认可的其他形式回复会员能够接收的商品数量。自接到仓库同意入库的回复之日起2个工作日之内，会员应当向仓库缴纳30元/吨的交割预报定金。仓库在收到交割预报定金的当日（工作日），开具《入库通知单》。

对已存放在仓库的商品申请期货交割的，仍应提交交割预报，无须交付交割预报定金。

《入库通知单》自开具之日起生效。

第十二条 《入库通知单》有效期（公历日）分别为：

（一）仓单普通小麦（以下简称仓单普麦）、优质强筋小麦（以下简称强麦）、一号棉、菜籽、菜油、菜粕、早籼稻、粳稻和、甲醇、硅铁、锰硅为40天。

(二) 白糖每年 11 月 1 日至次年 4 月 30 日, 广东、广西及云南三省(区)等交易所认可的白糖主产区仓库为 15 天(公历日); 其他时间和其他地区仓库为 40 天。

(三) 精对苯二甲酸(以下统称 PTA) 为 15 天。

交易所可视情况, 调整《入库通知单》的有效期。

【说明】 见“铁合金期货业务规则制定说明”。

第十三条 《入库通知单》有效期内相对应数量的商品全部到库的, 自商品入库完毕之日起 2 个工作日内, 交割预报定金予以返还; 部分到库的, 按实际到货量返还; 未到库部分, 交割预报定金不予返还。

第十四条 交易所公告暂停仓库入库业务的, 自公告之日(含该日)下午闭市起, 该仓库发生的交割预报视为无效预报, 交易所不再受理相关商品的仓库仓单注册申请。

第十五条 货主应当按交易所有关规定向仓库交纳各项费用。

第十六条 办理完交割预报的货主发货前, 须将运输方式、车(船)号、数量、到货时间等通知仓库。

第四章 仓库仓单的商品入库

第十七条 交割商品入库时, 商品的重量、包装相关单证等的验收及扦(采)样由仓库按照本办法的规定实施, 货主应到场监督, 验收结果须经双方认可。仓库、货主应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、货主签章确认的, 不得用于期货交割。

棉花样品的扦取由承检机构实施, 仓库应当予以协助配合。仓库及货主有权对样品扦取进行监督。

第十八条 入库商品质量指标由质检机构检验的, 自接到检验结果之日起 1 个工作日内, 仓库应当对检验结果进行确认并通知客户。

第十九条 交易所认可的免检商品和适用非通用标准仓单的商品入库后，仓库应当对货主的名称、联系人及联系方式、商品数量、生产厂家、存放库房及垛位等事项登记造册，并由货主签字确认。

第二十条 入库商品质量检验结束后，检验单位将检验报告以数字认证方式上传至交易所仓单注册注销系统。由质检机构检验的，质检机构应当及时将检验报告寄送仓库或由仓库领取。货主或者仓库业务急需的，质检机构可先行告知检验结果。

第一节 小麦入库

第二十一条 仓单普麦、强麦重量验收应当在库内整车过地磅。强麦不同品种须分开储存，不得混存。

第二十二条 强麦入库质量检验由交易所组织实施。强麦降落数值、稳定时间、拉伸面积和湿面筋指标由质检机构检验；其他质量指标由交割仓库或质检机构检验。

仓单普麦入库质量检验由交割仓库组织实施，入库检验样品由交割仓库在卸车前抽取，检验结果不符合交割质量标准的不允许注册。入库过程中发现不符合交割质量标准的部分不允许注册。

需由质检机构检验的强麦质量指标，样品由交割仓库扦取，交易所、客户到场监督。客户未到场监督的，视为对扦样无异议。样品扦取后由交易所进行封样，并寄（送）质检机构。

质检机构作出的检验结论为强麦入库质量检验的最终结果，不予复检。

强麦样品的检验时间由交易所公告。

第二节 棉花入库

第二十三条 自新年度（每年九月一日）起，交易所开始接受新年度一号棉的报验申请。

第二十四条 棉花入库时，仓库按《入库通知单》、原验证书和码单接收棉花。

第二十五条 棉花重量和质量检验实行公证检验制度。按照棉花国家标准（GB1103-2007）和《期货交割棉公证检验实施办法（试行）》执行。

第二十六条 入库棉花为符合《中华人民共和国国家标准 棉花包装》（GB6975-2007）规定的 I 型号棉包（ 227 ± 10 公斤），且须附有检验证书及原码单。

第二十七条 一号棉入库过程中和仓单注册前发现有下列情况之一的，交割仓库应当拒绝转存为期货交割商品，并及时通知会员或者货主：

- （一）掺杂使假的；
- （二）不符合GB1103.1-2012组批规则的；
- （三）棉包出现严重污染、水渍，发现火烧、霉变等，或者有异味的以及包装不完整的；
- （四）未经检验，棉包标志不符合国家标准规定的；
- （五）崩包率大于5%的；
- （六）非本棉花年度生产的；
- （七）单包回潮率大于10%的；采用塑料套包法包装的，一批棉花中单包回潮率超过9%，或者按批计算的平均回潮率超过8.5%的；

(八) 经检验发现颜色级有51、32、13、23、33、14、24，长度有小于27毫米，长度整齐度有U5档，马克隆值有C级C1档，断裂比强度有S5档的棉花；

(九) 其他不符合交割规定的。

第三节 白糖入库

第二十八条 白糖包装应当符合《郑州商品交易所期货交割细则》规定。

第二十九条 白糖入库的，应当按以下要求提供单证：

(一) 国产白糖：《全国工业产品生产许可证》、《产品合格证》、生产厂家营业执照（复印件）等。

(二) 进口白糖：允许该批白糖在中国境内销售（贸易方式为“一般贸易”）的《中华人民共和国海关进口货物报关单》（复印件）；该批商品报关口岸当地的中华人民共和国出入境检验检疫局对该批商品出具的《卫生证书》；生产厂商或者该批商品出口商出具的《产品质量证明书》、《产地证明书》，并签署《进口白砂糖单证合法、真实、有效保证书》。

第三十条 重量验收：可采用过地磅同时抽包检斤方式，或者单独抽包检斤方式。

第三十一条 质量检验：一个垛位扦取一个样品，样品一式两份，封样后寄（送）质检机构。货主也可委托经国家质量技术监督部门认证的第三方扦样，仓库配合并监督扦样，由此产生的费用（不包括仓库配合扦样费）由货主承担。

第三十二条 自收到每批白糖样品起5个工作日内，质检机构应当出具检验结果并通知仓库。

第四节 PTA 入库

第三十三条 生产日期超过 90 天的境内生产的 PTA 和自境外发运之日起超过 60 天的进口 PTA，仓库不得接收入库。

境内生产的 PTA 申请入库的，应当向仓库提交本批 PTA 生产厂家出具的符合交割标准的《产品质量证明书》。《产品质量证明书》须载有生产厂家、生产日期、适用的质量标准和该批产品的质量检验结果等信息。

境外生产的 PTA 申请入库的，应当向仓库提交本批商品的船运证明、《中华人民共和国海关进口货物报关单》，《海关进口关税专用缴款书》、《海关代征增值税专用缴款书》，生产厂家出具的《产品质量证明书》、《产地证明书》等材料的复印件，并加盖申请入库单位公章。商品所有人应当对所提供的单证签署《进口 PTA 单证合法、真实、有效保证书》。

不同生产厂家生产的 PTA 应当分开预报。

第三十四条 重量验收：PTA 单包净重为 1 吨或者 1.1 吨。重量验收可采用过地磅同时抽包检斤或单独抽包检斤的方式进行。

第三十五条 PTA 质量检验按每 550 吨一个样品抽取；不足 550 吨的按 550 吨计。样品一式三份，双方封样后寄（送）质检机构两份。自收到每批样品之日起 5 个工作日内，质检机构应当出具检验结果并通知仓库。

免检交割品牌生产厂家直接申请入库的，入库 PTA 质量可以免检；货主向交易所和仓库提交指定生产厂家出具符合交易所要求的产品质量责任承诺书及相关材料的，入库 PTA 质量可以免检。

第五节 菜籽入库

第三十六条 菜籽重量验收采取在仓库内整车过地磅方式进行。

第三十七条 入库质量检验由仓库负责。

仓库可全部或部分委托质检机构进行检验，检验费用由仓库承担。

第三十八条 入库菜籽采用仓房内堆放方式储存。不同客户入库的菜籽不允许混存。

第三十九条 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。

每次抽取样品就库分为二份，每份 1 公斤。仓库任选一份用于检验；另一份由货主和仓库签字封样，由仓库妥善保存。

第四十条 货物入库时，达不到交割质量标准的商品，经双方协商，仓库可提供整理等服务。

第四十一条 自每批货物样品抽取结束时起，仓库应于 24 小时内做出检验结果，并及时通知货主。

第六节 菜油入库

第四十二条 菜油运输必须符合国家卫生标准规定。

第四十三条 入库菜油应当提供加盖生产厂家公章的《产品生产许可证》（复印件）和《食品卫生许可证》（复印件）以及随货同行的产品化验单。

产品化验单中须载明产品名称、产地（包括原产国）、压榨或者浸出、产品执行标准、等级、是否转基因产品及编号等。

第四十四条 采用汽车运输的，菜油重量验收以地磅计量为准；采用火车运输的以火车罐打尺或者储油罐打尺计量为准；采用船舶运输的，以过磅或者储油罐打尺计量为准。

经交易所批准，菜油重量验收可以使用质量技术监督部门认可的其他先进衡器计量。

第四十五条 菜油运达仓库时，质量检验样品由仓库在卸货前扦取。每次扦取的样品分为两份，每份不低于 1 公斤。仓库任选一份用于检验，另一份由货主和仓库签字封样，由仓库妥善保存。

入库菜油的质量检验和掺伪检验由仓库负责。仓库可全部或者部分委托经国家质量技术监督部门认证的质检机构进行检验，检验费用由仓库承担。

自每批商品样品扦取结束时起，仓库应当于 48 小时内提供检验结果，并及时通知货主。

第四十六条 对检验合格的菜油，仓库应当按商品到库先后安排储油罐，并于检验报告出具之日起 5 个工作日内入库完毕。

转基因菜油应当与非转基因菜油分罐储存。入库客户未在交割预报单中注明菜油是否转基因产品，导致转基因菜油和非转基因菜油混罐储存的，由此引起的法律责任由该客户承担。责任主体以入库时仓库保留的样品确定。

菜油储油罐必须符合国家卫生标准规定。

第四十七条 货主应当保证入库菜油符合国家卫生标准。混罐储存的菜油不符合国家卫生标准的，根据入库时仓库保留的样品确定责任主体。

第四十八条 入库过程中和标准仓单注册前发现有下列情况之一的，仓库应当拒绝转存为期货交割商品，并及时通知会员或者货主：

- （一）掺伪的菜油；
- （二）菜油运输工具不符合国家规定；
- （三）入库菜油不符合交易所其他交割规定的。

第七节 菜粕入库

第四十九条 菜粕重量验收采取在仓库内整车过地磅方式进行。

第五十条 入库质量检验由仓库负责。检验结果不符合交割质量标准的不允许注册。入库过程中发现不符合交割质量标准的部分不允许注册。

第五十一条 检验原则上以垛为单位进行抽样，对同一厂家生产的同一批次的商品，以不超过 200 吨为单位进行抽样。

每次抽取样品就库分为二份，每份 1 公斤。仓库任选一份用于检验；另一份由货主和仓库签字封样，由仓库妥善保存。

第五十二条 自每批货物样品抽取结束时起，仓库应于 24 小时内做出检验结果，并及时通知货主。

第八节 早籼稻、粳稻入库

第五十三条 货物重量验收采取在仓库内整车过地磅方式进行。

第五十四条 入库质量检验由仓库负责。

仓库可全部或部分委托质检机构进行检验，检验费用由仓库承担。

第五十五条 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。

第五十六条 货物入库时，达不到交割质量标准的商品，经双方协商，仓库可提供整理等服务。

第五十七条 自每批货物样品抽取结束时起，仓库应于 24 小时内做出检验结果，并及时通知货主。

第九节 甲醇入库

第五十八条 甲醇运输必须符合国家关于危险化学品运输的规定。

第五十九条 入库货物单证及货主危险化学品经营资质由仓库负责审验。

境内生产的甲醇申请入库的，应当向仓库提交本批甲醇生产厂家出具的符合交割标准的《产品质量证明书》。《产品质量证明书》须载有生产厂家、生产日期、适用的质量标准和该批产品的质量检验结果等信息。

境外生产的甲醇申请入库的，应当向仓库提交本批商品的船运证明、进口货物报关单、生产厂家出具的《产品质量证明书》等材料的复印件、海关放行单原件。商品所有人应当对所提供的单证签署《进口甲醇单证合法、真实、有效保证书》。

第六十条 重量验收：采用汽车运输的，以地磅计量为准，由仓库负责验重；采用火车、船舶运输的，以仓库储罐打尺计量为准。货主可以委托质检机构或者仓库验重，由质检机构验重时，仓库应予以配合，由此产生的费用由货主承担。

经交易所批准，甲醇重量验收可以使用国家质量技术监督部门认可的其他先进衡器计量。

第六十一条 质量验收：入库甲醇的采样、质检由质检机构负责，仓库应予协助，由此产生的费用（不含仓库配合费用）由货主承担。

已经入库的甲醇，货主能够提供质检机构出具的该货物符合期货交割标准的检验报告，经仓库认可，可以申请注册仓单。

对期货、现货混罐存储的甲醇，仓库必须确保整罐货物符合期货交割标准的规定，不符合规定的，不允许混罐存储或申请注册仓单。

第六十二条 自完成采样之日起3个工作日内，质检机构应当出具检验结果，并及时通知仓库。

第十节 硅铁入库

第六十三条 硅铁入库时，货主应当向仓库提交本批硅铁生产厂家出具的《质量证明书》。《质量证明书》须载有生产厂家、生产（出厂）日期、适用的质量标准和该批产品的质量检验结果等信息。

入库硅铁应包装完好，包装物结实耐用。

生产（出厂）日期超过30天的硅铁不允许入库。

第六十四条 重量验收采用过地磅方式进行。

第六十五条 质量验收：入库硅铁的采样、制样、质检以及粒度检测由质检机构负责，按有关国家标准执行，仓库应予协助，由此产生的费用（不含仓库配合费用）由货主承担。

入库硅铁综合粒度偏差不能高于10%。

第六十六条 自完成采样之日起7个工作日内，质检机构应当出具检验结果，并及时通知仓库。

第六十七条 硅铁包装因取样损坏的，由仓库按相应国家标准重新灌包，费用由客户承担。

【说明】(1)硅铁保质期相对较短，一般可保存半年到一年。从严控制，要求硅铁入库时生产（出厂）日期在 30 天之内，加上硅铁仓单 3 个月的有效期，硅铁出库时存储时间最长为 4 个月，可以保证硅铁不会因储存时间太长而发生质量问题。

(2)硅铁的重量、质量、粒度验收参考现货贸易惯例执行，硅铁的采样、制样、质检都有相应国家标准，质检机构进行硅铁检验，有法可依。

(3)综合粒度偏差等于过小粒度偏差加过大粒度偏差之和。过小粒度偏差是指过小粒度（低于基准品下限，即低于 10mm）重量占检验用试样总重量的比例，过大粒度偏差是指过大粒度（高于基准品上限，即高于 50mm）重量占检验用试样总重量的比例。规定综合粒度偏差是为了保证入库货物的粒度能基本上符合基准品粒度的要求。采用综合粒度偏差指标，以及关于指标的规定符合现货贸易的惯例。

(4)硅铁指标检验需要两天时间，但第三方检验抽样、制样环节也需要两三天时间，总时间比在厂检验长，因此规定质检机构完成采样 7 个工作日内出具结果。

(5)质检机构在抽样时需要破包，破包后不适合再次运输，因此必须重新灌包，根据现货惯例，相关费用由客户承担。

第十一节 锰硅入库

第六十八条 锰硅入库时，货主应当向仓库提交本批锰硅生产厂家出具的《质量证明书》。《质量证明书》须载有生产厂家、生产（出厂）日期、适用的质量标准和该批产品的质量检验结果等信息。

锰硅入库时应包装完好，包装物结实耐用。

第六十九条 重量验收采用过地磅方式进行。

第七十条 质量验收：入库锰硅的采样、制样、质检以及粒度检测由质检机构负责，按有关国家标准执行，仓库应予协助，由此产生的费用（不含仓库配合费用）由货主承担。

入库锰硅综合粒度偏差不能高于 10%。

第七十一条 自完成采样之日起 7 个工作日内，质检机构应当出具检验结果，并及时通知仓库。

第七十二条 锰硅包装因取样损坏的，由仓库按相应国家标准重新灌包，费用由客户承担。

【说明】（1）锰硅保质期较长，可存储两年以上，且现货市场上一般不会长期存储（占用资金成本），几乎不存在出厂两年的锰硅，因此锰硅入库未规定生产日期限制。（2）有关锰硅重质量检验、粒度偏差、重新灌包等的说明同硅铁。

第五章 标准仓单注册

第一节 仓库仓单注册

第七十三条 自出具或者接到质检机构的检验结果之日起 1 个工作日内，仓库对检验结果进行确认并通知货主。对于质量符合交割规定的货物，货主无异议的，自通知货主之日起 2 个工作日内，仓库应当向交易所申请注册仓库仓单。

每年的8月1日之前不得申报注册二级白糖仓单。

第七十四条 交易所可在自仓库提出仓单注册申请之日起 7 个工作日内予以注册。

第七十五条 自交割月最后交易日（白糖、菜油为第 5 个交易日）下午 3 时起，交易所不再受理仓库提出的用于当月交割的仓库仓单注册申请。该日下午 3 时以后的注册申请所形成的标准仓单可以参与当月标准仓单的征购及后续月份交割。

交易所规定的可予质量免检的商品用于期货交割的，最迟应当在合约最后交易日前一日申请注册。

第七十六条 3 月、7 月、11 月第 12 个交易日之后（含该日）注册的菜粕标准仓单，货物生产日期须分别为 3 月 1 日、7 月 1 日、11 月 1 日之后（含该日）。注销后，符合规定的菜粕可以重新注册。

第二节 厂库仓单注册

第七十七条 非期货公司会员或客户与厂库结清货款等费用后，厂库通过交易所仓单注册注销系统提交仓单注册申请。动力煤厂库仓单注册时，厂家应提交收到基低位发热量等货物信息，交易所以此信息作为仓单注册标准的依据和货款计算的参考。

第七十八条 厂库申请仓单注册时，必须提供交易所认可的银行履约保函、现金或交易所认可的其他支付保证方式。

厂库提交的保证金数额按照最近交割月合约前一交易日结算价计算。

第七十九条 厂库最迟应当在合约交割月最后交易日前三个交易日下午 3 时前提交仓单注册申请。厂库提交的支付保证方式符合规定的，交易所可在自厂库提出仓单注册申请之日起 3 个工作日予以注册。

第八十条 单个厂库允许注册仓单的最大数量，由交易所确定和调整。

第八十一条 当商品市值发生较大波动时,交易所可根据市场变化情况要求厂库调整银行履约保函、现金或交易所认可的其他支付保证方式的数额。

第六章 标准仓单有效期

第八十二条 各品种标准仓单有效期分别如下:

仓单普麦、强麦: 每年9月的最后一个工作日。

一号棉: N年生产的棉花注册的标准仓单,有效期至N+2年3月的最后一个工作日。

白糖: N制糖年度(每年的10月1日至次年的9月30日)生产的白糖所注册的标准仓单有效期为该制糖年度结束后当年11月份的最后一个工作日(含该日)。

菜籽: N年6月1日起接受菜籽标准仓单注册,仓单有效期至N年11月份最后一个工作日(含该日)。

菜粕: 每年3月、7月、11月第12个交易日(不含该日)之前注册的标准仓单,应在当月的第15个交易日(含该日)之前全部注销。

菜油: N年6月1日起注册的菜油标准仓单有效期至N+1年5月份最后一个工作日(含该日)。

PTA: 每年9月第12个交易日(不含该日)之前注册的PTA标准仓单,在该月第15个交易日(含该日)之前全部注销;该月第16个交易日(含该日)之后开始受理新仓单的注册申请。

早籼稻: N年8月1日起注册的标准仓单,有效期至N+1年7月份最后一个工作日(含该日)。

粳稻: N年10月1日起注册的标准仓单,有效期至N+1年9月份最后一个工作日(含该日)。

甲醇、玻璃：每年5月、11月第12个交易日（不含该日）之前注册的标准仓单，应在当月的第15个交易日（含该日）之前全部注销。

动力煤：每年5月、11月第7个交易日（不含该日）之前注册的标准仓单，应在当月的第10个交易日（含该日）之前全部注销。

硅铁、锰硅：每年2月、5月、8月、11月第12个交易日（不含该日）之前注册的标准仓单，应在当月的第15个交易日（含该日）之前全部注销。已经注销的锰硅仓库仓单，货物尚未出库且距离生产（出厂）日期不超过一年的，可重新申请免检注册。

【说明】见“铁合金期货业务规则制定说明”。

第八十三条 标准仓单到期日前未办理注销手续的，交易所可在到期日将其注销，由此造成的一切损失，由标准仓单持有人承担，交易所不保证全部交割商品质量符合规定标准。

第七章 标准仓单的流通

第八十四条 标准仓单的流通是指标准仓单的交割和转让。

处于冻结状态和充抵保证金状态的标准仓单不能流通。

客户的标准仓单的流通应当委托会员办理，以会员名义在交易所进行，流通结果由客户承担。

第八十五条 标准仓单交割按《郑州商品交易所期货交割细则》的有关规定办理。

第八十六条 标准仓单的转让是指会员自行协商买卖标准仓单的行为。交易所受理标准仓单转让的时间为每个工作日交易时间的下午2时30分之前。最后交易日，交易所不办理一号棉、普麦、菜籽、动力煤、粳稻标准仓单转让业务。

第八十七条 转让标准仓单应当符合以下规定：

(一) 客户的标准仓单转让须委托会员办理；

(二) 达成转让意向的买卖双方会员应当向交易所提交标准仓单转让申请；

(三) 交易所对标准仓单转让申请审核后，为买卖双方会员办理标准仓单过户和货款结算划转等手续；

(四) 标准仓单转让的货款划转及增值税专用发票的开具、传递参照《郑州商品交易所期货交割细则》执行；

(五) 标准仓单转让手续费标准由交易所公告。

第八章 标准仓单注销

第八十八条 标准仓单注销是指标准仓单持有人直接或者委托会员到交易所办理标准仓单提货手续的过程。

客户注销标准仓单应当通过会员向交易所提交标准仓单注销申请。

对于已经注销的 PTA 标准仓单，货物尚未出库但仍符合入库条件的，可重新申请注册。

第八十九条 动力煤标准仓单注销时，提货人应提前与厂库沟通所提货物质量、重量情况。双方协商一致的，按协商结果提货，涉及升贴水的，由双方自行结算；协商不一致的，提货人按厂库仓单注册时提供的货物信息提取货物，涉及升贴水的，由交易所在货物发运完毕后统一结算。

动力煤提货人和厂库协商不一致的，提货人在指定港口提货时的质量认定、重量溢短按照《郑州商品交易所期货交割细则》“车（船）板交割”相关规定处理，结算价格按最近的交割结算价计价。

动力煤提货人和厂库确认提货事项并提交交易所后，交易所交割部门开具《提货通知单》。

动力煤买卖双方协商在交易所公布的指定交割地点以外的其他地点交货的，相关事项按双方约定办理。

动力煤之外的其他品种标准仓单注销时，交易所结算部门办理仓单升贴水结算，交易所交割部门开具《提货通知单》。

客户办理提货手续前，会员或客户应及时编制《提货通知单》验证密码，《提货通知单》验证密码为提货必备要件。

第九十条 适用通用标准仓单的商品需要提货的，交易所根据会员申请及仓库或厂库的具体情况，确定《提货通知单》对应的商品。

第九十一条 自交易所开出《提货通知单》之日起 10 个工作日内，《提货通知单》持有人应当凭《提货通知单》验证密码、提货人身份证、提货人所在单位证明到仓库或厂库办理提货手续、确认商品质量、确定运输方式、预交各项费用。

玻璃《提货通知单》持有人可根据玻璃厂库公告信息选择相应的规格、品级等，不涉及升贴水的，厂库应予以满足；涉及升贴水的，由双方协商，自行结算。

《提货通知单》持有人在提货期内向交易所提出商品质量复检申请的，自交易所收到申请之日起，《提货通知单》持有人的提货期间停止计算，待复检结果通知《提货通知单》持有人之日起重新计算。

逾期未办理相关手续的，按现货提货单处理，仓库不再保证全部商品质量符合规定标准；厂库不再保证按期货规定承担日发货速度等责任，具体提货事宜由货主与厂库自行协商。

第九章 仓库交割商品出库

第九十二条 期货交割商品出库的重量检验由货主与仓库共同实施，具体办法参照入库规定。

第九十三条 货主提供运输工具的，自货主凭《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；货主委托仓库代办运输的，自客户凭《提货通知单》与仓库联系出库事宜、指定运达地点并预交各种费用（包括铁路代办费、港杂费等）之日起，仓库不能在规定时间内（汽车、船舶 10 日，火车 20 日）发出商品的，不得再收取其后的仓储费。

由于货主变更发货方式、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，不受前款限制。

第一节 小麦出库

第九十四条 仓单普麦、强麦出库时，数量发生损耗（水分除外）造成短少的，仓库按实际出库数量补足。不能补足的，交割仓库按《提货通知单》开具之日前（含当日）普麦、强麦期货最近交割月最高交割结算价核算短少商品价款，赔偿买方货主。

第九十五条 强麦出库时，客户与交割仓库发生质量争议的，由入库时或交易所指定的质检机构按入库时规定的检验法检验。复检结果确定的等级高于（包括等于）初检结果确定的等级，或复检结果在初检结果允许误差范围内（以初检结果为基准，湿面筋允许绝对误差为-1.5%，稳定时间允许相对误差为-15%，拉伸面积允许相对误差为-10%，降落数值允许相对误差-10%），以入库检验结果确定的等级为准，由此产生的化验费和差旅费等由提出争议者负担；复检结果在入库检验结果允许误差范围外，且低于初检结果确定的等级，以复检结果确定的等级为准，由此产生的一切费用和责任由交割仓库负担。

第二节 棉花出库

第九十六条 仓库应将与其所提棉花相对应的《公证检验证书》随货同行联一份交货主。货主可在商品发运前逐批核对棉花的产地、包装、批次和件数等项目，验收结果应当经货主、仓库双方认可。

第九十七条 因自然变异导致标准仓单颜色级与注册时相比出现下降的，仍可正常办理出库手续，客户不得拒绝接货。

在《公证检验证书》有效期内，因自然变异造成颜色级下降未超过一个类型的，或在《公证检验证书》有效期外，因自然变异造成颜色级下降未超过两个类型的，由货主承担。交割仓库承担变异超过前述规定部分的颜色级差价，差价的计算根据交易所公告的颜色级之间升贴水标准执行。

《公证检验证书》超过有效期的仓单注销时需要重新检验的，由提出重新检验方支付公检及相关费用。

第九十八条 出库过程中，发现棉花崩包的，仓库应当免费回包。

第三节 白糖出库

第九十九条 因自然变异导致白糖色值变化在规定范围内的，仍可正常出库，货主不能拒绝接货。

一级白糖的色值小于等于 190IU 的，由货主承担；大于 190IU 小于等于 240IU 的，色值每增加 10IU（不足 10IU 按 10IU 计），仓库给提货方每吨 10 元的补偿。白糖色值大于 240IU 时，仓库承担赔偿责任。

第一百条 白糖出库时，出现包装霉变、严重污染，潮包、流包、真结块、异味的，仓库应当承担赔偿责任。

第四节 PTA 出库

第一百〇一条 仓库正常保管情况下，PTA 水分指标变化不影响使用的，货主不得拒绝接收。

第一百〇二条 出库时按照先进先出的原则出库。

第五节 菜籽出库

第一百〇三条 菜籽出库时，数量发生损耗（水分除外）造成短少的，交割仓库按照实际出库数量补足。不能补足的，交割仓库按照《提货通知单》开具之日前（含当日）菜籽期货最近交割月最高交割结算价核算短少商品价款，赔偿买方货主。

第一百〇四条 菜籽出库时，含油量指标低于入库质量指标 0.5 个百分点以内的，视作合格。

第六节 菜油出库

第一百〇五条 出库数量发生损耗造成短少的，仓库应及时补足。不能及时补足的，仓库按《提货通知单》开具日（含当日）之前菜油期货最近交割月最高交割结算价核算短少商品价款，赔偿货主。

第七节 菜粕出库

第一百〇六条 交割仓库菜粕出库水分溢短数量由货主承担，非水分减量的货款按照《提货通知单》开具之日前（含当日）菜粕期货最近交割月最高交割结算价核算短少商品价款，由仓库赔偿买方货主。出库水分检验费用由仓库承担。

菜粕出库水分溢短数量的计算方法：商品水分溢短数量＝提货数量×（入库时的实际水分指标－提货时的实际水分指标）÷（1－提货时的实际水分指标）。

菜粕出库应同时符合入库时包装物件数计算的重量。

交割厂库菜粕应足量出库。

菜粕出库时，粗蛋白质低于入库质量指标 0.5 个百分点以内的，视作合格。

第八节 早籼稻、粳稻出库

第一百〇七条 出库时，水分溢短数量由货主承担；非水分减量部分，仓库应及时补足。不能及时补足的，仓库按《提货通知单》开具日之前（含当日）该品种期货最近交割月最高交割结算价核算短少商品价款，赔偿货主。

第一百〇八条 粳稻出库时，垩白粒率不高于入库检验结果所在等级 5 个百分点（含）的，视同合格。

第九节 甲醇出库

第一百〇九条 出库时甲醇不符合交割质量标准的，仓库承担赔偿责任。

第一百一十条 出库数量发生损耗造成短少的，仓库应及时补足。不能及时补足的，仓库按《提货通知单》开具日（含当日）之前甲醇期货最近交割月最高交割结算价核算短少商品价款，赔偿货主。

第十节 硅铁出库

第一百一十一条 硅铁出库时，综合粒度偏差不大于 12%的，视为合格，超过 12%的，超出部分仓库应及时补足。不能及时补足的，仓库按《提货通知单》开具日之前（含当日）硅铁期货最近交割月最高交割结算价核算价款，赔偿货主。

第一百一十二条 出库过程中，发现硅铁包装损坏，不适宜再次装卸及运输的，仓库应当免费重新灌包。

【说明】硅铁在存储期间，过大粒度偏差不会变化，不过由于存在粉化的可能性，过小粒度偏差可能增加，综合以上考虑，将硅铁出库的综合粒度偏差放宽到 12%，即允许存在较轻程度的粉化现象，能减轻仓库存储压力，同时，仓库仍要承担一定赔偿责任，是对仓库尽到保管义务，防止出现严重粉化现象的一种约束。

硅铁在存储过程中，如遇不当操作，可能损坏包装，不能保证硅铁的安全运输，因此规定仓库要负责重新灌包。

第十一节 锰硅出库

第一百一十三条 出库过程中，发现锰硅包装损坏，不适宜再次装卸及运输的，仓库应当免费重新灌包。

【说明】同上条相关说明。

第十章 厂库交割商品交收

第一百一十四条 厂库出库时的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。

第一百一十五条 硅铁、锰硅货主提货前，厂库应与货主协商确定交货地点，由厂库送货，费用由双方协商；协商不成的，货主有权选择交易所公布的交割计价点作为交货地点。选择有升贴水的交割计价点交货的，升贴水额由厂库与货主自行结算。

第一百一十六条 货主与厂库办妥提货手续之日起，3 个日历日内开始发货，货主与厂库自行协商的除外。货主可自行到库提货或委托厂库代为发运。

硅铁、锰硅品种，货主应在每批交割货物送达后 3 个日历日（不含送达日）内完成提货，逾期未提货产生的费用及质量等责任由货主承担。

【说明】根据交割细则第八章“交割费用”的规定，正常情况下，装到货主车板前的费用由厂库承担。若由于货主未能及时提货而产生的额外费用，根据公平原则，费用应由货主承担。

第一百一十七条 由于货主变更发货方式、发货时间、提货手续不全、费用未按时交纳、其他特殊要求等原因，致使发货推迟的，不受前款限制。

动力煤厂库仓单在港口提货时，按照《郑州商品交易所期货交割细则》“车（船）板交割”规定流程办理。

第一百一十八条 厂库交割商品重量验收按照以下规定执行：

玻璃出库重量按标准厚度折算。

动力煤交收时，重量溢短范围适用《郑州商品交易所期货交割细则》“车（船）板交割”相关规定。

硅铁、锰硅在交割计价点上交货，称重产生费用的，费用由厂库承担；在其他地点交货的，称重由厂库与提货人协商实施。

【说明】铁合金在交割计价点交货，需要委托服务机构验重，需要明确相关费用的承担者。交割细则中规定：货物装到车板前一切费用由卖方承担。如果卖方是厂库自己，验重费用由厂库承担，等于是由卖方承担，与交割细则中的规定相一致。如果卖方是第三方，那么该卖方在前期获得仓单时已经向厂库支付了验重的费用，当然在交货时应由厂库负责验重费用。所以，验重费用由厂库承担。

玻璃、动力煤、硅铁、锰硅之外的其他品种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。

玻璃每次提货(指一张提货单)的溢短不超过一个包装单位(架)，由买方决定，溢短部分由双方自行结算，结算价格参考最近交割月交割结算价。

玻璃、动力煤之外的其他品种出库数量发生短少的，厂库应及时补足。不能补足的，厂库按《提货通知单》开具日(含当日)之前该品种期货最近交割月最高交割结算价核算短少商品价款，赔偿货主。

提货人在货物交收时应到交收地点监发，未到场监发的，视为对货物重量没有异议。

第一百一十九条 厂库交割商品质量验收按照以下规定执行：

玻璃出库时厂库向货主提供《质量合格证书》。

硅铁、锰硅交货时，厂库向货主提供符合交割标准《产品质量证明书》。

动力煤交收时，质量检验适用《郑州商品交易所期货交割细则》“车(船)板交割”相关规定。

粳稻出库时，厂库应与货主共同抽取样品，货主对检验结果无异议的，厂库方予发货。货物实际质量指标与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，客户应当接受，质量差异升贴水由厂库与客户按照交易所规定的标准自行结算。

玻璃、动力煤、粳稻、硅铁、锰硅之外的其他品种出库时，厂库应在提货人监督下在货物装运到买方运输工具前进行抽样，经双方确认后共同封样。样品一式三份，一份由货主保存，两份由厂库保存，厂库应将样品保留至发货后 30 个日历日，作为发生质量争议时的处理依据。

厂库须保证期货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。

【说明】硅铁、锰硅在点对点的现货贸易中，一般不使用第三方检验，通常是生产厂在货物出厂时自己检验，出具《产品质量证明书》，消费企业在使用时再次进行检验，两次检验结果相差较大时才申请复检。为与现货保持一致，同时不额外增加买卖双方的交割成本，规定厂库交货时提供《产品质量证明书》即可，不需要检验，不过保留买方申请复检的权利。

第一百二十条 货主办理提货手续时，应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，厂库应按照交易所批准的日发货速度发货。

第一百二十一条 多个货主同时提货时，厂库可按货主预约时间及办理提货手续的先后顺序等合理安排发货。

第一百二十二条 厂库或货主因故不能按照约定的发货计划发货或提货的，双方应及时协商并妥善调整发货速度或发货计划，并且过错方应付滞纳金。动力煤滞纳金由买卖双方协商解决。动力煤之外的其他品种滞纳金=5 元/吨×按日发货计划应发未发或应提未提的商品数量×该批商品的滞留天数。

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，货主可要求厂库终止发货并支付赔偿金。

赔偿金额=该品种期货最近交割月最高交割结算价×按商品总量应发而未发的商品数量×120%。

当厂库发生违约行为时，首先由厂库向货主支付赔偿金。厂库未支付或支付数额不足的，交易所可动用厂库出具的银行履约保函、现金或交易所认可的其他支付保证方式予以清偿。

第一百二十三条 因天气原因及其他不可抗力因素导致无法发货或提货时，厂库和货主不需支付赔偿金。

厂库和货主应妥善保管商品发货计划书、协商确认书、发货和提货单据，作为解决纠纷的依据。

第十一章 入库和出库复检

第一节 仓库商品入库复检

第一百二十四条 货主或者交割仓库对入库检验结果（强麦除外）有异议的，应当自收到检验结果之日起 3 个工作日内向交易所书面提出复检申请，并预交复检费用。

复检仅限于复检申请方提出的有异议的项目。

未在规定时间内提出复检申请的，视为同意检验结果。

第一百二十五条 白糖、PTA 和甲醇复检机构为原质检机构，交易所可调换或增加质检人员。

交易所同意由交割仓库检验的仓单普麦、强麦质量指标，复检机构由交易所指定。

菜籽、菜油、菜粕、早籼稻、粳稻复检机构由货主和仓库协商确定，协商不成的，由交易所指定。

第一百二十六条 由交易所指定复检机构的品种，复检样品由复检机构重新扦(采)取，仓库应予以配合。复检机构应当自扦(采)样完毕次日起3个工作日内作出复检结果(如样品量较大，可适当延迟)，并将复检结果书面通知交易所，交易所通知异议方。

复检机构为原质检机构的品种，复检机构只对其保留的样品进行复检，不再重新扦(采)样。复检机构自收到交易所复检通知之日起4个工作日内，应当作出复检结果，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。

第一百二十七条 由交易所指定复检机构的品种，复检结果与仓库原检验结论一致的，由货主承担相关费用(检验费、抽样费、差旅费、交通费等。下同)；复检结果与仓库原检验结论不一致的，相关费用由仓库承担。

复检机构为原质检机构的品种，复检结果与原检验结论一致的，由复检申请方承担相关费用；复检结果与原检验结论不一致的，相关费用由质检机构承担。

第一百二十八条 一号棉入库复检按《期货交割棉公证检验实施办法(试行)》执行。

第二节 仓库商品出库复检

第一百二十九条 自《提货通知单》开具之日起10个工作日内，仓单持有人对商品质量有异议的，可向交易所申请一次复检，并预交复检费用。

未在规定时间内提出异议的，视为确认出库商品质量。

第一百三十条 复检仅限于复检申请方提出的有异议的项目。

由仓库检验的项目，参照入库复检进行；由质检机构检验的项目，由交易所指定的质检机构进行复检。

复检结果为解决争议的依据。

第一百三十一条 交易所不受理超出规定时间或者已经出库的交割商品的质量和数量复检，不承担由此产生的一切责任。

第一百三十二条 自收到书面异议之日起2个工作日内，交易所通知仓库。复检机构在仓库协助下重新扦（采）样，样品经三方共同认可后封样。复检结果由交易所通知会员与仓库。

复检结果符合交易所出库规定的，复检及相关费用由复检申请方承担。复检结果不符合出库规定的，复检及相关费用由过错方承担。

第一百三十三条 复检结果不符合出库规定的，在双方约定或者规定的出库时间内，仓库或者标准仓单转让人可以用符合出库规定的商品调换，提货方不得拒收。商品调换不得影响商品及时出库，调换增加的运输、检验等费用由仓库或者标准仓单转让人承担。调换后商品的出库按交割商品的有关规定执行。

第一百三十四条 仓库或者标准仓单转让人未能用符合出库规定的其他商品调换，仓库或者标准仓单转让人可以与客户（提货方）协商处理。

协商无法达成一致的，按以下规定执行：

（一）仓库或者标准仓单转让人须及时对不合格的交割商品加工处理以达到出库规定，并承担补偿责任。补偿金额按照该品种期货最近交割月最高交割结算价的3%计算。加工处理且补偿后，客户（提货方）不得拒绝接受商品。

（二）无法加工处理或者加工处理后仍不能达到出库规定的，仓库或者标准仓单转让人承担赔偿责任，赔偿金额按照该品种期货最近

交割月最高交割结算价的 120%计算，货物归仓库或标准仓单转让人所有。

第一百三十五条 一号棉复检按照棉花国家标准（GB1103-2007）和《期货交割棉公证检验实施办法（试行）》执行。

第三节 厂库商品出库复检

第一百三十六条 货主或厂库对交割商品重量、质量有异议的，首先与厂库协商解决。协商不成的，可向交易所申请一次复检，并预交复检及相关费用。

重量异议，应在货物出库前或交货时提出。

质量异议：玻璃、粳稻应在货物出库前提出；动力煤应在收到质检报告之日起 5 个工作日内提出；~~玻璃、动力煤、粳稻之外的~~其他品种应在货物出库或交货之日起 5 个工作日内提出。

未在规定时间内提出异议的，视为确认出库商品的重量或质量。

【说明】硅铁、锰硅厂库交割实行送货制，与提货制称重采用厂库设备不同，厂库也可能对重量有异议，因此第一款作相应修改。另外，送货制时，交货时间和货物出库时间不同，因此对第二款作相应修改。

第一百三十七条 动力煤复检项目适用《郑州商品交易所期货交割细则》“车（船）板交割”相关规定。动力煤之外的其他品种复检仅限于复检申请方提出的有异议的项目。

复检由质检机构进行。复检机构由交易所指定并公告。

甲醇、动力煤复检样品仅限于保留样品。

玻璃、粳稻复检对象为申请方提出质量异议的对应货物。

复检结果为解决争议的依据。

第一百三十八条 交易所不受理超出规定时间的交割商品的质量复检，不承担由此产生的一切责任。

复检结果符合交割规定的，复检及相关费用由复检申请方承担。

复检结果不符合交割规定的，复检及相关费用由厂库承担。由此造成的损失由厂库与货主协商处理，双方协商无法达成一致的，厂库应承担赔偿责任，赔偿金额=该品种期货最近交割月最高交割结算价×复检不符合交割规定的商品数量×120%，对应的货物归厂库所有。

第十二章 监督、争议和处理

第一百三十九条 交易所所有权对用于期货交割的商品进行抽查。

对期货交割商品抽查不合格的不予注册。

对已经注册成仓单的商品质量和数量抽查中发现质量不合格或者数量有差额的，责成仓库、厂库或仓单持有人采取限期提供足量、合格商品等补救措施，由此发生的一切费用和损失由仓库或者仓单持有人承担。出现违规行为的，交易所按规定对违规者进行处罚。

第一百四十条 标准仓单转让人与受让人（提货方）之间、客户与仓库或厂库及仓单质量免检承诺人之间产生交割纠纷的，双方可先行协商解决；协商无法达成一致意见的，应当在纠纷发生之日起5个工作日内以书面形式向交易所申请调解。调解不成的，依法向人民法院起诉或者依约向仲裁机构申请仲裁。

第一百四十一条 交割商品出库时，对交割商品的质量和数量发生争议的，交易所按本办法规定对责任归属进行确认，最终责任由责任方承担。

第一百四十二条 仓库、厂库或标准仓单转让人不能向客户（提货方）交付符合合约出库规定标准的商品，造成客户（提货方）损失的，

应当承担赔偿责任。仓库或厂库不能履行其债务时，交易所仅对交割商品的重量和质量承担相应补充赔偿责任。

第一百四十三条 厂库发货完毕，经交易所书面确认无数量、质量责任，经厂库申请，交易所退还现金或交易所认可的其他支付保证方式。

附 则

第一百四十四条 本办法解释权属于郑州商品交易所。

第一百四十五条 本办法自 年 月 日起施行。

附件 4

郑州商品交易所期货交易风险控制管理办法（草案）

第一章 总 则

第一条 为加强期货交易风险管理，维护期货交易当事人的合法权益，保证郑州商品交易所（以下简称交易所）期货交易的正常进行，根据《郑州商品交易所交易规则》，制定本办法。

第二条 期货交易风险管理实行保证金制度、涨跌停板制度、限仓制度、大户报告制度、强行平仓制度、风险警示制度。

第三条 交易所、会员和客户必须遵守本办法。

第二章 保证金制度

第四条 期货交易实行保证金制度。

各品种⁵期货合约的最低交易保证金标准见下表：

品 种	最低交易保证金标准
普麦、强麦、一号棉、菜油、早籼稻、菜籽、菜粕、动力煤、粳稻、硅铁、锰硅	5%
白糖、PTA、甲醇、玻璃	6%

【说明】见“铁合金期货业务规则制定说明”。

⁵ 各品种中，普通小麦简称普麦，优质强筋小麦简称强麦，一号棉花简称一号棉，精对苯二甲酸统称PTA，菜籽油简称菜油，油菜籽简称菜籽，菜籽粕简称菜粕。

第五条 期货合约的交易保证金标准按照该期货合约上市交易的“一般月份”(交割月前一个月份以前的月份)、“交割月前一个月份”、“交割月份”三个期间依次管理。

第六条 三个期间各品种期货合约的交易保证金标准见下表：

品 种	一般月份	交割月前一个月份			交割月份
		上旬	中旬	下旬	
普麦、强麦、菜油、早籼稻、粳稻、硅铁、锰硅	5%	5%	10%	15%	20%
白糖、PTA、甲醇、玻璃	6%	6%	10%	15%	20%
一号棉、菜籽、菜粕	5%	5%	15%	25%	30%
动力煤	5%	5%	5%	10%	20%

【说明】 见“铁合金期货业务规则制定说明”。

第七条 交易过程中，当日开仓按照该期货合约前一交易日结算价收取相应标准的交易保证金。当日结算时，该期货合约的所有持仓按照当日结算价收取相应标准的交易保证金。

第八条 某期货合约所处期间符合调整交易保证金要求的，自该期间首日的前一交易日闭市起，该期货合约的所有持仓按照新的交易保证金标准收取相应的交易保证金。

第九条 某期货合约按结算价计算的价格变化，连续四个交易日（即 D1、D2、D3、D4 交易日）累计涨(跌)幅(N)达到期货合约规定涨(跌)幅的 3 倍或者连续五个交易日（即 D1、D2、D3、D4、D5 交易日）累计涨(跌)幅(N)达到期货合约规定涨(跌)幅的 3.5 倍的，交易所有权提高交易保证金标准；提高交易保证金标准的幅度不高于期货合约当时适用的交易保证金标准的 3 倍。

N 的计算公式如下：

$$N = (P_t - P_0) / P_0 \times 100\% \quad t=4, 5$$

P_0 为D1交易日前一交易日结算价

P_t 为t交易日结算价，t=4, 5

第十条 遇法定节假日休市时间较长的，交易所可以在休市前调整期货合约交易保证金标准和涨跌停板幅度。

第十一条 某期货合约交易行情特殊致使市场风险明显增大时，交易所可根据某期货合约市场风险情况采取下列措施：

- (一) 限制出入金；
- (二) 限制开、平仓；
- (三) 调整该期货合约交易保证金标准；
- (四) 调整该期货合约涨跌停板幅度。

当某期货合约市场行情趋于平缓时，交易所可以将上述措施恢复到正常水平。

交易所调整交易保证金标准或者涨跌停板幅度的，应予公告，并报中国证监会备案。

第十二条 同时适用本办法规定的两种或者两种以上有关调整交易保证金标准的期货合约，其交易保证金标准按照最高值收取。

第十三条 会员未能按时足额交纳交易保证金的，交易所所有权对其相关期货合约持仓执行强行平仓，直至保证金能够维持其持仓水平为止。

第三章 涨跌停板制度

第十四条 期货交易实行价格涨跌停板制度，由交易所规定各上市期货合约的每日最大价格波动幅度。

第十五条 各品种期货合约每日涨跌停板幅度为前一交易日结算价的±4%。

第十六条 新期货合约上市当日，涨跌停板幅度为期货合约实际执行的涨跌停板幅度的 2 倍。

当日如有成交，下一交易日恢复到规定的涨跌停板幅度。

当日如无成交，下一交易日继续执行前一交易日涨跌停板幅度。

第十七条 某期货合约以涨跌停板价格成交的，成交撮合原则为平仓优先和时间优先。

第十八条 某期货合约在某一交易日收盘前 5 分钟内出现只有停板价位的买入(卖出)申报、没有停板价位的卖出(买入)申报,或者一有卖出(买入)申报就成交、但未打开停板价位的情况,称为涨(跌)停板单方无报价(以下简称单边市)。

第十九条 某期货合约在某一交易日(该交易日称为 D1 交易日,以下几个交易日分别称为 D2、D3、D4 交易日)出现单边市的, D1 交易日结算时和 D2 交易日该期货合约交易保证金标准在原交易保证金标准基础上提高 50%; D2 交易日该期货合约的涨跌停板幅度在原涨跌停板幅度基础上扩大 50%。

D2 交易日该期货合约未出现同方向单边市的,当日结算时交易保证金标准恢复到调整前水平; D3 交易日涨跌停板幅度恢复到调整前水平。D2 交易日出现同方向单边市的,当日结算时和 D3 交易日维持提高后的交易保证金标准不变, D3 交易日涨跌停板幅度维持提高后的涨跌停板幅度不变。

D3 交易日该期货合约未出现同方向单边市的,当日结算时交易保证金标准恢复到调整前水平; D4 交易日涨跌停板幅度恢复到调整前水平。D3 交易日该期货合约仍出现同方向单边市的(即连续三个交易日出现同方向单边市), D4 交易日该期货合约暂停交易一天。

第二十条 根据市场情况, D4 交易日交易所决定在 D4 交易日

或 D5 交易日对该期货合约选择采取相应措施。

在 D4 交易日强制减仓。

在 D5 交易日分别采取下列措施：

- （一）提高交易保证金标准；
- （二）调整涨跌停板幅度；
- （三）暂停开、平仓；
- （四）限制出金；
- （五）限期平仓；
- （六）其他风险控制措施。

第二十一条 强制减仓是指 D4 交易日结算时，交易所将 D3 交易日闭市时以涨跌停板价申报的未成交平仓报单，且该客户（包括非期货公司会员，下同）该期货合约单位持仓亏损大于或者等于 D3 交易日结算价一定比例（该期货合约规定的最低交易保证金标准）的所有持仓，以 D3 交易日涨跌停板价，与该期货合约盈利持仓按规定方式和方法自动撮合成交。

强制减仓前，同一客户在该期货合约的双向持仓首先自动对冲。强制减仓后，下一交易日该期货合约交易保证金标准和涨跌停板幅度按照调整前水平执行。强制减仓造成的经济损失由会员及其客户承担。

第二十二条 强制减仓的方法和程序：

- （一）申报数量的确定

D3 交易日收市后，已在计算机系统中以涨（跌）停板价申报但没有成交的，且该客户该期货合约的单位持仓亏损大于或者等于 D3 交易日结算价一定比例（该期货合约规定的最低交易保证金标准）的所有申报平仓数量的总和。因自动对冲客户双向持仓造成客户持仓少于平仓单所报数量时，系统自动将平仓数量进行

调整。客户不愿按上述方法平仓的，可在收市前撤单，不作为申报的平仓报单。

客户单位持仓盈亏的计算方法：

$$\text{客户该期货合约单位持仓盈亏} = \frac{\text{客户该期货合约持仓盈亏的总和(元)}}{\text{客户该期货合约的持仓量(手)}}$$

客户该期货合约持仓盈亏总和，是指客户该期货合约的持仓按其实际成交价与当日结算价之差计算的盈亏总和。

（二）持仓盈利客户平仓范围的确定

根据上述方法计算的客户单位持仓盈利的投机持仓（包括跨期套利持仓）以及客户单位持仓盈利大于或等于期货合约规定价幅 2 倍的保值持仓都列入平仓范围。

（三）平仓数量的分配原则及方法

1. 平仓数量的分配原则

（1）在平仓范围内按盈利的大小和投机与保值的不同分成四级，逐级进行分配。

首先分配给属平仓范围内单位持仓盈利大于或者等于期货合约规定价幅（以 D3 交易日结算价计算，下同）2 倍的投机持仓（以下简称盈利 2 倍的投机持仓）。

其次分配给单位持仓盈利大于或者等于期货合约规定价幅 1 倍的投机持仓（以下简称盈利 1 倍的投机持仓）。

再次分配给单位持仓盈利大于或者等于期货合约规定价幅 1 倍以下的投机持仓（以下简称盈利 1 倍以下的投机持仓）。

最后分配给单位持仓盈利大于或等于合约规定价幅 2 倍的保值持仓（以下简称盈利 2 倍的保值持仓）。

（2）以上各级分配比例均按申报平仓数量（剩余申报平仓数量）与各级可平仓的盈利持仓数量之比进行分配。

2. 平仓数量的分配方法及步骤

若盈利 2 倍的投机持仓数量大于或者等于申报平仓数量，根据申报平仓数量与盈利 2 倍的投机持仓数量的比例，将申报平仓数量向盈利 2 倍的投机客户等比例分配实际平仓数量。

盈利 2 倍的投机持仓数量小于申报平仓数量，则根据盈利 2 倍的投机持仓数量与申报平仓数量的比例，将盈利 2 倍的投机持仓数量向申报平仓客户分配实际平仓数量；再把剩余的申报平仓数量按上述的分配方法向盈利 1 倍的投机持仓分配；还有剩余的，再向盈利 1 倍以下的投机持仓分配；若还有剩余，再向盈利 2 倍的保值持仓分配；仍有剩余的，不再分配。具体方法与步骤见本办法附件。

分配平仓数量以“手”为单位，不足一手的按如下方法计算。首先对每个交易编码所分配到的平仓数量的整数部分进行分配，然后按小数部分由大到小的顺序“进位取整”进行分配。

第二十三条 采取上述措施后该期货合约风险仍未释放的，交易所宣布进入异常情况，并按有关规定采取风险控制措施。

第二十四条 新期货合约成交首日期货合约出现单边市的，该期货合约的涨跌停板幅度和交易保证金标准不受本章以上条款限制。

进入交割月前一个月中旬起（动力煤中旬除外），期货合约出现单边市的，该期货合约的交易保证金标准不受本章以上条款限制。

某期货合约在交割月的最后交易日出现第三个连续同方向单边市的，则当日闭市后，交易所根据市场情况，决定对该期货合约先执行强制减仓之后配对交割或者直接配对交割。

第四章 限仓制度

第二十五条 期货交易实行限仓制度。

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。

第二十六条 期货合约的限仓数量按照该期货合约上市交易的“一般月份”、“交割月前一个月份”、“交割月份”三个期间的不同，分别适用不同的限仓标准。

第二十七条 期货公司会员三个期间各品种期货合约限仓统一规定见下表：

品 种	某一期期货合约市场 单边持仓量 (N)	期货公司会员该合约 单边总持仓比例 (M)
普麦、强麦、菜油、早籼稻、 甲醇、菜籽、菜粕	$N \geq 10$ 万手	$M \leq 25\%$
	$N < 10$ 万手	不限仓
玻璃	$N \geq 20$ 万手	$M \leq 25\%$
	$N < 20$ 万手	不限仓
一号棉、白糖、PTA	$N \geq 30$ 万手	$M \leq 25\%$
	$N < 30$ 万手	不限仓
动力煤	$N \geq 100$ 万手	$M \leq 25\%$
	$N < 100$ 万手	不限仓
粳稻	$N \geq 50$ 万手	$M \leq 25\%$
	$N < 50$ 万手	不限仓

第二十八条 非期货公司会员各品种期货合约限仓规定见下表：

品 种	非期货公司会员最大单边持仓 (手)				
	一般月份	交割月前一个月份			交割月份
		上旬	中旬	下旬	
普麦	2000	2000	1000	600	200
强麦	2500	2500	1200	600	300
一号棉	30000	30000	7500	3800	800

白糖	30000	30000	10000	5000	1000
PTA	30000	30000	10000	8000	3000
菜油	10000	10000	3000	2000	1000
早籼稻	7500	7500	1600	800	400
甲醇	1000	1000	500	300	100
玻璃	5000	5000	1200	900	300
菜籽	10000	10000	2000	1000	500
菜粕	10000	10000	4000	2000	800
动力煤	60000	60000	30000	10000	2000
粳稻	20000	20000	8000	3000	500
硅铁	15000	15000	10000	5000	1000
锰硅	30000	30000	20000	10000	2000

【说明】见“铁合金期货业务规则制定说明”。

第二十九条 客户各品种期货合约限仓规定见下表：

品 种	客户最大单边持仓（手）				
	一般月份	交割月前一个月份			交割月份 (自然人客户限 仓为0)
		上旬	中旬	下旬	
普麦	2000	2000	1000	600	200
强麦	2500	2500	1200	600	300
一号 棉	15000	15000	4500	2000	400
白糖	15000	15000	6000	3000	500
PTA	15000	15000	8000	3000	3000
菜油	10000	10000	3000	2000	1000
早籼 稻	7500	7500	1600	800	400
甲醇	1000	1000	500	300	100

玻璃	5000	5000	1200	900	300
菜籽	10000	10000	2000	1000	500
菜粕	10000	10000	4000	2000	800
动力煤	60000	60000	30000	10000	2000
粳稻	20000	20000	8000	3000	500
硅铁	15000	15000	10000	5000	1000
锰硅	30000	30000	20000	10000	2000

【说明】见“铁合金期货业务规则制定说明”。

不得交割的客户具体见《郑州商品交易所期货交割细则》相关规定。

第三十条 交割月前一个月的最后一个交易日收盘前，会员及客户应当将其期货合约持仓调整为最小交割单位的整倍数；自进入交割月起，会员及客户的持仓应当是最小交割单位的整倍数。

第三十一条 交易所可根据期货公司会员的净资产和经营情况调整其持仓限额。

持仓限额=基数×(1+信用系数+业务系数)

基数：是期货公司会员持仓限额的最低水平，由交易所规定。

信用系数：以期货公司会员净资产 1 亿元为底数（此时信用系数为 0），在此基础上，每增加 1000 万元净资产，则信用系数相应增加 0.1，信用系数最大值不得超过 0.5；

业务系数：期货公司会员业务系数以年交易金额 800 亿元、客户数 1000 个为底数（此时业务系数为 0），在此基础上，期货公司会员年交易金额及客户数达到规定水平，则相应提高其业务系数。业务系数的最大值不得超过 0.5。具体见下表：

档次	限仓增额条件（须同时具备）		限仓增额系数
	年交易金额（C1，亿元）	投资者总数（C2，个）	

1	$C1 \leq 800$	$C2 \leq 1000$	0
2	$800 < C1 \leq 1000$	$1000 < C2 \leq 1200$	0.10
3	$1000 < C1 \leq 1200$	$1200 < C2 \leq 1400$	0.20
4	$1200 < C1 \leq 1400$	$1400 < C2 \leq 1600$	0.30
5	$1400 < C1 \leq 1600$	$1600 < C2 \leq 1800$	0.40
6	$C1 > 1600$	$C2 > 1800$	0.50

第三十二条 期货公司会员的持仓限额，由交易所每一年核定一次。

期货公司会员须在当年4月15日前向交易所提供上一年度期末净资产金额证明文件（会计师事务所审计报告）。交易所统计上年1月1日至12月31日期货公司会员的交易量，核定持仓限额后于当年4月20日前通知期货公司会员，并予公布；该持仓限额适用于其当年4月21日起至次年4月20日止期间（含起、止日）的各品种期货合约的交易。

第三十三条 到期未提供证明文件、统计材料或所提供证明文件、统计材料无效的，则均以基数水平论。

第三十四条 交易所调整持仓限额报中国证监会备案后实施。

第三十五条 期货公司会员名下全部客户所有持仓的合计数（多头部位、空头部位分别计算，下同），不得超出该会员的限仓数额。

第三十六条 同一客户在不同期货公司会员处开有多个交易编码，各交易编码上所有持仓的合计数，不得超出一个客户的限仓数额。

第三十七条 会员或者客户的持仓数量不得超过交易所规定的持仓限额。

非期货公司会员或客户超过持仓限额的，交易所按有关规定实行强行平仓。期货公司会员达到或超过持仓限额的，不得同方向开新仓。

第五章 大户报告制度

第三十八条 期货交易实行大户报告制度。

会员或者客户持有某期货合约数量达到交易所对其规定的持仓限量80%以上（含本数）或者交易所要求报告的，应当向交易所报告其资金、持仓等情况。根据市场风险状况，交易所可调整持仓报告水平。

第三十九条 交易过程中，会员或者客户符合大户报告条件的，应当主动于下一交易日向交易所报告。会员或者客户履行首次报告义务后，需再次报告或者补充报告的，交易所通知有关会员。

第四十条 符合大户报告条件的期货公司会员应当向交易所提供下列材料：

- （一）《郑州商品交易所大户报告表》；
- （二）持仓前十名客户的开户资料及当日结算单据；
- （三）交易所要求提供的其他材料。

第四十一条 符合大户报告条件的非期货公司会员或客户应当向交易所提供下列材料：

- （一）《郑州商品交易所大户报告表》；
- （二）开户资料及当日结算单据；
- （三）交易所要求提供的其他材料。

第四十二条 符合大户报告条件的客户，应当按单位或者自然人属性类别，分别提供营业执照副本（复印件）或者自然人身份证（复印件）。

期货公司会员应当对客户所提供的有关材料进行初审并保证报告材料的真实性。

第六章 强行平仓制度

第四十三条 期货交易实行强行平仓制度。

强行平仓是指当会员、客户违反交易所相关业务规定时，交易所对其违规持有的相关期货合约持仓予以平仓的强制措施。

第四十四条 会员或者客户有下列情形之一的，交易所所有权进行强行平仓：

- （一）结算准备金余额小于零并未能在规定时间内补足的；
- （二）持仓量超出其限仓规定的（期货公司会员达到或超过持仓限额的，按照本办法第四章相关规定执行）；
- （三）进入交割月份的自然人持仓；
- （四）因违规受到交易所强行平仓处罚的；
- （五）根据交易所的紧急措施应予强行平仓的；
- （六）其他应予强行平仓的。

第四十五条 强行平仓的原则和程序：

强行平仓前先由会员自行平仓，除交易所特别规定的时限外，一律为开市后至 10 时 15 分之前。会员未在规定时限内平仓完毕的，交易所强制执行。

由会员自行平仓的，属前条第（一）、（二）、（三）项情形的，由会员自行确定，平仓结果符合交易所规定即可；属前条第（四）、（五）、（六）项情形的，由交易所确定。

由交易所强行平仓的，按以下程序实施：

- （一）交易所按照会员提供的平仓名单进行强行平仓。
- （二）会员没有提供平仓名单，属前条第（一）项的，按照上一交易日闭市后期货合约总持仓量由大到小顺序，先选择持仓量大的期货合约作为强行平仓的期货合约，再按照该会员客户该期货合约的净持仓亏损由大到小确定。多个会员均需要强行平仓的，按追加保证金

由大到小的顺序，先强平需要追加保证金大的会员。

（三）属前条第（二）项的，按照超仓量由大到小的顺序，对非期货公司会员或客户进行强行平仓。

（四）会员没有提供平仓名单，属前条第（三）项的，按照上一交易日闭市后自然人期货合约持仓由大到小顺序进行强行平仓。

（五）会员没有提供平仓名单，属前条第（四）、（五）、（六）项的，强行平仓头寸由交易所根据涉及的会员和客户具体情况确定。

（六）会员同时满足属前条第（一）、（二）、（三）项情况，交易所先按第（二）、（三）项情况确定强行平仓头寸，再按第（一）项情况确定强行平仓头寸。

由于市场原因无法满足上述原则和程序的，交易所所有权择机强行平仓。

第四十六条 交易所实施强行平仓，应当通知会员，会员应当通知客户。

属第四十四条第（一）、（二）项情况的，以交易所提供的结算结果为通知依据；属第四十四条第（三）、（四）、（五）、（六）项情况的，交易所向有关会员下达《强行平仓通知书》。

第四十七条 会员未在规定时间内自行平仓完毕的，剩余部分由交易所按第四十五条所确定的原则以市场价对会员直接执行强行平仓。

交易所强行平仓完毕后，应当将强行平仓结果随当日成交记录向会员发送，并将强行平仓记录予以存档。

强行平仓的价格通过市场交易形成。

第四十八条 由于涨跌停板或者其他市场原因无法在当日完成全部强行平仓的，剩余持仓可以顺延至下一交易日继续执行强行平仓，直至平仓完毕。

第四十九条 由于涨跌停板或者其他市场原因有关持仓的强行平仓只能延时完成的，因此发生的亏损仍由会员或者客户承担；未能完成平仓的，该持仓持有者须继续对此承担持仓责任或者交割义务。

第五十条 除第四十四条第（四）项外，强行平仓产生的盈利或者亏损均归持仓人。持仓人是客户的，强行平仓发生的亏损，客户所在会员先行承担后，自行向该客户追偿。

本办法第四十四条第（四）项实施的强行平仓，亏损由持仓人承担，盈利记入交易所营业外收入。

第七章 风险警示制度

第五十一条 期货交易实行风险警示制度。

交易所认为必要时，可以分别或者同时采取要求报告情况、谈话提醒、发布风险提示函等措施，以警示和化解风险。

第五十二条 出现下列情形之一的，交易所可以对指定的会员高级管理人员或者客户谈话提醒风险，或者要求会员或者客户报告情况：

- （一）会员或者客户交易异常；
- （二）会员或者客户持仓异常；
- （三）会员资金异常；
- （四）会员或者客户涉嫌违规、违约；
- （五）交易所接到涉及会员或者客户的投诉；
- （六）会员涉及执法调查；
- （七）交易所认定的其他情况。

交易所通过电话提醒的，应当保留电话录音；通过当面谈话的，应当保存谈话记录。

交易所要求会员或者客户报告情况的，报告方式和报告内容参照大户报告制度执行。

第五十三条 会员或者客户有违规嫌疑、交易头寸有较大风险的，交易所可以对会员或者客户发出书面的风险提示函。

第五十四条 发生下列情形之一的，交易所可以向全体或者部分会员和客户发出风险提示函：

- （一）期货价格出现异常；
- （二）期货价格和现货价格出现较大差距；
- （三）国内期货价格和国际市场价格出现较大差距；
- （四）交易所认定的其他异常情况。

附 则

第五十五条 违反本办法规定的，交易所按《郑州商品交易所违规处理办法》有关规定处理。

第五十六条 本办法解释权属郑州商品交易所。

第五十七条 本办法自 年 月 日起施行。

附件：平仓数量的分配方法及步骤

步骤	分配条件	分配数	分配比例	分配对象	结果
1	盈利 2 倍的投机持仓数量 \geq 申报平仓数量	申报平仓数量	申报平仓数量 \div 盈利 2 倍的投机持仓数量	盈利 2 倍的投机客户	分配完毕
2	盈利 2 倍的投机持仓数量 $<$ 申报平仓数量	盈利 2 倍的投机持仓数量	盈利 2 倍的投机持仓数量 \div 申报平仓数量	申报平仓客户	有剩余再按步骤 3, 4 分配
3	盈利 1 倍的投机持仓数量 \geq 剩余申报平仓数量 1	剩余申报平仓数量 1	剩余申报平仓数量 1 \div 盈利 1 倍的投机持仓数量	盈利 1 倍的投机客户	分配完毕
4	盈利 1 倍的投机持仓数量 $<$ 剩余申报平仓数量 1	盈利 1 倍的投机持仓数量	盈利 1 倍的投机持仓数量 \div 剩余申报平仓数量 1	剩余申报平仓客户	有剩余再按步骤 5, 6 分配
5	盈利 1 倍以下的投机持仓数量 \geq 剩余申报平仓数量 2	剩余申报平仓数量 2	剩余申报平仓数量 2 \div 盈利 1 倍以下的投机持仓数量	盈利 1 倍以下的投机客户	分配完毕
6	盈利 1 倍以下的投机持仓数量 $<$ 剩余申报平仓数量 2	盈利 1 倍以下的投机持仓数量	盈利 1 倍以下的投机持仓数量 \div 剩余申报平仓数量 2	剩余申报平仓客户	有剩余再按步骤 7, 8 分配
7	盈利 2 倍的保值持仓数量 \geq 剩余申报平仓数量 3	剩余申报平仓数量 3	剩余申报平仓数量 3 \div 盈利 2 倍的保值持仓数量	盈利 2 倍的保值客户	分配完毕
8	盈利 2 倍的保值持仓数量 $<$ 剩余申报平仓数量 3	盈利 2 倍的保值持仓数量	盈利 2 倍的保值持仓数量 \div 剩余申报平仓数量 3	剩余申报平仓客户	有剩余不再分配

- 注：1. 剩余申报平仓数量 1=申报平仓数量-盈利 2 倍的投机持仓数量；
 2. 剩余申报平仓数量 2=剩余申报平仓数量 1-盈利 1 倍的投机持仓数量；
 3. 剩余申报平仓数量 3=剩余申报平仓数量 2-盈利 1 倍以下的投机持仓数量；
 4. 投机持仓数量和保值持仓数量是指在平仓范围内盈利客户的持仓数量。