

签发人：张凡

关于公布有关期货业务细则的通知

郑商发[2012]151号

各会员单位：

《郑州商品交易所期货结算细则》、《郑州商品交易所标准仓单管理办法》和《郑州商品交易所违规处理办法》修订案已于2012年8月14日经郑州商品交易所第五届理事会审议通过。现予公布施行（详细内容见交易所网站）。

特此通知。

- 附件：
1. 《郑州商品交易所期货结算细则》
 2. 《郑州商品交易所期货结算细则》（修订案）
 3. 《郑州商品交易所标准仓单管理办法》
 4. 《郑州商品交易所标准仓单管理办法》修改条文
 5. 《郑州商品交易所违规处理办法》
 6. 《郑州商品交易所违规处理办法》（修订案）

二〇一二年九月三日

附件 1:

郑州商品交易所期货结算细则

(郑州商品交易所第五届理事会：2008 年 1 月 7 日审议通过，自 2008 年 1 月 15 日起施行；2009 年 3 月 28 日修订，自 2009 年 4 月 20 日起施行；2012 年 8 月 14 日修订，自 2012 年 9 月 3 日起施行)

第一章 总 则

第一条 为规范郑州商品交易所(以下简称交易所)期货交易的结算行为，保护期货交易当事人的合法权益和社会公众利益，防范和化解期货市场风险，根据《郑州商品交易所交易规则》，制定本细则。

第二条 结算是指根据交易结果和交易所有关规定对会员保证金、盈亏、手续费、交割货款及其他有关款项进行计算、划拨的业务活动。

第三条 交易所的期货业务结算实行保证金制度、当日无负债结算制度和风险准备金制度等。

第四条 交易所实行分级结算制度。交易所对会员进行结算，期货公司会员对客户进行结算。

第五条 交易所的期货结算业务按本细则进行。交易所、会员、客户和期货保证金存管银行（以下简称存管银行）必须遵守本细则。

第二章 结算机构

第六条 结算机构包括交易所和会员的结算部门。

第七条 交易所结算部门负责期货交易、交割的统一结算，保证金管理，风险准备金管理以及结算风险的防范。

所有在交易所交易系统中成交的合约必须通过结算部门进行统一结算。

交易所依据有关规章制度有权检查会员的结算资料、财务报表及相关的凭证和账册。

第八条 会员须设立结算部门。期货公司会员结算部门负责会员与交易所、会员与客户之间的结算工作；非期货公司会员结算部门负责会员与交易所之间的结算工作。

会员结算部门应当妥善保管结算资料、财务报表及相关凭证、账册，以备查询和核实。

第三章 存管银行

第九条 存管银行由交易所指定，协助交易所办理期货交易结算业务。经交易所同意成为存管银行后，存管银行须与交易所签订相应协议，明确双方的权利和义务，以规范相关业务行为。

交易所对存管银行的期货结算业务进行监督。

第十条 存管银行的权利：

- （一）开设交易所专用结算账户和会员专用资金账户；
- （二）吸收交易所和会员的存款；
- （三）了解会员在交易所的资信情况。

第十一条 存管银行的义务：

（一）向交易所提供会员专用资金账户的资金情况，根据交易所要求对会员保证金实施必要的监管措施；

（二）根据交易所提供的票据优先划转会员的资金；

（三）协助交易所核查会员资金的来源和去向；

- (四) 向交易所及时通报会员标准仓单的质押情况;
- (五) 向交易所及时通报会员在资金结算方面的不良行为和风险;
- (六) 交易所出现重大风险时, 必须协助交易所化解风险;
- (七) 保守交易所和会员的商业秘密;
- (八) 接受交易所对其期货业务的监督。

第十二条 结算机构及其工作人员应当保守交易所和会员的商业秘密。

第四章 保证金

第一节 保证金账户开立与管理

第十三条 交易所在存管银行开设专用结算账户, 用于存放会员的保证金及相关款项。

第十四条 会员须在存管银行开设专用资金账户, 用于存放保证金及相关款项。

第十五条 交易所与会员之间期货业务资金的往来通过交易所专用结算账户、会员保证金账户和会员专用资金账户办理。

第十六条 交易所对会员存入交易所专用结算账户的保证金实行分账管理, 为每一会员设立明细账户, 按日序时登记核算每一会员出入金、盈亏、保证金、手续费等。

第十七条 期货公司会员对客户存入会员保证金账户和专用资金账户的保证金实行分账管理, 为每一客户设立明细账户, 按日序时登记核算每一客户出入金、盈亏、保证金、手续费等。

第十八条 会员开设专用资金账户时，须经交易所审核同意，并提交《印鉴授权书》等相关资料；会员使用资金管理电子化系统，须与交易所签订《郑州商品交易所资金管理电子化会员服务协议》。

交易所所有权在不通知会员的情况下，通过存管银行从会员的专用资金账户中收取各项应收款项，并且有权随时查询该账户的资金情况。

第十九条 《印鉴授权书》中被授权的公章、财务章、法定代表人章或者被授权人章及《郑州商品交易所资金管理电子化会员服务协议》确定的电子签章均为会员的有效印鉴，会员应当对使用以上印鉴所产生的一切后果承担责任。

第二十条 会员更换专用资金账户的，须经交易所批准。

第二十一条 会员更名或者资格转让，须重新向交易所提交《印鉴授权书》，并办理相关专用资金账户的变更手续。

第二节 保证金管理

第二十二条 交易所实行保证金制度。保证金分为结算准备金和交易保证金。

第二十三条 结算准备金是指会员为了交易结算在交易所专用结算账户中预先准备的资金，是未被合约占用的保证金。

结算准备金的最低余额由交易所规定并公告，会员须以自有资金足额缴纳。

第二十四条 交易所根据会员当日结算准备金中的货币资金部分，以不低于中国人民银行公布的同期银行活期存款利率计算利息，并在每年3月、6月、9月、12月存管银行支付利息后的下一个交易日内，将利息转入会员结算准备金。

第二十五条 交易保证金是指会员在交易所专用结算账户中确保合约履行的资金，是已被合约占用的保证金。买卖双方成交后，交易所按持仓合约价值和规定的比例收取交易保证金。

持有标准仓单的卖方会员向交易所提交折抵头寸申请并征得同意后，与其标准仓单所示数量相同的卖持仓（不含按照本细则规定已经取得交易保证金优惠的持仓）交易保证金在结算时不再收取。会员向交易所提交申请之前须取得客户授权。最后交易日交割配对时，客户需要配对交割的仓单处于折抵状态的，交易所根据交割配对情况解除其相应的仓单折抵，用以交割配对。

交割月最后交易日下午不再进行交易的品种，交易所不办理该品种标准仓单折抵业务。

第二十六条 各品种期货合约的交易保证金比例及不同阶段的交易保证金比例按交易所有关规定执行。套利持仓和同一会员、同一客户、同一合约月份双向持仓按照单边收取交易保证金。

第二十七条 交易所根据会员当日成交合约数量及相关规定计收交易手续费。

第二十八条 经交易所同意，会员可用有价证券充抵保证金。

第二十九条 期货公司会员受托为客户交易，向客户收取的保证金属于客户所有，禁止挪作他用。

第三十条 期货公司会员向客户收取的交易保证金不得低于交易所向会员收取的交易保证金。

第五章 交易结算

第一节 当日结算

第三十一条 交易所实行当日无负债结算制度。

每日交易结束后,交易所按当日结算价结算所有合约的盈亏、交易保证金,收取手续费等费用,对应收应付的款项同时划转,相应增加或者减少会员的结算准备金。

当日有成交价格的期货合约,其当日结算价是指该合约当日成交价格按照成交量的加权平均价。违法违规交易行为影响当日结算价格公平产生的,交易所所有权消除违法违规交易行为的不利影响。当日无成交价格的期货合约,其当日结算价按照下列方法确定:

(一) 如果当日收盘时交易所计算机系统中该合约有买、卖双方报价的,按照最优的买方报价、卖方报价和该合约上一交易日的结算价格三者中居中的一个价格为该无成交合约的当日结算价。

(二) 如果当日该合约收盘前连续五分钟报价保持停板价格,且交易所计算机系统中只有单方报价时,则以该停板价格为该无成交合约的当日结算价。

(三) 除上述第(一)、(二)项之外的其他情况,该无成交价格期货合约的当日结算价按照下列方法确定:

1、如果当日无成交合约其当前一有成交的最近月份合约结算价的涨跌幅度(%)小于等于当日无成交合约当日的涨跌停板,则当日无成交合约结算价=该合约上一交易日的结算价 \times (1 \pm 该合约当前一有成交的最近月份合约结算价的涨跌幅度)。

2、如果当日无成交合约其当前一有成交的最近月份合约结算价的涨跌幅度(%)大于当日无成交合约当日的涨跌停板,则当日无

成交合约结算价=该合约上一交易日的结算价×（1±该合约的当日涨跌停板）。

3、如果当日无成交合约前面所有月份合约当日均无成交，无法找到该合约当日前一有成交的最近月份合约结算价的涨跌幅度，则当日无成交合约结算价=上一交易日该合约的结算价。

第三十二条 交易所结算部门根据会员的平仓、持仓情况及各期货合约的当日结算价计算各个会员的当日盈亏，当日盈亏 = 平仓盈亏 + 持仓盈亏 + 交割差额。

（一） 结算部门根据会员平仓合约计算会员平仓盈亏。平仓盈亏的计算公式如下：

$$\text{平仓盈亏} = \text{平历史仓盈亏} + \text{平当日仓盈亏}$$

$$\text{平历史仓盈亏} = \sum [(\text{卖出平仓价} - \text{上一交易日结算价}) \times \text{卖出平仓量}] + \sum [(\text{上一交易日结算价} - \text{买入平仓价}) \times \text{买入平仓量}]$$

$$\text{平当日仓盈亏} = \sum [(\text{当日卖出平仓价} - \text{当日买入开仓价}) \times \text{卖出平仓量}] + \sum [(\text{当日卖出开仓价} - \text{当日买入平仓价}) \times \text{买入平仓量}]$$

（二） 结算部门根据会员持仓合约和当日结算价计算持仓盈亏。持仓盈亏的计算公式如下：

$$\text{持仓盈亏} = \text{历史持仓盈亏} + \text{当日开仓持仓盈亏}$$

$$\text{历史持仓盈亏} = \sum [(\text{上一日结算价} - \text{当日结算价}) \times \text{卖出历史持仓量}] + \sum [(\text{当日结算价} - \text{上一日结算价}) \times \text{买入历史持仓量}]$$

$$\text{当日开仓持仓盈亏} = \sum [(\text{卖出开仓价} - \text{当日结算价}) \times \text{卖出开仓量}] + \sum [(\text{当日结算价} - \text{买入开仓价}) \times \text{买入开仓量}]$$

（三） 结算部门根据会员交割配对合约、当日结算价和交割结算价计算交割差额。交割差额的计算公式如下：

交割差额 = $\Sigma [(\text{当日结算价} - \text{交割结算价}) \times \text{卖出配对量}] + \Sigma [(\text{交割结算价} - \text{当日结算价}) \times \text{买入配对量}]$

第三十三条 当日盈亏在每日结算时进行划转，当日盈利划入会员结算准备金，当日亏损从会员结算准备金中扣划。

当日结算时的交易保证金超过上一交易日结算时的交易保证金部分从会员结算准备金中扣划。当日结算时的交易保证金低于上一交易日结算时的交易保证金部分划入会员结算准备金。

手续费等各项费用从会员的结算准备金中扣划。

第三十四条 结算准备金余额的具体计算公式如下：

当日结算准备金余额 = 上一交易日结算准备金 + 上一交易日交易保证金 - 当日交易保证金 + 当日有价证券充抵保证金 - 上一交易日有价证券充抵保证金 + 当日盈亏 + 入金 - 出金 - 手续费等

第三十五条 当日结算完毕后，交易所通过会员服务系统向会员发送结算结果。会员的结算准备金低于最低余额时，该结算结果即视为交易所向会员发出的追加保证金通知。

交易所发出追加保证金的通知后，可以通过存管银行从会员的专用资金账户中扣划。

会员必须在下一个交易日开市前补足至结算准备金最低余额。未补足的，结算准备金余额大于零而低于结算准备金最低余额时，禁止开新仓；结算准备金余额小于零时，交易所所有权对该会员持仓强行平仓。

交易所可根据市场风险和保证金变动情况，在交易期间发出追加保证金通知，会员须在通知规定的时间内补足保证金。结算准备金未按时补足且余额为负数的，交易所所有权对其持仓强行平仓。

第二节 出入金

第三十六条 会员入金方式：会员可用相关转账凭证、银期通系统向交易所专用结算账户划入资金。会员划入的资金，经存管银行确认到账后，交易所将及时增加会员的保证金。

第三十七条 会员出金方式：会员出金须在每交易日下午 3 时之前办理。使用银期通系统出金的，会员应在银期通系统上提出出金申请，经交易所审核后办理出金手续；特殊情况下使用转账凭证出金的，会员应加盖预留印鉴作为会计核算的依据。交易所可根据业务发展需要，变更出金方式和流程。

第三十八条 会员的出金标准为：

（一）当有价证券充抵保证金实际可用金额大于等于交易保证金的 80%时，可出金额=实有货币资金-交易保证金×20%-结算准备金最低余额；

（二）当有价证券充抵保证金实际可用金额小于交易保证金的 80%时，可出金额=实有货币资金-（交易保证金-有价证券充抵保证金实际可用金额）-结算准备金最低余额。

交易所可根据市场风险状况对会员出金标准做适当调整。

第三十九条 会员或者客户有下列情况之一的，交易所可以限制会员出金：

（一）涉嫌重大违规，经交易所立案调查的；

（二）因投诉、举报、交易纠纷等被司法部门、交易所或者其他有关部门正式立案调查，且正处在调查期间的；

（三）交易所认为必要的其他情况。

第三节 结算数据

第四十条 当日交易结束后，交易所对每一会员的盈亏、交易手续费、保证金等款项进行结算。交易所采用发放纸质结算单据或电子结算单据等方式向会员提供当日结算数据。结算数据是会员核对当日有关交易并对客户结算的依据。因特殊情况不能按时提供时结算数据的，交易所另行通知提供结算数据的时间。

第四十一条 会员应当每天及时获取交易所提供的结算数据，做好核对工作，妥善保存。

第四十二条 会员对结算结果有异议的，应当在下一交易日开市前以书面形式通知交易所。如遇特殊情况，会员可在下一交易日开市后 2 小时内以书面形式通知交易所。在规定时间内，会员没有对结算结果提出异议的，视作已认可结算结果的正确性。

第四十三条 交易所在每月月初向会员提供上月的《会员保证金核对单》，作为会员核查交易账簿记录的依据。

第四节 移仓

第四十四条 发生下列情况之一的，可由期货公司会员和客户提出申请，经交易所批准后，可以进行客户移仓：

（一）期货公司会员因故不能从事期货经纪业务，或发生经监管部门批准的合并、分立、破产等账号变更；

（二）期货公司会员和客户违反《郑州商品交易所期货交易风险控制管理办法》，引发交割违规、违约风险；

（三）交易所认可的其他移仓情况。

第四十五条 移仓申请经批准后，交易所与期货公司会员约定具体的客户移仓结算日。

客户移仓结算日当日结算完成后，交易所为期货公司会员实施客户移仓，并提供客户移仓前和移仓后的持仓清单由期货公司会员确认。

移仓内容仅包括客户的持仓不包括当日的盈亏、交易手续费、保证金等其他款项。

第六章 交割结算

第四十六条 会员进行交割，应当按规定向交易所交纳交割手续费。具体标准在交割细则中载明。

交割手续费在交割日结算时由交易所直接从会员的结算准备金中扣划。

第四十七条 交割货款结算实行一收一付，同时划转。

第四十八条 交割结算价的规定见交割细则。交割商品货款以交割结算价为基础，加减相应的升贴水和包装款。包装款按交易所公布的标准结算。

第四十九条 交割配对日结算时，交易所对会员交割月份配对持仓按交割结算价进行结算处理，产生的交割差额计入会员当日盈亏中。

第七章 有价证券充抵保证金

第五十条 有价证券充抵的保证金仅用于交易担保，会员发生的亏损、交割货款、出金、费用等款项均须以货币资金及时结清。

第五十一条 有价证券充抵保证金业务由交易所结算部门负责办理。交易所受理有价证券充抵保证金业务的时间为每个工作日交易

时间的下午 2 时 30 分之前。交割月最后交易日下午不再进行交易的品种，交易所不办理该品种标准仓单充抵保证金业务。

第五十二条 会员使用有价证券充抵保证金时，须将有价证券移转交易所占有，办理有价证券充抵保证金登记手续后，交易所享有有价证券的质押权。

非期货公司会员使用有价证券充抵保证金的，须以自己的名义到交易所办理。客户使用有价证券充抵保证金的，须委托期货公司会员并以期货公司会员名义办理，并向交易所申明愿为期货公司会员名下期货交易提供担保。

第五十三条 交易所接受以下有价证券充抵保证金：

- （一）可在交易所流通的标准仓单；
- （二）可流通并能够实现质押权登记的国债；
- （三）交易所认可的其他有价证券。

依前款规定的有价证券充抵保证金的，充抵的期限不得超过有价证券的有效期，每次充抵的有价证券价值不得低于 10 万元(人民币)。

第五十四条 有价证券充抵保证金应当符合以下规定：

（一）会员办理有价证券充抵保证金业务时，应当按交易所规定填报有价证券充抵保证金申请；

（二）以标准仓单充抵保证金时，由交易所结算部门负责人审批；以国债及其他有价证券充抵保证金时，须经交易所结算部门和法律部门签署意见后，报交易所主管领导批准；

（三）会员以标准仓单充抵保证金的，须将标准仓单提交交易所，并办理交存和充抵登记手续；国债及其他有价证券的验证交存和充抵登记须依法办理。

第五十五条 有价证券价值的确定标准：

（一）标准仓单充抵保证金时，以办理日前一交易日该标准仓单对应品种最近交割月份期货合约的结算价为基准价计算其价值；

（二）国债充抵保证金时，以充抵办理日前一交易日该国债在上海、深圳证券交易所较低的收盘价为基准价计算其价值；

（三）其他有价证券充抵保证金的价值由交易所核定。

第五十六条 有价证券充抵保证金的金额不得高于以下标准中的较低值：

（一）有价证券价值的 80%；

（二）会员在期货交易所专用结算账户中的实有货币资金的 4 倍。

第五十七条 有价证券充抵保证金生效当日，交易所结算部门按照充抵金额进行账务核算，同时增加会员保证金。

第五十八条 每次充抵保证金的期限原则上为 6 个月。

第五十九条 交易所所有权根据市场状况调整有价证券充抵保证金金额及实际可用充抵金额。

充抵期限内，有价证券的价值涨跌幅度大于或等于 10%时，交易所可以对充抵金额作相应调整；交易所可以依据市场风险情况，调整有价证券的基准计算价和会员充抵金额。调整会员充抵金额时，交易所结算部门向会员出具有价证券充抵保证金调整单，同时调整会员保证金。

充抵期限内，会员配比货币资金不足时，交易所按照充抵保证金配比规定即时对该会员的实际可用充抵金额作相应调减；会员增加货币资金时，交易所按照充抵配比规定即时调增其实际可用充抵金额。

第六十条 出现下列情况之一的，交易所有权取消有价证券充抵保证金的额度：

（一）使用有价证券充抵保证金的会员或者客户运用资金出现较大风险并有可能危及交易所合法权益的；

（二）充抵期内，市场出现较大风险，并有可能危及交易所合法权益的；

（三）有价证券所对应的货物出现瑕疵或者发生重大风险的；

（四）有价证券充抵业务经办会员或者客户（有价证券所有人）存在违规、违约行为嫌疑的；

（五）由于其他原因需要停止有价证券充抵保证金的。

取消有价证券充抵保证金额度的当日，交易所结算部门减少会员保证金，同时计算并收取充抵保证金手续费。会员保证金不能满足结算要求的，有价证券充抵关系不得解除。

第六十一条 交易所依据本细则第五十八条、第五十九条调整会员充抵金额或取消会员充抵保证金额度后，会员出现保证金不足又未及时追加的，交易所有权按照强行平仓制度对其采取措施。因交易所采取措施造成会员损失的，由会员先行承担，然后由会员向客户追偿；造成交易所损失的，交易所有权将充抵的有价证券按市场价格变现或兑现并从中优先受偿。交易所受偿结束前，会员保证金充抵关系不予解除。

第六十二条 有价证券充抵保证金期满，交易所解除充抵关系，应当减少会员保证金，向会员返还有价证券。充抵期内，会员提出申请要求提前解除充抵保证金的，必须在弥补应交保证金之后，方可办理相应手续，取回充抵的有价证券。

解除标准仓单充抵关系时，结算部门当日办理仓单解除充抵保证金手续。

解除国债及其他有价证券充抵保证金时，结算部门按有关程序 and 规定办理解除充抵保证金手续，归还其原有的有价证券。

第六十三条 有价证券所充抵的保证金不能全额及时清偿时，交易所有权将用作充抵保证金的有价证券按市场价兑现或者变现，用于清偿其充抵的保证金和相关债务。清偿后有余额的，将余额部分退还会员；兑现或者变现金额不足以清偿其充抵的保证金和相关债务的，交易所有权向会员追索。

兑现或者变现时，有价证券可以分割的，按其不能清偿的保证金数额、充抵费用、兑现或者变现费用以及相关费用等的合计数额进行分割兑现或者变现；有价证券不能分割的，全部兑现或者变现。

第六十四条 会员应当承担有价证券充抵保证金期内的手续费和其他相关费用。其他相关费用包括有价证券的仓储费、保管费等相关费用。

有价证券充抵保证金的手续费收取标准由交易所规定并公告。有价证券充抵保证金手续费在充抵关系解除时收取。

有价证券的仓储费、保管费等按有关规定交纳。

第六十五条 交易所应当建立有价证券充抵保证金相关资料的保管制度，完善相关手续。有价证券充抵保证金业务的相关资料保管期限与会计档案相同。

第八章 风险与责任

第六十六条 期货交易风险防范实行分级负责制度。交易所防范会员风险，会员防范客户的风险。

第六十七条 会员对其在交易所成交的合约负有承担风险的责任。

第六十八条 会员不能履行合约义务时，交易所所有权对其采取下列保障措施：

- （一）动用会员的结算准备金；
- （二）暂停开仓交易；
- （三）按规定强行平仓，直至用平仓后释放的保证金能够履约为止；
- （四）将充抵保证金的有价证券变现，用变现所得履约赔偿。

第六十九条 采取前条措施后会员仍不能清偿债务的，交易所可采取以下清偿措施：

- （一）转让会员资格，用转让所得抵偿；
- （二）经理事会批准，动用风险准备金进行履约赔偿；
- （三）动用交易所的自有资产进行履约赔偿；
- （四）通过法律程序继续对该会员追偿。

第七十条 交易所实行风险准备金制度。风险准备金由交易所设立，用于维护期货市场正常运转提供财务担保和弥补交易所难以控制的风险带来的亏损。

第七十一条 风险准备金的来源：

- （一）交易所按手续费收入 20% 的比例提取；
- （二）符合国家财政政策规定的其他收入。

当风险准备金余额达到一定规模时，经中国证监会批准可不再提取。

第七十二条 风险准备金必须单独核算，专户存储。

第七十三条 风险准备金的动用必须经交易所理事会批准，并报告中国证监会。

附 则

第七十四条 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。

第七十五条 本细则解释权属于郑州商品交易所。

第七十六条 本细则自 2012 年 9 月 3 日起施行。

附件 2:

《郑州商品交易所期货结算细则》

(修订案)

(郑州商品交易所第五届理事会: 2008 年 1 月 7 日审议通过, 自 2008 年 1 月 15 日起施行; 2009 年 3 月 28 日修订, 自 2009 年 4 月 20 日起施行; 2012 年 8 月 14 日修订, 自 2012 年 9 月 3 日起施行)

说明: 带删除线的为本次删去内容, 下划线及阴影为新修改内容。

第一章 总 则

第一条 为规范郑州商品交易所(以下简称交易所)期货交易的结算行为, 保护期货交易当事人的合法权益和社会公众利益, 防范和化解期货市场风险, 根据《郑州商品交易所交易规则》, 制定本细则。

第二条 结算是指根据交易结果和交易所有关规定对会员保证金、盈亏、手续费、交割货款及其他有关款项进行计算、划拨的业务活动。

第三条 交易所的期货业务结算实行保证金制度、当日无负债结算制度和风险准备金制度等。

第四条 交易所实行分级结算制度。交易所对会员进行结算, 期货公司会员对客户进行结算。

第五条 交易所的期货结算业务按本细则进行。交易所、会员、客户和期货保证金存管银行(以下简称存管银行)必须遵守本细则。

第二章 结算机构

第六条 结算机构包括交易所和会员的结算部门、~~存管银行~~。

第七条 交易所结算部门负责期货交易、交割的统一结算，保证金管理，风险准备金管理以及结算风险的防范。

所有在交易所交易系统中成交的合约必须通过结算部门进行统一结算。

交易所依据有关规章制度有权检查会员的结算资料、财务报表及相关的凭证和账册。

第八条 会员须设立结算部门。期货公司会员结算部门负责会员与交易所、会员与客户之间的结算工作；非期货公司会员结算部门负责会员与交易所之间的结算工作。

会员结算部门应当妥善保管结算资料、财务报表及相关凭证、账册，以备查询和核实。

第三章 存管银行

第九条 存管银行由交易所指定，协助交易所办理期货交易结算业务。经交易所同意成为存管银行后，存管银行须与交易所签订相应协议，明确双方的权利和义务，以规范相关业务行为。

交易所对存管银行的期货结算业务进行监督。

第十条 存管银行的权利：

- （一）开设交易所专用结算账户和会员专用资金账户；
- （二）吸收交易所和会员的存款；
- （三）了解会员在交易所的资信情况。

第十一条 存管银行的义务：

(一) 向交易所提供会员专用资金账户的资金情况，根据交易所要求对会员保证金实施必要的监管措施；

(二) 根据交易所提供的票据优先划转会员的资金；

(三) 协助交易所核查会员资金的来源和去向；

(四) 向交易所及时通报会员标准仓单的质押情况；

(五) 向交易所及时通报会员在资金结算方面的不良行为和风险；

(六) 交易所出现重大风险时，必须协助交易所化解风险；

(七) 保守交易所和会员的商业秘密；

(八) 接受交易所对其期货业务的监督。

第十二条 结算机构及其工作人员应当保守交易所和会员的商业秘密。

第三章 日常结算—保证金

第一节 保证金账户开立与管理

第十三条 交易所在存管银行开设专用结算账户，用于存放会员的保证金及相关款项。

第十四条 会员须在存管银行开设专用资金账户，用于存放保证金及相关款项。

第十五条 交易所与会员之间期货业务资金的往来通过交易所专用结算账户、会员保证金账户和会员专用资金账户办理。

第十六条 交易所对会员存入交易所专用结算账户的保证金实行分账管理，为每一会员设立明细账户，按日序时登记核算每一会员出入金、盈亏、保证金、手续费等。

第十七条 期货公司会员对客户存入会员保证金账户和专用资金账户的保证金实行分账管理，为每一客户设立明细账户，按日序时登记核算每一客户出入金、盈亏、保证金、手续费等。

第十八条 会员开设专用资金账户时，须经交易所审核同意，并提交《印鉴授权书》等相关资料；会员使用资金管理电子化系统，须与交易所签订《郑州商品交易所资金管理电子化会员服务协议》。

交易所所有权在不通知会员的情况下，通过存管银行从会员的专用资金账户中收取各项应收款项，并且有权随时查询该账户的资金情况。

第十九条 《印鉴授权书》中被授权的公章、财务章、法定代表人章或者被授权人章及《郑州商品交易所资金管理电子化会员服务协议》确定的电子签章均为会员的有效印鉴，会员应当对使用以上印鉴所产生的一切后果承担责任。

第二十条 会员更换专用资金账户的，须经交易所批准。

第二十一条 会员更名或者资格转让，须重新向交易所提交《印鉴授权书》，并办理相关专用资金账户的变更手续。

第二节 保证金管理

第二十二条 交易所实行保证金制度。保证金分为结算准备金和交易保证金。

第二十三条 结算准备金是指会员为了交易结算在交易所专用结算账户中预先准备的资金，是未被合约占用的保证金。

结算准备金的最低余额由交易所规定并公告，会员须以自有资金足额缴纳。

第二十四条 交易所根据会员当日结算准备金中的货币资金部分，以不低于中国人民银行公布的同期银行活期存款利率计算利息，

并在每年3月、6月、9月、12月存管银行支付利息后的下一个交易日内，将利息转入会员结算准备金。

第二十五条 交易保证金是指会员在交易所专用结算账户中确保合约履行的资金，是已被合约占用的保证金。买卖双方成交后，交易所按持仓合约价值和规定的比例收取交易保证金。

持有标准仓单的卖方会员向交易所提交折抵头寸申请并征得同意后，与其标准仓单所示数量相同的卖持仓（不含按照本细则规定已经取得交易保证金优惠的持仓）交易保证金在结算时不再收取。会员向交易所提交申请之前须取得客户授权。最后交易日交割配对时，客户需要配对交割的仓单处于折抵状态的，交易所根据交割配对情况解除其相应的仓单折抵，用以交割配对。~~同时对已进行交割配对的空头持仓释放相应的交割配对保证金。~~

交割月最后交易日下午不再进行交易的品种，交易所不办理该品种标准仓单折抵业务。

第二十六条 各品种期货合约的交易保证金比例及不同阶段的交易保证金比例按交易所有关规定执行。套利持仓和同一会员、同一客户、同一合约月份双向持仓按照单边收取交易保证金。

第二十七条 交易所根据会员当日成交合约数量及相关规定计收交易手续费。

第二十八条 经交易所同意，会员可用有价证券充抵保证金。

第二十九条 期货公司会员受托为客户交易，向客户收取的保证金属于客户所有，禁止挪作他用。

第三十条 期货公司会员向客户收取的交易保证金不得低于交易所向会员收取的交易保证金。

第五章 交易结算

第一节 当日结算

第三十一条 交易所实行当日无负债结算制度。

每日交易结束后,交易所按当日结算价结算所有合约的盈亏、交易保证金,收取手续费等费用,对应收应付的款项同时划转,相应增加或者减少会员的结算准备金。

当日有成交价格的期货合约,其当日结算价是指该合约当日成交价格按照成交量的加权平均价。**违法违规交易行为影响当日结算价格公平产生的,交易所所有权消除违法违规交易行为的不利影响。**当日无成交价格的期货合约,其当日结算价按照下列方法确定:

(一) 如果当日收盘时交易所计算机系统中该合约有买、卖双方报价的,按照最优的买方报价、卖方报价和该合约上一交易日的结算价格三者中居中的一个价格为该无成交合约的当日结算价。

(二) 如果当日该合约收盘前连续五分钟报价保持停板价格,且交易所计算机系统中只有单方报价时,则以该停板价格为该无成交合约的当日结算价。

(三) 除上述第(一)、(二)项之外的其他情况,该无成交价格期货合约的当日结算价按照下列方法确定:

1、如果当日无成交合约其当前一有成交的最近月份合约结算价的涨跌幅度(%)小于等于当日无成交合约当日的涨跌停板,则当日无成交合约结算价=该合约上一交易日的结算价×(1±该合约当前一有成交的最近月份合约结算价的涨跌幅度)。

2、如果当日无成交合约其当前一有成交的最近月份合约结算价的涨跌幅度(%)大于当日无成交合约当日的涨跌停板,则当日无

成交合约结算价=该合约上一交易日的结算价×（1±该合约的当日涨跌停板）。

3、如果当日无成交合约前面所有月份合约当日均无成交，无法找到该合约当日前一有成交的最近月份合约结算价的涨跌幅度，则当日无成交合约结算价=上一交易日该合约的结算价。

第三十二条 交易所结算部门根据会员的平仓、持仓情况及各期货合约的当日结算价计算各个会员的当日盈亏，当日盈亏 = 平仓盈亏 + 持仓盈亏 + 交割差额。

（一） 结算部门根据会员平仓合约计算会员平仓盈亏。平仓盈亏的计算公式如下：

$$\text{平仓盈亏} = \text{平历史仓盈亏} + \text{平当日仓盈亏}$$

$$\text{平历史仓盈亏} = \sum [(\text{卖出平仓价} - \text{上一交易日结算价}) \times \text{卖出平仓量}] + \sum [(\text{上一交易日结算价} - \text{买入平仓价}) \times \text{买入平仓量}]$$

$$\text{平当日仓盈亏} = \sum [(\text{当日卖出平仓价} - \text{当日买入开仓价}) \times \text{卖出平仓量}] + \sum [(\text{当日卖出开仓价} - \text{当日买入平仓价}) \times \text{买入平仓量}]$$

（二） 结算部门根据会员持仓合约和当日结算价计算持仓盈亏。持仓盈亏的计算公式如下：

$$\text{持仓盈亏} = \text{历史持仓盈亏} + \text{当日开仓持仓盈亏}$$

$$\text{历史持仓盈亏} = \sum [(\text{上一日结算价} - \text{当日结算价}) \times \text{卖出历史持仓量}] + \sum [(\text{当日结算价} - \text{上一日结算价}) \times \text{买入历史持仓量}]$$

$$\text{当日开仓持仓盈亏} = \sum [(\text{卖出开仓价} - \text{当日结算价}) \times \text{卖出开仓量}] + \sum [(\text{当日结算价} - \text{买入开仓价}) \times \text{买入开仓量}]$$

（三） 结算部门根据会员交割配对合约、当日结算价和交割结算价计算交割差额。交割差额的计算公式如下：

交割差额 = $\Sigma [(\text{当日结算价} - \text{交割结算价}) \times \text{卖出配对量}] + \Sigma [(\text{交割结算价} - \text{当日结算价}) \times \text{买入配对量}]$

第三十三条 当日盈亏在每日结算时进行划转，当日盈利划入会员结算准备金，当日亏损从会员结算准备金中扣划。

当日结算时的交易保证金超过上一交易日结算时的交易保证金部分从会员结算准备金中扣划。当日结算时的交易保证金低于上一交易日结算时的交易保证金部分划入会员结算准备金。

手续费等各项费用从会员的结算准备金中扣划。

第三十四条 结算准备金余额的具体计算公式如下：

当日结算准备金余额 = 上一交易日结算准备金 + 上一交易日交易保证金 - 当日交易保证金 + 当日有价证券充抵保证金 - 上一交易日有价证券充抵保证金 + 当日盈亏 + 入金 - 出金 - 手续费等

第三十五条 当日结算完毕后，交易所通过会员服务系统向会员发送结算结果。会员的结算准备金低于最低余额时，该结算结果即视为交易所向会员发出的追加保证金通知。

交易所发出追加保证金的通知后，可以通过存管银行从会员的专用资金账户中扣划。

会员必须在下一个交易日开市前补足至结算准备金最低余额。未补足的，结算准备金余额大于零而低于结算准备金最低余额时，禁止开新仓；结算准备金余额小于零时，交易所所有权对该会员持仓强行平仓。

交易所可根据市场风险和保证金变动情况，在交易期间发出追加保证金通知，会员须在通知规定的时间内补足保证金。结算准备金未按时补足且余额为负数的，交易所所有权对其持仓强行平仓。

第二节 出入金

第三十六条 会员入金划拨资金方式：~~（三）会员入金~~。会员可用专用资金账户转账凭证相关转账凭证、银期通系统向交易所专用结算账户划入资金。会员划入的资金，经存管银行确认到账后，交易所将及时增加会员的保证金。

第三十七条 ~~（一）会员出金~~方式：会员可在出金须在每交易日下午 3 时之前提出书面划款申请办理。使用银期通系统出金的，会员应在银期通系统上提出出金申请，经交易所审核后办理出金手续；特殊情况下使用转账凭证出金的，会员应并根据不同情况填写资金划拨单或者期货交易专用转账凭证，加盖预留印鉴作为会计核算的依据，资金管理电子化系统同时调减结算准备金。会员、交易所分别以银行的收、付款人回单作为会计核算的依据。辅助使用交易所资金调拨管理系统的会员，应当有会员的资金调拨指令且转出的保证金只能等于该指令显示金额，不符合规定的，不能办理出金手续。交易所可根据业务发展需要，变更出金方式和流程。

第三十八条 ~~会员出金必须符合交易所规定。~~

会员的出金标准为：

（一）当有价证券充抵保证金实际可用金额大于等于交易保证金的 80%时，可出金额 = 实有货币资金 - 交易保证金 × 20% - 结算准备金最低余额；

（二）当有价证券充抵保证金实际可用金额小于交易保证金的 80%时，可出金额 = 实有货币资金 - （交易保证金 - 有价证券充抵保证金实际可用金额） - 结算准备金最低余额。

交易所可根据市场风险状况对会员出金标准做适当调整。

第三十九条 会员或者客户有下列情况之一的，交易所可以限制会员出金：

（一）涉嫌重大违规，经交易所立案调查的；

（二）因投诉、举报、交易纠纷等被司法部门、交易所或者其他有关部门正式立案调查，且正处在调查期间的；

（三）交易所认为必要的其他情况。

第三节 结算数据

第四十条 当日交易结束后，交易所对每一会员的盈亏、交易手续费、保证金等款项进行结算。交易所采用发放纸质结算单据或电子结算单据等方式向会员提供当日结算数据。结算结果数据是会员核对当日有关交易并对客户结算的依据，~~会员可通过会员服务系统于每交易日下午4时以后接收结算结果~~。因特殊情况不能按时提供时~~结算数据~~的，交易所另行通知提供~~结算结果数据~~的时间。

第四十一条 会员应当每天及时获取交易所提供的~~结算报表数据~~，做好核对工作，妥善保存。

第四十二条 会员对结算结果有异议的，应当在下一交易日开市前以书面形式通知交易所。如遇特殊情况，会员可在下一交易日开市后2小时内以书面形式通知交易所。在规定时间内，会员没有对结算结果提出异议的，视作已认可结算结果的正确性。

第四十三条 交易所在每月~~第一个交易日~~月初向会员提供上月的《会员保证金核对单》，作为会员核查交易账簿记录的依据。

第四节 移仓

~~第四十四条 期货公司会员因故不能从事期货业务时，由期货公司会员和客户提出申请，经交易所批准，可进行客户移仓。~~

~~客户移仓申请材料应当包括：期货公司会员同意移入和移出仓位的申请书、客户同意移仓的申请书及客户持仓的详细清单。~~

发生下列情况之一的，可由期货公司会员和客户提出申请，经交易所批准后，可以进行客户移仓：

（一）期货公司会员因故不能从事期货经纪业务，或发生经监管部门批准的合并、分立、破产等账号变更；

（二）期货公司会员和客户违反《郑州商品交易所期货交易风险控制管理办法》，引发交割违规、违约风险；

（三）交易所认可的其他移仓情况。

第四十五条 移仓申请经批准后，交易所与期货公司会员约定具体的客户移仓结算日。

客户移仓结算日当日结算完成后，交易所为期货公司会员实施客户移仓，并提供客户移仓前和移仓后的持仓清单由期货公司会员确认。

移仓内容仅包括客户的持仓不包括当日的盈亏、交易手续费、保证金等其他款项。

第四十六章 交割结算

第四十六条 会员进行交割，应当按规定向交易所交纳交割手续费。具体标准在交割细则中载明。

交割手续费在交割日结算时由交易所直接从会员的结算准备金中扣划。

第四十七条 交割货款结算实行一收一付，同时划转。

第四十八条 交割结算价的规定见交割细则。交割商品货款以交割结算价为基础，加减相应的升贴水和包装款。包装款按交易所公布的标准结算。

第四十九条 交割配对日结算时，交易所对会员交割月份配对持仓按交割结算价进行结算处理，产生的交割差额计入会员当日盈亏中。

第五章 有价证券充抵保证金

第五十条 有价证券充抵的保证金仅用于交易担保，会员发生的亏损、交割货款、出金、费用等款项均须以货币资金及时结清。

第五十一条 有价证券充抵保证金业务由交易所结算部门负责办理。交易所受理有价证券充抵保证金业务的时间为每个工作日交易时间的下午 2 时 30 分之前。交割月最后交易日下午不再进行交易的品种，交易所不办理该品种标准仓单充抵保证金业务。

第五十二条 会员使用有价证券充抵保证金时，须将有价证券转移交易所占有，办理有价证券充抵保证金登记手续后，交易所享有有价证券的质押权。

非期货公司会员使用有价证券充抵保证金的，须以自己的名义到交易所办理。客户使用有价证券充抵保证金的，须委托期货公司会员并以期货公司会员名义办理，并向交易所申明愿为期货公司会员名下期货交易提供担保。

第五十三条 交易所接受以下有价证券充抵保证金：

- (一) 可在交易所流通的标准仓单；
- (二) 可流通并能够实现质押权登记的国债；
- (三) 交易所认可的其他有价证券。

依前款规定的有价证券充抵保证金的，充抵的期限不得超过有价证券的有效期限，每次充抵的有价证券价值不得低于 10 万元(人民币)。

第五十四条 有价证券充抵保证金应当符合以下规定：

(一) 会员办理有价证券充抵保证金业务时，应当按交易所规定填报有价证券充抵保证金申请；

(二) 以标准仓单充抵保证金时，由交易所结算部门负责人审批；以国债及其他有价证券充抵保证金时，须经交易所结算部门和法律部门签署意见后，报交易所主管领导批准；

(三) 会员以标准仓单充抵保证金的，须将标准仓单提交交易所，并办理交存和充抵登记手续；国债及其他有价证券的验证交存和充抵登记须依法办理。

第五十五条 有价证券价值的确定标准：

(一) 标准仓单充抵保证金时，以办理日前一交易日该标准仓单对应品种最近交割月份期货合约的结算价为基准价计算其价值；

(二) 国债充抵保证金时，以充抵办理日前一交易日该国债在上海、深圳证券交易所较低的收盘价为基准价计算其价值；

(三) 其他有价证券充抵保证金的价值由交易所核定。

第五十六条 有价证券充抵保证金的金额不得高于以下标准中的较低值：

- (一) 有价证券价值的 80%；
- (二) 会员在期货交易所专用结算账户中的实有货币资金的 4 倍。

第五十七条 有价证券充抵保证金生效当日，交易所结算部门按照充抵金额进行账务核算，同时增加会员保证金。

第五十八条 ~~有价证券标准仓单~~每次充抵保证金的期限原则上为6个月。

第五十九条 交易所根据市场状况调整有价证券充抵保证金金额及实际可用充抵金额。

充抵期限内，~~交易所结算部门负责对因有价证券价值变化导致的充抵金额进行核查调整。~~有价证券的价值涨跌幅度达到大于或等于10%及以上（含10%）时，交易所可以对充抵金额作相应调整；交易所可以依据市场风险情况，调整有价证券的基准计算价和会员充抵金额。调整会员充抵金额时，交易所结算部门向会员出具有价证券充抵保证金调整单，同时调整会员保证金。

充抵期限内，会员配比货币资金不足时，交易所按照充抵保证金配比规定即时对该会员的实际可用充抵金额作相应调减；会员增加货币资金时，交易所按照充抵配比规定即时调增其实际可用充抵金额。

第六十条 出现下列情况之一的，交易所取消有价证券充抵保证金的额度：

（一）使用有价证券充抵保证金的会员或者客户运用资金出现较大风险并有可能危及交易所合法权益的；

（二）充抵期内，市场出现较大风险，并有可能危及交易所合法权益的；

（三）有价证券所对应的货物出现瑕疵或者发生重大风险的；

（四）有价证券充抵业务经办会员或者客户（有价证券所有人）存在违规、违约行为嫌疑的；

(四**五**) 由于其他原因需要停止有价证券充抵保证金的。

取消有价证券充抵保证金额度的当日，交易所结算部门减少会员保证金，同时计算并收取充抵保证金手续费。会员保证金不能满足结算要求的，有价证券充抵关系不得解除。

第六十一条 交易所依据本细则第五十八条、第五十九条调整会员充抵金额或取消会员充抵保证金额度后，会员出现保证金不足又未及时追加的，交易所**所有**权按照强行平仓制度对其采取措施。因交易所采取措施造成会员损失的，由会员先行承担，然后由会员向客户追偿；造成交易所损失的，交易所**所有**权将充抵的有价证券按市场价格变现或兑现并从中优先受偿。交易所受偿结束前，会员保证金充抵关系不予解除。

第六十二条 有价证券充抵保证金期满，交易所解除充抵关系，应当减少会员保证金，向会员返还有价证券。充抵期内，会员提出申请要求提前解除充抵保证金的，必须在弥补应交保证金之后，方可办理相应手续，取回充抵的有价证券。

解除标准仓单充抵关系时，结算部门当日办理仓单解除充抵保证金手续。

解除国债及其他有价证券充抵保证金时，结算部门按有关程序和规定办理解除充抵保证金手续，归还其原有的有价证券。

第六十一条三条 有价证券所充抵的保证金不能全额及时清偿时，交易所**所有**权将用作充抵保证金的有价证券按市场价兑现或者变现，用于清偿其充抵的保证金和相关债务。清偿后有余额的，将余额部分退还会员；兑现或者变现金额不足以清偿其充抵的保证金和相关债务的，交易所**所有**权向会员追索。

兑现或者变现时，有价证券可以分割的，按其不能清偿的保证金数额、充抵费用、兑现或者变现费用以及相关费用等的合计数额进行分割兑现或者变现；有价证券不能分割的，全部兑现或者变现。

第六十二条 会员应当承担有价证券充抵保证金期内的手续费和其他相关费用。其他相关费用包括有价证券的仓储费、保管费等相关费用。

有价证券充抵保证金的手续费收取标准由交易所规定并公告。有价证券充抵保证金手续费在充抵关系解除时收取。

有价证券的仓储费、保管费等按有关规定交纳。

第六十三条 交易所应当建立有价证券充抵保证金相关资料的保管制度，完善相关手续。有价证券充抵保证金业务的相关资料保管期限与会计档案相同。

第六章 风险与责任

第六十四条 期货交易风险防范实行分级负责制度。交易所防范会员风险，会员防范客户的风险。

第六十五条 会员对其在交易所成交的合约负有承担风险的责任。

第六十六条 会员不能履行合约义务时，交易所所有权对其采取下列保障措施：

- （一）动用会员的结算准备金；
- （二）暂停开仓交易；
- （三）按规定强行平仓，直至用平仓后释放的保证金能够履约为止；
- （四）将充抵保证金的有价证券变现，用变现所得履约赔偿。

第六十七九条 采取前条措施后会员仍不能清偿债务的,交易所可采取以下清偿措施:

- (一) 转让会员资格,用转让所得抵偿;
- (二) 经理事会批准,动用风险准备金进行履约赔偿;
- (三) 动用交易所的自有资产进行履约赔偿;
- (四) 通过法律程序继续对该会员追偿。

第六十八七十条 交易所实行风险准备金制度。风险准备金由交易所设立,用于维护期货市场正常运转提供财务担保和弥补交易所难以控制的风险带来的亏损。

第六十九七十一条 风险准备金的来源:

- (一) 交易所按手续费收入 20% 的比例提取;
- (二) 符合国家财政政策规定的其他收入。

当风险准备金余额达到一定规模时,经中国证监会批准可不再提取。

第七十二二条 风险准备金必须单独核算,专户存储。

第七十一三条 风险准备金的动用必须经交易所理事会批准,并报告中国证监会。

附 则

第七十二四条 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。

第七十三五条 本细则解释权属于郑州商品交易所。

第七十四六条 本细则自 2012 年 9 月 3 日起施行。

附件 3:

郑州商品交易所标准仓单管理办法

(郑州商品交易所第五届理事会：2008 年 1 月 7 日审议通过，自 2008 年 1 月 15 日起施行；2009 年 3 月 28 日修订，自 2009 年 4 月 20 日起施行；2012 年 8 月 14 日修订，自 2012 年 9 月 3 日起施行)

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》第五章规定处理。

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、菜籽油、早籼稻、甲醇、玻璃。

第九条 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。

第十条 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。

第十一条 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。

第三章 仓库仓单的交割预报

第十二条 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。

第十三条 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。

第十四条 《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、菜籽油和早籼稻为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（以下简称PTA）为15天。

交易所可视情况，调整《入库通知单》的有效期。

第十五条 《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。

第十六条 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。

第十七条 货主应当按交易所有关规定向仓库交纳各项费用。

第十八条 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。

第四章交割商品入库

第十九条 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。

第二十条 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。

第二十一条 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。

第二十二条 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

第二十三条 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。

第二十四条 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

第二十五条 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。

第二十六条 棉花入库时，仓库按《入库通知单》、原验证书和码单接收棉花。

第二十七条 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。

第二十八条 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。

第二十九条 一号棉入库过程中和仓单注册前发现有下列情况之一的，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）非同一产地、非同一棉花加工厂生产的棉花；
- （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）经检验发现品级有六级及以下的；
- （九）经检验发现马克隆值有 C1 级的；
- （十）其他不符合交割规定的。

第三节 白糖入库

第三十条 白糖包装应当符合《郑州商品交易所期货交割细则》规定。

第三十一条 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》。

第三十二条 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。

第三十三条 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。

第三十四条 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

第三十五条 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。

第三十六条 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。

第三十七条 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 菜籽油入库

第三十八条 菜籽油运输必须符合国家卫生标准规定。

第三十九条 入库菜籽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。

第四十条 采用汽车运输的，菜籽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，菜籽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。

第四十一条 菜籽油运达仓库时，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，由仓库妥善保管。

入库菜籽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。

第四十二条 对检验合格的菜籽油，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。

转基因菜籽油应当与非转基因菜籽油分罐储存。入库客户未在交割预报单中注明菜籽油是否转基因产品，导致转基因菜籽油和非转基因菜籽油混罐储存的，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。

菜籽油储油罐必须符合国家卫生标准规定。

第四十三条 货主应当保证入库菜籽油符合国家卫生标准。混罐储存的菜籽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。

第四十四条 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）掺伪的菜籽油；
- （二）菜籽油运输工具不符合国家规定；
- （三）入库菜籽油不符合交易所其他交割规定的。

第六节 早籼稻入库

第四十五条 货物重量验收采取在仓库内整车过地磅方式进行。

第四十六条 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。

第四十七条 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。

第四十八条 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。

第四十九条 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。

第七节 甲醇入库

第五十条 甲醇运输必须符合国家关于危险化学品运输的规定。

第五十一条 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》。

第五十二条 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。

第五十三条 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。

第五十四条 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。

第五章 标准仓单注册

第一节 仓库仓单注册

第五十五条 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。

第五十六条 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。

第五十七条 自交割月最后交易日（白糖、菜籽油为第 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。

第二节 厂库仓单注册

第五十八条 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。

第五十九条 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。

第六十条 厂库最迟应当在合约交割月第七个交易日下午 3 时前提交仓单注册申请。对于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。

第六十一条 单个厂库允许注册仓单的最大数量，由交易所确定和调整。

第六十二条 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

第六十三条 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。

硬麦：N 年注册的仓单，在 N+1 年的 7 月份合约贴水 30 元/吨，9 月份合约贴水 60 元/吨。N+1 年 9 月合约交割结束后，于当月最后一个工作日前（含该日），N 年注册的仓单必须全部注销。

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）。

菜籽油：N 年 6 月 1 日起注册的菜籽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）。

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

第六十四条 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

第六十五条 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。

第六十六条 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。

第六十七条 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。一号棉期货合约的最后交易日，交易所不办理一号棉标准仓单转让业务。

第六十八条 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

第六十九条 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。

第七十条 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。

第七十一条 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。

第七十二条 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

第七十三条 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。

第七十四条 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

第七十五条 仓单普麦、强麦出库时，数量发生损耗（水分除外）造成短少的，交割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。

第七十六条 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

第七十七条 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。

第七十八条 因自然变异导致标准仓单主体品级或结算品级与注

册时相比出现下降或者无主体品级的，仍可正常办理出库手续，客户不得拒绝接货。

因自然变异造成主体品级或结算品级下降未超过一个品级的，由货主承担。仓库承担变异超过一个品级以上部分的品级差价，差价的计算根据交易所规定的品级之间升贴水标准执行；降至五级以下部分的品级之间的差价按 800 元/吨执行。

因自然变异造成无主体品级的，将各品级所占比例从高品级起依次降级累计，直至累计比例大于等于 80%为止，以累计终止的品级为结算品级，同时参照本条前款规定按此品级确定仓库和货主的权利和义务。

《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。

第七十九条 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

第八十条 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。

第八十一条 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

第八十二条 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。

第八十三条 出库时按照先进先出的原则出库。

第五节 菜籽油出库

第八十四条 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）之前菜籽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。

第六节 早籼稻出库

第八十五条 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》开具日之前（含当日）早籼稻期货最近交割月最高交割结算价核算短少商品价款，赔偿货主。

第七节 甲醇出库

第八十六条 出库时甲醇不符合交割质量标准的，仓库承担赔偿责任。

第八十七条 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。

第十章 厂库交割商品出库

第八十八条 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。

第八十九条 货主与厂库办妥提货手续之日起，甲醇、玻璃 3 个日历日内开始发货，厂库与货主另有约定的除外。货主可自行到库提货或委托厂库代为发运。

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。

第九十条 交割商品出库验收按照以下规定执行：

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。玻璃出库重量按标准厚度折算。

甲醇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。

玻璃每次提货（指一张提货单）的溢出数量不超过一个包装单位（架），溢出重量由双方自行结算，结算价格参考最近交割月交割结算价。

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。

质量验收：甲醇出库时，厂库应在提货人监督下在罐内或管道出口进行抽样，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。

玻璃出库时厂库向货主提供《质量合格证书》。

厂库须保证期货商品的质量符合交易所规定的交割标准。

第九十一条 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。

第九十二条 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。

第九十三条 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。甲醇、玻璃滞纳金=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，交易所可动用厂库工具的银行履约保函、现金或交易所认可的其他支付保证方式予以清偿。

第九十四条 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

第九十五条 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。

第九十六条 白糖、PTA复检机构为原检验机构；

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；

菜籽油和早籼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。

第九十七条 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。

第九十八条 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。

第九十九条 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。

第一百零一条 复检仅限于复检申请方提出的有异议的项目。

菜籽油复检项目限于酸值、过氧化值、溶剂残留量和掺伪。

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。

第一百零二条 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。

第一百零三条 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。

第一百零四条 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。

第一百零五条 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。

第一百零六条 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

第一百零七条 货主对交割商品重量、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，应在货物出库前提出。

甲醇质量异议，应在货物出库之日起 5 个工作日内提出，玻璃质量异议应在货物出库前提出。

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。

第一百零八条 复检仅限于复检申请方提出的有异议的项目。

甲醇复检样品仅限于保留样品。

复检由质检机构进行。玻璃复检对象为申请方提出质量异议的对应货物。复检机构由交易所指定并公告。

复检结果为解决争议的依据。

第一百零九条 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

第一百一十条 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。

第一百一十一条 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。

第一百一十二条 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。

第一百一十三条 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。

第一百一十四条 厂库发货完毕，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

第一百一十五条 本办法解释权属于郑州商品交易所。

第一百一十六条 本办法自 2012 年 9 月 3 日起施行。

附件 4:

《郑州商品交易所标准仓单管理办法》

修改条文

（郑州商品交易所第五届理事会：2008 年 1 月 7 日审议通过，自 2008 年 1 月 15 日起施行；2009 年 3 月 28 日修订，自 2009 年 4 月 20 日起施行；2012 年 8 月 14 日修订，自 2012 年 9 月 3 日起施行）

说明：由于本次《郑州商品交易所标准仓单管理办法》涉及修改的条文较少，故未全文列出，仅列出修改内容。

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》第五章规定处理。

第十四条 《入库通知单》有效期（公历日）分别为：

… …

（二）白糖每年 ~~12~~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交割仓库为 15 天（公历日）；其他时间和其他地区交割仓库为 40 天。

第三十一条 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》~~《卫生许可证》~~、《产品合格证》~~《食品生产许可证》~~、生产厂家营业执照（复印件）~~生产厂家检验报告等~~。

第三十七条 PTA 质量检验按每 ~~300~~550 吨一个样品扦取；不足 ~~300~~550 吨的按 ~~300~~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交割仓库。

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；货主向交易所和交割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。

第四十七条 入库检验样品由交割仓库在卸货前抽取，检验结果不符合交割质量标准的不允许~~入库~~注册。

~~入库过程中发现不符合交割质量标准的部分不允许入库。~~

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

附件 5:

郑州商品交易所违规处理办法

(郑州商品交易所第五届理事会: 2008 年 1 月 7 日审议通过, 自 2008 年 1 月 15 日起施行; 2009 年 3 月 28 日修订, 自 2009 年 4 月 20 日起施行; 2012 年 8 月 14 日修订, 自 2012 年 9 月 3 日起施行)

第一章 总 则

第一条 为加强期货市场管理, 规范期货交易行为, 保障期货市场参与者的合法权益, 根据《郑州商品交易所章程》、《郑州商品交易所交易规则》的有关规定, 制定本办法。

第二条 本办法所称违规行为是指会员、客户、交割仓库(交割厂库)及期货市场其他参与者违反郑州商品交易所(以下简称交易所)章程、交易规则及其他有关规定的行为。

第三条 交易所根据公平、公正的原则, 以事实为依据, 对违规行为进行调查、认定和纪律处分。

违规行为构成犯罪的, 移交司法机关, 依法追究刑事责任。

第四条 会员、客户、交割仓库及期货市场其他参与者违规行为已受到中国证监会处罚的, 交易所在决定纪律处分时可免除或减轻纪律处分。

第五条 从事交易所期货交易相关业务活动适用本办法。

第二章 稽 查

第六条 稽查是指交易所根据交易所的各项规章制度, 对会员、客

户、交割仓库及期货市场其他参与者的业务活动进行的监督和检查。

稽查包括日常稽查和立案调查。

第七条 交易所履行监管职责时，可行使下列职权：

（一）查阅、复制与期货交易有关的信息、资料；
（二）对会员、客户、交割仓库等单位 and 人员进行调查、取证；
（三）要求会员、客户、交割仓库等被调查者申报、陈述、解释、说明有关情况；

（四）制止、纠正、处理违规行为；

（五）交易所履行监管职责所必须的其他职权。

第八条 会员、客户、交割仓库及期货市场其他参与者应自觉接受交易所的监督。

第九条 交易所设立投诉、举报电话。投诉、举报人应身份真实、明确；投诉、举报人不愿公开其身份的，交易所为其保密。

第十条 对日常稽查工作中发现的、投诉举报的、期货监管部门和司法机关等单位移交的或其他途径获得的线索进行审查后，认为有违规行为发生的，交易所应予以立案调查。

第十一条 对已立案的期货违规案件，交易所应指定专人负责调查。

调查取证应当由两名以上调查人员参加，并出示本人工作证或交易所的证明文件。

第十二条 调查人员认为自己与本案有利害关系或者其他可能影响案件公正处理的，应当申请回避。

被调查人员认为调查人员与本案有关、可能影响公正办案的，有

权申请有关人员回避。

交易所认为调查人员应当回避的，指令其回避。

调查人员的回避由交易所主办部门负责人决定。主办部门负责人的回避由交易所总经理决定。

第十三条 证据包括书证、物证、当事人陈述、证人证言、调查笔录、鉴定结论、视听材料、电子记录等能够证明案件真实情况的一切材料。

证据应当调查核实才能作为定案的根据。

第十四条 询问被调查人应当制作调查笔录。调查笔录应当交被调查人核对，核对无误后，被调查人和调查人员应当在笔录上签名。被调查人拒绝签名的，调查人员应当注明原因。

书证、物证的提取应当制作提取笔录，注明提取的时间和地点，并由被调查人签名。被调查人拒绝或者无法签名的，由见证人签名。

视听资料、电子记录的收集应当注明收集或制作的时间、地点、方式、使用的设备及保存的条件，并由被调查人或见证人签名。

鉴定结论应当由中国证监会或交易所认定的有权鉴定单位做出，并由鉴定单位和鉴定人盖章签字。

第十五条 调查人员在日常稽查和立案调查过程中应严格遵守保密制度，不得滥用职权。对违反规定的，交易所根据不同情节给予相应的处分。

第十六条 会员、客户和交割仓库涉嫌重大违规，经交易所立案调查的，在确认违规行为之前，为防止违规行为后果进一步扩大，交易所可对其采取下列限制性措施：

- (一) 限期说明情况；
- (二) 暂停登录新的客户编码；
- (三) 限制出入金；
- (四) 限制开、平仓；
- (五) 限制交割仓库的交割业务；
- (六) 降低持仓限量或标准仓单持有限量；
- (七) 调高保证金比例；
- (八) 限期平仓、暂停平仓、强行平仓。

第三章 违规处理

第十七条 有多种违规行为的，分别定性，数罚并用。多次违规的，从重或加重纪律处分。

第十八条 期货公司会员具有下列违反经纪业务资格管理规定行为之一的，责令改正，没收违规所得。根据情节轻重给予警告、通报批评、公开谴责、强行平仓、暂停开仓交易 1 至 12 个月、取消会员资格的纪律处分；没有违规所得或者违规所得 5 万元以下的，可并处 5 至 25 万元的罚款；违规所得 5 万元以上的，可并处违规所得一倍以上五倍以下的罚款：

- (一) 以欺诈手段获取从事期货经纪业务资格的；
- (二) 擅自设立从事期货经纪业务分支机构的；
- (三) 聘用未取得期货从业人员资格和未经交易所培训合格的人员从事经纪业务的；
- (四) 其他违反中国证监会及交易所对交易所会员经纪业务资格

管理规定的行为。

第十九条 期货公司会员具有下列违反经纪业务管理规定行为之一的，责令改正，没收违规所得。情节较轻的，给予警告，可并处1至10万元的罚款；情节严重的，给予通报批评、公开谴责、强行平仓、暂停开仓交易1至12个月、取消会员资格、宣布为“市场禁止进入者”；没有违规所得或违规所得10万元以下的，可并处10至50万元的罚款；违规所得10万元以上的，可并处违规所得一倍以上五倍以下的罚款：

（一）为未履行开户手续或未按规定履行开户手续的客户进行期货交易；

（二）违反交易编码管理制度的；

（三）未按规定履行审核义务，为不符合开户条件的客户办理开户手续的；

（四）未如实向客户说明期货交易的风险或不签署风险声明书的；

（五）向客户作获利保证或与客户私下约定分享赢利或共担风险损失的；

（六）利用客户账户名义为自己或他人交易的；

（七）未按客户的委托事项进行交易，故意阻止、延误或改变客户下单指令，诱导、强制客户按自己的意志进行交易的；

（八）场外交易、私下对冲的；

（九）未将自有资金与客户资金分户存放的；

（十）无正当理由拖延客户出金的；

（十一）允许客户在保证金不足时开仓交易的；

- (十二)挪用或擅自允许他人挪用客户资金或套用不同账户资金的;
- (十三)故意制造和散布虚假的或容易使人误解的信息进行误导的;
- (十四)泄露客户委托事项或其他交易秘密的;
- (十五) 出市代表接受本单位以外的其他单位和个人的委托指令进行交易的;
- (十六) 未按规定向客户提供有关成交结果、资金结算报表的;
- (十七) 其他违反中国证监会和交易所对经纪业务管理规定的行为。

交易所可给予责任人暂停从事交易所期货业务 1 个月以内的纪律处分,情节严重的,给予责任人通报批评、公开谴责、暂停从事交易所期货业务 1 至 6 个月或取消其从事交易所期货业务资格的纪律处分。

第二十条 会员有下列行为之一的,责令改正,给予警告、暂停开仓交易 1 至 12 个月的纪律处分;情节严重的,给予通报批评、公开谴责、取消会员资格的纪律处分:

(一) 会员法定代表人、经营范围、注册地等变更后未履行报告义务的;

(二) 未按规定的期限要求向交易所报送财务报表等有关材料的;

(三) 未按大户报告制度向交易所履行申报义务,或作虚假报告、隐瞒不报的;

(四) 未协助交易所对其客户采取限制性措施或其他监管措施的;

- (五) 未按交易所规定及时缴纳年会费等有关费用的；
- (六) 不按规定保管有关交易、结算、财务、会计等资料的；
- (七) 伪造、变造、买卖各种凭证或审批文件的；
- (八) 非经纪会员从事经纪业务或经纪会员从事自营业务的；
- (九) 假借期货交易之名从事非法活动的。

第二十一条 会员有下列情况之一的, 取消会员资格:

(一) 被中国证监会吊销期货经纪业务许可证或被中国证监会宣布为“市场禁止进入者”的；

(二) 私下转让会员席位, 将席位委托给他人管理或承包给他人经营的；

(三) 资金、人员和设备严重不足, 管理混乱, 经整顿无效的；

(四) 拒不执行会员大会或理事会决议的；

(五) 无正当理由连续三个月不做交易的；

(六) 其他违反国家法律、法规、规章和严重违反交易所章程及有关规定的。

第二十二条 会员无正当理由未在规定期限内执行强行平仓的, 给予警告、通报批评、公开谴责、暂停部分期货业务、暂停开仓交易 1 至 12 个月的纪律处分, 可并处 5 万元以下的罚款。

第二十三条 会员具有下列违反交易所结算管理规定行为之一的, 责令改正, 可给予警告; 情节严重的, 给予通报批评、公开谴责、暂停部分期货业务、暂停开仓交易 1 至 12 个月的纪律处分, 可并处 1 至 20 万元的罚款:

(一) 会员未按时足额缴纳保证金的;

(二) 结算报告书、交易月报表和其他结算文件资料作不真实记载的;

(三) 对客户保证金未进行分帐管理的;

(四) 未对客户实行每日结算的;

(五) 伪造、变造交易记录、会计报表、帐册的;

(六) 开具空头支票、虚开增值税发票及其他伪造票证的。

第二十四条 交易所对会员(客户)套期保值申报过程中协助提供或出具虚假材料以及违反交易所其他规定的,除取消其套期保值申请资格外,可并处不超过其持有的虚假套期保值持仓总金额 5%的罚款,并视情节轻重,给予警告、通报批评、公开谴责、暂停部分期货业务、强行平仓、没收违规所得、取消会员资格、宣布为“市场禁止进入者”的纪律处分。

第二十五条 会员或客户违反交易所持仓管理规定的,给予强行平仓、警告、通报批评、公开谴责、暂停部分期货业务的纪律处分。

第二十六条 会员具有下列违反交易所信息和计算机通讯等设备管理规定行为之一的,责令改正,赔偿经济损失。情节较轻的,给予警告、暂停开仓交易 1 个月以内的纪律处分,可并处 1 至 5 万元的罚款;情节严重的,给予通报批评、公开谴责、暂停开仓交易 1 至 12 个月、取消会员资格的纪律处分,可并处 5 至 20 万元的罚款:

(一) 未经交易所许可,擅自发布交易所信息的;

(二) 擅自动用其他会员席位上的计算机或通讯设备的;

(三) 通过交易席位非法窃取其他会员的成交、结算资金等商业秘密或破坏交易系统的;

(四) 通过标准仓单管理系统非法窃取其他会员或客户仓单信息等商业秘密或破坏标准仓单管理系统的。

交易所可给予责任人暂停从事交易所期货业务 1 个月以内的纪律处分；情节严重的，给予责任人通报批评、公开谴责、暂停从事交易所期货业务 1 至 6 个月或取消其从事交易所期货业务资格的纪律处分。

客户有本条第一款第（四）项行为的，责令改正，给予警告、赔偿经济损失、公开谴责的纪律处分；情节严重的，给予通报批评、公开谴责，可以并处暂停交易 1 至 12 个月，直至宣布为“市场禁止进入者”的纪律处分。

第二十七条 会员从事标准仓单交易时，违反交易所规定的，交易所将对其处以警告、罚款 1 至 10 万元、暂停其从事标准仓单交易的纪律处分，情节严重的，给予通报批评、公开谴责，直至取消其会员资格的纪律处分。

第二十八条 期货市场参与者具有下列违反期货业务管理规定行为之一的，责令改正，没收违规所得。根据情节较轻重的，给予警告、强行平仓、暂停开仓交易 1 至 12 个月、取消会员资格、宣布为“市场禁止进入者”的纪律处分；没有违规所得或者违规所得 10 万元以下的，可并处 1 至 10 万元的罚款；违规所得 10 万元以上的，可并处违规所得一倍以上三倍以下的罚款：

(一) 单独或者合谋，集中资金优势、持仓优势或者利用信息优势，连续或者联合买卖合约，影响期货交易价格或者期货交易量的；

(二) 利用移仓、分仓、对敲等手段，规避交易所的持仓限制，超

量持仓，控制或企图控制市场价格，影响市场秩序的；

（三）利用移仓、分仓、对敲等手段，影响期货成交价格、转移资金或者牟取不当利益的；

（四）不以成交为目的或明知申报的指令不能成交，仍恶意或连续输入交易指令企图影响或者企图影响期货成交价格，扰乱市场秩序或转移资金的；

（五）以自己为交易对象，连续买卖或者自我买卖，影响或者企图影响期货成交价格或者期货交易量的；

（六）期货交易内幕信息的知情人或者非法获取期货交易内幕信息的人，在对期货成交价格有重大影响的信息尚未公开前，利用内幕信息或国家机密进行期货交易或者向他人泄露内幕信息，使他人利用内幕信息进行期货交易的；

（七）以垄断、囤积标的物 and 不当集中持仓量的方式，控制交易所大量交割仓库标准仓单，以及通过各种手段虚占交割仓库库容的；

（八）以操纵市场为目的，用直接或间接的方法操纵或扰乱交易秩序，妨碍或有损于公正交易，有损于国家利益和社会公众利益的；

（九）以非善意的期货转现货行为，影响期货市场秩序的；

（十）未按要求使用交易所标准仓单管理系统，影响系统正常运作的；

（十一）未遵守交易所风险警示有关要求或整改要求的；

（十二）其他违反中国证监会和交易所有关交易管理规定的。

本条所称对敲是指单独或者蓄意串通、按照事先约定的时间、价格和方式进行相互交易的行为。

第二十九条 期货市场参与者有下列行为之一的，交易所可以调整当日结算价：

（一）期货市场参与者以自己为交易对象，自买自卖期货合约，影响期货交易价格的；

（二）其他违规行为导致交易价格异常波动或者瞬间大幅度偏离市场价格的。

第三十条 经交易所立案调查，发现期货市场参与者有下列行为之一的，及时报告中国证监会，提请立案稽查：

（一）操纵市场等违法行为，情节严重的；

（二）利用自成交、对敲交易影响交割结算价，情节严重的；

（三）盗取他人交易密码进行期货交易的；

（四）其他涉嫌违法犯罪的行为。报告中国证监会后，不影响交易所对上述违规行为采取暂停开仓交易等限制性措施。

第三十一条 出市代表具有下列行为之一的，给予警告纪律处分；情节严重的，给予通报批评、公开谴责、暂停出市交易 1 至 12 个月或取消出市代表资格的纪律处分，可并处 1 千元至 1 万元的罚款：

（一）违反交易所有关交易大厅管理规定的；

（二）未按规定程序操作，给交易系统造成损害的；

（三）随意拆卸、搬动交易厅内各种设备或私接电话和其他设备的；

（四）采取虚假、欺骗和不正当手段骗取出市代表资格的；

（五）伪造、涂改、借用出市代表证件的。

具有本条第（二）、（三）项行为之一造成损害的，由其委派会员

承担赔偿责任。

第三十二条 结算交割员具有下列行为之一的，给予警告纪律处分；情节严重的，给予通报批评、公开谴责、暂停结算交割员资格1个月以内或取消结算交割员资格的纪律处分，可并处1千元至1万元的罚款：

- （一）采取虚假、欺骗和不正当手段骗取结算交割员资格的；
- （二）伪造、变造、借用《结算交割员证》的。

第三十三条 交割仓库及其直接负责的主管人员和其他直接责任人员有下列行为之一的，责令改正，没收违规所得。情节较轻的，给予警告，可并处1至10万元的罚款，对直接负责的主管人员和其他直接责任人员给予通报批评、暂停从事本交易所期货业务1个月以内的纪律处分，可并处1至5万元的罚款；情节严重的，给予通报批评、公开谴责、暂停交割业务、取消其交割仓库资格、宣布为“市场禁止进入者”的纪律处分，没有违规所得或违规所得10万元以下的，可并处10至50万元的罚款；违规所得10万元以上的，可并处违规所得一倍以上五倍以下的罚款，对直接负责的主管人员和其他直接责任人员给予暂停从事本交易所期货业务1至6个月、宣布为‘市场禁止进入者’的纪律处分，可并处5至20万元的罚款：

- （一）违反国家有关规定参与期货交易的；
- （二）出具虚假仓单的；
- （三）盗卖交割商品的；
- （四）泄露与期货有关不宜公开的仓储信息或散布虚假信息误导市场的；

- (五) 与会员或客户联手，影响或企图影响期货市场价格的；
- (六) 标准仓单所示商品中有牌号、商标、规格、质量等混杂的；
- (七) 交割商品与单证不符的；
- (八) 交割商品没有或缺少规定证明文件的；
- (九) 交割商品的捆数、块数、包装要求和交易所规定不符的；
- (十) 未完成规定的检验项目而开具仓单的；
- (十一) 错收错发的；
- (十二) 因保管不当，引起储存商品变质、灭失的；
- (十三) 在搬运、装卸、堆码等作业过程中造成包装和商品损坏的；
- (十四) 商品交割中滥行收费的；
- (十五) 蓄意刁难，造成卖方或买方违约的；
- (十六) 违反期货交割业务规则，限制、故意拖延交割商品的入库、出库的；
- (十七) 拒绝、阻挠交易所依法监督检查的；
- (十八) 其他违反中国证监会和交易所规定的行为。

第三十四条 会员在实物交割环节上蓄意违约，影响或企图影响实物交割的正常进行，牟取非法利益的，交易所视情节轻重对违约会员可给予警告、通报批评、公开谴责、暂停开仓交易 1 至 12 个月的纪律处分，有违约所得的，没收违约所得，可并处违约部分合约价值 10%至 30%的罚款。

第三十五条 指定期货保证金存管银行（以下简称存管银行）未履行《郑州商品交易所结算细则》中有关存管银行义务的，交易所对

其处以责令改正、警告、通报批评、公开谴责、暂停部分期货业务直至取消其存管银行资格。

第三十四六条 会员或客户以各种手段扰乱交易管理秩序的,给予警告、暂停开仓交易 1 个月以内的纪律处分,对直接责任人员给予暂停从事本交易所期货业务 1 个月以内的纪律处分;情节严重的,给予通报批评、公开谴责、暂停开仓交易 1 至 6 个月、取消会员资格、宣布为“市场禁止进入者”,对直接责任人暂停从事本交易所期货业务 1 至 6 个月、宣布为“市场禁止进入者”的纪律处分。

第三十七条 被交易所宣布为“市场禁止进入者”的,自宣布生效之日起 20 个交易日内清理原有持仓,了结交易业务,结清债权债务。

被中国证监会或其他期货交易所宣布为“市场禁止进入者”的,在市场禁入期限内不得从事本交易所期货业务。

第三十六八条 会员或客户有下列行为之一的,责令改正,给予通报批评、暂停开仓交易 12 个月以内的纪律处分,可并处 1 至 20 万元的罚款:

- (一) 拒不配合交易所常规检查、立案调查的;
- (二) 拒不执行交易所处理决定的;
- (二) 进行虚假性、误导性或者遗漏重要事实的申报、陈述、解释或者说明的;
- (三) 提供虚假的文件、资料或者信息的;
- (四) 不执行交易所限制性措施或者其他监管措施的。

第三十九条 会员或客户违反期转现规定,弄虚作假的,比照本

办法第二十七条给予纪律处分。

第四十条 会员或客户具有重大违规违约行为嫌疑或者违规违约行为可能或已经产生相应影响的，交易所可以对其采取以下自律监管措施：

- （一）口头警示；
- （二）出具警示函；
- （三）监管谈话；
- （四）要求公开说明；
- （五）要求参加培训；
- （六）要求定期报告；
- （七）要求提交书面承诺；
- （八）要求增加内部合规检查的次数；
- （九）要求聘请中介机构核查并发表意见；
- （十）要求处分有关人员；
- （十一）上报中国证监会；
- （十二）交易所交易规则及其实施细则规定的其他自律监管措施。

第四十一条 交易所工作人员违反有关规定的，按国家法律、法规和交易所人事管理制度及有关廉政规定处理。

第四十二条 司法机关、行政执法机关根据生效法律文书要求交易所协助冻结、划拨非期货公司会员在交易所专用结算账户资金的，非期货公司会员结算准备金超过现有持仓合约三个停板以外部分的，交易所根据生效法律文书予以协助；无法冻结、划拨期货公司会员在

交易所专用结算账户资金的，交易所应当向司法机关、行政执法机关说明无法协助执行的原因。

第四章 裁决与执行

第四十三条 交易所作出取消会员资格、宣布为“市场禁止进入者”的纪律处分应当由交易所理事会决定。

第四十四条 交易所对违规行为核查后，事实清楚、证据确凿的，依照交易所章程、交易规则及本办法规定予以裁决。

第四十五条 交易所作出裁决应制作处理决定书。
处理决定书主要包括以下内容：

- （一）当事人的姓名或者名称、住所；
- （二）违规事实和证据；
- （三）纪律处分种类和依据；
- （四）纪律处分的履行方式和期限；
- （五）不服纪律处分决定申请复议途径和期限；
- （六）作出处理决定的日期。

第四十六条 交易所应将处理决定书送达当事人。当事人为会员的，处理决定书送至交易席位视为送达；当事人为非会员的，可邮寄送达。邮件寄出后，市内 2 日、市外 5 日视为送达。邮寄地址以交易所留存地址为准。处理决定书同时分送有关协助执行部门。

按照中国证监会的规定需要抄报违规处理情况的，同时抄报中国证监会。

第四十七条 交易所作出的处理决定书自送达之日起生效。

当事人对处理决定书不服的，可于决定书生效之日起 10 日内向交易所书面申请复议一次，复议期间不停止决定的执行。

第四十八条 交易所应于收到复议申请书之日起一个月内作出复议决定，复议决定为终局决定。

第四十九条 经交易所作出处理决定承担履行义务的会员拒绝履行义务的，由交易所强制执行。

第五十条 违规处理决定中，具有罚没款项的，当事人应在处理决定书生效之日起 5 日内将罚没款项如数缴纳至交易所指定账户。逾期不付罚没款项的，交易所从会员专用资金账户中划付。对会员工作人员的罚没款项，由会员代缴。

会员应当配合执行交易所对客户的纪律处分，划拨客户在该会员处的资金。

第五十一条 违规处理决定中，具有罚没款项的，受纪律处分的交割仓库应在处理决定书生效之日起 5 日内将罚没款项缴纳至交易所指定账户；对交割仓库工作人员的罚没款项，由交割仓库代缴。逾期不缴的，交易所从该交割仓库交割担保金中划转。

第五章 纠纷调解

第五十二条 会员、客户、交割仓库之间发生的期货交易纠纷可自行协商解决，也可提请交易所调解。

第五十三条 交易所的调解机构是交易所理事会下设的调解委员会，其常设办事机构设在交易所法律事务部。

第五十四条 调解应在事实清楚、责任明确的基础上依据国家有

关期货交易的法律、法规和交易所的规章制度进行。

第五十五条 当事人向调解委员会提出调解申请，应当从其知道或应当知道其合法权益被侵害之日起 30 日内提出。

第五十六条 当事人申请调解应当符合下列条件：

- （一）有调解申请书；
- （二）有具体的事实、理由和请求；
- （三）属于调解委员会的受理范围。

第五十七条 当事人向调解委员会申请调解，必须提交书面申请和有关材料。

调解申请书应当写明以下事项：

- （一）当事人的姓名、性别、年龄、职业、工作单位和住所，或单位名称、住所和法定代表人或者负责人的姓名、职务；
- （二）请求调解的事实、理由及要求；
- （三）有关证据。

第五十八条 交易所调解委员会收到调解申请后，应当认真审查有关材料是否符合要求，并于 5 个工作日内以书面方式通知当事人是否受理。

第五十九条 有下列情形之一的，交易所调解委员会不予受理：

- （一）当事人已向人民法院起诉的；
- （二）当事人已向仲裁机构申请仲裁的；
- （三）当事人一方要求调解，另一方不愿意调解的；
- （四）交易所调解委员会认定不予受理的其他情形。

第六十条 交易所调解委员会应当自受理调解申请之日起 30 日

内完成调解。情况复杂，不能在规定期限内完成调解的，经双方当事人同意后，可以继续调解；双方当事人未达成继续调解事宜的，终止调解。

第六十一条 当事人根据有关规定负有举证的责任。调解委员会认为必要时，可调查收集证据。

第六十二条 调解委员会调解纠纷，应当在查明事实，分清是非和自愿的基础上调解，促使当事人相互谅解，达成协议。

第六十三条 经调解达成的协议应记录在案，并制作调解书，由双方当事人签字，调解员署名，加盖调解委员会印章后生效。

第六十四条 调解书应当写明以下内容：

（一）双方当事人的名称、住所、法定代表人或者负责人的姓名及职务；

（二）争议的事项和请求；

（三）协议结果。

第六十五条 调解委员会应当在受理调解后 30 天内结案，到期未结案的调解委员会应当向当事人说明理由。双方当事人要求继续调解的，调解委员会应继续调解。有一方要求终止调解的，应当终止调解。

第六十六条 调解不成的，当事人可以依法提请仲裁机构仲裁或向人民法院起诉。

附 则

第六十七条 本办法解释权属于郑州商品交易所。

第六十八条 本办法所称“以上”、“以下”均含本数。

第六十九条 本办法自 2012 年 9 月 3 日起施行。

附件 6:

《郑州商品交易所违规处理办法》

(修订案)

(郑州商品交易所第五届理事会: 2008 年 1 月 7 日审议通过, 自 2008 年 1 月 15 日起施行; 2009 年 3 月 28 日修订, 自 2009 年 4 月 20 日起施行; 2012 年 8 月 14 日修订, 自 2012 年 9 月 3 日起施行)

说明: 带删除线的为本次删去内容, 下划线及阴影为新修改内容。

第一章 总 则

第一条 为加强期货市场管理, 规范期货交易行为, 保障期货市场参与者的合法权益, 根据《郑州商品交易所章程》、《郑州商品交易所交易规则》的有关规定, 制定本办法。

第二条 本办法所称违规行为是指会员、客户、交割仓库(交割厂库)及期货市场相关其他参与者违反郑州商品交易所(以下简称交易所)章程、交易规则及其他有关规定的行为。

【说明】根据交易所业务规则变化情况及规范用语要求, 对相应内容进行完善。

第三条 交易所根据公平、公正的原则, 以事实为依据, 对违规行为进行调查、认定和处罚纪律处分。

违规行为构成犯罪的, 移交司法机关, 依法追究刑事责任。

第四条 会员、客户、交割仓库及期货市场相关其他参与者违规行为已受到中国证监会处罚的, 交易所在决定处罚纪律处分时可免除

或减轻处罚纪律处分。

第五条 从事交易所期货交易相关业务活动适用本办法。

第二章 稽 查

第六条 稽查是指交易所根据交易所的各项规章制度，对会员、客户、交割仓库及期货市场相关其他参与者的业务活动进行的监督和检查。

稽查包括日常稽查和立案调查。

第七条 交易所履行监管职责时，可行使下列职权：

- （一）查阅、复制与期货交易有关的信息、资料；
- （二）对会员、客户、交割仓库等单位 and 人员进行调查、取证；
- （三）要求会员、客户、交割仓库等被调查者申报、陈述、解释、说明有关情况；
- （四）制止、纠正、处理违规行为；
- （五）交易所履行监管职责所必须的其他职权。

第八条 会员、客户、交割仓库及期货市场相关其他参与者应自觉接受交易所的监督。

第九条 交易所设立投诉、举报电话。投诉、举报人应身份真实、明确；投诉、举报人不愿公开其身份的，交易所为其保密。

第十条 对日常稽查工作中发现的、投诉举报的、期货监管部门和司法机关等单位移交的或其他途径获得的线索进行审查后，认为有违规行为发生的，交易所应予以立案调查。

第十一条 对已立案的期货违规案件，交易所应指定专人负责调

查。

调查取证应当由两名以上调查人员参加，并出示本人工作证或交易所的证明文件。

第十二条 调查人员认为自己与本案有利害关系或者其他可能影响案件公正处理的，应当申请回避。

被调查人员认为调查人员与本案有关、可能影响公正办案的，有权申请有关人员回避。

交易所认为调查人员应当回避的，指令其回避。

调查人员的回避由交易所主办部门负责人决定。主办部门负责人的回避由交易所总经理决定。

第十三条 证据包括书证、物证、当事人陈述、证人证言、调查笔录、鉴定结论、视听材料、电子记录等能够证明案件真实情况的一切材料。

证据应当调查核实才能作为定案的根据。

【说明】根据我国相关证据类法律法规，丰富了证据种类。

第十四条 询问被调查人应当制作调查笔录。调查笔录应当交被调查人核对，核对无误后，被调查人和调查人员应当在笔录上签名。被调查人拒绝签名的，调查人员应当注明原因。

书证、物证的提取应当制作提取笔录，注明提取的时间和地点，并由被调查人签名。被调查人拒绝或者无法签名的，由见证人签名。

视听资料、电子记录的收集应当注明收集或制作的时间、地点、方式、使用的设备及保存的条件，并由被调查人或见证人签名。

鉴定结论~~必须~~应当由中国证监会或交易所认定的有权鉴定单位

做出，并由签定单位和鉴定人盖章签字。

【说明】根据我国证据类法律法规及交易所工作经验，完善了证据收集程序。

第十五条 调查人员在日常稽查和立案调查过程中应严格遵守保密制度，不得滥用职权。对违反规定的，交易所根据不同情节给予相应的处分。

第十六条 会员、客户和交割仓库涉嫌重大违规，经交易所立案调查的，在确认违规行为之前，为防止违规行为后果进一步扩大，交易所可对其采取下列限制性措施：

- （一）限期说明情况；
- （二）暂停登录新的客户编码；
- （三）限制出入金；
- （四）限制开新、平仓；
- （五）限制交割仓库的交割业务；
- （六）降低持仓限量或标准仓单持有限量；
- （七）调高保证金比例；
- （八）限期平仓、暂停平仓、强行平仓。

~~采取前款（五）至（八）项措施须经交易所理事会决定。~~

【说明】首先，鉴于五至八项为临时性限制措施，这些措施的决策与实施具有很强的实时性要求，因此不宜由理事会根据常规程序进行较为缓慢的非实时性决策；其次，将相应内容删去，不由理事会行使五至八项权利，也并不导致这些措施一定会由交易所总经理决策行使；再者，在须采取五至八项措施时，还可以由交易所理事会授权总经理相机行事。

第三章 违规处理

第十七条 有多种违规行为的，分别定性，数罚并用。多次违规的，从重或加重处罚纪律处分。

第十八条 期货公司会员具有下列违反经纪业务资格管理规定行为之一的，责令改正，没收违规所得。根据情节轻重给予警告、通报批评、公开谴责、强行平仓、暂停开仓交易 1 至 6 个月、取消会员资格的处罚纪律处分；没有违规所得或者违规所得 5 万元以下的，可并处 5 至 25 万元的罚款；违规所得 5 万元以上的，可并处违规所得一倍以上五倍以下的罚款：

- （一）以欺诈手段获取从事期货经纪业务资格的；
- （二）擅自设立从事期货经纪业务分支机构的；
- （三）聘用未取得期货从业人员资格和未经交易所培训合格的人员从事经纪业务的；
- （四）其他违反中国证监会及交易所对交易所会员经纪业务资格管理规定的行为。

【说明】根据交易所一线自律管理需要，丰富完善了自律管理措施。

第十九条 期货公司会员具有下列违反经纪业务管理规定行为之一的，责令改正，没收违规所得。情节较轻的，给予警告、通报批评，可并处 1 至 10 万元的罚款；情节严重的，给予通报批评、公开谴责、强行平仓、暂停开仓交易 1 至 6 个月、取消会员资格、宣布为“市场禁止进入者”；没有违规所得或违规所得 10 万元以下的，可并处 10 至 50 万元的罚款；违规所得 10 万元以上的，可并处违规所得

一倍以上五倍以下的罚款：

（一）为未履行开户手续或未按规定履行开户手续的客户进行期货交易；

（二）违反交易编码管理制度的；

（三）未按规定履行审核义务，为不符合开户条件的客户办理开户手续的；

（四）未如实向客户说明期货交易的风险或不签署风险声明书的；

（五）向客户作获利保证或与客户私下约定分享赢利或共担风险损失的；

（六）利用客户账户名义为自己或他人交易的；

（七）未按客户的委托事项进行交易，故意阻止、延误或改变客户下单指令，诱导、强制客户按自己的意志进行交易的；

（八）场外交易、私下对冲的；

（九）未将自有资金与客户资金分户存放的；

（十）无正当理由拖延客户出金的；

（十一）允许客户在保证金不足时开仓交易的；

（十二）挪用或擅自允许他人挪用客户资金或套用不同账户资金的；

（十三）故意制造和散布虚假的或容易使人误解的信息进行误导的；

（十四）泄露客户委托事项或其他交易秘密的；

（十五）入市代表接受本单位以外的其他单位和个人的委托指令进行交易的；

（十六）未按规定向客户提供有关成交结果、资金结算报表的；

（十七）其他违反中国证监会和交易所对经纪业务管理规定的行

为。

交易所可给予责任人暂停从事交易所期货业务 1 个月以内的~~处~~
~~罚~~纪律处分，情节严重的，给予责任人通报批评、公开谴责、暂停从
事交易所期货业务 1 至 6 个月或取消其从事交易所期货业务资格的~~处~~
~~罚~~纪律处分。

第二十条 会员有下列行为之一的，责令改正，给予警告、~~通报~~
~~批评~~、暂停开仓交易 1 至 ~~6~~12 个月的~~处~~~~罚~~纪律处分；情节严重的，~~给~~
~~予~~通报批评、公开谴责、取消会员资格的~~处~~~~罚~~纪律处分：

（一）会员法定代表人、经营范围、注册地等变更后未履行报告
义务的；

（二）未按规定的时间要求向交易所报送财务报表等有关材料
的；

（三）未按大户报告制度向交易所履行申报义务，或作虚假报告、
隐瞒不报的；

（四）未协助交易所对其客户采取限制性措施或其他监管措施
的；

（~~四~~五）未按交易所规定及时缴纳年会费等有关费用的；

（~~五~~六）未按规定保管有关交易、结算、财务、会计等资料的；

（~~六~~七）伪造、~~涂改~~变造、买卖各种凭证或审批文件的；

（~~七~~八）非经纪会员从事经纪业务或经纪会员从事自营业务的；

（~~八~~九）假借期货交易之名从事非法活动的。

第二十一条 会员有下列情况之一的，取消会员资格：

（一）被中国证监会吊销期货经纪业务许可证或被中国证监会宣

布为“市场禁止进入者”的；

(二) 私下转让会员席位, 将席位委托给他人管理或承包给他人经营的；

(三) 资金、人员和设备严重不足, 管理混乱, 经整顿无效的；

(四) 拒不执行会员大会或理事会决议的；

(五) 无正当理由连续三个月不做交易的；

(六) 其他违反国家法律、法规、规章和严重违反交易所章程及有关规定的。

第二十二条 会员无正当理由未在规定期限内执行强行平仓的, 给予警告、通报批评、公开谴责、暂停部分期货业务、暂停开仓交易 1 至 12 个月以内的处罚纪律处分, 可并处 5 万元以下的罚款。

第二十三条 会员具有下列违反交易所结算管理规定行为之一的, 责令改正, 可给予警告; 情节严重的, 给予通报批评、公开谴责、暂停部分期货业务、暂停开仓交易 1 至 12 个月以内的处罚纪律处分, 可并处 1 至 20 万元的罚款:

(一) 会员未按时足额缴纳保证金的;

(二) 结算报告书、交易月报表和其他结算文件资料作不真实记载的;

(三) 对客户保证金未进行分帐管理的;

(四) 未对客户实行每日结算的;

(五) 伪造、变造交易记录、会计报表、帐册的;

(六) 开具空头支票、虚开增值税发票及其他伪造票证的。

第二十四条 交易所对会员(客户)套期保值申报过程中协助提

供或出具虚假材料以及违反交易所其他规定的，除取消其套期保值申请资格外，可并处不超过其持有的虚假套期保值持仓总金额 5%的罚款，并视情节轻重，给予警告、通报批评、公开谴责、暂停部分期货业务、强行平仓、没收违规所得、取消会员资格、宣布为“市场禁止进入者”的~~处罚~~纪律处分。

第二十五条 会员或客户违反交易所持仓管理规定的，给予强行平仓、警告、通报批评、公开谴责、暂停部分期货业务的~~处罚~~纪律处分。

第二十六条 会员具有下列违反交易所信息和计算机通讯等设备管理规定行为之一的，责令改正，赔偿经济损失。情节较轻的，给予警告、暂停开仓交易 1 个月以内的~~处罚~~纪律处分，可并处 1 至 5 万元的罚款；情节严重的，给予通报批评、公开谴责、暂停开仓交易 1 至 6 个月、取消会员资格的~~处罚~~纪律处分，可并处 5 至 20 万元的罚款：

- (一) 未经交易所许可，擅自发布交易所信息的；
- (二) 擅自动用其他会员席位上的计算机或通讯设备的；
- (三) 通过交易席位非法窃取其他会员的成交、结算资金等商业秘密或破坏交易系统的；
- (四) 通过标准仓单管理系统非法窃取其他会员或客户仓单信息等商业秘密或破坏标准仓单管理系统的。

交易所可给予责任人暂停从事交易所期货业务 1 个月以内的~~处罚~~纪律处分；情节严重的，给予责任人通报批评、公开谴责、暂停从事交易所期货业务 1 至 6 个月或取消其从事交易所期货业务资格的~~处罚~~

罚纪律处分。

客户有本条第一款第（四）项行为的，责令改正，给予警告、赔偿经济损失、公开谴责的纪律处分；情节严重的，给予通报批评、公开谴责，可以并处暂停交易 1 至 12 个月，直至宣布为“市场禁止进入者”的纪律处分。

【说明】结合交易所自律管理工作经验，丰富了应受交易所自律管理处分的违规行为及其处理措施类型。

第二十七条 会员从事标准仓单交易时，违反交易所规定的，交易所将对其处以警告、~~通报批评~~、罚款 1 至 10 万元、暂停其从事标准仓单交易的~~处罚~~纪律处分，情节严重的，给予通报批评、公开谴责，~~将直至取消其会员资格的纪律处分~~。

第二十八条 期货市场参与者具有下列违反期货业务管理规定行为之一的，责令改正，没收违规所得。~~根据情节较轻重的，给予警告、强行平仓、暂停开仓交易 1 至 12 个月以内、取消会员资格、宣布为“市场禁止进入者”的处罚~~纪律处分；没有违规所得或者违规所得 510 万元以下的，可并处 51 至 2010 万元的罚款；违规所得 510 万元以上的，可并处违规所得一倍以上三倍以下的罚款；~~情节严重的，给予通报批评、强行平仓、暂停开仓交易 1 至 6 个月、取消会员资格、宣布为“市场禁止进入者”的处罚；没有违规所得或者违规所得 10 万元以下的，可并处 10 至 100 万元的罚款；违规所得 10 万元以上的，可并处违规所得二倍以上五倍以下的罚款：~~

（一）~~通过合谋集中资金，统一指令，联手买卖，操纵市场价格的，~~单独或者合谋，集中资金优势、持仓优势或者利用信息优势，连

续或者联合买卖合约，影响期货交易价格或者期货交易量的；

(二)利用移仓、分仓、对敲等手段，规避交易所的持仓限制，超量持仓，控制或企图控制市场价格，影响市场秩序的；

(三)利用移仓、分仓、对敲等手段，影响期货交易价格、转移资金或者牟取不当利益的；

(~~三~~四)不以成交为目的或明知申报的指令不能成交，仍恶意或连续输入交易指令企图影响或者企图影响期货交易价格，扰乱市场秩序或转移资金的；

(~~四~~五)为制造虚假的市场行情而进行连续买卖、自我买卖或蓄意串通，按事先约定的方式或价格进行交易或互为买卖，制造市场假象，影响或企图影响市场价格或持仓量的；以自己为交易对象，连续买卖或者自我买卖，影响或者企图影响期货交易价格或者期货交易量的；

(~~五~~六)期货交易内幕信息的知情人或者非法获取期货交易内幕信息的人，在对期货交易价格有重大影响的信息尚未公开前，利用内幕信息或国家机密进行期货交易或者向他人泄露内幕信息，使他人利用内幕信息进行期货交易影响期货交易的；

(~~六~~七)以垄断、囤积标的物 and 不当集中持仓量的方式，控制交易所大量交割仓库标准仓单，以及通过各种手段虚占交割仓库库容的；

(~~七~~八)以操纵市场为目的，用直接或间接的方法操纵或扰乱交易秩序，妨碍或有损于公正交易，有损于国家利益和社会公众利益的；

(八十九) ~~参与出具虚假仓单或者违反交易所规定，为出具虚假仓单提供便利的~~以非善意的期货转现货行为，影响期货市场秩序的；

(九十) ~~编造、传播虚假信息诋毁交易所信誉，破坏交易所形象~~的未按要求使用交易所标准仓单管理系统，影响系统正常运作的；

(十一) 未遵守交易所风险警示有关要求或整改要求的；

(十二) 其他违反中国证监会和交易所有关交易管理规定的。

本条所称对敲是指单独或者蓄意串通、按照事先约定的时间、价格和方式进行相互交易的行为。

【说明】结合我国相关法律法规、司法解释及交易所工作经验，丰富完善了应受交易所自律管理处理的市场违规行为及相应处理措施类型。以下两条理由相同。

第二十九条 期货市场参与者有下列行为之一的，交易所可以调整当日结算价：

(一) 期货市场参与者以自己为交易对象，自买自卖期货合约，影响期货交易价格的；

(二) 其他违规行为导致交易价格异常波动或者瞬间大幅度偏离市场价格的。

【说明】

第一，投资者因为对敲或其他违规行为对交易价格造成影响的，就会影响当日结算价格，而结算价格是交易所计算客户盈亏的依据，如果以受影响后的结算价格对投资者进行结算，会影响到所有投资者收益的变化，交易所认为应该对这种行为进行监督和处理。

第二，交易所可以调整当日结算价格的行为在法律上没有禁止。

第三，与上海期货交易所相同。

第三十条 经交易所立案调查，发现期货市场参与者有下列行为之一的，及时报告中国证监会，提请立案稽查：

- (一) 操纵市场等违法行为，情节严重的；
- (二) 利用自成交、对敲交易影响交割结算价，情节严重的；
- (三) 盗取他人交易密码进行期货交易的；
- (四) 其他涉嫌违法犯罪的行为。报告中国证监会后，不影响交易所对上述违规行为采取暂停开仓交易等限制性措施。

【说明】(1) 与上海期货交易所保持一致；(2) 按照监管工作指引，进一步规范工作程序。

~~第二十九~~**三十一条** 出市代表具有下列行为之一的，给予警告处罚纪律处分；情节严重的，给予通报批评、公开谴责、暂停出市交易 1 至 12 个月以内或取消出市代表资格的处罚纪律处分，可并处 1 千元至 1 万元的罚款：

- (一) 违反交易所有关交易大厅管理规定的；
- (二) 未按规定程序操作，给交易系统造成损害的；
- (三) 随意拆卸、搬动交易厅内各种设备或私接电话和其他设备的；
- (四) 采取虚假、欺骗和不正当手段骗取出市代表资格的；
- (五) 伪造、涂改、借用出市代表证件的。

具有本条第(二)、(三)项行为之一造成损害的，由其委派会员承担赔偿责任。

第三十二条 结算交割员具有下列行为之一的，给予警告处罚纪律处分；情节严重的，给予通报批评、公开谴责、暂停结算交割员

资格 1 个月以内或取消结算交割员资格的处罚纪律处分，可并处 1 千元至 1 万元的罚款：

- （一）采取虚假、欺骗和不正当手段骗取结算交割员资格的；
- （二）伪造、涂改变造、借用《结算交割员证》的。

第三十一条 交割仓库及其直接负责的主管人员和其他直接责任人员有下列行为之一的，责令改正，没收违规所得。情节较轻的，给予警告、通报批评，可并处 1 至 10 万元的罚款，对直接负责的主管人员和其他直接责任人员给予通报批评、暂停从事本交易所期货业务 1 个月以内的处罚纪律处分，可并处 1 至 5 万元的罚款；情节严重的，给予通报批评、公开谴责、暂停交割业务、取消其交割仓库资格、宣布为“市场禁止进入者”的纪律处分，没有违规所得或违规所得 10 万元以下的，可并处 10 至 50 万元的罚款；违规所得 10 万元以上的，可并处违规所得一倍以上五倍以下的罚款，对直接负责的主管人员和其他直接责任人员给予暂停从事本交易所期货业务 1 至 6 个月、宣布为“市场禁止进入者”的处罚纪律处分，可并处 5 至 20 万元的罚款：

- （一）违反国家有关规定参与期货交易的；
- （二）出具虚假仓单的；
- （三）盗卖交割商品的；
- （四）泄露与期货有关不宜公开的仓储信息或散布虚假信息误导市场的；
- （五）与会员或客户联手，影响或企图影响期货市场价格的；
- （六）标准仓单所示商品中有牌号、商标、规格、质量等混杂的；

- (七) 交割商品与单证不符的;
- (八) 交割商品没有或缺少规定证明文件的;
- (九) 交割商品的捆数、块数、包装要求和交易所规定不符的;
- (十) 未完成规定的检验项目而开具仓单的;
- (十一) 错收错发的;
- (十二) 因保管不当, 引起储存商品变质、灭失的;
- (十三) 在搬运、装卸、堆码等作业过程中造成包装和商品损坏的;
- (十四) 商品交割中滥行收费的;
- (十五) 蓄意刁难, 造成卖方或买方违约的;
- (十六) 违反期货交割业务规则, 限制、故意拖延交割商品的入库、出库的;
- (十七) 拒绝、阻挠交易所依法监督检查的;
- (十八) 其他违反中国证监会和交易所规定的行为。

第三十二、三十四条 会员在实物交割环节上蓄意违约, 影响或企图影响实物交割的正常进行, 牟取非法利益的, 交易所视情节轻重对违约会员可给予警告、通报批评、公开谴责、暂停开仓交易 1 至 6 12 个月的~~处罚~~纪律处分, 有违约所得的, 没收违约所得, 可并处违约部分合约价值 10%至 30%的罚款。

第三十二、三十五条 指定期货保证金存管银行(以下简称存管银行)未履行《郑州商品交易所结算细则》~~第十一条~~中有关存管银行义务的, 交易所对其处以责令改正、警告、通报批评、公开谴责、暂停部分期货业务直至取消其存管银行资格。

第三十四六条 会员或客户以各种手段扰乱交易管理秩序的,给予警告、~~通报批评~~、暂停开仓交易 1 个月以内的~~处罚~~纪律处分,对直接责任人员给予暂停从事本交易所期货业务 1 个月以内的~~处罚~~纪律处分;情节严重的,给予通报批评、公开谴责、暂停开仓交易 1 至 6 个月、取消会员资格、宣布为“市场禁止进入者”,对直接责任人暂停从事本交易所期货业务 1 至 6 个月、宣布为“市场禁止进入者”的~~处罚~~纪律处分。

第三十五七条 被交易所宣布为“市场禁止进入者”的,自宣布生效之日起 20 个交易日内清理原有持仓,了结交易业务,结清债权债务。

被中国证监会或其他期货交易所宣布为“市场禁止进入者”的,在市场禁入期限内不得从事本交易所期货业务。

第三十六八条 会员或客户~~拒绝、阻挠交易所依法对其交易行为、经纪行为进行监督检查的~~,有下列行为之一的,责令改正,给予通报批评、暂停开仓交易 1 至 12 个月以内的~~处罚~~纪律处分,可并处 1 至 20 万元的罚款:

- (一) 拒不配合交易所常规检查、立案调查的;
- (二) 拒不执行交易所处理决定的;
- (二) 进行虚假性、误导性或者遗漏重要事实的申报、陈述、解释或者说明的;
- (三) 提供虚假的文件、资料或者信息的;
- (四) 不执行交易所限制性措施或者其他监管措施的。

第三十七九条 会员或客户违反期转现规定,弄虚作假的,比照

本办法第二十七条给予~~处罚~~纪律处分。

第四十条 会员或客户具有重大违规违约行为嫌疑或者违规违约行为可能或已经产生相应影响的，交易所可以对其采取以下自律监管措施：

(一) 口头警示；

(二) 出具警示函；

(三) 监管谈话；

(四) 要求公开说明；

(五) 要求参加培训；

(六) 要求定期报告；

(七) 要求提交书面承诺；

(八) 要求增加内部合规检查的次数；

(九) 要求聘请中介机构核查并发表意见；

(十) 要求处分有关人员；

(十一) 上报中国证监会；

(十二) 交易所交易规则及其实施细则规定的其他自律监管措施。

【说明】 进一步完善和规范监管工作程序。

~~第三十八~~**四十一条** 交易所工作人员违反有关规定的，按国家法律、法规和交易所人事管理制度及有关廉政规定处理。

~~第三十九~~**四十二条** 司法机关、行政执法机关根据生效法律文书要求交易所协助冻结、划拨非期货公司会员在交易所专用结算账户资金的，非期货公司会员结算准备金超过现有持仓合约三个停板以外部

分的，交易所根据生效法律文书予以协助；无法冻结、划拨期货公司会员在交易所专用结算账户资金的，交易所应当向司法机关、行政执法机关说明无法协助执行的原因。

第四章 裁决与执行

第四十三条 交易所作出取消会员资格、宣布为“市场禁止进入者”的**处罚纪律处分**应当由交易所理事会决定。

第四十四条 交易所对违规行为核查后，事实清楚、证据确凿的，依照交易所章程、交易规则及本办法规定予以裁决。

第四十五条 交易所作出裁决应制作处理决定书。
处理决定书主要包括以下内容：

- （一）当事人的姓名或者名称、住所；
- （二）违规事实和证据；
- （三）**处罚纪律处分**种类和依据；
- （四）**处罚纪律处分**的履行方式和期限；
- （五）不服**处罚纪律处分**决定申请复议途径和期限；
- （六）作出处理决定的日期。

第四十六条 交易所应将处理决定书送达当事人。当事人为会员的，处理决定书送至交易席位视为送达；当事人为非会员的，可邮寄送达。邮件寄出后，市内**2**日、市外**7**日视为送达。**邮寄地址以交易所留存地址为准。**处理决定书同时分送有关协助执行部门。

按照中国证监会的规定需要抄报违规处理情况的，同时抄报中国证监会。

【说明】为提高送达效率及切实达到送达目的及效力，对此部分进行修改完善。

第四十四七条 交易所作出的处理决定书自送达之日起生效。当事人对处理决定书不服的，可于决定书生效之日起 10 日内向交易所书面申请复议一次，复议期间不停止决定的执行。

第四十五八条 交易所应于收到复议申请书之日起一个月内作出复议决定，复议决定为终局决定。

第四十六九条 经交易所作出处理决定承担履行义务的会员拒绝履行义务的，由交易所强制执行。

第四十七五十条 违规处理决定中，具有罚没款项的，当事人应在处理决定书生效之日起 5 日内将罚没款项如数缴纳至交易所指定账户。逾期不付罚没款项的，交易所从会员专用资金账户中划付。对会员工作人员的罚没款项，由会员代缴。

会员应当配合执行交易所对客户的~~处罚~~纪律处分，划拨客户在该会员处的资金。

第四十八五十一条 违规处理决定中，具有罚没款项的，受~~处罚~~纪律处分的交割仓库应在处理决定书生效之日起 5 日内将罚没款项缴纳至交易所指定账户；对交割仓库工作人员的罚没款项，由交割仓库代缴。逾期不缴的，交易所从该交割仓库交割担保金中划转。

第五章 纠纷调解

第四十九五十二条 会员、客户、交割仓库之间发生的期货交易纠纷可自行协商解决，也可提请交易所调解。

第五十三条 交易所的调解机构是交易所理事会下设的调解委员会，其常设办事机构设在交易所法律事务部。

第五十四条 调解应在事实清楚、责任明确的基础上依据国家有关期货交易的法律、法规和交易所的规章制度进行。

第五十五条 当事人向调解委员会提出调解申请，应当从其知道或应当知道其合法权益被侵害之日起 30 日内提出。

第五十六条 当事人申请调解应当符合下列条件：

- (一) 有调解申请书；
- (二) 有具体的事实、理由和请求；
- (三) 属于调解委员会的受理范围。

第五十七条 当事人向调解委员会申请调解，必须提交书面申请和有关材料。

调解申请书应当写明以下事项：

- (一) 当事人的姓名、性别、年龄、职业、工作单位和住所，或单位名称、住所和法定代表人或者负责人的姓名、职务；
- (二) 请求调解的事实、理由及要求；
- (三) 有关证据。

第五十八条 交易所调解委员会收到调解申请后，应当认真审查有关材料是否符合要求，并于 5 个工作日内以书面方式通知当事人是否受理。

【说明】为进一步明确交易所调解工作受理程序，丰富了关于交易所调解工作开展的程序性规定。

第五十九条 有下列情形之一的，交易所调解委员会不予受理：

(一) 当事人已向人民法院起诉的；

(二) 当事人已向仲裁机构申请仲裁的；

(三) 当事人一方要求调解，另一方不愿意调解的；

(四) 交易所调解委员会认定不予受理的其他情形。

【说明】(1) 根据工作实际情况，采取排除法进行列举式规定，进一步明确交易所调解委员会受理调解的范围；(2) 法律未禁止；(3) 与上海期货交易所保持一致。

第六十条 交易所调解委员会应当自受理调解申请之日起 30 日内完成调解。情况复杂，不能在规定期限内完成调解的，经双方当事人同意后，可以继续调解；双方当事人未达成继续调解事宜的，终止调解。

【说明】(1) 为进一步增强市场对交易所调解工作预期性，明确规定了交易所调解工作时限；(2) 与上海期货交易所保持一致。

第五十五六十一条 当事人根据有关规定负有举证的责任。调解委员会认为必要时，可调查收集证据。

第五十六十二条 调解委员会调解纠纷，应当在查明事实，分清是非和自愿的基础上调解，促使当事人相互谅解，达成协议。

第五十七六十三条 经调解达成的协议应记录在案，并制作调解书，由双方当事人签字，调解员署名，加盖调解委员会印章后生效。

第五十八六十四条 调解书应当写明以下内容：

(一) 双方当事人的名称、住所、法定代表人或者负责人的姓名及职务；

(二) 争议的事项和请求；

(三) 协议结果。

第五十九六十五条 调解委员会应当在受理调解后 30 天内结案，到期未结案的调解委员会应当向当事人说明理由。双方当事人要求继续调解的，调解委员会应继续调解。有一方要求终止调解的，应当终止调解。

第六十六条 调解不成的，当事人可以依法提请仲裁机构仲裁或向人民法院起诉。

附 则

第六十七条 本办法解释权属于郑州商品交易所。

第六十八条 本办法所称“以上”、“以下”均含本数。

第六十九条 本办法自 2012 年 9 月 3 日起施行。