附件1

郑州商品交易所期货交易风险控制管理  
办法修订案

对《郑州商品交易所期货交易风险控制管理办法》作如下修改：

一、将第十二条删除。

二、将第二十六条修订为：“棉花、白糖、PTA、菜油、甲醇、玻璃、菜粕、动力煤、硅铁、锰硅、尿素、纯碱和短纤期货合约自合约挂牌至交割月前一个月第15个日历日期间的交易日，当合约的单边持仓量大于或等于一定规模时，非期货公司会员和客户按单边持仓量的10%确定限仓数额；当合约的单边持仓量小于一定规模时，非期货公司会员和客户按绝对量方式确定限仓数额。具体限仓标准见下表：

|  |  |  |
| --- | --- | --- |
| 品 种 | 期货合约单边持仓量 | 非期货公司会员及客户最大单边持仓 |
| 棉花 | 单边持仓量＜20万 | 20000 |
| 单边持仓量≥20万 | 单边持仓量×10% |
| 白糖 | 单边持仓量＜30万 | 30000 |
| 单边持仓量≥30万 | 单边持仓量×10% |
| PTA | 单边持仓量＜50万 | 50000 |
| 单边持仓量≥50万 | 单边持仓量×10% |
| 菜油 | 单边持仓量＜10万 | 10000 |
| 单边持仓量≥10万 | 单边持仓量×10% |
| 甲醇 | 单边持仓量＜30万 | 30000 |
| 单边持仓量≥30万 | 单边持仓量×10% |
| 玻璃 | 单边持仓量＜20万 | 20000 |
| 单边持仓量≥20万 | 单边持仓量×10% |
| 菜粕 | 单边持仓量＜20万 | 20000 |
| 单边持仓量≥20万 | 单边持仓量×10% |
| 动力煤 | 单边持仓量＜60万 | 60000 |
| 单边持仓量≥60万 | 单边持仓量×10% |
| 硅铁 | 单边持仓量＜10万 | 10000 |
| 单边持仓量≥10万 | 单边持仓量×10% |
| 锰硅 | 单边持仓量＜30万 | 30000 |
| 单边持仓量≥30万 | 单边持仓量×10% |
| 尿素 | 单边持仓量＜10万 | 10000 |
| 单边持仓量≥10万 | 单边持仓量×10% |
| 纯碱 | 单边持仓量＜20万 | 20000 |
| 单边持仓量≥20万 | 单边持仓量×10% |
| 短纤 | 单边持仓量＜10万 | 10000 |
| 单边持仓量≥10万 | 单边持仓量×10% |

注：单位，手。

“普麦、强麦、早籼稻、菜籽、粳稻、晚籼稻、棉纱和苹果期货合约自合约挂牌至交割月前一个月第15个日历日期间的交易日限仓标准见下表：

|  |  |
| --- | --- |
| 品 种 | 非期货公司会员及客户最大单边持仓（手） |
| 普麦 | 2000 |
| 强麦 | 1000 |
| 早籼稻 | 7500 |
| 菜籽 | 10000 |
| 粳稻 | 20000 |
| 晚籼稻 | 20000 |
| 棉纱 | 5000 |
| 苹果 | 1000 |

“红枣期货合约自合约挂牌至交割月前一个月第15个日历日期间的交易日限仓标准见下表：

|  |  |  |
| --- | --- | --- |
| 品种 | 非期货公司会员及客户最大单边持仓（手） | |
| 自挂牌至交割月前二个月最后一个日历日期间的交易日 | 自交割月前一个月第一个日历日至交割月前一个月第15个日历日期间的交易日 |
| 红枣 | 600 | 200 |

“各品种期货合约自交割月前一个月第16个日历日至交割月限仓标准见下表：

|  |  |  |
| --- | --- | --- |
| 品 种 | 非期货公司会员及客户最大单边持仓（手） | |
| 交割月前一个月第16个日历日至交割月前一个月最后一个日历日期间的交易日 | 交割月份 |
| （自然人客户限仓为0） |
| 普麦 | 600 | 200 |
| 强麦 | 300 | 100 |
| 棉花 | 4000 | 800 |
| 白糖 | 6000 | 1000 |
| PTA | 10000 | 5000 |
| 菜油 | 3000 | 1000 |
| 早籼稻 | 2000 | 400 |
| 甲醇 | 3000 | 1000 |
| 玻璃 | 5000 | 1000 |
| 菜籽 | 1000 | 500 |
| 菜粕 | 2000 | 1000 |
| 动力煤 | 20000 | 4000 |
| 粳稻 | 3000 | 500 |
| 晚籼稻 | 3000 | 500 |
| 硅铁 | 2000 | 1000 |
| 锰硅 | 10000 | 2000 |
| 棉纱 | 500 | 100 |
| 苹果 | 200 | 20 |
| 红枣 | 40 | 10 |
| 尿素 | 3000 | 1000 |
| 纯碱 | 4000 | 800 |
| 短纤 | 1500 | 300 |

“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。”

三、将第四十六条修订为：“……交易所通过电话提醒的，应当保留电话录音；通过视频谈话的，应当保留视频录像；通过当面谈话的，应当保存谈话记录。……”

作上述修订后，条款顺序相应调整。

**《郑州商品交易所期货交易风险控制管理办法》**

**修订条款对照表**

（删除部分使用双删除线，增加部分使用**加粗下划线**）

|  |  |  |
| --- | --- | --- |
| **现行条文** | **修订草案条文** | **说明** |
| **第二章 保证金制度** | | |
| 第十二条 会员未能按时足额交纳交易保证金的，交易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。 | 第十二条 会员未能按时足额交纳交易保证金的，交易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。 | 删除重复性条款，调整后续条款序号。 |
| **第四章 限仓制度** | | |
| 第二十六**五**条 棉花、白糖、PTA、菜油、甲醇、玻璃、菜粕、动力煤、**硅铁、锰硅、**尿素、纯碱和短纤期货合约自合约挂牌至交割月前一个月第15个日历日期间的交易日，当合约的单边持仓量大于或等于一定规模时，非期货公司会员和客户按单边持仓量的10%确定限仓数额；当合约的单边持仓量小于一定规模时，非期货公司会员和客户按绝对量方式确定限仓数额。具体限仓标准见下表：   |  |  |  | | --- | --- | --- | | 品 种 | 期货合约单边持仓量 | 非期货公司会员及客户最大单边持仓 | | 棉花 | 单边持仓量＜20万 | 20000 | | 单边持仓量≥20万 | 单边持仓量×10% | | 白糖 | 单边持仓量＜30万 | 30000 | | 单边持仓量≥30万 | 单边持仓量×10% | | PTA | 单边持仓量＜50万 | 50000 | | 单边持仓量≥50万 | 单边持仓量×10% | | 菜油 | 单边持仓量＜10万 | 10000 | | 单边持仓量≥10万 | 单边持仓量×10% | | 甲醇 | 单边持仓量＜30万 | 30000 | | 单边持仓量≥30万 | 单边持仓量×10% | | 玻璃 | 单边持仓量＜20万 | 20000 | | 单边持仓量≥20万 | 单边持仓量×10% | | 菜粕 | 单边持仓量＜20万 | 20000 | | 单边持仓量≥20万 | 单边持仓量×10% | | 动力煤 | 单边持仓量＜60万 | 60000 | | 单边持仓量≥60万 | 单边持仓量×10% | | **硅铁** | **单边持仓量＜10万** | **10000** | | **单边持仓量≥10万** | **单边持仓量×10%** | | **锰硅** | **单边持仓量＜30万** | **30000** | | **单边持仓量≥30万** | **单边持仓量×10%** | | 尿素 | 单边持仓量＜10万 | 10000 | | 单边持仓量≥10万 | 单边持仓量×10% | | 纯碱 | 单边持仓量＜20万 | 20000 | | 单边持仓量≥20万 | 单边持仓量×10% | | 短纤 | 单边持仓量＜10万 | 10000 | | 单边持仓量≥10万 | 单边持仓量×10% |   注：单位，手。  普麦、强麦、早籼稻、菜籽、粳稻、晚籼稻、硅铁、锰硅、棉纱和苹果期货合约自合约挂牌至交割月前一个月第15个日历日期间的交易日限仓标准见下表：   |  |  | | --- | --- | | 品 种 | 非期货公司会员及客户最大单边持仓（手） | | 普麦 | 2000 | | 强麦 | 1000 | | 早籼稻 | 7500 | | 菜籽 | 10000 | | 粳稻 | 20000 | | 晚籼稻 | 20000 | | 硅铁 | 8000 | | 锰硅 | 30000 | | 棉纱 | 5000 | | 苹果 | 500**1000** |   红枣期货合约自合约挂牌至交割月前一个月第15个日历日期间的交易日限仓标准见下表：   |  |  |  | | --- | --- | --- | | 品种 | 非期货公司会员及客户最大单边持仓（手） | | | 自挂牌至交割月前二个月最后一个日历日期间的交易日 | 自交割月前一个月第一个日历日至交割月前一个月第15个日历日期间的交易日 | | 红枣 | 300**600** | 60**200** |   各品种期货合约自交割月前一个月第16个日历日至交割月限仓标准见下表：   |  |  |  | | --- | --- | --- | | 品 种 | 非期货公司会员及客户最大单边持仓（手） | | | 交割月前一个月第16个日历日至交割月前一个月最后一个日历日期间的交易日 | 交割月份  （自然人客户限仓为0） | | 普麦 | 600 | 200 | | 强麦 | 300 | 100 | | 棉花 | 4000 | 800 | | 白糖 | 6000 | 1000 | | PTA | 10000 | 5000 | | 菜油 | 3000 | 1000 | | 早籼稻 | 2000 | 400 | | 甲醇 | 3000 | 1000 | | 玻璃 | 5000 | 1000 | | 菜籽 | 1000 | 500 | | 菜粕 | 2000 | 1000 | | 动力煤 | 20000 | 4000 | | 粳稻 | 3000 | 500 | | 晚籼稻 | 3000 | 500 | | 硅铁 | 2000 | 500**1000** | | 锰硅 | 10000 | 2000 | | 棉纱 | 500 | 100 | | 苹果 | 100**200** | 10**20** | | 红枣 | 20**40** | 6**10** | | 尿素 | 3000 | 1000 | | 纯碱 | 4000 | 800 | | 短纤 | 1500 | 300 |   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。 | | 1.将硅铁、锰硅一般月份限仓方式调整为比例限仓，并根据限仓测算评估情况，将硅铁一般月份比例限仓基数设置为10万手。  2.根据硅铁交割月份限仓测算结果和现货实际情况，将硅铁交割月份限仓由500手调整为1000手。  3.根据苹果规则修改以及苹果、红枣合约运行和交割情况，适度上调苹果（2110及之后合约）、红枣品种各阶段限仓标准。 |
| **第八章 风险警示制度** | | |
| 第四十六条 出现下列情形之一的，交易所可以对指定的会员、境外经纪机构高管人员或者客户谈话提醒风险，或者要求会员、境外经纪机构、客户报告情况：  （一）合约价格出现异常波动；  （二）会员、境外经纪机构或者客户交易异常；  （三）会员、境外经纪机构或者客户持仓异常；  （四）会员资金异常；  （五）会员、境外经纪机构或者客户涉嫌违规、违约；  （六）交易所接到涉及会员、境外经纪机构或者客户的投诉；  （七）会员、境外经纪机构涉及执法调查；  （八）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。  交易所实施谈话提醒的，会员、境外经纪机构或者客户应当按照交易所要求的时间、地点和方式认真履行。  交易所要求会员、境外经纪机构或者客户报告情况的，会员、境外经纪机构或者客户应当按照交易所要求的时间、内容和方式如实报告。 | 第四十六**五**条 出现下列情形之一的，交易所可以对指定的会员、境外经纪机构高管人员或者客户谈话提醒风险，或者要求会员、境外经纪机构、客户报告情况：  （一）合约价格出现异常波动；  （二）会员、境外经纪机构或者客户交易异常；  （三）会员、境外经纪机构或者客户持仓异常；  （四）会员资金异常；  （五）会员、境外经纪机构或者客户涉嫌违规、违约；  （六）交易所接到涉及会员、境外经纪机构或者客户的投诉；  （七）会员、境外经纪机构涉及执法调查；  （八）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；**通过视频谈话的，应当保留视频录像；**通过当面谈话的，应当保存谈话记录。  交易所实施谈话提醒的，会员、境外经纪机构或者客户应当按照交易所要求的时间、地点和方式认真履行。  交易所要求会员、境外经纪机构或者客户报告情况的，会员、境外经纪机构或者客户应当按照交易所要求的时间、内容和方式如实报告。 | 增加视频约谈手段，丰富风控工作方式。 |