

郑州商品交易所期货交割细则

（郑州商品交易所第五届理事会：2009年3月28日审议通过，自2009年4月20日起施行；2011年10月17日修订，自2011年10月28日起施行；2012年8月6日修订，自2012年12月3日起施行）

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。

使用标准仓单的期货交割实行三日交割法。

使用非标准仓单的期货交割根据品种不同确定具体的交货日期。

第三条 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。

第四条 不能交付或者接收增值税专用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。

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，交易所所有权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

第五条 交割单位：50吨。

第六条 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。

第七条 普麦接收、储存、发运采用散粮方式。

第二节 优质强筋小麦（WH）¹

第八条 交割单位：20吨。

第九条 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。

¹ 强麦（WH）自2013年7月合约执行。

将于2013年5月摘牌的强麦期货（WS）的交割标准及相关规定适用于2011年10月17日修订，自2011年10月28日起施行的《郑州商品交易所期货交割细则》，主要内容如下：

一、交割单位：10吨。

二、强麦交割标准由交易所依法自行制定。

基准交割品：符合郑州商品交易所《期货交易用优质强筋小麦标准》（Q/ZSJ 001-2003）（以下简称《强麦所标》，见附件一*）的二等优质强筋小麦。

替代品及升贴水：

（一）符合《强麦所标》的一等强麦升水30元/吨；

（二）同等级强麦不完善粒大于6.0%小于10.0%的（其中霉变粒小于等于2.0%），贴水10元/吨。

三、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。

（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% 。

降落数值、湿面筋、稳定时间、拉伸面积指标检验规定见附件一。

第十条 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。

第三节 棉花

第十一条 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。

第十二条 一号棉交割单位： $185\text{包} \pm 5\text{包}$ （ $227 \pm 10\text{公斤/包}$ ），对应8手期货合约。

第十三条 一号棉交割适用国家标准。

基准交割品：符合《中华人民共和国国家标准 棉花 细绒棉》（GB1103-2007）规定的328B级国产锯齿细绒白棉。

期货交割棉实行分级计价。分级计价按重新检验的结果计算：

（一）有主体品级的棉花，各品级棉花分级计价。主体品级确定方法：按批检验时，占 80% 及以上的品级，其余品级仅与其相邻。

（二）无主体品级的棉花，以累计方式产生结算品级，累计棉花按结算品级与未累计棉花分级计价。结算品级确定方法：根据按批检验结果，从高品级起依次降级累计，直至累计比例大于等于 80% 的品级，且未累计品级仅与其相邻。

替代品及升贴水：符合《中华人民共和国国家标准 棉花 细绒棉》（GB1103-2007）规定的，主体品级和按本条第三款第（二）项累

计产生的结算品级为四级及以上，长度级为 28 毫米及以上，马克隆值级为 A 级和 C2 级的国产锯齿细绒白棉，可以替代交割。

（一）品级升贴水：符合 GB1103-2007 规定的国产锯齿细绒白棉一级升水 450 元/吨，二级升水 300 元/吨；四级贴水 500 元/吨；五级贴水 1300 元/吨。

（二）长度升贴水：棉花的平均长度大于或等于 30 毫米以上的，升水 100 元/吨。

（三）主体马克隆值级为 A 级的棉花，升水 50 元/吨；主体马克隆值级为 C2 级的棉花，贴水 100 元/吨。

（四）每交割单位棉花中，抽样检验时发现异性纤维的包数为 1 包的，正常交割；超过 1 包的，每发现一包增加贴水 200 元/吨。

升贴水随货款一并结算。

第十四条 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。

第十五条 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

第十六条 交割单位：10 吨。

第十七条 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；

第十八条 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。

第十九条 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

第二十条 交割单位：5吨。

第二十一条 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。

第二十二条 出现破包、潮包、结块、严重污染等情况的，不得入库。

第六节 菜油（OI）²

第二十三条 交割单位：10 吨。

第二十四条 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。

（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。

第二十五条 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

² 菜油（OI）自 2013 年 7 月合约执行。

将于 2013 年 5 月摘牌的菜籽油期货（RO）的交割标准及相关规定适用于 2011 年 10 月 17 日修订，自 2011 年 10 月 28 日起施行的《郑州商品交易所期货交割细则》，主要内容如下：

一、交割单位：5 吨。

二、菜籽油交割标准由交易所依法自行制定。

基准交割品：符合郑州商品交易所《期货交易用菜籽油标准》（Q/ZSJ 003-2007）（以下简称《菜籽油所标》，见附件二*）四级质量指标的菜籽油。

替代品及升贴水：

（一）符合菜籽油所标三级、二级、一级质量指标的菜籽油可以替代交割，无升贴水。

（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籽油，可以替代交割，贴水 30 元/吨。该菜籽油须以菜籽原油标示。

三、自每年 6 月 1 日（含该日）起至当年 12 月 1 日止（不含该日）入库的菜籽油，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）入库的菜籽油，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。

菜籽油出库时，应符合《菜籽油所标》及本细则规定。

红不超过6.5。

菜油出库时，其过氧化值不得超过 5.5mmol/kg。

第七节 早籼稻（RI）³

第二十六条 交割单位：20 吨。

第二十七条 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）。

（二）早籼稻出库时，水分 $< 13.5\%$ 的，水分减量部分由提货人承担。

³ 早籼稻（RI）自 2013 年 7 月合约执行。

将于 2013 年 5 月摘牌的早籼稻期货（ER）的交割标准及相关规定适用于 2011 年 10 月 17 日修订，自 2011 年 10 月 28 日起施行的《郑州商品交易所期货交割细则》，主要内容：

一、交割单位：10 吨。

二、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—1999）及本细则规定的三等及以上等级早籼稻谷。

替代品及升贴水：

（一）早籼稻的整精米率小于 50%但不小于 44%的，无升贴水。

（二）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）。

（三）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）。

（四）早籼稻杂质超过 1.0%但不超过 1.5%的，扣量 0.5%。

三、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%。

四、非本生产年度产早籼稻交割时贴水由交易所另行公告。

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%。

第二十八条 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%。

第二十九条 非本生产年度产早籼稻交割时贴水由交易所另行公告。

第八节 甲醇

第三十条 交割单位：50吨。

第三十一条 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。

第八节 玻璃

第三十二条 交割单位：20吨。

第三十三条 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。

第三章 交割基准价与升贴水

第三十四条 普麦交割分标准仓单（以下简称仓单普麦）交割和车船板交割（以下简称车船板普麦）两种方式。

车船板交割是指在交易所指定交割计价点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。买卖双方以货物装上买方车船板为界，实现货物的所有权和风险转移，各自承担对货物的数量、质量责任。

交割计价点是指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。具体地点由交易所公告。

第三十五条 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⁴、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。

菜油⁵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。

早籼稻⁶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。

⁴ 本细则中提到强麦时，未有特指的，适用于强麦（WS）、强麦（WH）两个合约。

⁵ 本细则中提到菜油时，未有特指的，适用于菜油（RO）、菜油（OI）两个合约。

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。

第三十六条 指定交割仓库、指定交割计价点及升贴水由交易所确定并公告。

第三十七条 通用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、交割仓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，交割仓库负责监督。交割仓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

第三十八条 普麦、一号棉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、标准仓单或普麦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。卖方提出棉花期货交割申请时，需同时提交相应的棉花仓单信息；卖方提出普麦车船板交割申请时，需同时提交相应的拟交割货物信息，包括：品种、等级、数量、生产年度、交割计价点、存放地点等。

（二）买方会员在会员服务系统响应卖方会员的交割申请（选择棉花或普麦仓单，或选择普麦车船板交割货物信息）；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，

⁶ 本细则中提到早籼稻时，未有特指的，适用于早籼稻（ER）、早籼稻（RI）两个合约。

由计算机系统判为作废。当日闭市后，交易所按确认结果进行配对（即配对日）。

第三十九条 普麦、一号棉期货合约在最后交易日的配对原则：

（一）最后交易日下午，普麦、一号棉合约不再进行交易。上午闭市后，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）下午 1 时 30 分之前，普麦车船板交割的，卖方应提出交割申请，提交车船板交割货物信息。一号棉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 分公布卖方所有棉花有效仓单信息供买方挑选；买方挑选卖方仓单的总数量不超过卖方该合约的持仓量。普麦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，交易所按仓单交割对待。

（三）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）。

第四十条 普麦、一号棉之外品种的配对原则：

（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）。

第四十一条 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。

第四十二条 交割关系一经确定，买卖双方不得擅自调整或者变更。

第四十三条 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。

第四十四条 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，会员均应按本细则第四、六章规定办理。

第四十五条 普麦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，买方会员应当将尚欠货款划入交易所账户。

（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第五章有关规定。

（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，卖方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。全部货物交收完毕后，交易所释放收取的买卖双方交易保证金。增值税发票流转参照本细则第六章有关规定执行。

2、不委托交易所结算的，交易所退还收取的买卖双方交易保证金。买卖双方终止交割。

第四十六条 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

第四十七条 车船板交割时，卖方货物存放地点应具备以下条件：

（一）交通便利，核定载重20吨以上货车能够顺畅通行；

（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；

（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）。

第四十八条 自通知日起三个交易日内，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《普通小麦车船板交割协议书》。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《普通小麦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，按照本办法第九章相关规定处理。

第四十九条 买方可以选择在卖方货物所在地或交割计价点交割，卖方不得拒绝。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《普通小麦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货。

在交割计价点交货的，买卖双方应及时与交割计价点指定交割仓库联系，安排交割事宜。卖方必须在规定的时间内把货物运达交割计价点，并承担交收过程中的中转费。

第五十条 货物发运前，买方应到场查验货物质量，卖方应予以配合。验收无误后，双方签署《质量验收确认单》。

第五十一条 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，买方有权对计量衡器的准确性进行确认。发运完毕后，双方签署《数量验收确认单》。

买方需要包装物时，包装物由买方自理或者委托卖方代办，其费用由买方支付。

第五十二条 一方对货物质量、数量有异议的，应停止交接货物，并与对方协商解决。协商不成的，可以书面向交易所提出复检申请，并预交复检费用（含检验费、质检人员差旅费等），交易所组织指定质检机构或双方认可的质检机构、国家计量技术监督部门验重、验质，复检费用由过错方承担。复检结果为解决争议的依据。

第五十三条 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，首先进行协商解决。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=Σ[2(元/吨)×延误天数×应发(收)而未发(收)货商品数量]。

由于不可抗力导致商品装运推迟的，可以顺延。

第五十四条 在最后交货日之前交割完毕的，交易所根据买卖双方的确认进行划款。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，按照规定流程进行划款。

（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 增值税专用发票的流转

第五十五条 期货交割由交割卖方向对应的买方开具增值税专用发票。增值税专用发票由双方会员转交、领取并协助核实。

第五十六条 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。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的，视为拒绝提供增值税专用发票，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、菜油、棉花和早籼稻的违约金比例为 13%；白糖、PTA、甲醇和玻璃的违约金比例为 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。

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。

第五十七条 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

第五十八条 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。

第五十九条 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。

第六十条 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；

（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第四十条执行。

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第五十二条的有关规定执行。

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。

第六十一条 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。

第六十二条 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

第六十三条 强麦、一号棉、白糖和早籼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。

PTA、菜油和甲醇运达交割仓库指定货位前的一切费用由卖方客户承担，货物装到汽车板（菜油包括火车、轮船）后的一切费用由买方客户承担。出入库费用由卖方客户承担，货物入库时向交割仓库支付。

仓单普麦自指定交割仓库装至车船板之前的其他一切费用（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。

车船板普麦交割时，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其他一切费用（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。

第六十四条 各品种出入库费用、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、菜籽油、早籼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。仓单普麦及车船板普麦出库检验费用均由买方承担。

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，交割仓库直接向货主收取。

第六十五条 普麦、强麦无包装物。棉花、白糖、PTA、早籼稻包装物不另行计价。

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。

第六十六条 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

第六十七条 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。

第六十八条 普麦交割(含仓单和车船板)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。

第六十九条 计算普麦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:

卖方交割违约合约数量(手)=[$\text{应交标准仓单数量(张)} - \text{已交标准仓单数量(张)}$] $\times$ 交割单位 $\div$ 交易单位

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

第七十条 普麦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。

第七十一条 普麦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。

第七十二条 普麦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。

第七十三条 普麦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。

第七十四条 普麦之外品种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%。

第七十五条 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。

第七十六条 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。

第七十七条 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

第七十八条 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。

第七十九条 本细则解释权属于郑州商品交易所。

第八十条 本细则自 2012 年 12 月 3 日起施行。