

关于发布仓单交易、基差贸易两项业务 指引的公告

(2018)第14号

为保障仓单交易、基差贸易业务的正常进行，郑州商品交易所制定了《郑州商品交易所仓单交易业务指引》、《郑州商品交易所基差贸易业务指引》，现予发布施行。

特此公告。

郑州商品交易所

2018年3月27日

郑州商品交易所仓单交易业务指引

第一条 为保障郑州商品交易所（以下简称交易所）综合业务平台（以下简称平台）仓单交易业务的正常进行，根据《郑州商品交易所期货交割细则》、《郑州商品交易所标准仓单及中转仓单管理办法》和《郑州商品交易所综合业务平台管理办法》，制定本指引。

第二条 仓单交易，是指转让在交易所注册的标准仓单的交易活动。

第三条 参与仓单交易的客户，应当具有相关商品的经营资质。

第四条 仓单交易时间为每个交易日的上午 9:00-11:30，下午 1:30-2:30。

普麦及适用非通用标准仓单的品种，在其期货合约的最后交易日不进行仓单交易业务。

第五条 仓单交易方式包括挂牌交易和协商交易。

第六条 仓单交易由卖方发起。发起仓单交易前，客户应当将其仓单转至平台。

第七条 卖方发起的交易指令，包括品种、产期、等级、价格、数量和参考合约等信息。卖方可录入仓单备注信息，并对信息真实性承担责任。

第八条 仓单交易的报价单位为“元/吨”。报价方式分

为一口价和浮动价。使用一口价时，成交价为卖方的报价。使用浮动价时，卖方基于参考期货合约进行升贴水报价，成交价格为买卖双方达成交易时的参考期货合约最新价格加上升贴水。

第九条 仓单交易的单位为“张”，仓单交易应当以“一张”的整数倍进行。

第十条 成交后，交易所冻结买方全额货款，同时收取买方手续费。

全额货款=成交价格×成交量×交割单位

不同品种每张仓单的交割单位参见《郑州商品交易所期货交割细则》相关规定。其中，棉花仓单按公定重量计。

第十一条 交易所办理仓单过户后，卖方申请划转首付款，交易所划转货款的80%给卖方，同时收取卖方手续费。

第十二条 卖方收到首付款后，应当向买方开具增值税专用发票（普通）发票，发票可一次全额或多次分笔开具。买方收到发票后，应当及时确认。买方确认后，交易所根据以下公式计算并划转剩余货款给卖方：

划转剩余货款金额=（总货款-首付款）×（开票金额÷总货款）

第十三条 发票流转事宜按照《郑州商品交易所综合业务平台管理办法》有关规定执行。

第十四条 本指引由交易所负责解释。

第十五条 本指引自发布之日起实施。

郑州商品交易所基差贸易业务指引

第一条 为保障郑州商品交易所（以下简称交易所）综合业务平台（以下简称平台）基差贸易业务的正常进行，根据《郑州商品交易所期货交割细则》、《郑州商品交易所标准仓单及中转仓单管理办法》和《郑州商品交易所综合业务平台管理办法》，制定本指引。

第二条 基差贸易，是指买卖双方以某月份期货合约价格为计价基础，加上双方商定的升贴水，来确定商品价格的现货贸易活动。

第三条 基差贸易的标的是交易所上市的期货品种或交易所认可的其他品种。

第四条 参与基差贸易的客户，应当具有相关商品的经营资质。

第五条 基差贸易的交易时间为每个交易日的上午9:00-11:30，下午1:30-3:00。

第六条 基差贸易的交易方式包括挂牌交易和协商交易。

第七条 采用挂牌交易的，实行双边约定清算。采用协商交易的，可选择双边约定清算或双边指令清算。

第八条 基差贸易的交易指令包括货物的品种、品级、数量、买卖方向、交收方式、最后点价日、参考期货合约、升贴水、仓库、附属合同等信息。

其中，交收方式分为仓单交收和现货交收；最后点价日是双方可以点价的最后一个交易日。采用双边约定清算的，需当日完成点价；附属合同应当包含违约情形认定及处理等条款。

第九条 买卖双方就升贴水达成一致后，生成待点价合同。选择双边指令清算的，交易所根据双方指令冻结或调整保证金。

第十条 从生成待点价合同开始到最后点价日闭市之前，一方发起点价，另一方确认后，待点价合同转为基差贸易合同。

第十一条 点价成功后，交易所收取交易双方手续费。

第十二条 基差贸易合同生成后，买方发起交收申请，交易所根据以下公式计算并冻结买方货款：

冻结货款=（期货点价+升贴水）×交收数量（手）×交收因子

上述公式中，期货点价由双方参考期货合约价格确定，作为现货交收价格的基础；实行双边约定清算的，交收因子为相应品种的期货交割单位；实行双边指令清算的，交收因子为1吨/手。

第十三条 买方发起交收申请后，卖方进行交收确认并配货。采用仓单交收的，卖方选择仓单进行配货，买方确认后，交易所办理仓单过户。采用现货交收的，卖方选择现货

进行配货，由买方确认收货。

采用棉花仓单交收的，买方确认收货时，交易所根据公定重量重新计算并冻结货款。

第十四条 交易所办理仓单过户或买方确认收货后，卖方申请划转首付款。首付比例由双方在办理交收时协商确定。

第十五条 卖方收到首付款后，应当向买方开具增值税专用发票（普通）发票，发票可一次全额或多次分笔开具。买方收到发票后，应当及时确认。买方确认后，交易所根据以下公式计算并划转剩余货款给卖方：

划转剩余货款金额=（总货款-首付款）×（开票金额÷总货款）

第十六条 最后点价日闭市后，待点价合同仍未完成点价，采用双边约定清算的，待点价合同自动了结。采用双边指令清算的，在交易所根据双方共同确认的指令划转盈亏后了结。

第十七条 买卖双方协商一致，可以更改交收方式和合同了结方式。

第十八条 交易日下午 2:30 之后，交易所不受理各品种仓单的转入、转出及过户业务。普麦及适用非通用仓单期货合约的最后交易日，交易所不受理相关品种仓单的转入、转出及过户业务。

第十九条 发票流转事宜按照《郑州商品交易所综合业

务平台管理办法》有关规定执行。

第二十条 买卖双方存在争议的，由双方按照合同自行处理。

第二十一条 本业务指引由交易所负责解释。

第二十二条 本业务指引自发布之日起实施。