附件6

《郑州商品交易所期货交易风险控制管理办法》修订案

（2020年9月22日郑州商品交易所第七届理事会第六次会议审议通过）

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、将第四条第二款修改为：

“各品种[[1]](#footnote-2)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、棉花、菜油、菜籽、菜粕、动力煤、早籼稻、晚籼稻、粳稻、甲醇、硅铁、锰硅、白糖、PTA、玻璃、棉纱、尿素、纯碱、短纤 | 5% |
| 苹果、红枣 | 7% |

”

二、将第二十六条修改为：“棉花、白糖、PTA、菜油、甲醇、玻璃、菜粕、动力煤、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% |
| 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。

“……

“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 |
| 锰硅 | 10000 | 2000 |
| 棉纱 | 500 | 100 |
| 苹果 | 100 | 10 |
| 红枣 | 20 | 6 |
| 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。”

《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

（删除部分使用双删除线，增加部分使用加粗下划线**）**

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[[2]](#footnote-3)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、棉花、菜油、菜籽、菜粕、动力煤、早籼稻、晚籼稻、粳稻、甲醇、硅铁、锰硅、白糖、PTA、玻璃、棉纱、尿素、纯碱**、短纤** | 5% |
| 苹果、红枣 | 7% |

第四章 限仓制度

第二十六条 棉花、白糖、PTA、菜油、甲醇、玻璃、菜粕、动力煤、尿素和**、**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 |
| … | …… | …… |
| **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。

……

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） |
| … | …… | …… |
| **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. 各品种中，普通小麦简称“普麦”，优质强筋小麦简称“强麦”，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”，鲜苹果简称“苹果”， 干制红枣简称“红枣”，涤纶短纤简称“短纤”。 [↑](#footnote-ref-2)
2. 各品种中，普通小麦简称“普麦”，优质强筋小麦简称“强麦”，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”，鲜苹果简称“苹果”， 干制红枣简称“红枣”，**涤纶短纤简称“短纤”**。 [↑](#footnote-ref-3)