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**

（2019年 10月16日郑州商品交易所第六届理事会第二十二次会议审议通过）

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、将第十条第一款修改为：“某期货合约市场风险明显增大时，交易所可根据某期货合约市场风险情况采取下列措施：

“（一）对全部或者部分会员、境外经纪机构、客户限制出入金；

“（二）对全部或者部分非期货公司会员、客户限制开平仓；

“（三）调整该期货合约交易保证金标准；

“（四）调整该期货合约涨跌停板幅度。”

二、将第二十六条修改为：“一号棉、白糖、PTA、菜油、甲醇、玻璃、菜粕、动力煤和尿素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 |
| 一号棉 | 单边持仓量<20万 | 20000 |
| 单边持仓量≥20万 | 单边持仓×10% |
| 白糖 | 单边持仓量<30万 | 30000 |
| 单边持仓量≥30万 | 单边持仓×10% |
| PTA | 单边持仓量<50万 | 50000 |
| 单边持仓量≥50万 | 单边持仓×10% |
| 菜油 | 单边持仓量<10万 | 10000 |
| 单边持仓量≥10万 | 单边持仓×10% |
| 甲醇 | 单边持仓量<30万 | 30000 |
| 单边持仓量≥30万 | 单边持仓×10% |
| 玻璃 | 单边持仓量<20万 | 20000 |
| 单边持仓量≥20万 | 单边持仓×10% |
| 菜粕 | 单边持仓量<20万 | 20000 |
| 单边持仓量≥20万 | 单边持仓×10% |
| 动力煤 | 单边持仓量<60万 | 60000 |
| 单边持仓量≥60万 | 单边持仓×10% |
| 尿素 | 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（非7月合约） | 500 |
| 苹果（7月合约） | 100 |

“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 | 60 |

“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 |
| 一号棉 | 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  （非7月合约） | 100 | 10 |
| 苹果（7月合约） | 20 | 6 |
| 红枣 | 20 | 6 |
| 尿素 | 3000 | 1000 |

“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、第二十九条第二款修改为：“非期货公司会员或者客户超过持仓限额的，交易所按照本办法第七章强行平仓制度有关规定进行处理，并可以采取要求提交书面说明、书面警示、约见谈话、限制开仓等措施。”

四、将第三十条第二款修改为：“套期保值交易和做市交易的开仓数量不受本条前款限制。”

五、第四十六条第一款增加一项，作为第一项：“（一）合约价格出现异常波动；”

将第四十六条第三款删除。

第四十六条第二款后增加两款，作为第三款、第四款：“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。”