

(上接 A9 版)

按照中国证监会的规定需要抄报违规处理情况的,同时抄报中国证监会。  
第三十八条 处理决定书自送达之日起生效。  
当事人对处理决定书不服的,可以于处理决定书生效之日起10日内向交易所书面申请复议一次,复议期间不停止决定的执行。  
第三十九条 交易所应当于收到复议申请书之日起30日内做出复议决定,复议决定为终局决定。  
第四十条 处理决定中包含惩罚性违约金的,当事人应当在处理决定书生效之日起5日内将惩罚性违约金缴付至交易所指定的银行账户。逾期不缴付的,当事人是清算会员的,交易所应将其清算会员专用资金账户中划付;当事人不是清算会员的,有关清算会员应当协助交易所扣划其在该清算会员处的资金。  
对会员工作人员员的惩罚性违约金,由会员代缴。  
第五节 纠纷调解  
第四十一条 会员、客户、期货保证金存管银行及期货市场其他参与者之

间发生期货交易纠纷的,可以自行协商解决,也可以提请交易所调解。  
第四十二条 交易所的调解机构是交易所董事会下设的调解委员会,其常设办事机构设在交易所监管部门。  
第四十三条 调解应当在事实清楚、责任明确的基础上依据国家有关期货交易的法律、行政法规、规章和交易所的规章制度进行。  
第四十四条 当事人向调解委员会提出调解申请,应当从其知道或者应当知道其合法权益被侵害之日起30日内提出。  
第四十五条 当事人申请调解应当符合下列条件:  
(一)有调解申请书;  
(二)有具体的事实、理由和请求;  
(三)属于调解委员会的受理范围。  
第四十六条 当事人向调解委员会申请调解,应当提交书面申请和有关材料。

调解申请书应当写明下列事项:  
(一)当事人的姓名、性别、年龄、职业、工作单位和住所,或者单位名称、住所和法定代表人或者负责人的姓名、职务;  
(二)请求调解的事实、理由及要求;  
(三)有关证据。  
第四十七条 当事人根据有关规定负有举证的责任。调解委员会认为必要时,可以调查收集证据。  
第四十八条 调解委员会应当在查明事实、分清是非和当事人自愿的基础上调解,促使当事人相互谅解,达成协议。  
第四十九条 经调解达成的协议应当记录在案,并制作调解书,由双方当事人签收后生效。  
第五十条 调解书应当写明下列内容:  
(一)双方当事人的名称、住所、法定代表人或者负责人的姓名及职务;

(二)争议的事项和请求;  
(三)协议结果。  
第五十一条 调解委员会应当在受理调解后30日内结案;到期未结案的,调解委员会应当向当事人说明理由。双方当事人要求继续调解的,调解委员会应当继续调解。一方要求终止调解的,应当终止调解。  
第五十二条 调解不成的,当事人可以依法提请仲裁机构仲裁或者向人民法院提起诉讼。  
第六章 附则  
第五十三条 本办法未作规定的违规行为处理,适用交易所其他相关规则的规定。  
第五十四条 本办法所称“以上”、“以下”均含本数。  
第五十五条 本办法由交易所负责解释。  
第五十六条 本办法自2007年6月27日起实施。

# 中国金融期货交易所交易细则

**第一章 总则**  
第一条 为规范期货交易行为,保护期货交易当事人的合法权益,保障中国金融期货交易所(以下简称交易所)期货交易的顺利进行,根据《中国金融期货交易所交易规则》,制定本细则。  
第二条 交易所、会员、客户应当遵守本细则。  
**第二章 品种与合约**  
第三条 交易所上市品种为股指期货及经中国证券监督管理委员会(以下简称中国证监会)批准的其他期货品种。  
第四条 期货合约是指由交易所统一制定的、规定在将来某一特定的时间和地点交割一定数量标的物的标准化合约。  
第五条 股指期货合约主要要素包括合约标的、合约乘数、报价单位、最小变动价位、合约月份、交易时间、每日价格最大波动限制、最低交易保证金、最后交易日、交割日期、交割方式、交易代码、上市交易所等。  
合约附件与合约具有同等法律效力。  
第六条 沪深300股指期货合约的合约标的为沪深300指数,该指数由中证指数有限公司编制和发布。  
第七条 沪深300股指期货合约的合约乘数为每点人民币300元,股指期货合约价值为股指期货指数点乘以合约乘数。  
第八条 沪深300股指期货合约以指数点报价。  
第九条 沪深300股指期货合约的最小变动价位是0.2点指数点。该合约报价指数点须为0.2点的整数倍。  
第十条 沪深300股指期货合约的合约月份为当月、下月及随后两个季月。季月是指3、6、9、12月。  
第十一条 沪深300股指期货合约的最后交易日为合约到期月份的第三个周五,最后交易日即为交割日。最后交易日为法定假日或者因不可抗力未交易的,以下一交易日为最后交易日和交割日。  
到期合约交割日的下一交易日,新的月份合约开始交易。  
第十二条 股指期货的交易时间为交易日9:15-11:30(第一节)和13:00-15:15(第二节),最后交易日交易时间为9:15-11:30(第一节)和13:00-15:00(第二节)。  
第十三条 沪深300股指期货合约的每日价格最大波动限制是指其每日价格涨跌幅幅度,为上一交易日结算价的10%。  
第十四条 股指期货合约到期采用现金交割方式。  
第十五条 股指期货合约的交易单位为“手”,1手等于1张合约。期货交易额须以交易单位的整数倍进行。  
**第三章 席位管理**  
第十六条 席位是指会员向交易所申请设立的、参与交易与接受监管及服务的基本业务单位。会员可以根据业务需要向交易所申请一个或者一个以上的席位。  
第十七条 会员申请席位,应当具备下列条件:  
(一)经营状况良好,无严重违法违规记录;  
(二)通讯、资金划拨条件符合交易所要求;  
(三)配备符合交易所要求的业务系统及相关专业人员;  
(四)有健全的规章制度和交易管理制度;  
(五)业务系统的建设和管理符合中国证监会相关技术管理规范的要求。  
第十八条 会员申请席位,应当提交下列材料:  
(一)近两年期货交易基本情况;  
(二)包含新增席位理由、条件、可行性论证等内容的申请报告;  
(三)机构、人员现状及拟负责交易管理事务的主要人员的名单、简历、专业背景等基本情况;  
(四)交易管理的业务制度(包括数据安全管理制度);  
(五)计算机系统、通讯系统(包括通讯线路)、系统软件、应用软件等配置清单;  
(六)交易所要求提供的其他材料。  
第十九条 交易所收到符合要求的申请报告和有关材料之日起15个工作日内,对申请报告做出书面批复。  
第二十条 会员应当在收到交易所同意其席位申请的批复后5个工作日内,与交易所签订席位使用协议。无故逾期的,视为放弃。会员申请增加席位需与交易所另行签订席位使用协议。  
第二十一条 席位使用费按年收取。席位年申报量不超过20万笔的,年使用费为人民币2万元;席位年申报量超过20万笔的,年使用费为人民币3万元。申报量是指买入、卖出以及报撤委托笔数的总和。  
席位撤销时,已收取的席位使用费不予退还。  
第二十二条 会员交易设施安装和系统调试完成之后,达到交易所规定标准且符合开市条件的,方可投入使用。  
第二十三条 会员增加席位后期货管理和交易业务系统维护、主要设施需要更换或者作技术调整时,应当事先征得交易所同意。席位转移出原登记档案地,应当事先报交易所审批。交易所对席位的使用情况进行监督检查。

第二十四条 有下列情形之一的,席位予以撤销:  
(一)会员提出撤销申请,经交易所核准;  
(二)私下转包、转租或者转让席位;  
(三)管理混乱,存在严重违法违规行为或者查实已不符合开市条件;  
(四)利用席位窃密或者破坏交易所系统;  
(五)所属会员被取消会员资格;  
(六)交易所认为其不适宜拥有席位。  
第二十五条 由于交易所系统、通讯系统等交易设施发生故障,致使10%以上的会员不能正常交易的,交易所应当暂停交易,直至故障消除为止。  
**第四章 价格**  
第二十六条 交易所应当及时发布开盘价、收盘价、最高价、最低价、最新价、涨跌、最高买价、最低卖价、实买量、实卖量、结算价、成交量、持仓量等与交易有关的信息。  
第二十七条 开盘价是指某一期货合约开市前5分钟内经集合竞价产生的成交价格。集合竞价未产生成交价格的,以集合竞价后第一笔成交价为开盘价。  
第二十八条 收盘价是指某一期货合约当日交易的最后一笔成交价格。  
第二十九条 最高价是指一定时间内某一期货合约成交价格中的最高成交价格。  
第三十条 最低价是指一定时间内某一期货合约成交价格中的最低成交价格。  
第三十一条 最新价是指某一期货合约在当日交易期间的即时成交价格。  
第三十二条 涨跌是指某一期货合约在当日交易期间的最新价与上一交易日结算价之差。  
第三十三条 最高买价是指某一期货合约当日买方申请买出的即时最高价格。  
第三十四条 最低卖价是指某一期货合约当日卖方申请卖出的即时最低价格。  
第三十五条 买量是指某一期货合约当日交易所交易系统未成交的最高价位申报买出的下单数量。  
第三十六条 卖量是指某一期货合约当日交易所交易系统未成交的最低价位申报卖出的下单数量。  
第三十七条 结算价是指某一期货合约当日一定时间内成交价格按照成交量的加权平均价。结算价是进行当日未平仓合约盈亏结算和计算下一交易日交易保证金的依据。  
第三十八条 成交量是指某一期货合约在当日交易期间所有成交合约的单边数量。  
第三十九条 持仓量是指期货交易所所持有的未平仓合约的单边数量。

当bp≥sp≥cp,则:最新成交价=sp  
bp>cp>sp, 最新成交价=bp  
cp>bp>sp, 最新成交价=cp  
集合竞价未产生开盘价的,以上一交易日收盘价为前一成交价,按照上述办法确定第一笔成交价。  
第四十八条 新上市合约的挂盘基准价由交易所确定并提前公布。挂盘基准价是确定新合约上市首日交易价格的依据。  
**第六章 交易编码**  
第四十九条 交易所实行交易编码制度。交易编码是指会员和客户进行期货交易的身份代码。  
第五十条 交易编码由会员号和客户号两部分组成。交易编码由十二位数字构成,前四位为会员号,后八位为客户号,如客户交易编码为001200000001,则会员号为0012,客户号为00000001。  
第五十一条 客户可以在不同的会员处开户,但在交易所内只能有一个客户号。其交易编码中会员号不同,客户号相同。  
第五十二条 会员应当按照交易所系统中关于客户资料录入的提示输入客户资料,不得跳栏或者漏填。  
第五十三条 会员应当通过电子文档方式将客户开户、变更及销户资料向交易所备案,并保证交易所资料真实、准确。  
第五十四条 会员在交易所系统中录入客户开户资料后,客户交易编码由系统自动生成,经交易所审核后后方可使用。  
第五十五条 证券公司、证券投资基金等特定客户开立客户号应当向交易所提交书面开户申请,由交易所为其开立客户号。  
第五十六条 会员应当建立客户开户、变更及销户资料档案。自然人客户资料为《自然人客户开户登记表》和本人身份证复印件;法人客户资料为《法人客户开户登记表》、营业执照复印件和组织机构代码证复印件;客户销户资料包括《客户销户申请表》等。  
对上述资料,会员应当自期货经纪合同终止之日起至少保存20年。  
第五十七条 有下列情形之一的,客户交易编码予以注销:  
(一)客户备案资料不真实;  
(二)客户被认定为市场禁止交易者;  
(三)未按照交易所要求提供客户备案资料;  
(四)客户申请注销;  
(五)交易所认定的其他情形。  
第五十八条 客户提供虚假的资料或者会员协助客户使用虚假资料开户的,交易所责令会员限期平仓,平仓后注销该客户交易编码,同时按照《中国金融期货交易所违规违约处理办法》的有关规定进行处理。  
**第七章 附则**  
第五十九条 违反本细则规定的,交易所按照本细则和《中国金融期货交易所违规违约处理办法》的有关规定处理。  
第六十条 本细则由交易所负责解释。  
第六十一条 本细则自2007年6月27日起实施。

第一联: 申请人留存		第二联: 会员单位留存 法人客户开户登记表			
会员单位名称	中国金融期货交易所	上海期货交易所	大连商品交易所	郑州商品交易所	
姓名					
性别					
年龄					
职业					
身份证号码					
联系电话					
联系地址					
指定下单人					
姓名					
身份证号码					
联系电话					
联系地址					
邮政编码					
资金调拨人					
姓名					
身份证号码					
联系电话					
联系地址					
邮政编码					
结算单确认人					
姓名					
身份证号码					
联系电话					
联系地址					
邮政编码					
同意开户记录(以下由会员单位填写)					
客户					
中国金融期货交易所					
上海期货交易所					
大连商品交易所					
郑州商品交易所					
审核意见:					
会员单位盖章: 负责人签字: 审批日期: 年 月 日					
第一联: 申请单位留存		第二联: 会员单位留存 客户销户申请表			
会员单位名称					
中国金融期货交易所					
上海期货交易所					
大连商品交易所					
郑州商品交易所					
姓名					
身份证号码					
客户					
中国金融期货交易所					
上海期货交易所					
大连商品交易所					
郑州商品交易所					
姓名					
身份证号码					
客户					
中国金融期货交易所					
上海期货交易所					
大连商品交易所					
郑州商品交易所					
姓名					
身份证号码					
客户					
中国金融期货交易所					
上海期货交易所					
大连商品交易所					
郑州商品交易所					
姓名					
身份证号码					
客户					
中国金融期货交易所					
上海期货交易所					
大连商品交易所					
郑州商品交易所					
姓名					
身份证号码					
客户					
中国金融期货交易所					
上海期货交易所					
大连商品交易所					
郑州商品交易所					
姓名					
身份证号码					
客户					
中国金融期货交易所					
上海期货交易所					
大连商品交易所					
郑州商品交易所					
姓名					
身份证号码					
客户					
中国金融期货交易所					
上海期货交易所					
大连商品交易所					
郑州商品交易所					
姓名					
身份证号码					
客户					
中国金融期货交易所					
上海期货交易所					
大连商品交易所					
郑州商品交易所					
姓名					
身份证号码					
客户					
中国金融期货交易所					
上海期货交易所					
大连商品交易所					
郑州商品交易所					
姓名					
身份证号码					
客户					
中国金融期货交易所					
上海期货交易所					
大连商品交易所					
郑州商品交易所					
姓名					
身份证号码					
客户					
中国金融期货交易所					
上海期货交易所					
大连商品交易所					
郑州商品交易所					
姓名					
身份证号码					
客户					
中国金融期货交易所					
上海期货交易所					
大连商品交易所					
郑州商品交易所					
姓名					
身份证号码					
客户					
中国金融期货交易所					
上海期货交易所					
大连商品交易所					
郑州商品交易所					
姓名					
身份证号码					
客户					
中国金融期货交易所					
上海期货交易所					
大连商品交易所					
郑州商品交易所					
姓名					
身份证号码					
客户					
中国金融期货交易所					
上海期货交易所					
大连商品交易所					
郑州商品交易所					
姓名					
身份证号码					
客户					
中国金融期货交易所					
上海期货交易所					
大连商品交易所					
郑州商品交易所					
姓名					
身份证号码					
客户					
中国金融期货交易所					
上海期货交易所					
大连商品交易所					
郑州商品交易所					
姓名					
身份证号码					
客户					
中国金融期货交易所					
上海期货交易所					
大连商品交易所					
郑州商品交易所					
姓名					
身份证号码					
客户					
中国金融期货交易所					
上海期货交易所					
大连商品交易所					
郑州商品交易所					
姓名					
身份证号码					
客户					
中国金融期货交易所					
上海期货交易所					
大连商品交易所					
郑州商品交易所					
姓名					
身份证号码					
客户					
中国金融期货交易所					
上海期货交易所					
大连商品交易所					
郑州商品交易所					
姓名					
身份证号码					
客户					
中国金融期货交易所					
上海期货交易所					
大连商品交易所					
郑州商品交易所					
姓名					
身份证号码					
客户					
中国金融期货交易所					
上海期货交易所					
大连商品交易所					
郑州商品交易所					
姓名					
身份证号码					
客户					
中国金融期货交易所					
上海期货交易所					
大连商品交易所					
郑州商品交易所					
姓名					
身份证号码					
客户					
中国金融期货交易所					
上海期货交易所					
大连商品交易所					
郑州商品交易所					
姓名					
身份证号码					
客户					
中国金融期货交易所					
上海期货交易所					
大连商品交易所					
郑州商品交易所					
姓名					
身份证号码					
客户					
中国金融期货交易所					
上海期货交易所					
大连商品交易所					
郑州商品交易所					
姓名					
身份证号码					
客户					
中国金融期货交易所					
上海期货交易所					
大连商品交易所					
郑州商品交易所					
姓名					
身份证号码					
客户					
中国金融期货交易所					
上海期货交易所					
大连商品交易所					
郑州商品交易所					
姓名					
身份证号码					
客户					
中国金融期货交易所					
上海期货交易所					
大连商品交易所					
郑州商品交易所					
姓名					
身份证号码					
客户					
中国金融期货交易所					
上海期货交易所					
大连商品交易所					
郑州商品交易所					
姓名					
身份证号码					
客户					
中国金融期货交易所					
上海期货交易所					
大连商品交易所					
郑州商品交易所					
姓名					
身份证号码					
客户					
中国金融期货交易所					
上海期货交易所					
大连商品交易所					
郑州商品交易所					
姓名					
身份证号码					
客户					
中国金融期货交易所					
上海期货交易所					
大连商品交易所					
郑州商品交易所					
姓名					
身份证号码					
客户					
中国金融期货交易所					
上海期货交易所					
大连商品交易所					
郑州商品交易所					
姓名					
身份证号码					
客户					
中国金融期货交易所					
上海期货交易所					
大连商品交易所					
郑州商品交易所					
姓名					
身份证号码					
客户					
中国金融期货交易所					
上海期货交易所					
大连商品交易所					
郑州商品交易所					
姓名					
身份证号码					
客户					
中国金融期货交易所					
上海期货交易所					
大连商品交易所					
郑州商品交易所					
姓名					
身份证号码					
客户					
中国金融期货交易所					
上海期货交易所					
大连商品交易所					
郑州商品交易所					
姓名					
身份证号码					
客户					
中国金融期货交易所					
上海期货交易所					
大连商品交易所					
郑州商品交易所					
姓名					
身份证号码					
客户					
中国金融期货交易所					
上海期货交易所					
大连商品交易所					
郑州商品交易所					
姓名					
身份证号码					
客户					
中国金融期货交易所					
上海期货交易所					
大连商品交易所					
郑州商品交易所					
姓名					
身份证号码					
客户					
中国金融期货交易所					
上海期货交易所					
大连商品交易所					
郑州商品交易所					
姓名					
身份证号码					
客户					
中国金融期货交易所					
上海期货交易所					
大连商品交易所					
郑州商品交易所					
姓名					
身份证号码					
客户					
中国金融期货交易所					
上海期货交易所					
大连商品交易所					
郑州商品交易所					
姓名					
身份证号码					
客户					
中国金融期货交易所					
上海期货交易所					
大连商品交易所					
郑州商品交易所					
姓名					
身份证号码					
客户					
中国金融期货交易所					
上海期货交易所					
大连商品交易所					
郑州商品交易所					
姓名					
身份证号码					
客户					
中国金融期货交易所					
上海期货交易所					
大连商品交易所					
郑州商品交易所					
姓名					
身份证号码					
客户					
中国金融期货交易所					
上海期货交易所					
大连商品交易所					
郑州商品交易所					
姓名					
身份证号码					
客户					
中国金融期货交易所					
上海期货交易所					
大连商品交易所					
郑州商品交易所					
姓名					
身份证号码					
客户					
中国金融期货交易所					
上海期货交易所					
大连商品交易所					
郑州商品交易所					
姓名					
身份证号码					
客户					
中国金融期货交易所					
上海期货交易所					
大连商品交易所					
郑州商品交易所					
姓名					
身份证号码					
客户					
中国金融期货交易所					
上海期货交易所					
大连商品交易所					
郑州商品交易所					
姓名					
身份证号码					
客户					
中国金融期货交易所					
上海期货交易所					
大连商品交易所					
郑州商品交易所					
姓名					
身份证号码					
客户					
中国金融期货交易所					
上海期货交易所					
大连商品交易所					
郑州商品交易所					
姓名					
身份证号码					
客户					
中国金融期货交易所					
上海期货交易所					
大连商品交易所					
郑州商品交易所					
姓名					
身份证号码					
客户					
中国金融期货交易所					
上海期货交易所					
大连商品交易所					
郑州商品交易所					
姓名					
身份证号码					
客户					
中国金融期货交易所					
上海期货交易所					
大连商品交易所					
郑州商品交易所					
姓名					
身份证号码					
客户					
中国金融期货交易所					
上海期货交易所					
大连商品交易所					
郑州商品交易所					
姓名					
身份证号码					
客户					
中国金融期货交易所					
上海期货交易所					
大连商品交易所					
郑州商品交易所					
姓名					
身份证号码					
客户					
中国金融期货交易所					
上海期货交易所					
大连商品交易所					
郑州商品交易所					
姓名					
身份证号码					
客户					
中国金融期货交易所					
上海期货交易所					
大连商品交易所					
郑州商品交易所					
姓名					
身份证号码					
客户					
中国金融期货交易所					
上海期货交易所					
大连商品交易所					
郑州商品交易所					
姓名					
身份证号码					