

附件

上海期货交易所交易细则 (修订案)

第一章 总则

第一条 为规范期货交易，保护期货交易当事人的合法权益，保障上海期货交易所（以下简称交易所）期货交易的顺利进行，根据《上海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 席位管理

第三条 交易席位是会员将交易指令输入交易所计算机交易系统参与集中竞价交易的通道。

交易席位分为场内交易席位和远程交易席位。

第四条 在取得会员资格后，会员即拥有一个场内交易席位。会员因业务发展需要增加交易席位，应当向交易所提出申请，经交易所批准，可以增加交易席位。

第五条 会员增加交易席位仅是增加该会员的交易通道，交易所对会员的持仓限额、风险控制及其他有关方面的管理规定不变。

第六条 会员申请增加场内交易席位，应当具备以下条件：

(一) 经营状况良好且无严重违规记录；

(二) 自申请之日起前三个月成交量连续排名前50位，或从事交易所期货交易的单量较多；

(三) 交易所要求应当具备的其他条件。

第七条 会员申请增加场内交易席位应当填写《上海期货交易所会员增加席位申请表》，并提交近一年期货经纪业务的基本情况、申请增加场内交易席位说明等材料。

第八条 增加场内交易席位申请经交易所批准后，会员应当与交易所签订协议书，协议期限为一年，使用费按年收取，每年为2万元。

第九条 协议签署后，会员应当在10个工作日内到交易所办理有关入场手续。无故逾期的，视同放弃。

第十条 协议尚未到期的，会员提出申请终止使用增加席位，经交易所批准后可以提前解除协议。

第十一条 会员丧失交易所会员资格的，其拥有的交易席位全部终止使用。

第十二条 有下列情况之一的，交易所可以强制撤销会员增加的交易席位：

(一) 管理混乱、有严重违规行为或经查实已不符合条件的；

(二) 私下转包、转租或转让交易席位的。

第十三条 会员终止使用场内交易席位后，使用费不予返还。

第十四条 由于计算机终端、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。

第三章 交易大厅管理

第十五条 交易大厅是集中交易期货合约的场所，出入交易大厅的人员为：经交易所登记批准的出市代表、交易所场务管理人员、交易所特许人员。

第十六条 出市代表是受会员委派并代表会员在交易大厅接受本会员的交易指令进行期货交易的人员，其在交易大厅与交易有关的行为由会员负责。

第十七条 出市代表应当具备下列条件：

- (一) 年满十八周岁，具有完全民事行为能力；
- (二) 经交易所专业培训并取得合格证书；
- (三) 品行端正，有良好的职业道德；
- (四) 没有刑事处罚记录。

第十八条 办理出市代表证件应当提供会员法人委托书原件、出市代表申请表（加盖单位公章）、出市代表资格证、身份证、学历证等材料。

第十九条 每个交易席位限两名出市代表进场，特殊情况应当经交易所批准。

第二十条 出市代表可以在每个交易日开市前30分钟内进入交易大厅做开市准备；出市代表在交易时间内不得随意出入交易大厅，特殊情况应当经场务管理人员批准；收市后出市代表应当在30分钟内离开交易大厅。

第二十一条 出市代表应当佩带有效证件、着指定的专用服装出

入交易大厅。

第二十二条 入市代表应当爱护交易大厅内的各种设施，严格按照交易所有关交易大厅计算机设备管理规定操作，损坏者要照价赔偿并按有关规定处罚。

第二十三条 入市代表携带交易设备进出交易大厅应当经交易所批准核准。

第二十四条 入市代表应当服从交易所场务管理人员的管理。

第二十五条 入市代表应当将交易所文件、通知、公告等材料及时送交所在会员。

第二十六条 会员应当妥善管理交易密码。因交易密码泄露造成的后果由会员承担。

第二十七条 入市代表不得有下列行为：

- (一) 无故迟到或早退；
- (二) 携带器械、各种食品进入交易大厅；
- (三) 行为举止不文明，损害、破坏交易设施，影响交易大厅内的卫生环境；
- (四) 在交易大厅内未按要求着装；
- (五) 未按正常程序操作交易系统；
- (六) 在交易期间随意走动、互串交易席位、大声喧哗、打闹、玩游戏机等影响交易秩序；
- (七) 影响其他席位的正常交易或交易所场务管理人员的正常工作；
- (八) 借用、盗用其他会员的电话或交易终端；

- (九) 未经许可在交易大厅拍照、录像；
- (十) 伪造、转借出市代表证；
- (十一) 其他影响交易所声誉、交易大厅内正常秩序的行为。

第二十八条 会员辞退、更换出市代表或出市代表离开原会员，应当及时到交易所办理撤销出市代表委托手续，并交还出市代表证。会员未能交还出市代表证的，应当及时向交易所有关部门书面报告情况，得到回执后，即可免除会员责任。会员未及时办理撤销手续或交还出市代表证的，所造成的一切后果由会员承担。

第二十九条 除会员合并、分立、破产以及经原会员同意外，被撤销出市代表授权的人员，交易所在三个月内不受理其到其他会员处任出市代表的注册申请。

第四章 远程交易

第三十条 远程交易是指会员在其营业场所、通过同交易所计算机交易系统联网的电子通讯系统直接输入交易指令、参加交易所集中竞价交易的一种交易方式。

第三十一条 远程交易席位的权利和义务与场内交易席位等同。

第三十二条 远程交易席位按终端装置数量分为两种形式：

- (一) 单机式，即一个远程交易席位只配置一台终端；
- (二) 网络式，即一个远程交易席位通过服务器连接多台终端。

第三十三条 会员申请开设单机式远程交易席位，应当具备下列条件：

- (一) 经营状况良好，无严重违规违约记录；
- (二) 拟开设远程交易的所在地的通讯、资金划拨条件能满足交易所期货交易运作要求；
- (三) 配备有一定数量的计算机、通讯专业技术人员；
- (四) 有健全的规章制度和远程交易管理办法；
- (五) 交易量和资金量达到交易所要求的规模。

第三十四条 会员申请开设网络式远程交易席位，除应当具备前条所列条件之外，还应当具备下列条件：

- (一) 具有期货经纪业务资格；
- (二) 具有双机备份的计算机系统和通讯系统（包括通讯线路）以及其他必需的相关设施。

第三十五条 会员申请远程交易席位，应当向交易所提交下列材料：

- (一) 近两年期货交易基本情况；
- (二) 开设远程交易席位的理由、条件、可行性论证等内容的申请报告；
- (三) 机构、人员现状及拟负责远程交易管理事务的主要人员的名单、简历、专业等基本情况；
- (四) 远程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。

第三十六条 交易所应当自收到会员提交的申请报告和有关材

料之日起一个月内，对申请报告作出书面批复。

第三十七条 会员在收到交易所同意其进行远程交易的批复后一周内，应当与交易所签订远程交易协议书。无故逾期的，视同放弃。

第三十八条 会员远程交易设施安装和系统调试完成之后，由交易所组织整体测试和模拟运作。达到标准要求和符合开通条件的，方可投入使用，启用起始日期由交易所通知会员。

第三十九条 会员未经允许不得擅自将单机式交易席位改造成网络式交易席位。

第四十条 开通远程交易的会员，其场内交易席位作为备用通道继续保留。在交易时间内，会员远程交易席位不能正常使用时，会员应当通过场内交易席位进行交易。

会员如不委派出市代表进场，远程交易席位不能正常使用时，后果自负。

第四十一条 会员应当加强对其远程交易的管理和远程交易系统的维护。主要设施需要更换或作技术调整的，应当事先征得交易所的同意。远程交易席位迁移出原登记备案地，应当事先报交易所审批。交易所所有权对远程交易席位的使用情况进行监督检查。

第四十二条 有下列情况之一的，远程交易席位予以撤销：

- (一) 会员提出撤销申请，经交易所核准的；
- (二) 私下转包、转租或转让席位的；
- (三) 管理混乱，或有严重违规行为，或经查实已不符合开设条件的；

- (四) 利用远程交易系统窃密或破坏交易系统的；
- (五) 所属会员丧失会员资格的；
- (六) 擅自将单机式交易席位改造成网络式交易席位的；
- (七) 交易所认为应当予以撤销远程交易席位的其他情况。

第五章 价格

第四十三条 交易所应当及时发布以下与交易有关的信息：

(一) 开盘价。开盘价是指某一期货合约开市前五分钟内经集合竞价产生的成交价格。

(二) 收盘价。收盘价是指某一期货合约当日交易的最后一笔成交价格。

(三) 最高价。最高价是指一定时间内某一期货合约成交价中的最高成交价格。

(四) 最低价。最低价是指一定时间内某一期货合约成交价中的最低成交价格。

(五) 最新价。最新价是指某交易日某一期货合约交易期间的最新成交价格。

(六) 涨跌。涨跌是指某交易日某一期货合约交易期间的最新价与上一交易日结算价之差。

(七) 最高买价。最高买价是指某一期货合约当日买方申请买入的即时最高价格。

(八) 最低卖价。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。

(九) 申买量。申买量是指某一期货合约当日交易所交易系统中未成交的最高价位申请买入的下单数量。

(十) 申卖量。申卖量是指某一期货合约当日交易所交易系统中未成交的最低价位申请卖出的下单数量。

(十一) 结算价。结算价是指某一期货合约当日成交价格按成交量的加权平均价。当日无成交的，当日结算价按照交易所相关规定确定。结算价是进行当日未平仓合约盈亏结算和制定下一交易日涨跌停板额的依据。

(十二) 成交量。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双边数量。

(十三) 持仓量。持仓量是指期货交易参与者所持有的未平仓合约的双边数量。

第四十四条 交易指令分限价指令、取消指令和交易所规定的其他指令。

限价指令每次最大下单数量为500手。交易指令每次最小下单量为1手。

交易指令的报价只能在价格波动限制之内。

第四十五条 开盘集合竞价在某品种某月份合约每一交易日开市前5分钟内进行，其中前4分钟为期货合约买、卖指令申报时间，后1分钟为集合竞价撮合时间，开市时产生开盘价。

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。第一笔成交价按照《上海期货交易所交易规则》相关规定确

定，此时前一成交价为上一交易日收盘价。

交易系统自动控制集合竞价申报的开始和结束并在计算机终端上显示。

第四十六条 集合竞价采用最大成交量原则，即以此价格成交能够得到最大成交量。高于集合竞价产生的价格的买入申报全部成交；低于集合竞价产生的价格的卖出申报全部成交；等于集合竞价产生的价格的买入或卖出申报，根据买入申报量和卖出申报量的多少，按少的一方的申报量成交。

第四十七条 开盘集合竞价中的未成交申报单自动参与开市后竞价交易。

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上市合约第一天交易涨跌停板额的依据。

第四十九条 新上市合约挂盘当日涨跌停板为正常涨跌停板的二倍（交易保证金维持合约规定比例）。如当日有成交，于下一交易日恢复到合约规定的涨跌停板，该合约其当日结算价按照《上海期货交易所结算细则》第三十八条中当日有成交的期货合约当日结算价确定方式确定；如当日无成交，下一交易日继续执行前一交易日涨跌停板和保证金，该合约其当日结算价参照《上海期货交易所结算细则》第三十八条中当日无成交的期货合约当日结算价确定方式确定，在适用该部分规定时，新上市合约挂盘当日的挂牌基准价视为“该合约上一交易日的结算价”。

第六章 交易编码

第五十条 交易所实行交易编码备案制度。交易编码是指会员和客户进行期货交易的专用代码。

第五十一条 交易编码分非期货公司会员交易编码和客户交易编码。交易编码由会员号和客户号两部分组成。

第五十二条 客户交易编码有十二位数字构成，前四位数是会员号，后八位数是客户号。如客户交易编码为000100001535，会员号为0001，客户号为00001535。入市代表在输入交易指令时只输入客户号1535即可。

第五十三条 非期货公司会员交易编码和客户交易编码位数相同，但后八位是其会员号。如非期货公司会员的会员号为120，其非期货公司会员交易编码是012000000120，入市代表在输入交易指令时只输入会员号120即可。

第五十四条 非期货公司会员交易编码与客户交易编码互不占用，001至1000号预留给非期货公司会员，客户号从1001号开始编制。

第五十五条 一个客户在交易所内只能有一个客户号，但可以在不同的期货公司会员开户。其交易编码只能是会员号不同，而客户号应当相同。

第五十六条 期货公司会员应当按交易所要求，根据会员服务系统中关于客户录入的提示输入客户资料。

第五十七条 期货公司会员在会员服务系统中录入客户资料后，应当将该客户资料传送于交易所备案，交易所在收到符合要求的客

户资料后，即开通该客户在交易系统中的应用。

第五十八条 有下列情况之一的，客户交易编码予以注销：

- (一) 客户备案资料不真实的；
- (二) 期货公司会员申请注销，且客户交易编码下没有持仓的；
- (三) 违反交易编码制度的其他情况。

第五十九条 客户提供虚假的开户资料或期货公司会员协助客户使用虚假资料开户的，交易所责令期货公司会员限期平仓，平仓后交易所注销该客户交易编码，同时按《上海期货交易所违规处理办法》的有关规定进行处理。

第七章 信息管理

第六十条 交易所期货交易信息是指在交易所期货交易活动中所产生的所有上市品种的期货交易行情、各种期货交易数据统计资料、交易所发布的各种公告信息以及中国证监会指定披露的其他相关信息。

第六十一条 期货交易信息所有权属交易所，由交易所统一管理和发布。未经交易所许可，任何机构和个人不得将之用于商业用途。

第六十二条 交易所按即时、每日、每周、每月、每年向会员、客户和社会公众提供期货交易信息。

交易所应当及时公布各合约的交割结算价。

交易所可根据需要调整上市品种标准仓单相关信息公布的频率。

第六十三条 即时行情是指在交易时间内，与交易活动同步发布的交易行情信息（见附件一）。

信息内容主要有：

~~商品名称、交割月份~~ **合约名称**、最新价、涨跌、成交量、持仓量、持仓量变化、申买价、申卖价、申买量、申卖量、~~每笔成交量~~、~~结算价~~、开盘价、收盘价、最高价、最低价、前结算价。

第六十四条 每日期货交易信息发布是指在每个交易日结束后发布的有关当日期货交易信息。

信息内容主要有：

（一）每日行情（见附件二）：商品名称、交割月份、开盘价、最高价、最低价、收盘价、前结算价、结算价、涨跌、成交量、持仓量、持仓量变化、成交额。

（二）~~期货合约活跃月份期货公司会员的总成交量、总买卖持仓量~~，~~活跃月份非期货公司会员的总成交量、总买卖持仓量~~和活跃月份**期货合约前20名期货公司会员的成交量、买卖持仓量和卖持仓量**，以及该合约所属期货品种**期货公司会员、非期货公司会员的总成交量、总买持仓量和总卖持仓量**。

第六十五条 每周期货交易信息发布是指在每周最后一个交易日结束后发布的期货交易信息。

信息内容主要有：

（一）每周行情（见附件三）：商品名称、交割月份、周开盘价、最高价、最低价、周收盘价、涨跌（周末收盘价与上周末**结算价**之差）、持仓量、持仓量变化（本周末持仓量与上周末持

仓量之差)、周末结算价、成交量、成交额。

(二)各上市商品标准仓单数量及与上次发布的增减量、可供期货交割使用仓库容量等情况。

(三)最后交割日后的第一个周五发布交割配对结果和实物交割量。

第六十六条 每月期货交易信息发布是指在每月最后一个交易日结束后交易所发布的期货交易信息。

信息内容主要有：

(一)每月行情(见附件四)：商品名称、交割月份、月开盘价、最高价、最低价、月末收盘价、涨跌(月末收盘价与上月末结算价收盘价之差)、持仓量、持仓量变化(本月末持仓量与上月末持仓量之差)、月末结算价、成交量、成交额。

(二)各指定交割仓库经交易所核定的可用于期货交割的库容量和已占用库容量及标准仓单量。

第六十七条 每年期货交易信息发布按照中国证监会有关规定执行。

第六十八条 交易所期货即时行情通过计算机网络传送至交易席位，并通过与交易所签订协议的有关公共媒体和信息商对社会公众发布。

第六十九条 交易所应当建立同步报价和即时成交回报系统。

第七十条 交易所、会员对不宜公开的交易资料、资金情况等信息有保密义务。

交易所在经批准的情况下，可以向有关监管部门或其他相关单

位提供相关信息，并执行相应的保密规定。

第七十一条 因信息经营机构或公众媒体转发即时交易行情信息发生故障，影响会员或客户正常交易的，交易所不承担责任。

第七十二条 会员、信息经营机构和公众媒体以及个人，均不得发布虚假的或带有误导性质的信息。

第八章 附 则

第七十三条 违反本细则规定的，交易所按《上海期货交易所违规处理办法》的有关规定处理。

第七十四条 有关连续交易相关的交易暂停、调整交易开市收市时间，上海期货交易所连续交易细则有特殊规定的，从其规定。

第七十五条 本细则解释权属于上海期货交易所。

第七十六条 本细则自2016年12月19日起实施。

附件一：上海期货交易所即时行情（表式）

附件二：上海期货交易所每日行情（表式）

附件三：上海期货交易所每周行情（表式）

附件四：上海期货交易所每月行情（表式）

附件一：

上海期货交易所
即时行情（样本）
（表式）

商品 名称	交割 月份 合约 名称	最新 价	涨跌	成交 量	持仓 量	持仓 量 变 化	申买 价	申卖 价	申买 量	申卖 量	每笔 成交 量	结算 价	开盘 价	收盘 价	最高 价	最低 价	前结 算价

注：①价格：元/吨； ②交易量、持仓量：手（按双边计算）； ③涨跌：最新价与前结算价之差。

附件二：

上海期货交易所
每日行情（样本）
（表式）

年 月 日 星期

商品名称	交割月份	开盘价	最高价	最低价	收盘价	前结算价	结算价	涨跌	成交量	持仓量	持仓量变化	成交额
小计												
小计												
小计												
小计												
总计												

注：①价格：元/吨； ②交易量、持仓量：手（按双边计算）； ③成交额：万元（按双边计算）； ④涨跌：收盘价与前结算价之差。

附件三：

上海期货交易所
每周行情（样本）
（表式）

年 月 日 星期

商品名称	交割月份	周开盘价	最高价	最低价	周收盘价	涨跌	持仓量	持仓量变化	周末结算价	成交量	成交额
小计											
小计											
小计											
小计											
总计											

注：①价格：元/吨； ②成交量、持仓量：手（按双边计算）； ③成交额：亿元（按双边计算）； ④涨跌：周收盘价与上周末~~结算价~~
收盘价之差。

附件四：

上海期货交易所
每月行情（样本）
（表式）

年 月

商品名称	交割月份	月开盘价	最高价	最低价	月收盘价	涨跌	持仓量	持仓量变化	月末结算价	成交量	成交额
小计											
小计											
小计											
小计											
总计											

注：①价格：元/吨； ②成交量、持仓量：手（按双边计算）； ③成交额：亿元（按双边计算）； ④涨跌：月收盘价与上月末~~结算价~~收盘价之差。