

# 广东塑料交易所风险控制管理细则

为加强广东塑料交易所（以下简称塑交所）交易风险管理，维护交易商的合法权益，保证塑交所商品交易的正常运行，根据《广东塑料交易所交易管理办法》制定本细则。

第一条 塑交所风险管理实行信誉担保金制度、分期付款制度、自律价格制度、限制持有量制度、强行转让制度、风险警示制度。

第二条 信誉担保金是交易商在塑交所专用结算账户中预先准备的资金，是未被合同占用的资金，最低余额由塑交所根据具体情况决定。

第三条 分期付款制度是指交易商存入本塑交所专用结算帐户中确保合同履行的资金，是已被合同占用的资金。交易分期付款按《广东塑料交易所管理办法》第十九条执行。

第四条 卖方卖出货物，须向塑交所提交货物入库凭证，在未提交的前须向买方提供交收保证金。

第五条 塑交所实行自律价格制度，PVC、ABS、PS、PP、LLDPE、烧碱、纯碱、PVCMB、PVCHSZ 的自律价格为上一交易日塑交所结算价的±500元/吨；自律价格作为交易涨跌限幅。如果连续三个交易日收市时的报价达到自律价格或交易风险明显增大时，本塑交所有权根据相应交易品种的市场价格波动情况临时或长期调整自律价格的幅度并采取其他相应措施。新品种上市时，塑交所有权调整相关产品的自律价格。

第六条 当交易价格出现同方向连续涨跌停板时或市场风险明显增大时，塑交所可以采取调整自律价格幅度及按一定原则强行转让等措施释放交易风险。

第七条 塑交所对交易商违约行为有权采取下列保障措施：

- （一）暂停订立电子订货合同；
- （二）按规定强行转让，并用转让后释放的资金履约赔偿；
- （三）依法处置质押物；
- （四）依法追偿。

第八条 塑交所实行强行转让制度，是指当交易商违约、违规或帐户余额不足，塑交所对其持有的电子订货合同进行转让的一种强制措施。因强行转让发生的亏

损及相关费用由该交易商承担，强行转让产生的盈利仍归该交易商。

第九条 当交易商出现下列情形之一时，塑交所所有权对其进行强行转让：

- （一）未按交易合同约定及时、足额支付合同分期付款；
- （二）未按交易合同约定及时、足额提交入库凭证或支付交收保证金；
- （三）帐户余额小于零并未能在规定的时间内补足的；
- （四）订货量超过塑交所相关规定的；
- （五）因违规受到塑交所强行转让的；
- （六）根据塑交所紧急措施应予以强行转让的；
- （七）其他应予以强行转让的。

第十条 塑交所执行强行转让的原则：

强行转让先由交易商自己执行，时限除本塑交所特别规定外，一律为开市后三十分钟内。若时限内交易商未执行完毕，则由本所强制执行。因帐户资金余额小于零而被要求强行转让的，在资金补足前，只允许转让原持有合同。

（一）属第九条第（一）、（二）、（三）、（四）项强行转让，其强行转让可由交易商主动提出，否则本所将按其某合同订货量“后订立先转让”的原则进行强行转让。当某合同达到自律价格时，若同时以自律价格申报时，则按“强行转让优先、时间优先”的原则排序。

（二）属第九条第（五）、（六）、（七）项强行转让的，其强行转让由本所确定。若多个交易商需要强行转让的，按追加资金由大到小的顺序，持有量、超出量由大到小的原则进行转让。

第十一条 强行转让的执行

（一）通知。资金不足的通过塑交所交易平台随当日结算数据报表中的资金结算表发送，有关交易商可以通过塑交所交易平台获得。本所以“资金追加通知书”的书面形式传真向有关交易商下达强行转让要求。

（二）执行及确认。

1、开市后，有关交易商必须首先在限定时间内自行转让，直至达到转让要求；

2、超过交易商自行转让时限而未执行完毕的，剩余部份由本所直接执行强行转让。

3、强行转让结果随当日成交记录发送，有关交易商可以通过塑交所交易平台获得。

第十二条 强行转让的价格通过市场交易形成。本所不负避免或减少被强行转让合同交易商损失的责任。

第十三条 PVC、ABS、PS、PP、LLDPE、烧碱、纯碱、PVCMB、PVCHSZ合同由于价格涨跌停板限制或其他市场原因，有关订货合同的强行转让只能延时完成的，因此发生的亏损，仍由该交易商承担；如强行转让在合同约定的交收日之前无法完成，该交易商者须继续对此持有量承担责任或履行交收义务，相关规定详见《广东塑料交易所交易管理办法》或《交收细则》。

第十四条 塑交所实行风险警示制度，当塑交所认为必要时，可以分别或同时采取要求报告情况、谈话提醒、发布风险提示函等措施中的一种或多种，以警示和化解风险。

第十五条 出现下列情形之一的，塑交所可以约见交易商谈话提醒风险。

- (一) 合同价格出现异常；
- (二) 交易商订货量异常；
- (三) 交易商交易异常；
- (四) 交易商资金异常；
- (五) 交易商涉嫌违规违约；
- (六) 塑交所接到交易商的投诉；
- (七) 塑交所认定有其他情况。

第十六条 发现交易商有违规嫌疑、订货量有较大风险的，塑交所可以对交易商发出书面风险提示函。

第十七条 本细则解释权属于广东塑料交易所股份有限公司。

第十八条 本细则自 2013 年 6 月 1 日起实施。