

异常交易

一、异常交易定义

交易所实行异常交易行为管理制度。对非期货公司会员、直接入场交易的境外交易者、客户等存在异常交易行为的，交易所可以采取相应的自律监管措施。期货公司会员、境外经纪机构应当履行对客户交易行为的管理职责，及时发现、及时制止、及时报告客户的异常交易行为，不得纵容、诱导、怂恿或者支持客户进行异常交易。

期货交易出现以下情形之一的，交易所认定为异常交易行为：

（一）以自己为交易对象，大量或多次进行自买自卖的行为（自成交）；

（二）委托授权给同一机构或者同一人代为从事交易的客户之间，大量或者多次进行相互为对手方的交易；

（三）日内出现频繁申报并撤销申报，可能影响期货或期权交易价格或者误导市场其他参与者进行期货期权交易的行为（频繁报撤单）；

（四）日内出现多次大额申报并撤销申报，可能影响期货期权交易价格或者误导期货期权市场其他参与者进行期货期权交易的行为（大额报撤单）；

（五）一组实际控制关系账户合并持仓超过交易所持仓限额规定的；

(六) 单个交易日在某一上市品种或者期货合约上的开仓交易数量超过交易所制定的日内开仓交易量的；

(七) 采取程序化交易方式下达交易指令，可能影响交易所系统安全或者正常交易秩序的行为；

(八) 中国证监会规定或者交易所认定的其他情形。

二、异常交易处罚措施

客户出现以上所列异常交易行为之一的，交易所可以采取下列措施：

(一) 要求报告情况；

(二) 列入交易所重点关注名单；

(三) 向会员通报；

(四) 约见谈话；

(五) 限期平仓；

(六) 限制开仓；

(七) 强行平仓；

(八) 根据交易所业务规则可以采取的其他措施。

被采取限制开仓自律管理措施的客户，交易所将向市场公告。涉嫌违反法律法规的，交易所应当提请中国证监会进行立案调查。

三、异常交易上报流程

(一) 一般处理流程：交易运行部在接到交易所异常交易通知后及时联系客户本人并发送异常交易提示短信、通知

客户所在营业部、业务单位。营业部、业务单位在接到异常交易通知后及时通知客户异常交易情况，并且对客户进行风险教育，了解客户交易的真实目的，教育客户合规交易、理性交易，并要求客户签署《客户异常交易行为确认书》，提交公司内部流程。

（二）特殊处理流程：根据交易所认定的具体内容，各营业部、业务部门在接到通知后，整理所需上报的客户资料上报至交易运行部。