

中国金融期货交易所异常交易管理办法

(2019年6月3日发布 2020年3月1日第一次修订)

第一条 为进一步规范期货交易行为，维护市场秩序，防范风险，保护期货交易当事人的合法权益，根据《中国金融期货交易所交易规则》《中国金融期货交易所违规违约处理办法》《中国金融期货交易所会员管理办法》和《中国金融期货交易所风险控制管理办法》等规定，制定本办法。

第二条 交易所对期货交易进行监控，发现期货交易出现异常情形的，有权对相关会员或者客户采取相应措施。

第三条 会员应当切实履行客户交易行为管理职责，及时发现、及时报告、及时制止客户的异常交易行为，不得纵容、诱导、怂恿、支持客户进行异常交易。

第四条 非期货公司会员、客户参与期货交易应当遵守法律法规和交易所业务规则的规定，接受交易所监管及会员对其交易行为的合法合规性管理，自觉规范交易行为。

第五条 期货交易出现以下情形之一的，为异常交易行为：

(一) 以自己为交易对象，大量或者多次进行自买自卖（包括一组实际控制关系账户内的交易）；

(二) 频繁报撤单行为；

(三) 大额报撤单行为；

(四) 实际控制关系账户合并持仓超过交易所持仓限额规定；

(五) 通过计算机程序下单可能影响交易所系统安全或者正常交易秩序的行为；

(六) 中国证监会规定或者交易所认定的其他情形。

第六条 交易所对实际控制关系账户的持仓和自成交、频繁报撤单、大额报撤单等异常交易行为合并计算。

第七条 非期货公司会员、客户出现本办法第五条所列异常交易行为之一的，交易所可以采取电话提醒、要求报告情况、要求提交书面承诺、列入监管关注名单、约见谈话、限制开仓等措施；情节严重的，交易所可以根据《中国金融期货交易所交易规则》和《中国金融期货交易所违规违约处理办法》等规定采取相应措施；涉嫌违反法律、法规、规章的，交易所提请中国证监会进行立案调查。

第八条 会员应当督促客户遵守与期货交易相关的法律、法规、规章及交易所业务规则，持续开展风险教育。

第九条 会员应当建立、完善有效的交易和资金监控系统，并制定相关的管理制度，密切关注客户的交易行为，积极防范客户在交易中可能出现的异常交易行为，引导客户理性、合规参与期货交易。

会员发现客户在期货交易过程中出现本办法第五条所

列异常交易行为之一的，应当予以提醒、劝阻和制止，并及时向交易所报告。

第十条 会员应当与客户约定，客户出现交易所规定的异常交易行为并经劝阻、制止无效的，会员可以采取提高交易保证金、限制开仓、拒绝客户委托或者终止经纪关系等措施。

第十一条 会员应当加强客户交易行为的合法合规管理，指定专门部门履行客户交易行为监督管理职责，并配合交易所市场监管工作。

第十二条 交易所对达到处理标准的异常交易行为，以电话、电子邮件、会员服务系统信息等数据电文形式通知会员。会员应当及时与相关客户取得联系，告知交易所的相关监管信息和书面决定，保留有关证据，并采取有效措施，规范客户交易行为。

第十三条 会员具有下列情形之一的，交易所可以责令其整改，并采取电话提示、约见谈话、发出警示函、发出意见函等措施：

（一）未及时、准确地向客户传达、送达交易所有关监管信息或者书面决定；

（二）未采取有效措施制止客户异常交易行为；

（三）未按照交易所要求尽责对涉嫌违法违规行为协助调查或者存在故意拖延、隐瞒和遗漏等行为；

(四) 纵容、诱导、怂恿、支持客户进行异常交易;

(五) 交易所规定的其他情形。

第十四条 交易所就客户异常交易行为相关事宜约见会员高管人员及相关人员的, 会员应当积极配合。对交易所在约见时提出的监管意见, 会员应当按照要求认真落实, 采取有效措施督促客户消除异常交易行为的负面影响。

第十五条 会员未尽到相关义务, 交易所已向同一期货公司会员发出两次警示函的, 第三次将对该会员发出意见函。

构成其他违规行为的, 按照《中国金融期货交易所违规违约处理办法》处理。

第十六条 异常交易行为的认定标准及处理程序由交易所另行规定。

第十七条 本办法由交易所负责解释。

第十八条 本办法自 2020 年 3 月 9 日起实施。