

大连商品交易所-异常交易行为

大连商品交易所-异常交易行为	
自成交行为	单个交易日在某一合约上的自成交次数达到5次以上的。
频繁报撤单行为	单个交易日在某一合约上的撤单次数达到500次以上的。
大额报撤单行为	单个交易日在某一合约上的撤单次数达到50次以上，且单笔撤单的撤单量达到合约最大下单手数的80%以上的。
程序化交易行为	采取程序化交易方式下达交易指令，影响或者可能影响交易所系统安全或者扰乱正常交易秩序的行为。
日内开仓交易量超仓行为	
豁免	1、交易所的市价指令、止损（盈）指令、套利指令产生的自成交、频繁报撤单、大额报撤单行为不构成异常交易行为； 2、套期保值交易产生的自成交、频繁报撤单、大额报撤单行为不构成异常交易行为； 3、做市交易产生的频繁报撤单行为不构成异常交易行为； 4、除上述情形外，实施申报费的合约上符合交易所公布情形的频繁报撤单行为不构成异常交易行为。
异常交易行为处理	对客户自成交、频繁报撤单、大额报撤单的处理程序 1、第一次达到处理标准的，交易所于当日对客户所在期货公司会员、境外特殊经纪参与者进行提示，要求其及时将交易所提示转达客户，对客户进行教育、引导、劝阻及制止； 2、第二次达到处理标准的，交易所将该客户列入重点监管名单，同时向客户所在期货公司会员、境外特殊经纪参与者通报； 3、第三次达到处理标准的，交易所于当日闭市后对该客户采取限制开仓的自律管理措施，限制开仓的时间为1个月。 客户自成交、频繁报撤单、大额报撤单行为发生在两个以上期货公司会员的，交易所根据异常交易行为的类别，分别选择自成交、频繁报撤单、大额报撤单行为发生次数最多的期货公司会员进行提示。
其他规定	交易所对实际控制关系账户的自成交、频繁报撤单、大额报撤单等异常交易行为合并计算； 交易所对期货、期权合约上的自成交、频繁报撤单、大额报撤单行为分别统计和处理； 客户或非期货公司会员单日在多个期权合约上自成交、频繁报撤单或大额报撤单达到交易所处理标准的，按照一次认定。一组实际控制关系账户单日在多个期权系列上合并持仓超限达到交易所处理标准的，按照一次认定。

广州期货交易所-异常交易行为

广州期货交易所-异常交易行为

自成交行为	单个交易日在某一合约上的自成交次数达到5次以上的。
频繁报撤单行为	单个交易日在某一合约上的撤单次数达到500次以上的。
大额报撤单行为	单个交易日在某一合约上的撤单次数达到50次以上，且单笔撤单的撤单量达到合约最大下单手数的80%以上的。
程序化交易行为	采取程序化交易方式下达交易指令，影响或者可能影响交易所系统安全或者扰乱正常交易秩序的行为。
日内开仓交易量超仓行为	_____
豁免	1、套期保值交易产生的自成交、频繁报撤单、大额报撤单行为不构成异常交易行为。 2、交易所的市价指令、止损（盈）指令、套利指令产生的自成交、频繁报撤单、大额报撤单行为不构成异常交易行为。 3、做市交易产生的频繁报撤单行为不构成异常交易行为。 4、除上述情形外，实施申报费的合约上，符合交易所规定情形的频繁报撤单行为不构成异常交易行为。
异常交易行为处理	对客户自成交、频繁报撤单、大额报撤单的处理程序 1、第一次达到处理标准的，交易所对该非期货公司会员、境外特殊非经纪参与者进行提示； 2、第二次达到处理标准的，交易所对该非期货公司会员、境外特殊非经纪参与者的高级管理人员进行约见谈话； 3、第三次达到处理标准的，交易所对该非期货公司会员、境外特殊非经纪参与者采取限制开仓的自律管理措施，限制开仓的时间不少于3个月。 客户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，交易所可以采取约见谈话、限制开仓等自律监管措施。 客户自成交、频繁报撤单、大额报撤单行为发生在两个以上期货公司会员的，交易所根据异常交易行为的类别，分别选择自成交、频繁报撤单、大额报撤单行为发生次数最多的期货公司会员行提示。
其他规定	交易所对实际控制关系账户的自成交、频繁报撤单、大额报撤单等异常交易行为合并计算。 客户单个交易日在两个以上期货合约或者期权合约上因自成交、频繁报撤单、大额报撤单达到交易所处理标准的，同一种异常交易行为按照发生一次认定。 交易所对期货、期权合约上的自成交、频繁报撤单、大额报撤单行为分别统计和处理。

郑州商品交易所-异常交易行为

郑州商品交易所-异常交易行为

自成交行为	单个交易日在某一合约自成交5次以上。
频繁报撤单行为	单个交易日在某一合约撤销定单次数500次以上；或者当某个交易日某一合约出现涨（跌）停板后，当日在该合约涨（跌）停板价位买（卖）单撤销定单次数100次以上。
大额报撤单行为	客户单日在某一合约撤单笔数50笔以上且每笔撤单量800手以上。
程序化交易行为	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。
日内开仓交易量 超仓行为	——
豁免	1、套期保值交易产生的自成交、频繁报撤单、大额报撤单行为不构成异常交易行为。 2、市价指令、套利指令产生的自成交、频繁报撤单、大额报撤单行为不构成异常交易行为。 3、做市交易产生的频繁报撤单行为不构成异常交易行为。 4、除上述情形外，施申报费收费的合约上符合交易所公布情形的频繁报撤单行为不构成异常交易行为。
异常交易行为处理	客户自成交、频繁报撤单、大额报撤单行为达到处理标准的，交易所按照以下程序进行处理： 1、第一次达到处理标准的，交易所于当日对客户所在期货公司会员进行提示，要求其及时将交易所提示转达客户，对客户进行教育、引导、劝阻及制止； 2、第二次达到处理标准的，交易所将该客户列入重点监管名单； 3、第三次达到处理标准的，交易所于当日闭市后对该客户采取限制开仓的自律监管措施，限制开仓时间不少于1个月。 当某个交易日某一合约出现涨（跌）停板后，客户当日在涨（跌）停板价位买（卖）单撤销定单次数100次以上且撤销定单手数合计10000手以上的，视为频繁报撤单情节严重的行为，交易所于当日闭市后对该客户采取限制开仓的自律监管措施，限制开仓时间不少于1个月。 客户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，交易所可以采取约见谈话、限制开仓等自律监管措施。同一客户异常交易行为发生在两个以上期货公司会员的，交易所对自成交、频繁报撤单、大额报撤单发生次数最多的期货公司会员进行提示。 客户出现异常交易行为的，除按照本办法规定的程序处理外，交易所视情节轻重还可以采取要求提交书面说明、书面警示、约见谈话、限制出金、限期平仓、限制开仓、强行平仓等自律监管措施；情节严重的，依据《郑州商品交易所违规处理办法》有关规定进行处理。
其他规定	客户或者一组实际控制关系账户单个交易日在两个以上合约因自成交、频繁报撤单、大额报撤单达到异常交易行为处理标准的，同一种异常交易行为按照发生一次认定。

上海期货交易所-异常交易行为

上海期货交易所-异常交易行为

自成交行为	单个交易日在某一合约上的自成交次数达到5次及以上的。
频繁报撤单行为	单个交易日在某一合约上的撤单次数达到500次及以上的。
大额报撤单行为	单个交易日在某一合约上的大额撤单（单笔撤单的撤单量达到300手及以上）次数达到50次及以上的。
程序化交易行为	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。
日内开仓交易量超仓行为	客户或者一组实际控制关系账户合并计算后，在某一期权合约上的开仓交易量超过交易所制定的日内开仓交易量的，构成异常交易行为。
豁免	因套期保值交易等产生的自成交、频繁报撤单、大额报撤单等行为不构成异常交易行为。 因做市交易产生的频繁报撤单行为不构成异常交易行为。 除上述情形外，实施申报费收费的合约上符合交易所公布情形的频繁报撤单行为不构成异常交易行为。
异常交易行为处理	客户自成交、频繁报撤单、大额报撤单行为的处理程序： 1、客户第一次达到处理标准的，交易所于当日对客户所在期货公司电话提示，要求其及时将交易所提示转达客户，责令其对客户进行教育、引导、劝阻及制止； 2、同一客户第二次达到处理标准的，交易所将该客户列入重点关注名单，同时将客户异常交易行为向期货公司通报； 3、同一客户第三次达到处理标准的，交易所于当日闭市后对客户采取限制开仓的自律管理措施，限制开仓的时间原则上不能少于1月。 客户或者一组实际控制关系账户合并计算后，单个交易日在某一上市品种或者合约上的开仓交易量超过交易所制定的日内开仓交易量，交易所于次日对其采取限制开仓的自律管理措施，限制开仓时间原则上不少于3个交易日。 客户异常交易行为发生在两个及以上期货公司会员的，交易所分别选择自成交、频繁报撤单、大额报撤单行为发生次数最多的期货公司会员进行电话提示。
其他规定	交易所对期货、期权合约上的自成交、频繁报撤单、大额报撤单达到交易所处理标准的次数分开统计。 客户或者一组实际控制关系账户合并计算后，单个交易日在两个及以上期货合约或者两个及以上期权合约因自成交、频繁报撤单、大额报撤单达到交易所异常交易行为处理标准的，同一种异常交易行为按照发生一次异常交易行为认定。

上海国际能源交易中心 -异常交易行为

上海国际能源交易中心-异常交易行为

自成交行为	单个交易日在某一合约上的自成交次数达到5次及以上的。
频繁报撤单行为	单个交易日在某一合约上的撤单次数达到500次及以上的。
大额报撤单行为	单个交易日在某一合约上的大额撤单（单笔撤单的撤单量达到300手及以上）次数达到50次及以上的。
程序化交易行为	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。
日内开仓交易量超仓行为	客户或者一组实际控制关系账户合并计算后，在某一期权合约上的开仓交易量超过交易所制定的日内开仓交易量的，构成异常交易行为。
豁免	因套期保值交易等产生的自成交、频繁报撤单、大额报撤单等行为不构成异常交易行为。 因做市交易产生的频繁报撤单行为不构成异常交易行为。 除上述情形外，实施申报费收费的合约上符合交易所公布情形的频繁报撤单行为不构成异常交易行为。
异常交易行为处理	客户自成交、频繁报撤单、大额报撤单行为的处理程序： 1、客户第一次达到处理标准的，交易所于当日对客户所在期货公司电话提示，要求其及时将交易所提示转达客户，责令其对客户进行教育、引导、劝阻及制止； 2、同一客户第二次达到处理标准的，交易所将该客户列入重点关注名单，同时将客户异常交易行为向期货公司通报； 3、同一客户第三次达到处理标准的，交易所于当日闭市后对客户采取限制开仓的自律管理措施，限制开仓的时间原则上不能少于1月。 客户或者一组实际控制关系账户合并计算后，单个交易日在某一上市品种或者合约上的开仓交易量超过交易所制定的日内开仓交易量，交易所于次日对其采取限制开仓的自律管理措施，限制开仓时间原则上不少于3个交易日。 客户异常交易行为发生在两个及以上期货公司会员的，交易所分别选择自成交、频繁报撤单、大额报撤单行为发生次数最多的期货公司会员进行电话提示。
其他规定	交易所对期货、期权合约上的自成交、频繁报撤单、大额报撤单达到交易所处理标准的次数分开统计。 客户或者一组实际控制关系账户合并计算后，单个交易日在两个及以上期货合约或者两个及以上期权合约因自成交、频繁报撤单、大额报撤单达到交易所异常交易行为处理标准的，同一种异常交易行为按照发生一次异常交易行为认定。

中国金融期货交易所-异常交易行为

中国金融期货交易所-异常交易行为

自成交行为	客户单日在某一合约上的自成交次数达到5次（含5次）的，构成“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客户之间的交易）”的异常交易行为。
频繁报撤单行为	股指期货：客户单日在某一合约上的撤单次数达到400次（含400次）的，构成“频繁报撤单”的异常交易行为。 股指期货/国债期货：客户单日在某一合约上的撤单次数达到500次（含500次），构成“频繁报撤单”的异常交易行为。
大额报撤单行为	客户单日在某一合约上的撤单次数达到100次（含100次），且单笔撤单量达到交易所规定的限价指令每次最大下单数量80%的，构成“大额报撤单”的异常交易行为。
程序化交易行为	_____
日内开仓交易量超仓行为	_____
豁免	股指期货/期权：因即时全部成交或撤销限价指令、即时成交剩余撤销限价指令、市价指令形成的自成交、频繁报撤单和大额报撤单不计入次数统计，由客户主动发出的撤单行为计入撤单次数统计。 国债期货： 1、因市价指令形成的自成交、频繁报撤单、大额报撤单不计入次数统计； 2、因限价指令（包括即时全部成交或撤销限价指令、即时成交剩余撤销限价指令和其他限价指令）形成的自成交、大额报撤单计入自成交次数统计； 3、因即时全部成交或撤销限价指令、即时成交剩余撤销限价指令形成的撤单行为计入频繁报撤单次数统计，因其他限价指令形成的撤单行为不计入频繁报撤单次数统计。 套期保值交易所产生的自成交、频繁报撤单和大额报撤单行为不构成异常交易行为。 做市交易所产生的频繁报撤单行为不构成异常交易行为。
异常交易行为处理	自成交、频繁报撤单、大额报撤单行为处理程序： 股指期货：客户出现自成交、频繁报撤单、大额报撤单行为达到交易所处理标准的，交易所于当日收市后对客户采取限制开仓的监管措施，限制开仓的时间原则上不低于1个月。 股指期货/国债期货：客户第一次出现自成交、频繁报撤单、大额报撤单行为达到交易所处理标准的，交易所于当日对客户所在会员进行电话提示。第二次出现，交易所将该客户列入重点监管名单。第三次出现，交易所于当日收市后对客户采取限制开仓的监管措施，限制开仓的时间原则上不低于1个月。 实际控制关系账户合并持仓超限行为的监管标准及处理程序： 1、实际控制关系账户组第一次出现合并持仓超限行为的，交易所将该组实际控制关系账户列入重点监管名单，并在当日收市后通知所在会员首席风险官，要求客户自行平仓。 客户在次日上午收市前未自行平仓的，交易所对客户持仓进行强行平仓，直至合并持仓不高于交易所规定的持仓限额，同时于强行平仓当日收市后对其采取限制开仓的监管措施，限制开仓的时间原则上不低于1个月。 2、实际控制关系账户组第二次出现合并持仓超限行为的，交易所在当日收市后通知所在会员首席风险官，要求客户自行平仓。客户自行平仓的，对该组实际控制关系账户采取限制开仓的监管措施，限制开仓的时间原则上不低于10个交易日。 客户在次日上午收市前未自行平仓的，交易所对客户持仓进行强行平仓，直至合并持仓不高于交易所规定的持仓限额，同时于强行平仓当日收市后对其采取限制开仓的监管措施，限制开仓的时间原则上不低于1个月。 3、实际控制关系账户组第三次出现合并持仓超限行为的，交易所在当日收市后通知所在会员首席风险官，要求客户自行平仓。客户在次日上午收市前未自行平仓的，交易所对客户持仓进行强行平仓，直至合并持仓不高于交易所规定的持仓限额。交易所对该组实际控制关系账户采取限制开仓的监管措施，限制开仓的时间原则上不低于6个月，并视情况采取进一步措施。
其他规定	一组实际控制关系账户单日在单品种多个合约上因实际控制关系账户组合并持仓超限达到交易所处理标准的，按照一次认定。