

# 中国金融期货交易所异常交易管理办法

(2019年6月3日实施)

**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，保护投资者合法权益，根据《期货交易管理条例》《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** 本交易所对期货交易进行监控，发现期货交易所出现异常情形时，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、纵容、支持客户进行异常交易。

**第四条** 客户参与期货交易应当遵守法律法规和交易所业务规则，不得利用交易所交易系统从事违法违规交易活动。

**第五条** 下列行为属于异常交易行为：

- (一) 以客户名义交易，或者以他人名义进行自营交易（包括一组实际控制关系账户内的客户之间的交易）；
- (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）通过计算机程序下载可能影响交易系统的指令。

**第六条** 会员应当实际控制其分支机构在境内从事

**第七条** 客户出现本办法第五条所列异常交易行为之一

的，会员应当立即向所在地中国证监会派出机构报告，

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有关的法律、

法规和交易所业务规则，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，

并制定相应的管理制度，密切关注客户的交易行为，

及时发现客户在交易中出现的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，应当立即向所在地中国证监会派出

机构报告。

**第十条** 会员应当建立、完善有效的交易和资金监控系统，

并制定相应的管理制度，密切关注客户的交易行为，

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**

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要求，督促客户规范客户交易行为。

**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) 未按照交易所要求主动报送违法违规异常交易数据或者存在异常交易行为未及时报告；
- (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，会员应当积极配合，对交易所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警示函。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