

1. 哪些属于异常交易行为？

	中金所	上海期货交易所	郑州商品交易所	大连商品交易所
相 同	(1) 自成交行为 (2) 频繁报撤单行为 (3) 大额报撤单行为 (4) 实际控制关系账户合并持仓超限行为 客户单日在多个合约因自成交、频繁报撤单、大额报撤单或实际控制关系账户合并持仓超限达到交易所处理标准的，按一次认定。 一组实际控制关系账户单日在多个合约上因合并持仓超限达到交易所处理标准的，按照一次认定。			
不 同	1、日内过度交易：股指期货单品种日内双边开仓数量最大为 10 手，套保交易不受此限制； 2、由于套保交易所产生的自成交行为、频繁报撤单行为、大额报撤单行为不作为异常交易行为。	1、FOK\FAK 指令不计入异常交易； 2、因套期保值交易产生的自成交、频繁报撤单、大额报撤单不作为异常交易行为	1、影响交割结算价行为 2、盗码交易行为 3、自然人客户违规持仓行为 4、由于套保交易所产生的自成交行为、频繁报撤单行为、大额报撤单行为不作为异常交易行为。	1、 FOK\FAK 指令不计入异常交易； 2、 由于套利、套保交易所产生的自成交行为、频繁报撤单行为、大额报撤单行为不作为异常交易行为。

2. 自成交的认定标准有哪些？

	中金所	上海期货交易所	郑州商品交易所	大连商品交易所
相同	客户或非期货公司会员单日在某一合约上的自成交次数达到 5 次（含 5 次）以上的，构成“以自己为交易对象，多次进行自买自卖”的异常交易行为。 交易所认定的一组实际控制关系账户之间发生成交的，参照自成交行为进行处理。			

3. 频繁报撤单行为认定标准有哪些？

	中金所	上海期货交易所	郑州商品交易所	大连商品交易所
不同	单日在某一合约上的撤单次数达到 400 次（含 400 次）以上的，构成“日内撤单次数过多”的异常交易行为。	单日在某一合约上的撤单次数达到 500 次（含 500 次）以上的，构成“日内撤单次数过多”的异常交易行为。		

4. 大额报撤单行为认定标准有哪些？

	中金所	上海期货交易所	郑州商品交易所	大连商品交易所
	客户单日在某一合约上的撤单次数超过 100 次（含 100 次），且单笔撤单量达到或者超过交易所规定的限价指令每次最大下单数量 80%的。	客户单日在某一合约上的大额撤单次数超过 50 次（含 50 次），单笔撤单的撤单量达到 300 手以上（含 300 手）。	客户单日在某一合约撤单笔数 50 笔（含 50 笔）以上且每笔撤单量 800 手（含 800 手）以上。	客户或非期货公司会员单日在某一合约上的撤单次数达到 400 次（含 400 次）以上，且单笔撤单的撤单量超过合约最大下单手数的 80%。
备注	内容形式相同，具体数据规定不同。			

5. 实际控制关系账户合并持仓超限行为认定标准有哪些？

中金所	上海期货交易所	郑州商品交易所	大连商品交易所
“两个或者两个以上涉嫌存在实际控制关系的交易编码”是指我所根据《中国金融期货交易所实际控制关系账户报备指引（试行）》所规定标准认定的具有实际控制关系的账户。	<p>（1）交易所对已认定的实际控制关系账户视作同一客户，对其投机持仓合并计算后按照《上海期货交易所风险控制管理办法》（以下简称《风控办法》）投机头寸限仓制度一个客户的标准进行限仓。</p> <p>（2）一组实际控制关系账户投机持仓合并计算后超过交易所持仓限额规定的，视作合并持仓超限异常交易行为，交易所启动异常交易行为处理程序。</p> <p>（3）一组实际控制关系账户出现合并持仓超限异常交易行为的，交易所按照《风控办法》及第二部分（二）第2条中强行平仓的原则执行操作。如果由交易所执行强行平仓的，交易所则按照投机持仓从大到小的原则选择客户（或非期货公司会员）执行强行平仓，直到该组实际控制关系账户投机持仓合并计算后符合交易所限仓标准。</p>	<p>（1）实际控制关系账户合并持仓超限行为：被交易所认定为实际控制关系账户的一组客户持仓合并计算后超出交易所规定客户持仓限额。</p> <p>（2）一组实际控制关系账户合并持仓超限，但持仓分布在不同会员的，交易所对持仓分布最大的会员参照上述规定采取相关措施。</p>	（1）实际控制关系账户的监管标准适用《关于〈大连商品交易所异常交易管理办法（试行）〉有关实际控制关系账户监管标准的通知》。

6.郑州商品交易所影响交割结算价行为是指什么？

客户利用对倒、对敲等手段交易，造成交割月合约价格异常波动幅度达到该合约涨跌停板幅度 40%以上，影响该合约交割结算价。

7.郑州商品交易所盗码交易行为是指什么？

客户盗取他人交易密码进行违法违规交易并转移资金。

8.郑州商品交易所自然人客户违规持仓行为是指什么？

自然人客户在交割月前一月最后一个交易日闭市时仍保留该交割月份持仓。

9.中金所日内过度交易行为是指什么？

客户单日在股指期货某一品种开仓交易量超过 10 手的，构成“日内开仓交易量较大”的异常交易行为。

日内开仓交易量是指客户单日在股指期货某一品种上的买开仓数量与卖开仓数量之和，套期保值交易开仓数量不受此限。

10.自成交、频繁报撤单、大额报撤单的具体处理程序是什么？

	中金所	上海期货交易所	郑州商品交易所	大连商品交易所
相同		1. 客户自成交、频繁报撤单、大额报撤单行为第一次达到交易所处理标准的，交易所于当日对客户所在会员的首席风险官进行电话提示。 2. 客户自成交、频繁报撤单、大额报撤单行为第二次达到交易所处理标准的，交易所将该客户列入重点监管名单。 3. 客户自成交、频繁报撤单、大额报撤单行为第三次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。		
不同	客户自成交、频繁报撤单、大额报撤单行为第一次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。	1. 客户第一次达到交易所处理标准的，交易所于当日对客户所在会员的首席风险官进行电话提示， 要求会员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. 客户第二次达到交易所处理标准的，交易所将该客户列入重点监管名单， 同时将客户异常交易行为向会员通报。	1. 客户第一次达到处理标准的，交易所于当日对客户所在会员的首席风险官进行电话提示， 要求会员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，并报送书面报告。	2. 客户自成交、频繁报撤单、大额报撤单行为第二次达到交易所处理标准的，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通报。

11.实际控制关系账户合并持仓超限行为的处理程序是什么？

中金所	上海期货交易所	郑州商品交易所	大连商品交易所
<p>（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。</p> <p>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。</p> <p>（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</p>	<p>（1）一组客户已被交易所认定为实际控制关系账户，且发生合并持仓超限行为，交易所于当日闭市后通知所在会员首席风险官，要求客户自行平仓；客户次日第一节交易时间前未自行平仓的，交易所对客户进行强行平仓，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闭市后对已认定的该组实际控制关系客户采取限制开仓的监管措施，限制开仓的时间不低于1个月。</p> <p>（2）一组实际控制关系账户出现合并持仓超限的，交易所除按前款要求进行处理外，</p> <p>（一）第一次出现的，交易所将该组实际控制关系账户列入重点监管名单；</p> <p>（二）第二次出现的，交易所于次日对该组实际控制关系账户采取限制开仓的监管措施，限制开仓的时间不低于10个交易日。</p> <p>（三）第三次出现的，交易所于次日对该组实际控制关系账户采取限制开仓的监管措施，限制开仓的时间不低于6个月。</p> <p>（3）一组实际控制关系账户当日结算时在某合约发生合并持仓超限行为，但其在该合约的持仓未超过上一交易日结算时交易所持仓限额，此种情形可豁免前款的监管措施。交易所当日已进行强行平仓的一组实际控制关系账户在同一合约同一持仓方向继续发生合并持仓超限行为的，若该组实际控制关系账户当日未在该合约该方向增仓的，可豁免本款第2项的监管措施。</p>		

<p>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。</p> <p>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。</p> <p>（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。</p>	<p>（2）（一）第一次达到交易所处理标准的，交易所将该组实际控制关系账户列入重点监管名单，并向会员通报。</p> <p>被采取限制开仓监管措施的客户，交易所将向市场公告。</p>	<p>(2)（三）第三次出现的，交易所对该组实际控制关系账户的持仓进行强行平仓，直至合并持仓不高于交易所规定的持仓限额，并对该组实际控制关系账户给予暂停开仓交易6个月的纪律处分。</p>	
--	---	--	--

12.中金所日内过度交易行为处理程序是什么？

1. 客户日内过度交易行为第一次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。
2. 客户异常交易行为达到交易所处理标准的，交易所对客户所在会员进行电话提示，会员应当及时将交易所提示转达客户，并对客户进行教育、引导、劝阻及制止。
3. 客户达到交易所处理标准的日内过度交易行为发生在同一会员的，交易所对该会员进行电话提示，发生在不同会员的，交易所对开仓交易量分布最大的会员进行电话提示。
4. 对于未按照交易所要求对客户尽到通知、教育、引导、劝阻及制止义务的会员，交易所可根据情节的严重程度采取提示、约见谈话、下发监管警示函、下发监管意见函等监管措施。
5. 由于会员未尽到相关义务，交易所已向会员下发两次监管警示函的，第三次向该会员下发监管意见函，并向中国证监会提请减少会员分类评价分值。