

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，保护非会员投资者合法权益，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，及时识别、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等规定，不得出现异常交易行为。

第五条 下列行为属于异常交易行为：

- (一) 以自己或交易对手名义或以他人名义进行自买自卖（包括一组实际控制关系账户内的客户之间的交易）；
- (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) 通过操纵和不正当手段影响合约价格或持仓量。

第六条 会员应当实际控制

第七条 客户出现本办法第五条所列异常交易行为之一

中国证监会进行立案调查。

第八条 会员应当督促客户遵守《期货交易所管理办法》、《期货交易所业务规则》、《期货交易所风险教育

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 会员发现客户出现异常交易行为并经劝阻、制止无效的，会员可以采取适当

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，告知交易所的相关信息和要求，督促客户及时采取有效举措，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）未按规定履行客户交易行为监督管理信息或者书面决定；

（二）未采取有效措施制止客户异常交易行为；

（三）未按交易所要求及时报告涉嫌违法违规交易行为；

（四）纵容、诱导、纵容、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单的，第三次将对该会员发出警示单。~~
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