附件2

**《郑州商品交易所异常交易行为管理办法》**

**修订条款对照表**

（**加下划线并加粗部分**为新增内容，双删除线部分为删除内容）

|  |  |
| --- | --- |
| **修订前条文** | **修订后条文** |
| **第五条** 期货交易出现以下情形之一的，交易所认定为异常交易行为：……（四）实际控制关系账户合并持仓超限行为，即被交易所认定为具有实际控制关系的一组账户持仓合并计算后超出交易所规定持仓限额的行为；（五）程序化交易扰乱交易秩序行为，即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；（六）中国证监会规定或者交易所认定的其他行为。 | **第五条** 期货交易出现以下情形之一的，交易所认定为异常交易行为：……（四）实际控制关系账户合并持仓超限行为，即被交易所认定为具有实际控制关系的一组账户持仓合并计算后超出交易所规定持仓限额的行为；（五**四**）程序化交易扰乱交易秩序行为，即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；（六**五**）中国证监会规定或者交易所认定的其他行为。 |
| **第六条** 客户或者一组实际控制关系账户合并计算后出现以下情形之一的，即达到自成交、频繁报撤单、大额报撤单、实际控制关系账户合并持仓超限等异常交易行为处理标准：……（四）一组实际控制关系账户持仓合并计算后超出交易所规定的持仓限额。 | **第六条** 客户或者一组实际控制关系账户合并计算后出现以下情形之一的，即达到自成交、频繁报撤单、大额报撤单、实际控制关系账户合并持仓超限等异常交易行为处理标准：……（四）一组实际控制关系账户持仓合并计算后超出交易所规定的持仓限额。 |
|  | **第十一条 实施申报费收费的合约上产生的频繁报撤单行为不构成异常交易行为。** |
| **第十一条** 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、大额报撤单或者实际控制关系账户合并持仓超限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。 | **第十一十二条** 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、大额报撤单或者实际控制关系账户合并持仓超限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。 |
| **第十六条** 一组实际控制关系账户出现自成交、频繁报撤单和大额报撤单行为，达到异常交易处理标准的，交易所按照本办法第十二条至第十五条的规定进行处理。 | **第十六十七条** 一组实际控制关系账户出现自成交、频繁报撤单和大额报撤单行为，达到异常交易处理标准的，交易所按照本办法第十二**十三**条至第十五**十六**条的规定进行处理。 |
| **第十七条** 一组实际控制关系账户发生合并持仓超限行为，交易所于当日闭市后通知客户所在期货公司会员，要求客户自行平仓。该组实际控制关系账户持仓分布在不同期货公司会员的，交易所通知持仓最大客户所在的期货公司会员。客户在规定时限内未自行平仓完毕的，由交易所执行强行平仓。由交易所执行强行平仓的，当日闭市后对该组实际控制关系账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。 | **第十七条** 一组实际控制关系账户发生合并持仓超限行为，交易所于当日闭市后通知客户所在期货公司会员，要求客户自行平仓。该组实际控制关系账户持仓分布在不同期货公司会员的，交易所通知持仓最大客户所在的期货公司会员。客户在规定时限内未自行平仓完毕的，由交易所执行强行平仓。由交易所执行强行平仓的，当日闭市后对该组实际控制关系账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。 |
| **第十八条** 一组实际控制关系账户合并持仓超限，交易所除按照本办法第十七条处理外，还应当按照以下程序进行处理：（一）第一次达到处理标准的，交易所将该组实际控制关系账户列入重点监管名单；（二）第二次达到处理标准的，交易所于下一交易日对该组实际控制关系账户采取限制开仓的自律监管措施，限制开仓时间不少于10个交易日；（三）第三次达到处理标准的，交易所于下一交易日对该组实际控制关系账户采取限制开仓的自律监管措施，限制开仓时间不少于6个月。 | **第十八条** 一组实际控制关系账户合并持仓超限，交易所除按照本办法第十七条处理外，还应当按照以下程序进行处理：（一）第一次达到处理标准的，交易所将该组实际控制关系账户列入重点监管名单；（二）第二次达到处理标准的，交易所于下一交易日对该组实际控制关系账户采取限制开仓的自律监管措施，限制开仓时间不少于10个交易日；（三）第三次达到处理标准的，交易所于下一交易日对该组实际控制关系账户采取限制开仓的自律监管措施，限制开仓时间不少于6个月。 |
| **第十九条** 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，可以豁免本办法第十八条的自律监管措施。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，因为市场原因在下一交易日无法平仓且结算时继续持仓超限的，下一交易日可以豁免本办法第十八条的自律监管措施。前两款豁免本办法第十八条自律监管措施的合并持仓超限行为，其超过持仓限额的部分仍应当按照本办法第十七条有关规定执行。 | **第十九条** 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，可以豁免本办法第十八条的自律监管措施。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，因为市场原因在下一交易日无法平仓且结算时继续持仓超限的，下一交易日可以豁免本办法第十八条的自律监管措施。前两款豁免本办法第十八条自律监管措施的合并持仓超限行为，其超过持仓限额的部分仍应当按照本办法第十七条有关规定执行。 |