

# 关于发布实施《郑州商品交易所异常交易行为监管工作指引（试行）》的通知

郑商发[2010]181号

各会员单位：

为规范期货交易行为，保护期货投资者合法权益，郑州商品交易所根据有关业务细则规定制定了《郑州商品交易所异常交易行为监管工作指引（试行）》，现发布实施。

特此通知。

附件：郑州商品交易所异常交易行为监管工作指引（试行）

二〇一〇年十月二十五日

附件:

## 郑州商品交易所异常交易行为监管工作指引（试行）

第一条 为规范期货交易行为，保护期货投资者合法权益，郑州商品交易所（以下简称“交易所”）根据《郑州商品交易所会员管理办法》（以下简称“《会员管理办法》”）、《郑州商品交易所期货交割细则》（以下简称“《交割细则》”）、《郑州商品交易所期货交易风险控制管理办法》（以下简称“《风控管理办法》”）、《郑州商品交易所违规处理办法》（以下简称“《违规处理办法》”）等有关规定，制定本指引。

第二条 交易所对期货交易行为进行监管，发现出现异常情况的，有权对有关会员或客户采取相应监管措施或纪律处分措施。

第三条 会员应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、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的规定，接受交易所监管及会员对其交易行为的合法合规管理，自觉规范交易行为。

第五条 异常交易行为情形：

（一）自成交行为，是指同一客户以自己为交易对象自买自卖的行为。属于《违规处理办法》第二十八条第（四）项应予规范的行为。

（二）频繁报撤单行为，是指同一客户频繁撤销定单的行为。属于《违规处理办法》第二十八条第（三）项应予规范的行为。

（三）大额报撤单行为，是指同一客户多次撤销单笔数量较大定

单的行为。属于《违规处理办法》第二十八条第（三）项应予规范的行为。

（四）关联帐户合并持仓超限行为，是指被交易所认定为关联账户的一组客户持仓合并计算后超出交易所规定持仓限额的行为。属于《违规处理办法》第二十八条第（二）项应予规范的行为。

（五）影响交割结算价行为，是指客户利用对倒、对敲等手段交易，影响交割结算价的行为。属于《违规处理办法》第二十八条第（二）项或第（四）项应予规范的行为。

（六）盗码交易行为，是指客户利用盗取他人交易密码进行交易等手段转移资金或扰乱交易管理秩序的行为。属于《违规处理办法》第二十八条第（三）项或第三十四条应予规范的行为。

（七）自然人客户违规持仓行为，是指自然人客户在交割月前一月最后交易日闭市时仍保留该交割月份持仓的行为。属于《交割细则》第四条、《风控管理办法》第四十七条第（三）项以及《违规处理办法》第三十四条等应予规范的行为。

（八）交易所认定的其他行为。

第六条 市场异常状况，是指因市场原因，致使交易风险、交割风险或结算风险明显增大的状况。属于《风控管理办法》第十四条、第二十三条、第四十七条、第五十四条等应予规范的行为。

第七条 会员应当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、合规参与交易。

会员发现客户出现本指引第五条异常交易行为之一或造成第六条状况的，应及时予以提醒、劝阻和制止，并及时向交易所报告。

第八条 客户出现本指引第五条异常交易行为之一或造成第六条

状况，经提醒、劝阻无效的，会员可以采取提高交易保证金、限制开仓、强行平仓等措施，及时制止客户异常交易行为。

第九条 出现本指引第五条异常交易行为之一或第六条状况的，交易所可以采取电话提醒、要求报告情况、列入重点监管名单、约见会员高管谈话、发出警示函、发布风险提示函等措施。情节严重的，交易所可以根据《风控管理办法》、《违规处理办法》的有关规定采取限期平仓、强行平仓、限制开仓等相应监管措施或纪律处分措施。涉嫌违法的，交易所提请中国证监会立案稽查。

第十条 交易所采取有关监管措施或做出书面决定的，通过客户所在会员向客户发出，会员应及时与有关客户取得联系，告知交易所的相关监管信息和书面决定，并采取有效措施，规范客户交易行为。

第十一条 会员存在下列情形之一的，属于会员违反《会员管理办法》有关规定，对客户未尽提醒、管理职责或敷衍、阻挠、拒绝交易所依法合规履行自律监管职责的失信行为。

（一）未及时、准确地向客户传达、送达交易所有关监管信息或书面决定。

（二）未采取有效措施制止客户异常交易行为。

（三）未按照交易所要求尽责对涉嫌违规违法行为协助调查或存在拖延、隐瞒和故意遗漏等行为。

（四）交易所认定的其他情形。

第十二条 对出现失信行为的会员，交易所可采取以下处理措施：

（一）约见会员总经理或法定代表人谈话。

（二）向会员发出监管警示函。

（三）向会员发出监管意见函，依据《违规处理办法》有关规定

采取警告、通报批评等相应监管措施或纪律处分措施，并提请中国证监会分类监管扣分。

第十三条 本指引解释权属于郑州商品交易所。

第十四条 本指引自 2010 年 11 月 8 日起施行。