

# 期货公司夜盘交易风险控制操作指引

## 第一章 总 则

**第一条** 为配合夜盘交易业务顺利推出，加强期货公司会员在夜盘交易期间的风险控制水平，根据《郑州商品交易所夜盘交易细则》以及相关业务实施细则，制定本操作指引。

**第二条** 期货公司会员应根据本操作指引要求配合交易所进行夜盘交易期间的风险控制管理。

## 第二章 运维保障

**第三条** 为确保夜盘交易的有序进行，期货公司会员应合理安排人员、设备资源和后勤保障等，同时指定夜盘交易期间的业务联系人，并将联系方式告知交易所。

**第四条** 期货公司会员应对行情发布、交易及结算系统运行情况进行评估，确保系统能够满足客户进行夜盘交易的需求。

**第五条** 期货公司会员应制定切实有效的交易、结算、风险控制、应急处理制度和流程，保障夜盘交易的开展。

## 第三章 风险揭示

**第六条** 期货公司会员应当向客户充分揭示夜盘交易的风险，在其营业场所备置夜盘交易业务规则，供客户查阅。

**第七条** 对于在交易所推出夜盘交易前与期货公司会员建立期货经纪业务关系的客户，期货公司会员应根据与其签订的期货经纪合同，通过约定的方式向客户通知夜盘交易业务规则。

**第八条** 对于在交易所推出夜盘交易后与期货公司会员建立期货经纪业务关系的客户，期货公司会员应在与客户签订的期货经纪合同中约定有关夜盘交易的内容。

#### 第四章 交 易

**第九条** 夜盘交易期间，期货公司会员应采取远程交易方式进行交易。期货公司会员可以引导客户采取网上交易方式进行夜盘交易。

#### 第五章 结 算

**第十条** 夜盘交易期间，交易所不办理有价证券充抵保证金、仓单折抵保证金和出金业务，期货公司会员应提前做好资金准备。

期货公司会员应在每个交易日日盘结算完毕后向客户发送该交易日的交易结算报告。

对于参与夜盘交易品种的客户，对结算数据有异议的，应在下一个交易日夜盘交易开市前三十分钟以书面形式或其他约定方式通知会员，客户在规定时间内没有对结算数据提出异议的，则视作客户对结算结果的确认。

**第十一条** 对于不参与夜盘交易品种的客户，其结算结果的确认依照期货经纪合同约定执行。

#### 第六章 监 察

**第十二条** 期货公司会员应切实履行客户交易行为监控职责，及时发现、报告或制止客户的异常交易行为，不得纵容、诱导、怂恿、支持客户在夜盘交易期间进行异常交易。

## **第七章 风险控制**

**第十三条** 期货公司会员应根据夜盘交易期间的强行平仓执行原则制定本公司内部强行平仓操作流程。

**第十四条** 当客户风险率达到期货经纪合同约定标准时，期货公司会员应在交易结算报告中向客户发出追加保证金通知。

对于参与夜盘交易品种的客户，期货公司会员可以重新约定保证金的追加程序。

对于不参与夜盘交易品种的客户，其保证金的追加程序依照期货经纪合同约定执行。

## **第八章 应急管理**

**第十五条** 期货公司会员应针对夜盘交易制定相应的应急预案，以应对夜盘交易发生的突发情况。

**第十六条** 期货公司会员应与信息服务商建立夜盘交易保障机制，确保故障发生时进行快速响应服务。

**第十七条** 期货公司会员应选择多个期货保证金账户作为交易所入金账户，在银期转账系统发生故障时应采取可靠措施保障客户入金。

**第十八条** 期货公司会员在夜盘交易开市前半小时未能完成全市场结算或交易系统初始化工作的，应及时向交易所报告。

**第十九条** 期货公司确认出现技术故障导致无法交易时，须及时向交易所申报故障，以便交易所核对故障情况。并须在故障排除后向交易所通报故障解除。

**第二十条** 当期货公司会员收到交易所关于夜盘交易暂停、取消或恢复的通知时，期货公司会员应及时向客户通知。

**第二十一条** 如因期货公司会员原因无法正常参与当日夜盘交易的，期货公司会员应及时通知客户。

## 第九章 附 则

**第二十二条** 本指引的解释权属于郑州商品交易所。

**第二十三条** 本指引自夜盘交易正式运行之日起实施。