**广州期货交易规则简表（交易所异常交易行为监管标准）**

|  |  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- | --- |
|  | **上海期货交易所** | **上海国际能源交易中心** | **大连期货交易所** | **郑州期货交易所** | **中国金融期货交易所** |
| **自成交****行为** | 客户单日在某一合约上的自成交次数超过5次（含5次）行为构成“以自己为交易对象，多次进行自买自卖”的。 | 客户单日在某一合约上的自成交次数超过5次（含5次），构成“以自己为交易对象，多次进行自买自卖”的。（账户组间亦视为自成交） | 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。交易所认定的实际控制关系账户之间发生成交的，按照自成交行为进行处理，实际控制关系账户发生自成交行为合并计算 | 客户单日在某一合约自我成交 5次以上(含本数，下同) | 客户每日在单个合约上自成交行 为达到或者超过5次的，认定为“异常交易行为”。套期保值交易的自成交次数不受此限。 |
| **频繁报撤单行为** | 客户单日在某一合约上的撤单次数超过500次（含500次），构成“日内出现频繁申报并撤销申报，可能影响期货交易价格或误导其他客户进行期货交易的行为的 | 客户单日在某一合约上的撤单次数超过500次（含500次），构成“日内出现频繁申报并撤销申报，可能影响期货交易价格或误导其他客户进行期货交易的行为”的。 | 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 500次（含500次）以上的，构 成“频繁报撤单”的异常交易 行为。实际控制关系账户发生频繁报撤单行为合并计算 | **（1）客户单日在某一合约撤单笔数500笔以上。****（**2**）当某个交易日某一合约停板后，客户当日在涨停板价位买单撤单量或者在跌停板价位卖单撤单量超过** 100 **笔的，属于频繁报撤单行为。客户有上述停板价位频繁报撤单超过** 100 **笔的行为且当日客户在该合约涨跌停板价位撤单量累计达到** 10000**手的，视为情节严重的行为。** | 客户单日在股指期货交易品种某一合约上的撤单次数达到或者超过400次的，构成“日 内撤单次数过多”的异常交易行为。套期保 值交易和FAK、FOK指令的撤单数量不受此限。 |
| **大额报撤单** | 客户单日在某一合约上的大额撤单次数超过50次（含50次），构成“日内出现多次大额申报并撤销申报，可能影 响期货交易价格或误导其他客户进行期货交易的行为”的 。单笔撤单的撤单量达到300手以上（含300手），视作大额 报撤单。 | 客户单日在某一合约上的大额撤单次数超过50次（含50次），构成“日内出现多次大额申报并撤销申报，可能影响期货交易价格或误导其他客户进行期货交易的行为”的。单笔撤单的撤单量达到300手以上（含300手），视作大额报撤单 | 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）以上的，且 单笔撤单的撤单量超过合约最 大下单手数的80%，构成“大 额报撤单”的异常交易行为，实际控制关系账 户发生大额报撤单行为合并计算。 | 客户单日在某一合约撤单笔数50笔以 上且每笔撤单量800手以上 | 客户单日在某一合约上的撤单次数超过100次（含），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， 构成“大量或者多次申报并撤销申报”的异常交易行为。套期保值交易~~、套利交易~~的撤单数量不受此限。 |
| **日内开仓交易量较大行为** |  |  | 单个客户在焦炭和焦煤品种， 单个品种、单日开仓量不得超 过1000手。套期保值交易开仓 数量不受限制。 |  | 客户在股指期货交易单品种单日开仓交量 超过20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 单日在单产品所有合约上的买开仓数量与卖开仓数量之和。套期保值交易的日内开仓交易量不受此限。 |
| **影响交割结算价行为** |  |  |  | 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 |  |
| **自然人客户违规持仓行为** |  |  | 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 | 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 |  |
| **盗码交易行为** |  |  |  | 客户盗取他人交易账号、密码进行交易并转移资金 |  |
| **关联账户合并持仓超限行为** | **根据实质重于形式的原则，具有下列情形之一的，应当认 定为行为人对他人期货账户的交易具有实际控制关系： （1）行为人作为他人的控股股东，即行为人的出资额占他 人资本总额50%以上或者其持有的股份占他人股本总额50% 以上的股东，出资额或者持有股份的比例虽然不足50%，但 依其出资额或者持有的股份所享有的表决权已足以对股东会、股东大会的决议产生重大影响的股东；（2）行为人作为他人的开户授权人、指定下单人、资金调拨人、结算单确认人或者其他形式的委托代理人； 关联账 （3）行为人作为他人的法定代表人、主要合伙人、董事、户合并 监事、高级管理人员等，或者行为人与他人的法定代表人持仓超 、主要合伙人、董事、监事、高级管理人员等一致的；限行为 （4）行为人与他人之间存在配偶关系；（5）行为人与他人之间存在父母、子女、兄弟姐妹等关系，且对他人期货账户的日常交易决策具有决定权或者重大影响；（6）行为人通过投资关系、协议、融资安排或者其他安排，能够对他人期货账户的日常交易决策具有决定权或者重大影响；（7）行为人对两个或者多个他人期货账户的日常交易决策具有决定权或者重大影响；（8）交易所认定的其他情形。** | **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》。一组实际关系账户单日在多个 合约上合并持仓超限达到交易 所处理标准的，按照一次认定 。** | 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。 | **“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。**  |

备注：

上海交易所： 1.因套利交易产生的自成交、频繁报撤单、大额报撤单不作为异常交易行为。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。3.在统
计客户和非期货公司会员自成交、频繁报撤单和大额报撤单次数时，FOK（立即全部成交否则自动撤销指令）和FAK（立即成交剩余指令自动撤销指令）交易指令形成的自成交和撤单 不计入在内。

大连交易所：1、在统计客户和非期货公司会员自成交、频繁报撤单和大额报撤单次数时，市价指令、止损（盈）指令、套利指令、附加立即全部成交否则自动撤销（FOK）和立即成 交剩余指令自动撤销（FAK）指令属性形成的撤单和自成交不计入在内。2、由于套利交易、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。3.期权异常交易同期货，由于期权做市交易所产生的频繁报撤单行为不作为异常交易行为。4.期权由于套利交易、套保交易产生的自成交行为、频繁报撤单行为、大额报撤单行为不作为异常交易行为。

郑州交易所：1.由于套期保值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.在统计客户和非期货公司会员自成交、频繁报撤单和大额报撤单 次数时，市价指令、立即成交剩余指令自动撤销（FAK）指令属性形成的自成交行为、频繁报撤单行为、大额报撤单行为不计入在内。3、期权异常交易同期货，由于期权做市交易所产生的频繁报撤单行为不作为异常交易行为。

中金所：1、在统计客户频繁报撤单和大额报撤单次数时，因即时全部成交或撤销限价指令、即时成交剩余撤销限价指令、市价指令自动形成的撤单行为不计入频繁报撤、大额报撤单次数统计，由客户主动发出的撤单行为计入撤单次数统计。2、因即时全部成交或撤销限价指令、即时成交剩余撤销限价指令、市价指令形成的自成交行为不计入自成交次数统计。