

异常交易及违规行为的主要类型、监管标准、处理程序及罚则

(2018年7月简版, 具体以最新版规则为准)

编号	异常或违规行为类型	监管标准	处理程序及罚则
一	自买自卖	(一) 单一客户或实际控制关系账户单日在某一合约上的自成交次数达到5次(含5次)以上 (二) 实际控制关系账户的自成交行为合并计算	(一) 第一次达标电话提示 (二) 第二次达标列入重点监管名单 (三) 第三次达标限制开仓不低于1个月
二	频繁报撤单	(一) 客户单日在某一合约上的撤单次数达到500次(含500次)以上 (二) 实际控制关系账户的频繁报撤单行为合并计算	
三	大额报撤单	(一) 客户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% (二) 实际控制关系账户的大额报撤单行为合并计算	

四	<p style="text-align: center;">实际控制关系账户 认定及报备</p>	<p>(一) 实际控制是指行为人对他人期货账户具有管理、使用、收益或者处分等权限，从而对他人交易决策拥有决定权的行为或事实</p> <p>(二) 账户之间的关系达到下列八条认定标准，应向交易所报备：</p> <p>(1) 控股股东</p> <p>(2) 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</p> <p>(3) 法定代表人、主要合伙人、董事、监事、高级管理人员等（或法定代表人、主要合伙人、董事、监事、高级管理人员等一致）</p> <p>(4) 配偶</p> <p>(5) 父母、子女、兄弟姐妹</p> <p>(6) 投资关系、协议、融资安排等</p> <p>(7) 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</p> <p>(8) 交易所认定的其他情形</p>	<p>(一) 具有实际控制关系账户的客户应通过期货公司会员主动申报相关信息；非期货公司会员应通过交易所主动申报相关信息。</p> <p>(二) 经调查认为符合认定标准的客户和非期货公司会员，交易所有权责令其进行报备，拒不报备的，交易所有权直接认定</p> <p>(三) 对于具有实际控制关系但不如实报备相关信息、不如实回复交易所询问、隐瞒事实真相、故意回避等不协助报备或不协助调查工作的非期货公司会员、客户，交易所可以采取谈话提醒、书面警示、暂停开仓等监管措施；情节严重的，交易所将依据《大连商品交易所违规处理办法》有关规定进行处理</p>
五	<p style="text-align: center;">实际控制关系账户组合 并持仓超限</p>	<p>实际控制关系账户投机持仓合并计算，且不得超过单个客户的投机持仓限额</p>	<p>(一) 实际控制关系账户合并持仓超限的，客户自行平仓；如客户次日第二节前未自行平仓的，交易所对客户进行强行平仓，同时限制开仓不低于 1 个月</p> <p>(二) 第一次超仓列入重点监管名单</p> <p>(三) 第二次超仓限制开仓不低于 10 个交易日</p> <p>(四) 第三次超仓限制开仓不低于 6 个月</p>

六	违反持仓管理规定	交易所实行限仓制度。限仓是指交易所规定会员或客户可以持有的,按单边计算的某一期货合约投机头寸的最大数额	(一) 警告 (二) 通报批评 (三) 公开谴责 (四) 强行平仓 (五) 暂停部分期货业务 (六) 暂停开仓交易 1 个月以内 (七) 可并处 1 至 20 万元罚款
七	操纵市场	(一) 单独或者合谋,集中资金优势、持仓优势或者利用信息优势,连续或者联合买卖合约,恶意影响或者企图影响期货交易价格或者期货交易量 (二) 利用移仓、分仓、对敲等手段,规避交易所的持仓限制,超量持仓,控制或企图控制市场价格,影响市场秩序 (三) 不以成交为目的或明知申报的指令不能成交,仍恶意或连续输入交易指令影响或者企图影响期货价格,扰乱市场秩序或转移资金 (四) 为制造虚假的市场行情而进行连续买卖、自我买卖或蓄意串通,按事先约定的方式或价格进行交易或互为买卖,制造市场假象,影响或企图影响市场价格或持仓量	(一) 交易所视情节上报证监会 (二) 责令改正 (三) 赔偿损失、没收违规所得 (四) 情节较轻的: 警告 强行平仓 暂停开仓交易 1 个月以内 没有违规所得或者违规所得 5 万元以下的,可并处 5 至 20 万元的罚款;违规所得 5 万元以上的,可并处违规所得一倍以上三倍以下的罚款 (五) 情节严重的: 通报批评 公开谴责 强行平仓 暂停部分期货业务 暂停开仓交易 1 至 6 个月 取消其相应资格 宣布为“市场禁止进入者” 没有违规所得或者违规所得 10 万元以下的,可并处 10 至 100 万元的罚款;
八	对敲转移资金	利用对敲手段,转移资金或者牟取不当利益	
九	自成交影响价格	利用自成交手段,影响市场价格或者牟取不当利益	
十	内幕交易	利用内幕信息或国家机密进行期货交易或泄露内幕信息影响期货交易	

十一	未妥善保管交易编码	未按交易所规定妥善管理交易编码，导致交易编码被他人利用实施违规行为	违规所得 10 万元以上的，可并处违规所得三倍以上五倍以下的罚款
十二	套期保值持仓超仓	交易期间，非期货公司会员或客户当日开仓导致套保持仓与投机持仓合计超过交易所规定标准的；结算后，非期货公司会员或客户套期保值持仓与投机持仓合计超过交易所规定标准，并且未在下一交易日第二节交易结束前自行调整或调整后仍不符合要求	交易期间，非期货公司会员或客户当日开仓导致套保持仓与投机持仓合计超过交易所规定标准的，交易所禁止其当日超仓合约开仓交易，并在结算后恢复其开仓权限。结算后，非期货公司会员或客户套保持仓与投机持仓合计超过规定标准的，应在下一个交易日第一节自行平仓。未平仓或平仓后仍未符合规定标准的，交易所禁止其超仓合约开仓交易，并在结算后恢复其交易权限，因价格涨跌停板、异常情况或不可抗力导致无法在第一小节完成平仓的情形除外。 非期货公司会员或客户累计 2 个交易日（含 2 个）以上出现套保持仓与投机持仓合计超过规定标准情形的，交易所自下一交易日起连续 3 个交易日禁止其超仓合约开仓交易；情节严重的，按照《大连商品交易所违规处理办法》处理。
十三	套期保值交易影响价格	具有套期保值交易资格的客户频繁进行开平仓交易，影响或者企图影响市场价格	<ul style="list-style-type: none"> （一）谈话提醒 （二）书面警示 （三）调整或者取消其套期保值持仓增加额度 （四）取消套期保值交易资格 （五）必要时可以采取限制开仓、限期平仓、强行平仓等措施，并按《大连商品交易所违规处理办法》的有关规定处理

十四	虚假套期保值	在申请套期保值交易资格、申请增加套期保值持仓额度和交易时，有欺诈或违反交易所规定行为	<p>(一) 不受理其增加套期保值持仓额度的申请</p> <p>(二) 调整或者取消已批准的套期保值持仓增加额度</p> <p>(三) 取消其套期保值交易资格</p> <p>(四) 必要时可以采取限制开仓、限期平仓、强行平仓等处置措施，并按《大连商品交易所违规处理办法》的有关规定处理</p>
十五	套利交易影响价格	利用套利交易影响或者企图影响市场价格	<p>(一) 谈话提醒</p> <p>(二) 书面警示</p> <p>(三) 调整或者取消其套利持仓增加额度</p> <p>(四) 限制开仓、限期平仓、强行平仓等措施，并按《大连商品交易所违规处理办法》的有关规定处理</p>
十六	虚假套利	在申请增加套利持仓额度和交易时，有欺诈或违反交易所规定行为	<p>(一) 不受理其增加套利持仓额度的申请</p> <p>(二) 调整或者取消已批准的套利持仓增加额度</p> <p>(三) 限制开仓、限期平仓、强行平仓等处置措施，并按《大连商品交易所违规处理办法》的有关规定处理</p>