

# 异常交易监管指标

行为	上海期货交易所	大连商品交易所	郑州商品交易所	上海国际能源交易中心	中国金融期货交易所
自成交	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。	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。	客户单日在某一合约自我成交 5次以上（含本数，下同）	单个交易日在某一合约上的自成交次数达到5次及以上的	客户单日在某一合约上的自成交次数达到或者超过5次的，构成“以自己为交易对象，大量或者多次进行自买自卖”的异常交易行为。套期保值交易、套利交易的自成交次数不受此限。
频繁报撤单	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。	客户单日在某一合约撤销定单笔数500笔以上。	单个交易日在某一合约上的撤单次数达到500次及以上的	客户单日在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、套利交易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。	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。	单个交易日在某一合约上的大额撤单（单笔撤单的撤单量达到300手及以上）次数达到50次及以上的	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。
日内过度交易	日内开仓交易的最大数量是指非期货公司会员或者客户在某一交易日某一合约上的买开仓报单数量与卖开仓报单数量之和。套期保值交易的开仓数量不受此限制	单日开仓量是指非期货公司会员或者客户某个交易日在某个品种所有合约上的买开仓数量与卖开仓数量之和。套期保值交易开仓数量不受限制。具有实际控制关系的账户按照一个账户管理。	/	/	客户在沪深300、上证50、中证500单个股指期货品种单日开仓交易量单个合约超过500手，套期保值交易开仓数量不受此限；
实际控制关系账户合并持仓超限行为	一组实际控制关系账户内的客户合并持仓超过交易所持仓的限额规定。	交易所认定的实际控制关系组合并持仓超过交易所持仓限额规定。其中期权一组实际控制关系账户持有的某月份期权合约中所有看涨期权的买持仓量和看跌期权的卖持仓量之和、看跌期权的买持仓量和看涨期权的卖持仓量之和，分别不得超过期权持仓标准。实际关系账户限仓标准与单一客户相同，根据《关于豆粕期货期权上市交易有关事项的通知》，上市初期为300手。一组实际控制关系账户单日在多个期权系列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。	客户或者一组实际控制关系账户合并计算后，在某一上市品种或者期货合约上的开仓交易数量超过上期能源制定的日内开仓交易量的，构成异常交易行为；一组实际控制关系账户一般持仓及套利交易持仓合并计算后超过一般持仓限额和其获批的套利交易持仓额度总和的，构成异常交易行为；	两个或两个以上涉嫌存在实际控制关系的交易编码合并持仓超过交易所持仓限额规定。
异常行为次数认定	一组实际控制关系账户单日在多个合约上因合并持仓超限达到交易所处理标准的，按照一次认定。	一组实际控制关系账户单日在多个合约上因合并持仓超限达到交易所处理标准的，按照一次认定。	客户一天在多个合约自成交、频繁报撤单、大额报撤单或实际控制关系账户合并持仓超限达到交易所处理标准的，按一次认定。	客户或者一组实际控制关系账户合并计算后，单个交易日在两个及以上合约因自成交、频繁报撤单、大额报撤单达到上期能源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异常交易行为认定	客户单日在多个合约上因实际控制关系账户合并持仓超限达到交易所处理标准的，按照一次认定。
	客户单日在多个合约上因自成交、频繁报撤单、大额报撤单达到交易所处理标准的，同一种异常交易行为按照一次认定。	客户或非期货公司会员单日在多个合约上自成交、频繁报撤单、大额报撤单达到交易所处理标准的，按照一次认定。	单一客户和实控组自成交、频繁报撤单等行为的异常交易达标次数均按单个合约累计统计。		
	因套期保值交易、立即全部成交否则自动撤	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	对实控组内每个客户频繁报撤单行为、大额报撤单行为次数分开计算。	一组实际控制关系账户单个交易日在两	客户单日在多个合约上因自成交、频繁报撤单、大额报撤单达到交易所处理标准的，按照一

	销指令（FOK）和立即成交剩余指令自动撤销指令（FAK）等产生的自成交、频繁报撤单、大额报撤单等行为不构成异常交易行为	则自动撤销（FOK）和立即成交剩余指令自动撤销（FAK）指令属性形成的自成交和撤单不计入在内。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。	实际控制关系账户自成交行为、频繁报撤单行为、大额报撤单行为情节恶劣的，不受次数限制，交易所可直接根据《郑州商品交易所违规处理办法》有关规定对实际控制关系账户所有人或实际控制人给予警告、强行平仓等纪律处分	个及以上合约因合并持仓超过持仓限额达到上期能源处理标准的，按照发生一次异常交易行为认定	以认定。
其他异常交易行为	中国证监会或交易所认定的其他交易情形	通过计算机程序自动批量下单、快速下单影响交易所系统安全或者正常交易秩序。	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价。	采取程序化交易方式下达交易指令，可能影响上期能源系统安全或者正常交易秩序的行为	大笔申报、连续申报、密集申报后者申报价格明显偏离申报时的最新成交价格，可能影响期货交易价格。
			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。	一组实际控制关系账户内的客户之间多次进行互为对手方的交易	大量或者多次申报并撤销申报可能影响期货价格或者误导其他客户进行期货交易。
			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。	一组实际控制关系账户内的客户之间发生成交的，构成异常交易行为	大量或者多次进行高买低卖交易。
		交易所认定的其他情形	交易所认定的其他情形	通过计算机程序自动批量下单、快速下单影响交易所系统安全或者正常交易秩序。	交易所认定的其他情形

以上信息仅供参考，如有变更，以交易所和公司通知为准。并不对此表单独出具变更公告。（2019年4月版）  
交易所对期货、期权的自成交、频繁报撤单、大额报撤单、实际控制关系账户超仓达到交易所处理标准的次数分开统计。