

倍特期货交易规则-交易所异常交易行为监管标准

异常交易监管	大商所	郑商所	上期所	能源中心	中金所
自成交	单日在某一合约上的自成交次数达到5次（含5次）以上				
频繁报撤单	单日在某一合约上的撤单次数达到500次（含500次）以上	1. 单个交易日在某一合约撤销定单次数500次以上 2. 当某个交易日某一合约出现涨（跌）停板后，当日在该合约涨（跌）停板价位买（卖）单撤销定单次数100次以上 3. 当某个交易日某一合约出现涨（跌）停板后，客户当日在涨（跌）停板价位买（卖）单撤销定单次数100次以上且撤销定单手数合计10000手以上的，视为频繁报撤单情节严重的行为，交易所于当日闭市后对该客户采取限制开仓的自律监管措施，限制开仓时间不少于1个月。	单个交易日在某一合约上的撤单次数达到500次及以上		股指期货： 单个交易日在某一合约上的撤单次数达到400次及以上 国债期货： 单个交易日在某一合约上的撤单次数达到500次及以上
大额报撤单	单日在某一合约上的撤单次数达到400次（含400次）以上，且单笔撤单的撤单量超过合约最大下单手数的80%	单个交易日在某一合约撤销定单次数50次以上且每次撤销定单量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		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%

以上内容仅供参考，以交易所最新规则或通知为准，我司并不对此表单独出具变更通告 20190528

倍特期货交易规则-交易所异常交易行为监管标准

异常交易监管		大商所			郑商所			上期所			能源中心			中金所		
		自成交	频繁报撤单	大额报撤单	自成交	频繁报撤单	大额报撤单	自成交	频繁报撤单	大额报撤单	自成交	频繁报撤单	大额报撤单	自成交	频繁报撤单	大额报撤单
异常交易豁免情形	市价指令	√	√	√	√	√	√	-	-	-	-	-	-	-	-	-
	FOK/FAK指令	√	√	√	√	√	√	√	√	√	√	√	√	√	√	√
	套利交易	√	√	√	√	√	√	-	-	-	-	-	-	-	-	-
	套保交易	√	√	√	√	√	√	√	√	√	√	√	√	√	√	√
	做市交易	-	√	-	-	√	-	-	√	-	-	√	-	-	-	-
异常交易处理	自成交 & 频繁报撤单 & 大额报撤单	第一次	交易所于当日通知期货公司，期货公司通知客户										国债期货：通知客户 股指期货：限制异常交易 (自成交、频繁报撤单、大额报撤单、日内开仓限制) 合约所属品种开仓至少一个月			
		第二次	交易所将客户列入重点监管名单										国债期货：交易所将客户列入重点监管名单			
		第三次	交易所于当日闭市后对客户采取限制开仓的监管措施，限制开仓的时间不低于1个月										国债期货：交易所于当日闭市后对客户采取限制开仓的监管措施，限制开仓的时间不低于1个月			

以上内容仅供参考，以交易所最新规则或通知为准，我司并不对此表单独出具变更通告 20190528

倍特期货交易规则-交易所异常交易行为监管标准

异常交易监管	大商所	郑商所	上期所	能源中心	中金所
日内交易开仓限制	暂无品种或合约交易限制				客户在股指期货 单个合约 单日内开仓交易量超过500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内在单个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。
实际控制关系定义	实际控制是指行为人（包括个人、单位）对他人（包括个人、单位）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。				
实际控制关系认定	<p>（一）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；</p> <p>（二）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；</p> <p>（三）行为人作为他人的法定代表人、主要合伙人、董事、监事、高级管理人员等，或者行为人与他人的法定代表人、主要合伙人、董事、监事、高级管理人员等一致的；</p> <p>（四）行为人与他人之间存在配偶关系；</p> <p>（五）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；</p> <p>（六）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；</p> <p>（七）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；</p> <p>（八）交易所认定的其他情形。</p>				

以上内容仅供参考，以交易所最新规则或通知为准，我司并不对此表单独出具变更通告 20190528

倍特期货交易规则-交易所异常交易行为监管标准

异常交易监管		大商所	郑商所	上期所	能源中心	中金所
实际控制关系账户持仓超限		交易所对实际控制关系账户的持仓合并计算。一组实际控制关系账户单日在多个期货合约或者多个期权合约系列上持仓超限达到交易所处理标准的，分别认定为出现一次持仓超限行为。同一期货合约衍生出的所有期权合约为一个期权合约系列。				
实际控制账户持仓超限处理		交易所于当日闭市后通知期货公司，期货公司通知客户，要求其自行平仓。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，直至持仓不高于交易所规定的持仓限额，同时于强行平仓当日闭市后对已认定的该组实际控制关系客户采取限制开仓的监管措施，限制开仓的时间不低于1个月。	交易所于当日闭市后通知客户所在期货公司会员，要求客户自行平仓。客户在规定时间内未自行平仓完毕的，由交易所执行强行平仓。由交易所执行强行平仓的，当日闭市后对该组实际控制关系账户采取限制开仓的自律监管措施，限制开仓时间不少于1个月。	交易所在当日收市后通知客户所在的期货公司会员要求其自行平仓。客户在下一交易日第一节交易时间内未自行平仓完毕的，由交易所执行强行平仓。交易所按照非套期保值持仓合并计算后从大到小的原则选择客户的持仓执行强行平仓，直到该组实际控制关系账户合并持仓符合交易所持仓限额制度的规定。由交易所执行强行平仓的，当日闭市后对该组实际控制关系账户采取限制开仓的自律管理措施，限制开仓的时间原则上不少于1个月。	交易所于当日闭市后通知客户所在期货公司会员，要求客户自行平仓。客户在规定时间内未自行平仓完毕的，由交易所执行强行平仓。由交易所执行强行平仓的，当日闭市后对该组实际控制关系账户采取限制开仓的自律监管措施，限制开仓时间不少于1个月。	
实际控制关系账户超仓	第一次	交易所将该组实际控制关系账户列入重点监管名单				
	第二次	交易所于次日对该组实际控制关系账户采取限制开仓的监管措施，限制开仓的时间不低于10个交易日				
	第三次	交易所于次日对该组实际控制关系账户采取限制开仓的监管措施，限制开仓的时间不低于6个月。				

备注：

1. 异常交易豁免情形中，“√”表示豁免，“-”表示无豁免情形
2. 上期所和能源交易中心无市价指令和套利交易指令
3. FAK: 立即成交剩余指令自动撤销
FOK: 立即全部成交否则自动撤销

以上内容仅供参考，以交易所最新规则或通知为准，我司并不对此表单独出具变更通告 20190528