

# 监查业务相关运行注意事项及准备工作

上海期货交易所  
二〇一三年六月六日

# 目录

一、连续交易期间的风险控制管理

二、连续交易期间的违规处理与异常交易管理



上海期货交易所  
SHANGHAI FUTURES EXCHANGE



# 连续交易期间的风险控制管理

- 连续交易期间，《上海期货交易所风险控制管理办法》规定的各项风险控制制度继续适用。
- 上海期货交易所的风险控制管理办法
  - (一) 保证金制度；
  - (二) 涨跌停板制度；
  - (三) 限仓制度；
  - (四) 大户报告制度；
  - (五) 强行平仓制度；
  - (六) 风险警示制度。



# 连续交易期间的大户报告管理

- 根据大户报告制度，当会员或者客户某品种持仓合约的投机头寸达到交易所对其规定的投机头寸持仓限额80%以上（含本数）或者交易所要求报告的，会员或客户应当向交易所报告其资金情况、头寸情况。
- 会员或客户一旦在某个交易日达到大户报告标准，应在交易日当天收盘结束（15:00点）后向交易所进行报告，最迟应不晚于下一交易日15:00时前向交易所报告。
- 在连续交易时段内，会员或客户可以进行大户报告。



# 上海期货交易所大户报告电子平台系统

- 2012年11月7日，为贯彻落实证监会“科学监管”理念，提高工作效率，我所优化大户报告业务流程，上线运行大户报告电子平台系统。系统正式启用运行后，只需通过系统提交电子版文件即可，相关加盖公章的纸质版文件由会员单位留档备查。





# 连续交易期间的强行平仓制度

- 连续交易实施后，强行平仓制度按照原有规则执行。由于连续交易和次日日盘交易的第一节作为次日交易的第一节，因此，对于会员和客户需强行平仓的头寸，会员和客户可在连续交易中自行执行，也可在次日日盘的第一节交易中自行执行。
- 若时限内会员未执行完毕，则由交易所强制执行。因结算准备金小于零而被要求强行平仓的，在保证金补足前，禁止相关会员的开仓交易。



# 目录

一、连续交易期间的风险控制管理

二、连续交易期间的违规处理与异常交易管理



上海期货交易所  
SHANGHAI FUTURES EXCHANGE

# 连续交易期间的违规处理与异常交易管理

- 连续交易期间视作交易日正常的交易时段，交易所目前实施的《上海期货交易所违规处理办法》、《上海期货交易所异常交易监控暂行规定》及配套的处理标准及处理程序继续适用。对违规行为与异常交易的盘中监控与监管照常进行。
- 交易所将在每个交易日收盘（15:00）后对达到处理标准的自成交、频繁报撤单等异常交易行为客户采取相应的监管措施。
- 连续交易期间，若发生重大风险事件，会员可以及时与交易所取得联系。连续交易期间交易所联系方式见连续交易百问百答手册。



## 连续交易期间的违规处理与异常交易管理

- 会员应落实连续交易期间的监管联系人及相关联系方式，并授权监管联系人有权限暂停、限制客户交易、出金等事宜，确保风险控制措施的正常执行。



# 常见违规与异常交易行为

- (一) 对敲
- (二) 自成交
- (三) 频繁报撤单
- (四) 大额报撤单
- (五) 实际控制关系帐户



# 对敲

- (一) 转移资金
- (二) 影响价格
- (三) 盗码





# 自我成交、频繁报撤单、大额报撤单、实际控制关系帐户

- （一）自成交：超过5次/日（单个合约）
- （二）频繁报撤单：超过500次/日（单个合约）
- （三）大额报撤单：超过50次/日（单个合约，撤单量大于 等于300手）
- （四）实际控制关系帐户：

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。

实际控制关系账户监管包括合并持仓超限、自成交（帐户组中客户间相互成交，视为自成交）等。

参见：《上海期货交易所异常交易监控暂行规定》有关处理标准及处理程序

谢谢!

稳健 诚信 卓越



上海期货交易所  
SHANGHAI FUTURES EXCHANGE