

异常交易行为认定

期货交易出现以下情形之一的，交易所认定为异常交易行为：

(一) 自成交行为，即以自己为交易对象，进行自买自卖的行为，或者实际控制关系账户组内发生的互为对手方交易的行为；

(二) 频繁报撤单行为，即频繁申报并撤销申报的行为；

(三) 大额报撤单行为，即多次大额申报并撤销申报的行为；

(四) 程序化交易扰乱交易秩序行为，即采取程序化交易方式下达交易指令，影响或者可能影响交易所系统安全或者扰乱正常交易秩序的行为；

(五) 实际控制关系账户合并持仓超过交易所持仓限额规定；

(六) 中国证监会规定或者交易所认定的其他情形。

客户或者一组实际控制关系账户合并计算后出现以下情形之一的，即达到自成交、频繁报撤单、大额报撤单等异常交易行为处理标准如下表：

异常交易处理标准				备注
交易所	自成交	频繁报撤单	大额报撤单	1.套期保值交易所产生的自成交、频繁报撤单和大额报撤单行为不构成异常交易行为。 2.交易所的市
上期所	单个交易日在某一合约上的自成交次数达到5次及以上	单个交易日在某一合约上的撤单次数达到500次及以上的	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	

能源中心	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	单个交易日在某一合约上的撤单次数达到500次及以上的	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	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
大商所	单个交易日在某一合约上的自成交次数达到5次以上的	单个交易日在某一合约上的撤单次数达到500次以上的	单个交易日在某一合约上的撤单次数达到50次以上,且单笔撤单的撤单量达到合约最大下单手数的80%以上的	指令自动撤销(FAK)属性的指令产生的自成交、频繁报撤单、大额报撤单行为不构成异常交易行为
郑商所	单个交易日在某一合约自成交5次以上	单个交易日在某一合约撤销定单次数500次以上;或者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	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	3. 期货、期权合约上的自成交、频繁报撤单、大额报撤单行为分别统计和处理,异常交易行为标准相同
中金所	单日在某一合约上的自成交次数达到5	单日在股指期货某一合约上的撤单次数达到400次	单日在某一合约上的撤单次数达到100次(含	

	次 (含 5 次)	(含 400 次) 单日在股指期货或 国债期货某一合约 上的撤单次数达到 500 次 (含 500 次)	100 次), 且单笔 撤单量达到交易 所规定的限价指 令每次最大 下单 数量 80%	
--	-----------	--	---	--

注：此表由各交易所规则汇总所得，以交易所最新规则为准。