

[首页](#) > [法规/规则](#) > [交易所规则](#) > [业务办法](#)  
大连商品交易所异常交易管理办法（试行）

A+ A A-

（根据2021年2月5日《关于发布〈大连商品交易所境外特殊参与者管理办法〉和相关规则修正案的通知》（大商所发〔2021〕73号）修订，修订部分自发布之日起实施。）

第一条 为规范期货交易行为，保护期货交易当事人的合法权益，维护市场正常秩序，根据《大连商品交易所交易规则》、《大连商品交易所会员管理办法》、《大连商品交易所风险管理办法》和《大连商品交易所违规处理办法》等规定，制定本办法。

第二条 交易所对期货交易进行监控，发现期货交易出现异常情形的，有权对相关期货公司会员、境外特殊参与者、境外中介机构、非期货公司会员和客户采取相应监管措施或者纪律处分措施。

第三条 期货公司会员、境外特殊经纪参与者、境外中介机构应当切实履行客户交易行为管理职责，及时发现、及时报告、及时制止客户的异常交易行为，不得纵容、诱导、怂恿、支持客户进行异常交易。

第四条 非期货公司会员、境外特殊非经纪参与者和客户参与期货交易应当遵守法律、法规和交易所业务规则的规定，接受交易所监管，自觉规范交易行为。客户还应接受期货公司会员、境外特殊经纪参与者、境外中介机构对其交易行为的合法合规性管理。

第五条 使用程序化交易应当事先向交易所备案。非期货公司会员、境外特殊非经纪参与者和客户采取程序化交易方式下达交易指令，可能影响交易所系统安全或者正常交易秩序的，交易所可以采取相关限制性措施。

程序化交易是指由计算机按照事先设定的具有行情分析、风险管理等功能的交易模型，自动下达交易信号或者报单指令的交易方式。

第六条 期货交易出现以下情形之一的，为异常交易行为：

- （一）以自己为交易对象，多次进行自买自卖；
- （二）交易所认定的实际控制关系账户组内发生的多次互为对手方的交易；
- （三）频繁报撤单行为；
- （四）大额报撤单行为；
- （五）交易所认定的实际控制关系账户组合并持仓超过交易所持仓限额规定；
- （六）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；
- （七）交易所认定的其他情形。

第七条 期货公司会员、境外特殊经纪参与者、境外中介机构应当密切关注客户的交易行为，积极防范客户在交易中可能出现的异常交易行为，引导客户理性、合规参与期货交易。

期货公司会员、境外特殊经纪参与者、境外中介机构发现客户在期货交易过程中出现本办法第六条所列异常交易行为之一的，应当及时予以提醒、劝阻和制止，并及时向期货公司会员、交易所报告。

第八条 客户出现本办法第六条所列异常交易行为之一，经劝阻、制止无效的，期货公司会员可以采取提高交易保证金、限制开仓、强行平仓等措施。

第九条 非期货公司会员、境外特殊非经纪参与者或客户出现本办法第六条所列异常交易行为之一的，交易所可以采取电话提示、要求报告情况、要求提交书面承诺、列入重点监管名单等措施；情节严重的，交易所可以根据《大连商品交易所违规处理办法》等相关规则的规定采取强行平仓、限制开仓等监管措施；涉嫌违反法律、法规、规章的，交易所可以向中国证监会进行立案调查。

第十条 交易所对存在异常交易行为的客户采取有关监管措施或者做出相关书面决定的，通过客户所在期货公司会员、境外特殊经纪参与者向客户发出。期货公司会员、境外特殊经纪参与者应当及时与相关客户取得联系，告知交易所的相关监管信息和书面决定，保留有关证据，并采取有效措施，规范客户交易行为。涉及境外中介机构的，境外中介机构应当协助期货公司会员、境外特殊经纪参与者及时与相关客户取得联系，告知交易所的相关监管信息和书面决定。

第十一条 期货公司会员具有下列情形之一的，交易所可以责令其整改，并按照《大连商品交易所违规处理办法》等相关规则的规定，采取相应监管措施或者纪律处分措施，可同时向中国证监会提请分类监管扣分。

- （一）未及时、准确地向客户传达、送达交易所有关监管信息或者书面决定；
- （二）未采取有效措施制止客户异常交易行为；
- （三）未按照交易所要求尽责对涉嫌违法违规行为协助调查或者存在故意拖延、隐瞒和遗漏等行为；
- （四）纵容、诱导、怂恿、支持客户进行异常交易；
- （五）交易所认定的其他情形。

第十二条 异常交易行为的认定标准及处理程序，由交易所另行通知。

第十三条 本办法由交易所负责解释。

第十四条 本办法自公布之日起实施。