

期货异常交易认定标准

目前国内的期货已经全面实现了看穿式监管，客户一定有异常交易，交易所会上发出警示，但是很多客户还不知道期货异常交易包括哪些行为及期货异常交易认定标准，这里为您分享一下期货异常交易的有关内容。

一、期货异常交易包括哪些行为

根据交易所规定，当客户的交易出现自成交、频繁报撤单、大额报撤单等情况时，有可能会被交易所认定为异常交易。

客户交易中金所股指品种出现异常交易行为将被限制开仓。客户在其他期货公司被限制开仓了，只能等交易所解除限制开仓后才能下单，因此，有些客户在我们公司新开户后账户活跃状态，做交易提示只能平仓，很有可能是客户在其他期货公司已经被限制开仓了。

二、期货异常交易认定标准

	上期所	大商所	郑商所	中金所	能源中心
自成交	单日在某一合约上的自成交次数 ≥ 5 次	单日在某一合约上的自成交次数 ≥ 5 次	单日在某一合约上的自成交次数 ≥ 5 次	单日在某一合约上的自成交次数 ≥ 5 次	单日在某一合约上的自成交次数 ≥ 5 次
频繁报撤单	单日在某一合约上的撤单次数 ≥ 500 次	单日在某一合约上的撤单次数 ≥ 500 次	单日在某一合约上的撤单次数 ≥ 500 次	单日在某一合约上的撤单次数 ≥ 400 次	单日在某一合约上的撤单次数 ≥ 500 次
大额报撤单	单日在某一合约上的大额撤单次数 ≥ 50 次，且单笔撤单的撤单量 ≥ 300 手	在某一合约上的撤单次数 ≥ 400 次，且单笔撤单的撤单量超过合约最大下单手数的80%	单日在某一合约撤单次数 ≥ 50 次且每次撤单量 ≥ 800 手	单日在某一合约上的撤单次数 ≥ 100 次，且单笔撤单量 \geq 交易所规定的限价指令每次最大下单数量80%	单日在某一合约上的大额撤单次数 ≥ 50 次，且单笔撤单的撤单量 ≥ 300 手
日内开仓交易量较大				单个产品（品种）、单日开仓交易量 > 20 手	
影响交割结算价			利用对倒、对敲等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		
自然人客户违规持仓		自然人客户在交割月前一月最后交易日闭市时仍保留该交割月份持仓的行为	自然人客户在交割月前一月最后交易日闭市时仍保留该交割月份持仓的行为		自然人客户在最后交易日前8个交易日闭市时仍保留该交割月份持仓的行为
盗码交易			盗取他人交易账号、密码进行交易并转移资金		
实际控制关系账户合并持仓超限	两个或者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的规定，其中实际控制关系账户的监管标准详见交易所规定				

备注：

1、日内开仓交易量是指客户单日在单个产品所有合约上的买开仓数量与卖开仓数量之和。

2、客户单日在单产品多个合约上因自成交、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，按照一次认定。

3、以上规定的自成交、频繁报撤单、大额报撤单和日内开仓交易量较大的异常交易行为，套期保值（套利）交易不受限制。