

## 关于 2021 年 6 月查处违法违规行为情况的公告

### 上海期货交易所

为切实强化风险防范，加强一线监管，规范期货交易行为，保障期货市场参与者的合法权益，上海期货交易所（以下简称上期所）持续对违法违规行为进行查处。2021 年 6 月份查处情况如下：

异常交易行为管理方面，处理异常交易行为 89 起。其中，自成交超限 30 起，频繁报撤单超限 53 起，大额报撤单 3 起，实际控制关系账户组合并持仓超限 3 起。通过会员单位对上述达到异常交易处理标准的客户进行电话提示 92 次，将 17 名客户和 3 个实际控制关系账户组列入重点监管名单，在会员服务系统通报 25 次，并对其中 3 名客户和 2 个实际控制关系账户组采取限制开仓的监管措施并进行全市场公告。

实际控制关系账户认定与协查方面，对 192 组 563 个客户进行实际控制关系认定，对 42 组 106 个客户进行实际控制关系协查。

违规交易处理方面，处理涉嫌违规交易线索 10 起。其中，涉嫌相互交易转移资金 1 起，存在实控关系未申报 5 起，市价指令报单等原因导致价格异常波动 2 起，错单交易 2 起，均对相关会员和客户进行合规警示教育并采取相应监管措施。本月，上期所对 2 起涉嫌违规交易进行立案调查。

上期所提醒投资者在日常交易中注意合规风险并做好实际控制关系账户的报备。

特此公告。

上海期货交易所

2021年7月9日