

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