

附件 3

上海期货交易所异常交易行为管理办法 (修订案)

第二章 异常交易行为认定

第八条 一组实际控制关系账户非套期保值持仓合并计算后超过交易所规定的持仓限额和同时期其获批的套利交易头寸总和的，构成异常交易行为。

交易所对期货、期权合约上的实际控制关系账户组合并持仓超限达到交易所处理标准的次数分开统计。

第十一条 客户或者一组实际控制关系账户合并计算后，单个交易日在两个及以上期货合约或者两个及以上期权合约因自成交、频繁报撤单、大额报撤单达到交易所异常交易行为处理标准的，同一种异常交易行为按照发生一次异常交易行为认定。

一组实际控制关系账户单个交易日在两个及以上期货合约或者两个及以上期权系列合约因合并持仓超过持仓限额达到交易所处理标准的，按照发生一次异常交易行为认定。标的物为同一期货合约的所有期权合约为一个期权系列合约。