**附件2**

**《上海期货交易所风险控制管理办法》修订对照表**

注：灰色底纹加删除线表示删除内容，红色字体加粗表示新增内容，条款进行相应调整

|  |  |
| --- | --- |
| **2019年9月18日版本** | **修订版本** |
| **第二条** 交易所风险管理实行保证金制度、涨跌停板制度、持仓限额制度、交易限额制度、大户报告制度、强行平仓制度、风险警示制度。 | **第二条** 交易所风险管理实行保证金制度、涨跌停板制度、持仓限额制度、交易限额制度、大户报告制度、强行平仓制度、风险警示**等**制度。 |
| **第十二条** 当某期货合约在某一交易日（该交易日称为D1交易日，以下几个交易日分别称为D2、D3、D4、D5、D6交易日，D0交易日为D1交易日前一交易日）出现单边市，则该期货合约D2交易日涨跌停板幅度按下述方法调整：铜、铝、锌、铅、镍、锡、螺纹钢、线材、热轧卷板、不锈钢、黄金、白银、天然橡胶、燃料油、石油沥青和漂针浆期货合约的涨跌停板幅度为在D1交易日涨跌停板幅度的基础上增加3个百分点。D1交易日结算时，该期货合约交易保证金比例按下述方法调整：铜、铝、锌、铅、镍、锡、螺纹钢、线材、热轧卷板、不锈钢、黄金、白银、天然橡胶、燃料油、石油沥青和漂针浆期货合约的交易保证金比例为在D2交易日涨跌停板幅度的基础上增加2个百分点。如果该期货合约调整后的交易保证金比例低于D0交易日结算时的交易保证金比例，则按D0交易日结算时该期货合约交易保证金比例收取。  若D1交易日为该期货合约上市挂盘后第一个交易日，则该期货合约上市挂盘当日交易保证金比例视为该期货合约D0交易日结算时的交易保证金比例。 | **第十二条** 当某期货合约在某一交易日（该交易日称为D1交易日，**D1**以下几个交易日**后的连续五个交易日**分别称为D2、D3、D4、D5、D6交易日，D0交易日为D1交易日前一交易日**为D0交易日**）出现单边市，则该期货合约D2交易日涨跌停板幅度**和交易保证金比例**按下述方法调整：  **（一）**铜、铝、锌、铅、镍、锡、螺纹钢、线材、热轧卷板、不锈钢、黄金、白银、天然橡胶、燃料油、石油沥青和漂针浆期货合约的涨跌停板幅度为在D1交易日涨跌停板幅度的基础上增加3个百分点**；**。  **（二）**D1交易日结算时，该期货合约交易保证金比例按下述方法调整：铜、铝、锌、铅、镍、锡、螺纹钢、线材、热轧卷板、不锈钢、黄金、白银、天然橡胶、燃料油、石油沥青和漂针浆期货合约的交易保证金比例为在D2交易日涨跌停板幅度的基础上增加2个百分点**，但**。如果该期货合约调整后的交易保证金比例低于D0交易日结算时的交易保证金比例**的**，则按D0交易日结算时该期货合约交易保证金比例收取。  若D1交易日为该期货合约上市挂盘后第一个交易日**的**，则该期货合约**D1交易日**上市挂盘当日交易保证金比例视为该期货合约D0交易日结算时的交易保证金比例。 |
| **第十三条** 该期货合约若D2交易日未出现单边市，则D3交易日涨跌停板、交易保证金比例恢复到正常水平。  若D2交易日出现反方向单边市，则视作新一轮单边市开始，该日即视为D1交易日，下一日交易保证金和涨跌停板参照本办法第十二条规定执行。  若D2交易日出现同方向单边市，则该期货合约D3交易日涨跌停板幅度按下述方法调整：铜、铝、锌、铅、镍、锡、螺纹钢、线材、热轧卷板、不锈钢、黄金、天然橡胶、燃料油、石油沥青和漂针浆期货合约的涨跌停板幅度为在D1交易日涨跌停板幅度的基础上增加5个百分点，白银期货合约的涨跌停板幅度为在D1交易日涨跌停板幅度的基础上增加6个百分点。D2交易日结算时，该期货合约交易保证金比例按下述方法调整：铜、铝、锌、铅、镍、锡、螺纹钢、线材、热轧卷板、不锈钢、黄金、天然橡胶、燃料油、石油沥青和漂针浆期货合约的交易保证金比例为在D3交易日涨跌停板幅度上增加2个百分点，白银期货合约的交易保证金比例为在D3交易日涨跌停板幅度上增加3个百分点。如果该期货合约调整后的交易保证金比例低于D0交易日结算时交易保证金比例，则按D0交易日结算时该期货合约的交易保证金比例收取。 | **第十三条** **本办法第十二条所述的**该期货合约**在**若D2交易日未出现单边市**的**，则D3交易日涨跌停板**幅度和**、交易保证金比例恢复到正常水平。  若D2交易日出现反方向单边市**的**，则视作新一轮单边市开始，该日即视为D1交易日，下一日交易保证金和涨跌停板参照本办法第十二条规定执行。  若D2交易日出现同方向单边市**的**，则该期货合约D3交易日涨跌停板幅度**和交易保证金比例**按下述方法调整：  **（一）**铜、铝、锌、铅、镍、锡、螺纹钢、线材、热轧卷板、不锈钢、黄金、天然橡胶、燃料油、石油沥青和漂针浆期货合约的涨跌停板幅度为在D1交易日涨跌停板幅度的基础上增加5个百分点，白银期货合约的涨跌停板幅度为在D1交易日涨跌停板幅度的基础上增加6个百分点**；**。  **（二）**D2交易日结算时，该期货合约交易保证金比例按下述方法调整：铜、铝、锌、铅、镍、锡、螺纹钢、线材、热轧卷板、不锈钢、黄金、天然橡胶、燃料油、石油沥青和漂针浆期货合约的交易保证金比例为在D3交易日涨跌停板幅度上增加2个百分点，白银期货合约的交易保证金比例为在D3交易日涨跌停板幅度上增加3个百分点。**但**如果该期货合约调整后的交易保证金比例低于D0交易日结算时交易保证金比例**的**，则按D0交易日结算时该期货合约的交易保证金比例收取。 |
| **第十四条** 若D3交易日未出现单边市，则D4交易日涨跌停板、交易保证金比例恢复到正常水平。  若D3交易日出现反方向单边市，则视作新一轮单边市开始，该日即视为D1交易日，下一日交易保证金和涨跌停板参照本办法第十二条规定执行。  若D3交易日期货合约出现同方向单边市（即连续三天达到涨跌停板），则当日收盘结算时，该铜、铝、锌、铅、镍、锡、螺纹钢、线材、热轧卷板、不锈钢、黄金、白银、天然橡胶、燃料油、石油沥青和漂针浆期货合约的交易保证金仍按照D2交易日结算时的交易保证金比例收取，并且交易所可以对部分或者全部会员暂停出金。  当D3交易日期货合约出现同方向单边市（即连续三天达到涨跌停板）时，若D3交易日是该合约的最后交易日，则该合约直接进入交割；若D4交易日是该合约的最后交易日，则D4交易日该合约按D3交易日的涨跌停板和保证金水平继续交易；除上述两种情况之外，D4交易日该期货合约暂停交易一天。交易所在D4交易日根据市场情况决定对该期货合约实施下列两种措施中的任意一种：  措施一：D4交易日，交易所决定并公告在D5交易日采取单边或者双边、同比例或者不同比例、部分会员或者全部会员提高交易保证金，暂停部分会员或者全部会员开新仓，调整涨跌停板幅度，限制出金，限期平仓，强行平仓等措施中的一种或者多种化解市场风险，但调整后的涨跌停板幅度不超过20%。在交易所宣布调整保证金水平之后，保证金不足者应当在D5交易日开市前追加到位。若D5交易日该期货合约的涨跌幅度未达到当日涨跌停板，则D6交易日该期货合约的涨跌停板和交易保证金比例均恢复正常水平；若D5交易日该期货合约的涨跌幅度与D3交易日同方向再达到当日涨跌停板，则交易所宣布为异常情况，并按有关规定采取风险控制措施；若D5交易日该期货合约的涨跌幅度与D3交易日反方向达到当日涨跌停板，则视作新一轮单边市开始，该日即视为D1交易日，下一日交易保证金和涨跌停板参照本办法第十二条规定执行。  措施二：在D4交易日结算时，交易所将D3交易日闭市时以涨跌停板价申报的未成交平仓报单，以D3交易日的涨跌停板价，与该合约净持仓盈利客户（或者非期货公司会员，下同）按持仓比例自动撮合成交。同一客户持有双向头寸，则首先平自己的头寸，再按上述方法平仓。具体操作方法如下：  （一）申报平仓数量的确定  在D3交易日收市后，已在计算机系统中以涨跌停板价申报无法成交的，且客户该合约的单位净持仓亏损大于或者等于D3交易日结算价6%（天然橡胶、燃料油、石油沥青和漂针浆为8%）的所有申报平仓数量的总和为平仓数量。若客户不愿按上述方法平仓可以在收市前撤单，则已撤报单不再作为申报的平仓报单。  （二）客户单位净持仓盈亏的计算方法  客户该合约净持仓盈亏的总和（元）  客户该合约单位净持仓盈亏 =  客户该合约的净持仓量（重量单位）  上式中铜、铝、锌、铅、镍、锡、螺纹钢、线材、热轧卷板、不锈钢、天然橡胶、燃料油、石油沥青和漂针浆的重量单位为吨，白银的重量单位为千克，黄金的重量单位为克。  客户该合约净持仓盈亏的总和，是指在客户该合约的历史成交库中从当日向前找出累计符合当日净持仓数的开仓合约的实际成交价与当日结算价之差的总和。  （三）持仓盈利客户平仓范围的确定  根据上述方法计算的客户单位净持仓盈利的投机头寸以及客户单位净持仓盈利大于或者等于D3交易日结算价6%（天然橡胶、燃料油、石油沥青和漂针浆为8%）的保值头寸都列入平仓范围。  （四）平仓数量的分配原则及方法  1、平仓数量的分配原则  （1）在平仓范围内按盈利的大小和投机与保值的不同分成四级，逐级进行分配。  首先分配给属平仓范围内单位净持仓盈利大于或者等于D3交易日结算价6%（天然橡胶、燃料油、石油沥青和漂针浆为8%）的投机头寸（以下铜、铝、锌、铅、镍、锡、螺纹钢、线材、热轧卷板、不锈钢、黄金、白银简称盈利6%以上的投机头寸，天然橡胶、燃料油、石油沥青和漂针浆简称盈利8%以上的投机头寸）；  其次分配给单位净持仓盈利大于或者等于D3交易日结算价3%（天然橡胶、燃料油、石油沥青和漂针浆为4%），小于6%（天然橡胶、燃料油、石油沥青和漂针浆为8%）的投机头寸（以下铜、铝、锌、铅、镍、锡、螺纹钢、线材、热轧卷板、不锈钢、黄金、白银简称盈利3%以上的投机头寸，天然橡胶、燃料油、石油沥青和漂针浆简称盈利4%以上的投机头寸）；  再次分配给单位净持仓盈利小于D3交易日结算价3%（天然橡胶、燃料油、石油沥青和漂针浆为4%）的投机头寸（以下铜、铝、锌、铅、镍、锡、螺纹钢、线材、热轧卷板、不锈钢、黄金、白银简称盈利3%以下的投机头寸，天然橡胶、燃料油、石油沥青和漂针浆简称盈利4%以下的投机头寸）；  最后分配给单位净持仓盈利大于或者等于D3交易日结算价6%（天然橡胶、燃料油、石油沥青和漂针浆为8%）的保值头寸（以下铜、铝、锌、铅、镍、锡、螺纹钢、线材、热轧卷板、不锈钢、黄金、白银简称盈利6%以上的保值头寸，天然橡胶、燃料油、石油沥青和漂针浆简称盈利8%以上的保值头寸）。  （2）以上各级分配比例均按申报平仓数量（剩余申报平仓数量）与各级可平仓的盈利头寸数量之比进行分配。  2、平仓数量的分配方法及步骤（见附件）  （1）铜、铝、锌、铅、镍、锡、螺纹钢、线材、热轧卷板、不锈钢、黄金、白银品种平仓数量的分配方法及步骤  若盈利6%以上的投机头寸数量大于或者等于申报平仓数量，则根据申报平仓数量与盈利6%以上的投机头寸数量的比例，将申报平仓数量向盈利6%以上的投机客户分配实际平仓数量；  若盈利6%以上的投机头寸数量小于申报平仓数量，则根据盈利6%以上的投机头寸数量与申报平仓数量的比例，将盈利6%以上投机头寸数量向申报平仓客户分配实际平仓数量。再把剩余的申报平仓数量按上述的分配方法向盈利3%以上的投机头寸分配；若还有剩余，则再向盈利3%以下的投机头寸分配；若还有剩余，则再向盈利6%以上的保值头寸分配。若还有剩余则不再分配。  （2）天然橡胶、燃料油、石油沥青和漂针浆品种平仓数量的分配方法及步骤  若盈利8%以上的投机头寸数量大于或者等于申报平仓数量，则根据申报平仓数量与盈利8%以上的投机头寸数量的比例，将申报平仓数量向盈利8%以上的投机客户分配实际平仓数量；  若盈利8%以上的投机头寸数量小于申报平仓数量，则根据盈利8%以上的投机头寸数量与申报平仓数量的比例，将盈利8%以上投机头寸数量向申报平仓客户分配实际平仓数量。再把剩余的申报平仓数量按上述的分配方法向盈利4%以上的投机头寸分配；若还有剩余，则再向盈利4%以下的投机头寸分配；若还有剩余，则再向盈利8%以上的保值头寸分配。若还有剩余则不再分配。  （五）平仓数量尾数的处理方法  首先对每个客户编码所分配到的平仓数量的整数部分分配后再按照小数部分由大到小的顺序进行排序，然后按照该排序的顺序进行分配，每个客户编码1手；对于小数部分相同的客户，如果分配数量不足，则随机进行分配。  采取措施二之后，若风险化解，则下一个交易日的涨跌停板和交易保证金比例均恢复正常水平；若还未化解风险，交易所则宣布为异常情况，并按有关规定采取风险控制措施。  因采取措施二平仓造成的经济损失由会员及其客户承担。 | **第十四条** **本办法第十二条所述的期货合约在**若D3交易日未出现单边市**的**，则D4交易日**的**涨跌停板**幅度和**、交易保证金比例恢复到正常水平。  若D3交易日出现反方向单边市**的**，则视作新一轮单边市开始，该日即视为D1交易日，下一日交易保证金和涨跌停板参照本办法第十二条规定执行。  若D3交易日期货合约出现同方向单边市**的**（即连续三天达到涨跌停板），则当日收盘结算时，该铜、铝、锌、铅、镍、锡、螺纹钢、线材、热轧卷板、不锈钢、黄金、白银、天然橡胶、燃料油、石油沥青和漂针浆期货合约的交易保证金仍按照D2交易日结算时的交易保证金比例收取，并且交易所可以**在当日收盘结算时**对部分或者全部会员暂停出金**，并按照下列方式处理:**。  **（一）**当D3交易日期货合约出现同方向单边市（即连续三天达到涨跌停板）时，若D3交易日是该合约的最后交易日**的**，则该合约**在下一交易日**直接进入交割；  **（二）**若D4交易日是该合约的最后交易日**的**，则**该合约在**D4交易日该合约按**照**D3交易日的涨跌停板和保证金水平继续交易**，并在下一交易日直接进入交割**；  **（三）**除上述两种情况之外，**交易所可以在D3交易日收盘后，根据市场情况执行本办法第十五条或者第十六条规定的措施。** |
| **第十五条 交易所可以根据本办法第十四条第三款第三项的规定，在D3交易日收盘后决定并公告该期货合约在D4交易日继续交易，并采取下列一种或者多种措施：**  **（一）调整涨跌停板幅度，但调整后的涨跌停板幅度不得超过20%；**  **（二）对部分会员或者全部会员、**D4交易日该期货合约暂停交易一天。交易所在D4交易日根据市场情况决定对该期货合约实施下列两种措施中的任意一种：  措施一：D4交易日，交易所决定并公告在D5交易日采取单边或者双边、同比例或者不同比例、部分会员或者全部会员提高交易保证金**；**，  **（三）**暂停部分会员或者全部会员开新仓**；**，  调整涨跌停板幅度，  **（四）**限制出金**；**，  **（五）**限期平仓**；**，  **（六）**强行平仓**；**  **（七）交易所认为必要的其他**等措施中的一种或者多种化解市场风险，但调整后的涨跌停板幅度不超过20%。  **交易所执行前款规定的，本办法第十二条所述的期货合约**在交易所宣布调整保证金水平之后，保证金不足者应当在D5交易日开市前追加到位。若D5交易日**的交易按照下列方式处理：**  **（一）D4交易日未出现单边市的，**该期货合约的涨跌幅度未达到当日涨跌停板，则D6 **D5**交易日该期货合约的涨跌停板**幅度**和交易保证金比例均恢复**到**正常水平；若D5交易日该期货合约的涨跌幅度与D3交易日同方向再达到当日涨跌停板，则交易所宣布为异常情况，并按有关规定采取风险控制措施；若D5交易日该期货合约的涨跌幅度与D3  **（二）D4**交易日**出现**反方向**单边市的**达到当日涨跌停板，则视作新一轮单边市开始，该日即视为D1交易日，下一日交易保证金和涨跌停板参照本办法第十二条规定执行**；**。  **（三）D4交易日出现同方向单边市的，交易所可以宣布为异常情况，并按照相关规定采取风险控制措施。** |
| **第十六条 交易所可以根据本办法第十四条第三款第三项的规定，在D3交易日收盘后决定并公告该期货合约在D4交易日暂停交易一天，并在D4交易日决定并公告执行本办法第十七条或者第十八条规定的措施。** |
| **第十七条 交易所可以根据本办法第十六条的规定，决定本办法第十二条所述的期货合约在D5交易日继续交易，并采取下列一种或者多种措施：**  **（一）调整涨跌停板幅度，但调整后的涨跌停板幅度不得超过20%；**  **（二）对部分会员或者全部会员、单边或者双边、同比例或者不同比例提高交易保证金；**  **（三）暂停部分会员或者全部会员开新仓；**  **（四）限制出金；**  **（五）限期平仓；**  **（六）强行平仓；**  **（七）交易所认为必要的其他措施。**  **交易所执行前款规定的，本办法第十二条所述的期货合约在D6交易日的交易按照下列方式处理：**  **（一）D5交易日未出现单边市的， D6交易日的涨跌停板幅度和交易保证金比例恢复到正常水平；**  **（二）D5交易日出现反方向单边市的，视作新一轮单边市开始，该日即视为D1交易日，下一日交易保证金和涨跌停板参照本办法第十二条规定执行；**  **（三）D5交易日出现同方向单边市的，交易所可以宣布为异常情况，并按照相关规定采取风险控制措施。** |
| **第十八条 交易所宣布进入异常情况并采取强制减仓措施的，应当同时明确强制减仓基准日和采取强制减仓的相关合约。强制减仓基准日为最近一次出现单边市并应用强制减仓紧急措施的交易日。**  措施二：在D4交易日结算时，交易所**在采取强制减仓紧急措施时,**将**强制减仓基准**D3交易日闭市时以涨跌停板价申报的未成交平仓报单，以**强制减仓基准**D3交易日的涨跌停板价，与该合约净持仓盈利客户（或者非期货公司会员，下同）按持仓比例自动撮合成交。同一客户持有双向头寸，则首先平自己的头寸，再按上述方法平仓。具体操作方法如下：  （一）申报平仓数量的确定  在**强制减仓基准**D3交易日收市后，已在计算机系统中以涨跌停板价申报无法成交的，且客户该合约的单位净持仓亏损大于或者等于**强制减仓基准**D3交易日结算价6%（天然橡胶、燃料油、石油沥青和漂针浆为8%）的所有申报平仓数量的总和为平仓数量。若客户不愿按上述方法平仓可以在收市前撤单，则已撤报单不再作为申报的平仓报单。  （二）客户单位净持仓盈亏的计算方法  客户该合约净持仓盈亏的总和（元）  客户该合约单位净持仓盈亏 =  客户该合约的净持仓量（重量单位）  上式中铜、铝、锌、铅、镍、锡、螺纹钢、线材、热轧卷板、不锈钢、天然橡胶、燃料油、石油沥青和漂针浆的重量单位为吨，白银的重量单位为千克，黄金的重量单位为克。  客户该合约净持仓盈亏的总和，是指在客户该合约的历史成交库中从当日向前找出累计符合当日净持仓数的开仓合约的实际成交价与当日结算价之差的总和。  （三）持仓盈利客户平仓范围的确定  根据上述方法计算的客户单位净持仓盈利的投机头寸以及客户单位净持仓盈利大于或者等于**强制减仓基准**D3交易日结算价6%（天然橡胶、燃料油、石油沥青和漂针浆为8%）的保值头寸都列入平仓范围。  （四）平仓数量的分配原则及方法  1、平仓数量的分配原则  （1）在平仓范围内按盈利的大小和投机与保值的不同分成四级，逐级进行分配。  首先分配给属平仓范围内单位净持仓盈利大于或者等于**强制减仓基准**D3交易日结算价6%（天然橡胶、燃料油、石油沥青和漂针浆为8%）的投机头寸（以下铜、铝、锌、铅、镍、锡、螺纹钢、线材、热轧卷板、不锈钢、黄金、白银简称盈利6%以上的投机头寸，天然橡胶、燃料油、石油沥青和漂针浆简称盈利8%以上的投机头寸）；  其次分配给单位净持仓盈利大于或者等于**强制减仓基准**D3交易日结算价3%（天然橡胶、燃料油、石油沥青和漂针浆为4%），小于6%（天然橡胶、燃料油、石油沥青和漂针浆为8%）的投机头寸（以下铜、铝、锌、铅、镍、锡、螺纹钢、线材、热轧卷板、不锈钢、黄金、白银简称盈利3%以上的投机头寸，天然橡胶、燃料油、石油沥青和漂针浆简称盈利4%以上的投机头寸）；  再次分配给单位净持仓盈利小于**强制减仓基准**D3交易日结算价3%（天然橡胶、燃料油、石油沥青和漂针浆为4%）的投机头寸（以下铜、铝、锌、铅、镍、锡、螺纹钢、线材、热轧卷板、不锈钢、黄金、白银简称盈利3%以下的投机头寸，天然橡胶、燃料油、石油沥青和漂针浆简称盈利4%以下的投机头寸）；  最后分配给单位净持仓盈利大于或者等于**强制减仓基准**D3交易日结算价6%（天然橡胶、燃料油、石油沥青和漂针浆为8%）的保值头寸（以下铜、铝、锌、铅、镍、锡、螺纹钢、线材、热轧卷板、不锈钢、黄金、白银简称盈利6%以上的保值头寸，天然橡胶、燃料油、石油沥青和漂针浆简称盈利8%以上的保值头寸）。  （2）以上各级分配比例均按申报平仓数量（剩余申报平仓数量）与各级可平仓的盈利头寸数量之比进行分配。  2、平仓数量的分配方法及步骤（见附件）  （1）铜、铝、锌、铅、镍、锡、螺纹钢、线材、热轧卷板、不锈钢、黄金、白银品种平仓数量的分配方法及步骤  若盈利6%以上的投机头寸数量大于或者等于申报平仓数量，则根据申报平仓数量与盈利6%以上的投机头寸数量的比例，将申报平仓数量向盈利6%以上的投机客户分配实际平仓数量；  若盈利6%以上的投机头寸数量小于申报平仓数量，则根据盈利6%以上的投机头寸数量与申报平仓数量的比例，将盈利6%以上投机头寸数量向申报平仓客户分配实际平仓数量。再把剩余的申报平仓数量按上述的分配方法向盈利3%以上的投机头寸分配；若还有剩余，则再向盈利3%以下的投机头寸分配；若还有剩余，则再向盈利6%以上的保值头寸分配。若还有剩余则不再分配。  （2）天然橡胶、燃料油、石油沥青和漂针浆品种平仓数量的分配方法及步骤  若盈利8%以上的投机头寸数量大于或者等于申报平仓数量，则根据申报平仓数量与盈利8%以上的投机头寸数量的比例，将申报平仓数量向盈利8%以上的投机客户分配实际平仓数量；  若盈利8%以上的投机头寸数量小于申报平仓数量，则根据盈利8%以上的投机头寸数量与申报平仓数量的比例，将盈利8%以上投机头寸数量向申报平仓客户分配实际平仓数量。再把剩余的申报平仓数量按上述的分配方法向盈利4%以上的投机头寸分配；若还有剩余，则再向盈利4%以下的投机头寸分配；若还有剩余，则再向盈利8%以上的保值头寸分配。若还有剩余则不再分配。  （五）平仓数量尾数的处理方法  首先对每个客户编码所分配到的平仓数量的整数部分分配后再按照小数部分由大到小的顺序进行排序，然后按照该排序的顺序进行分配，每个客户编码1手；对于小数部分相同的客户，如果分配数量不足，则随机进行分配。  **交易所执行本条**采取措施二之后，若风险化解**的**，则下一个交易日的涨跌停板**幅度**和交易保证金比例均恢复正常水平；若还未化解风险**未化解的**，交易所**进一步**则宣布为异常情况，并按有关规定采取风险控制措施。  **交易所执行本条**因采取措施二平仓造成的经济损失由会员及其客户承担。 |
| **第十九条 根据本办法规定宣布为异常情况的，交易所可以采取调整开市闭市时间、暂停交易、调整涨跌停板幅度、提高保证金标准、限期平仓、强行平仓、限制出金、强制减仓、限制交易等紧急措施。** |
| **第五十条** 本办法自2019年9月18日起施行。 | **第五十五条** 本办法自**2020**2019年**4**9月**24**18日起施行。 |