附件2

《上海国际能源交易中心异常交易行为管理细则》条文修订对照表

注：加双删除线表示删除内容，红色字体加粗表示新增内容

|  |  |
| --- | --- |
| **修订版** | **2018年3月20日版本** |
| **第五条** 期货交易出现以下情形之一的，上期能源认定为异常交易行为：（一）以自己为交易对象，多次进行自买自卖的行为（自成交）；（二）一组实际控制关系账户内的客户之间多次进行相互为对手方的交易；（三）日内出现频繁申报并撤销申报，可能影响期货交易价格或者误导期货市场其他参与者进行期货交易的行为（频繁报撤单）；（四）日内出现多次大额申报并撤销申报，可能影响期货交易价格或者误导期货市场其他参与者进行期货交易的行为（大额报撤单）；（五）一组实际控制关系账户合并持仓超过上期能源持仓限额规定的；（**五**六）单个交易日在某一上市品种或者期货合约上的开仓交易数量超过上期能源制定的日内开仓交易量的；（**六**七）采取程序化交易方式下达交易指令，可能影响上期能源系统安全或者正常交易秩序的行为；（**七**八）中国证监会规定或者上期能源认定的其他情形。 | **第五条** 期货交易出现以下情形之一的，上期能源认定为异常交易行为：（一）以自己为交易对象，多次进行自买自卖的行为（自成交）；（二）一组实际控制关系账户内的客户之间多次进行相互为对手方的交易；（三）日内出现频繁申报并撤销申报，可能影响期货交易价格或者误导期货市场其他参与者进行期货交易的行为（频繁报撤单）；（四）日内出现多次大额申报并撤销申报，可能影响期货交易价格或者误导期货市场其他参与者进行期货交易的行为（大额报撤单）；（五）一组实际控制关系账户合并持仓超过上期能源持仓限额规定的；（六）单个交易日在某一上市品种或者期货合约上的开仓交易数量超过上期能源制定的日内开仓交易量的；（七）采取程序化交易方式下达交易指令，可能影响上期能源系统安全或者正常交易秩序的行为；（八）中国证监会规定或者上期能源认定的其他情形。 |
| **第八条** 一组实际控制关系账户一般持仓及套利交易持仓合并计算后超过一般持仓限额和其获批的套利交易持仓额度总和的，构成异常交易行为。 | **第八条** 一组实际控制关系账户一般持仓及套利交易持仓合并计算后超过一般持仓限额和其获批的套利交易持仓额度总和的，构成异常交易行为。 |
| **第九十条**  因套期保值交易、立即全部成交否则自动撤销指令（FOK）和立即成交剩余指令自动撤销指令（FAK）等产生的自成交、频繁报撤单、大额报撤单等行为不构成异常交易行为。**实施申报费收费的合约上产生的频繁报撤单行为不构成异常交易行为。** | **第十条**  因套期保值交易、立即全部成交否则自动撤销指令（FOK）和立即成交剩余指令自动撤销指令（FAK）等产生的自成交、频繁报撤单、大额报撤单等行为不构成异常交易行为。 |
| **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合约因自成交、频繁报撤单、大额报撤单达到上期能源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合约因合并持仓超过持仓限额达到上期能源处理标准的，按照发生一次异常交易行为认定。 | **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合约因自成交、频繁报撤单、大额报撤单达到上期能源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合约因合并持仓超过持仓限额达到上期能源处理标准的，按照发生一次异常交易行为认定。 |
| **第十七条** 一组实际控制关系账户发生合并持仓超过持仓限额的，上期能源提示通知客户所在期货公司会员、境外特殊经纪参与者，期货公司会员、境外特殊经纪参与者应当及时将上期能源提示通知转达客户，负责对客户进行教育、引导、劝阻及制止。客户委托境外中介机构从事期货交易的，期货公司会员、境外特殊经纪参与者应及时通过境外中介机构将上期能源提示通知转达客户，境外中介机构对客户进行教育、引导、劝阻及制止。合并持仓超过持仓限额发生在不同会员、境外特殊参与者或者境外中介机构的，上期能源直接提示通知持仓分布最大的会员或者境外特殊参与者，对持仓分布最大的境外中介机构由其所在的期货公司会员、境外特殊经纪参与者进行转达。 | **第十七条** 一组实际控制关系账户发生合并持仓超过持仓限额的，上期能源提示通知客户所在期货公司会员、境外特殊经纪参与者，期货公司会员、境外特殊经纪参与者应当及时将上期能源提示通知转达客户，负责对客户进行教育、引导、劝阻及制止。客户委托境外中介机构从事期货交易的，期货公司会员、境外特殊经纪参与者应及时通过境外中介机构将上期能源提示通知转达客户，境外中介机构对客户进行教育、引导、劝阻及制止。合并持仓超过持仓限额发生在不同会员、境外特殊参与者或者境外中介机构的，上期能源直接提示通知持仓分布最大的会员或者境外特殊参与者，对持仓分布最大的境外中介机构由其所在的期货公司会员、境外特殊经纪参与者进行转达。 |
| **第十八条** 一组实际控制关系账户发生合并持仓超过持仓限额的，上期能源在当日收市后通知客户所在的期货公司会员或者境外特殊参与者，要求客户自行平仓。客户在下一交易日第一节交易时间内未自行平仓完毕的，由上期能源执行强行平仓，上期能源按照一般持仓和套利交易持仓合并计算后从大到小的原则选择客户的持仓执行强行平仓，直到该组实际控制关系账户合并持仓符合上期能源持仓限额制度的规定。由上期能源执行强行平仓的，当日闭市后对该组实际控制关系账户采取暂停开仓交易的自律管理措施，暂停开仓交易的时间原则上不少于1个月。 | **第十八条** 一组实际控制关系账户发生合并持仓超过持仓限额的，上期能源在当日收市后通知客户所在的期货公司会员或者境外特殊参与者，要求客户自行平仓。客户在下一交易日第一节交易时间内未自行平仓完毕的，由上期能源执行强行平仓，上期能源按照一般持仓和套利交易持仓合并计算后从大到小的原则选择客户的持仓执行强行平仓，直到该组实际控制关系账户合并持仓符合上期能源持仓限额制度的规定。由上期能源执行强行平仓的，当日闭市后对该组实际控制关系账户采取暂停开仓交易的自律管理措施，暂停开仓交易的时间原则上不少于1个月。 |
| **第十九条** 一组实际控制关系账户出现合并持仓超过持仓限额的，上期能源除按照第十七条、第十八条处理外，还将采取下列自律管理措施：（一）第一次达到上期能源处理标准的，上期能源将该组实际控制关系账户列入重点关注名单，并通报会员、境外特殊参与者以及境外中介机构。（二）第二次达到上期能源处理标准的，上期能源于下一交易日对该组实际控制关系账户采取暂停开仓交易的自律管理措施，暂停开仓交易的时间原则上不少于10个交易日。（三）第三次达到上期能源处理标准的，上期能源于下一交易日对该组实际控制关系账户采取暂停开仓交易的自律管理措施，暂停开仓交易的时间原则上不少于6个月。 | **第十九条** 一组实际控制关系账户出现合并持仓超过持仓限额的，上期能源除按照第十七条、第十八条处理外，还将采取下列自律管理措施：（一）第一次达到上期能源处理标准的，上期能源将该组实际控制关系账户列入重点关注名单，并通报会员、境外特殊参与者以及境外中介机构。（二）第二次达到上期能源处理标准的，上期能源于下一交易日对该组实际控制关系账户采取暂停开仓交易的自律管理措施，暂停开仓交易的时间原则上不少于10个交易日。（三）第三次达到上期能源处理标准的，上期能源于下一交易日对该组实际控制关系账户采取暂停开仓交易的自律管理措施，暂停开仓交易的时间原则上不少于6个月。 |
| **第二十条** 包含非期货公司会员、境外特殊非经纪参与者的一组实际控制关系账户合并持仓超过持仓限额的，参照本细则第十七条至第十九条进行处理。 | **第二十条** 包含非期货公司会员、境外特殊非经纪参与者的一组实际控制关系账户合并持仓超过持仓限额的，参照本细则第十七条至第十九条进行处理。 |
| **第二十一条** 一组实际控制关系账户当日结算时在某合约发生合并持仓超过持仓限额，但其在该合约的持仓未超过上一交易日结算时上期能源持仓限额的，可以豁免本细则第十九条的自律管理措施。一组实际控制关系账户当日结算时在某合约发生合并持仓超过持仓限额，因市场原因在下一交易日无法减仓且结算时继续发生合并持仓超过持仓限额的，下一交易日也可以豁免本细则第十九条的自律管理措施。前两款豁免本细则第十九条自律管理措施的合并持仓超过持仓限额的，其超过持仓限额的部分仍应当按照本细则第十八条有关规定执行。 | **第二十一条** 一组实际控制关系账户当日结算时在某合约发生合并持仓超过持仓限额，但其在该合约的持仓未超过上一交易日结算时上期能源持仓限额的，可以豁免本细则第十九条的自律管理措施。一组实际控制关系账户当日结算时在某合约发生合并持仓超过持仓限额，因市场原因在下一交易日无法减仓且结算时继续发生合并持仓超过持仓限额的，下一交易日也可以豁免本细则第十九条的自律管理措施。前两款豁免本细则第十九条自律管理措施的合并持仓超过持仓限额的，其超过持仓限额的部分仍应当按照本细则第十八条有关规定执行。 |
| **第二十四八条** 异常交易行为导致市场风险明显增大时，上期能源可以采取下列措施：（一）调整交易手续费；（二）对特定客户、部分或者全部会员、境外特殊参与者收取申报费、撤单费等费用；（三）对部分或者全部会员、境外特殊参与者单边或者双边、同比例或者不同比例提高交易保证金；（四）对不同的上市品种、合约，对特定客户、部分或者全部会员、境外特殊参与者，制定日内开仓交易量；（五）根据证监会规定及上期能源业务规则可以采取的其他措施。 | **第二十四条** 异常交易行为导致市场风险明显增大时，上期能源可以采取下列措施：（一）调整交易手续费；（二）对特定客户、部分或者全部会员、境外特殊参与者收取申报费、撤单费等费用；（三）对部分或者全部会员、境外特殊参与者单边或者双边、同比例或者不同比例提高交易保证金；（四）对不同的上市品种、合约，对特定客户、部分或者全部会员、境外特殊参与者，制定日内开仓交易量；（五）根据证监会规定及上期能源业务规则可以采取的其他措施。 |
| **第二三十五一条** 本细则自XX2018年XX3月XX20日起实施。 |  **第三十一条** 本细则自2018年3月20日起实施。 |

《上海国际能源交易中心实际控制关系账户管理细则》条文修订对照表

注：加双删除线表示删除内容，红色字体加粗表示新增内容

|  |  |
| --- | --- |
| **修订版** | **2018年3月20日版本** |
| **第十六条 一组实际控制关系账户发生合并持仓超过持仓限额的，上期能源在当日收市后通知客户所在的期货公司会员或者境外特殊参与者，要求客户自行平仓。客户委托境外中介机构从事期货交易的，期货公司会员、境外特殊经纪参与者应及时通过境外中介机构将上期能源通知转达客户。****客户在下一交易日第一节交易时间内未自行平仓完毕的，由上期能源执行强行平仓，上期能源按照一般持仓和套利交易持仓合并计算后从大到小的原则选择客户的持仓执行强行平仓，直到该组实际控制关系账户合并持仓符合上期能源持仓限额制度的规定。** |  |
| **第十八七条** 一组实际控制关系账户的自成交量、报撤单笔数、大额报撤单笔数、日内开仓交易量、持仓量等合并计算后达到《上海国际能源交易中心异常交易行为管理细则》异常交易行为处理标准的，上期能源对该组实际控制关系账户按照异常交易行为采取自律管理措施。 | **第十七条** 一组实际控制关系账户的自成交量、报撤单笔数、大额报撤单笔数、日内开仓交易量、持仓量等合并计算后达到《上海国际能源交易中心异常交易行为管理细则》异常交易行为处理标准的，上期能源对该组实际控制关系账户按照异常交易行为采取自律管理措施。 |
| **第二十一条** 本细则自XX2018年XX3月XX20日起实施。 | **第二十条** 本细则自2018年3月20日起实施。 |

《上海国际能源交易中心结算细则》条文修订对照表

注：加双删除线表示删除内容，红色字体加粗表示新增内容

|  |  |
| --- | --- |
| **修订版** | **2021年6月11日版本** |
| **第三十三条** 能源中心根据会员当日成交合约数量按照相关标准计收交易手续费，并可以根据市场情况，按照上市品种或者合约，对特定客户、部分或者全部会员、境外特殊参与者收取申报费、撤单费等费用。能源中心另有规定的除外。 | **第三十三条** 能源中心根据会员当日成交合约数量按照相关标准计收交易手续费，并可以根据市场情况，按照上市品种或者合约，对特定客户、部分或者全部会员、境外特殊参与者收取申报费、撤单费等费用。能源中心另有规定的除外。 |
| **第九十三条** 本细则自XX2021年XX 6月XX11日起实施。 | **第九十三条** 本细则自2021年 6月11日起实施。 |