

东航期货—异常交易行为简表																					
	广州期货交易所			大连商品交易所			郑州商品交易所			上海期货交易所			上期能源交易中心			中国金融期货交易所					
自成交行为	客户或非期货公司会员单日在某一合约上的自成交次数≥5次，构成“以自己为交易对象，多次进行自买自卖”的异常交易行为。																				
频繁报撤单行为	客户或非期货公司会员单日在某一合约上的撤单次数≥500次，构成“频繁报撤单”的异常交易行为。			客户或非期货公司会员单日在某一合约上的撤单次数≥500次，构成“频繁报撤单”的异常交易行为。实施申报费的合约上产生的频繁报撤单行为不构成异常交易行为。			(1) 客户单日在某一合约撤单次数≥500次。 (2) 当某一交易日某一合约停牌后，客户当日在涨停板价位买单撤单或者在跌停板价位卖单撤单≥100次的，属于频繁报撤单行为。客户有上述涨停板价位频繁报撤单≥100次的行为且当日客户在该合约涨停板价位撤单累计≥10000手的，视为情节严重的行为。 实施申报费的合约上产生的频繁报撤单行为不构成异常交易行为。			客户或非期货公司会员单日在某一合约上的撤单次数≥500次，构成“频繁报撤单”的异常交易行为。实施申报费的合约上产生的频繁报撤单行为不构成异常交易行为。			股指：客户单日在股指期货交易品种某一合约上的撤单次数≥400次，构成“日内撤单次数过多”的异常交易行为； 股指期货：客户单日在股指期货交易品种某一合约上的撤单次数≥500次，构成“日内撤单次数过多”的异常交易行为； 国债：客户单日在国债期货交易品种某一合约上的撤单次数≥500次，构成“日内撤单次数过多”的异常交易行为。								
大额报撤单行为	单个交易日在某一合约上的撤单次数达到50次以上，且单笔撤单的撤单量达到合约最大下单手数的80%以上的			客户或非期货公司会员单日在某一合约上的撤单次数≥50次且单笔撤单的撤单量超过合约最大下单手数的80%，构成“大额报撤单”的异常交易行为。			客户单日在某一合约撤单次数≥50次且单笔撤单量≥800手。			客户单日在某一合约上的大额撤单次数≥50次且单笔撤单量≥300手，构成大额报撤单行为。			客户单日在某一合约上的撤单次数≥100次且单笔撤单量达到或者超过交易所规定的限价指令每次最大下单数量80%的，构成“大量或者多次申报并撤销申报”的异常交易行为。								
日内开仓交易量较大行为	工业硅期货：非期货公司会员或者客户单日开仓量不得超过3000手，其中单日开仓量是指非期货公司会员或者客户在单个合约单个交易日的买开仓数量与卖开仓数量之和。 碳酸锂期货：非期货公司会员或者客户在碳酸锂期货LC2407合约上单日开仓量不得超过3000手，在碳酸锂期货其他各合约上单日开仓量不得超过10000手。 聚乙炔期货：各合约上单日开仓量不得超过18000手。 豆粕期货：各合约上单日开仓量不得超过20000手。 菜油、白糖及棉花期货：各合约上单日开仓交易的最大数量为10000手。 聚乙炔期货：各合约上单日开仓量不得超过18000手。 豆油期货：各合约上单日开仓量不得超过15000手。 聚丙烯期货：各合约上单日开仓量不得超过10000手。 玉米期货：各合约上单日开仓量不得超过8000手。 聚乙烯期货：各合约上单日开仓量不得超过8000手。			棕榈油期货：在棕榈油期货各月份合约上的单日开仓量不得超过10000手。 焦炭期货：各月份合约上单日开仓量不得超过50手。 焦煤期货：各月份合约上单日开仓量不得超过1000手。 铁矿石期货：非期货公司会员或者客户在铁矿石期货I2405合约上单日开仓量不得超过500手，在铁矿石期货其他合约上单日开仓量不得超过2000手。 生猪期货：非期货公司会员或者客户在生猪期货各合约上单日开仓量合计不得超过1000手。 液化石油气期货：在液化石油气期货各月份合约上的单日开仓量不得超过10000手。 豆粕期货：各合约上单日开仓量不得超过20000手。 聚乙炔期货：各合约上单日开仓量不得超过18000手。 豆油期货：各合约上单日开仓量不得超过15000手。 聚丙烯期货：各合约上单日开仓量不得超过10000手。 玉米期货：各合约上单日开仓量不得超过8000手。 聚乙烯期货：各合约上单日开仓量不得超过8000手。			动力煤期货：非期货公司会员或者客户在动力煤期货各月份合约上单日开仓交易的最大数量为20手。 PTA期货：各合约上单日开仓交易的最大数量为30000手。 甲醇期货：各合约上单日开仓交易的最大数量为25000手。 玻璃期货：FG2405、2406、2407及2408合约上单日开仓交易的最大数量为10000手。其他各合约上单日开仓交易的最大数量为25000手。 菜粕期货：各合约上单日开仓交易的最大数量为15000手。 菜油、白糖及棉花期货：各合约上单日开仓交易的最大数量为10000手。 纯碱期货：SA2405、2406、2407及2408合约上单日开仓交易的最大数量为10000手。其他各合约上单日开仓交易的最大数量为10000手。 红枣期货：非期货公司会员或者客户在红枣期货2405、2407及2409合约上单日开仓交易的最大数量为100手。套期保值交易的开仓数量不受交易限额限制。 尿素期货：UR2405、2406、2407、2408及2409合约上单日开仓交易的最大数量为2000手。			螺纹钢期货：各合约日内开仓交易最大数量32000手。 燃料油期货：各合约日内开仓交易最大数量16000手。 白银期货：各合约日内开仓交易最大数量13000手。 热轧卷板期货：各合约日内开仓交易最大数量10000手。 纸浆期货：各合约日内开仓交易最大数量8000手。 天然橡胶期货：各合约日内开仓交易最大数量6000手。 铝期货：各合约日内开仓交易最大数量4000手。 锌期货：各合约日内开仓交易最大数量3000手。 黄金期货：各合约日内开仓交易最大数量2800手。 铜期货：各合约日内开仓交易最大数量2000手。			原油期货：各合约日内开仓交易最大数量3200手。			集运指数（欧线）期货：非期货公司会员、境外特殊非经纪参与者、客户在集运指数（欧线）EC2406、EC2408、EC2410、EC2412合约日内开仓交易的最大数量为100手。在集运指数（欧线）期货其他各合约日内开仓交易的最大数量为10000手。 原油期货：各合约日内开仓交易最大数量3200手。			客户在股指期货交易品种单日开仓交易量超过500手的，构成“日内开仓交易量较大”的异常交易行为。日内开仓交易量是指客户单日在单产品所有合约上的买开仓数量与卖开仓数量之和。 自2022年12月19日起，客户该期权品种日内开仓交易的最大数量为200手，单个月份期权合约日内开仓交易的最大数量为100手。单个深度虚值合约日内开仓交易的最大数量为30手。深度虚值合约是指同一月份合约中，行权价格高于上一交易日合约标的指数收盘价的第十个及以上的看涨期权合约和行权价格低于上一交易日合约标的指数收盘价的第十个及以下的看跌期权合约。		
套保头寸交易频繁行为	套保交易每自然周开卖平仓交易量超过可使用产品额度的2倍或买入平仓交易量超过卖产品额度的2倍																				
	自成交	频繁报撤单	大额报撤单	自成交	频繁报撤单	大额报撤单	自成交	频繁报撤单	大额报撤单	自成交	频繁报撤单	大额报撤单	自成交	频繁报撤单	大额报撤单	自成交	频繁报撤单	大额报撤单			
豁免情形	市价指令	√	√	√	√	√	√	√	√	—	—	—	—	—	—	—	—	—			
	FAK/FOK	√	√	√	√	√	√	√	√	√	√	√	√	√	√	√	√	√			
	套期保值	√	√	√	√	√	√	√	√	√	√	√	√	√	√	√	√	√			
	套利交易	√	√	√	√	√	√	√	√	—	—	—	—	—	—	—	—	—			
	做市交易	X	√	X	X	√	X	X	√	X	X	√	X	—	—	—	X	√			
	实施申报费收费的合约	X	√	X	X	√	X	X	√	X	X	√	X	X	√	X	X	X			

备注：异常交易豁免情形中，“√”表示有豁免，“×”表示无豁免，“—”表示无此种情形。

以上仅供参考，具体以交易所规则及最新通告为准。我司并不对此表单独出具变更通告