

关于期货异常交易行为风险警示

尊敬的客户：

根据中国金融期货交易所、郑州商品交易所、上海期货交易所及能源中心、大连商品交易所关于异常交易的相关规定，我公司现向您揭示期货异常交易行为的风险如下：

投资者参与期货交易应当遵守法律法规和交易所业务规则的规定，必须接受交易所监管及期货公司对其交易行为的合法合规性管理和监控，自觉规范交易行为。当投资者的期货交易出现以下情形之一的，将被认定为异常交易行为：

- (一) 以自己为交易对象，大量或者多次进行自买自卖；
- (二) 委托、授权给同一机构或者同一个人代为从事交易的投资者之间，大量或者多次进行互为对手方交易；
- (三) 大笔申报、连续申报、密集申报或者申报价格明显偏离申报时的最新成交价格，可能影响期货交易价格；
- (四) 大量或者多次申报并撤销申报可能影响期货交易价格或者误导其他投资者进行期货交易；
- (五) 日内撤单次数过多；
- (六) 日内频繁进行回转交易或者日内开仓交易量较大；
- (七) 两个或者两个以上涉嫌存在实际控制关系的交易编码合并持仓超过交易所持仓限额规定；
- (八) 大量或者多次进行高买低卖交易；

(九) 通过计算机程序自动批量下单、快速下单影响交易所系统安全或者正常交易秩序;

(十) 利用对倒、对敲等手段交易, 影响交割结算价;

(十一) 利用盗取他人交易密码进行交易等手段转移资金或扰乱交易管理秩序;

(十二) 自然人投资者在交割月前一月最后交易日闭市时仍保留该交割月份持仓;

(十三) 交易所认定的其他情形。

相关行为的认定标准及处理程序详见各交易所关于期货异常交易的法规文件。

请您根据交易所上述规定, 自觉规范您的期货交易行为, 合法合规地参与期货交易。若您的账户出现异常交易行为的情况, 按照交易所的相关规定, 我公司可以对您采取提高交易保证金、限制开仓、强行平仓、拒绝投资者委托或者终止经纪关系等措施; 交易所可以对您采取电话提醒、要求报告情况、要求提交书面承诺、列入监管关注名单、约见谈话、发布警示函、发布风险提示函等措施; 情节严重的, 交易所可以根据相关办法和规定采取限期平仓、强行平仓、限制开仓等相应监管措施或者纪律处分措施; 涉嫌违反法律、法规、规章的, 交易所提请中国证监会进行立案调查。**由此产生的损失, 需您自行承担。**

以上关于期货异常交易行为的风险, 请充分知晓。

民生期货有限公司