

中国金融期货交易所违规违约处理办法

(2007 年 6 月 27 日发布)

第一章 总 则

第一条 为依法对期货市场进行管理，规范期货交易行为，保障期货市场参与者的合法权益，根据《期货交易管理条例》、《期货交易所管理办法》、《中国金融期货交易所章程》和《中国金融期货交易所交易规则》等有关规定，制定本办法。

第二条 中国金融期货交易所（以下简称交易所）对参与期货交易的会员、客户、期货保证金存管银行及期货市场其他参与者违规违约行为的调查、认定和处理适用本办法。

第三条 交易所根据公平、公正的原则，以事实为依据，依照国家法律、行政法规、规章和本办法，对期货市场的违规行为和违约行为进行调查、认定和处理。

违规行为涉嫌犯罪的，移交司法机关处理。

第四条 交易所调查、认定和处理违规行为和违约行为，应当做到事实清楚、证据确凿、程序规范、适用规定准确、处理决定适当。

第二章 稽查与立案、调查

第五条 稽查是指交易所根据其各项规章制度，对会员、客户、保证金存管银行及期货市场其他参与者的业务活动进行的监督和检查。

稽查包括日常稽查和专项稽查。

第六条 交易所履行监管职责时，可以行使下列职权：

- （一）查阅、复制与期货交易有关的信息、资料；
- （二）对会员、客户、保证金存管银行等单位 and 人员进行调查、取证；
- （三）要求会员、客户、保证金存管银行等被调查者申报、陈述、解释、说明有关情况；
- （四）制止、纠正、处理违规违约行为；
- （五）交易所履行监管职责所必需的其他职权。

第七条 会员、客户、保证金存管银行及期货市场其他参与者应当接受交易所的监督检查，配合交易所履行监管职责，如实提供交易所要求提供的文件和资料。

第八条 交易所受理书面或者口头投诉、举报。受理口头投诉、举报应当制作笔录或者录音。

第九条 投诉、举报人应当身份真实、明确；除法律、行政法规和规章另有规定外，交易所应当为投诉人、举报人保密。

第十条 对日常稽查和专项稽查工作中发现的、投诉举报的、监管部门和司法机关等单位移交的或者通过其他途径获得的线索进行审查后，认为有违规行为发生的，交易所应当予以立案调查。

第十一条 对已立案的期货违规案件，交易所指定专人负责调查。

第十二条 调查取证应当由两名以上调查人员参加，并出示合法证件或者交易所的证明文件。

第十三条 调查人员认为自己与本案有利害关系或者存在其他可能影响案件公正处理情形的，应当申请回避。

被调查人员认为调查人员与本案有关、可能影响公正办案的，有权申请有关人员回避。

交易所认为调查人员应当回避的，指令其回避。

第十四条 证据包括书证、物证、视听资料、电子记录、证人证言、当事人陈述、调查笔录、鉴定结论等能够证明案件真相的一切材料。法律法规另有规定的，依照法律法规执行。

证据应当调查核实方能作为定案的根据。

第十五条 询问被调查人应当制作调查笔录。调查笔录应当交被调查人核对，核对无误后由被调查人和调查人员签名。被调查人拒绝签名的，调查人员应当注明原因。

书证、物证的提取应当制作提取笔录，注明提取的时间和地点，并由被调查人签名。被调查人拒绝或者无法签名的，由见证人签名。

视听资料、电子记录的收集应当注明收集或者制作的时间、地点、方式、使用的设备及保存的条件，并由被调查人或者见证人签名。

调查取证时需要复制原件的，应当注明原件的保存单位

（或者个人）和出处，由原件保存单位（或者个人）签注“与原件核对无误”，并由其盖章或者签名。

鉴定结论应当由中国证监会或者交易所认可的鉴定单位做出，并由鉴定单位和鉴定人签字盖章。

第十六条 会员、客户和期货保证金存管银行涉嫌违规，经交易所立案调查的，在确认违规行为之前，为防止违规后果进一步扩大，保障处理决定的执行，交易所可以对被调查人采取下列限制性措施：

- （一）限期说明情况；
- （二）暂停登录新的客户编码；
- （三）限制入金；
- （四）限制出金；
- （五）限制开仓；
- （六）降低持仓限额；
- （七）提高保证金标准；
- （八）限期平仓；
- （九）强行平仓。

采取前款第（一）至（六）项限制性措施，可以由交易所总经理决定；其他限制性措施由交易所董事会决定，并及时报告中国证监会。

第十七条 交易所调查人员在稽查、立案调查过程中，应当严格遵守保密制度，不得滥用职权。

违反前款规定的，交易所根据不同情节对其给予相应的处分。

第三章 违规违约处理

第十八条 会员具有下列违反会员管理规定情形之一的，责令改正，并根据情节轻重给予谈话提醒、书面警示、通报批评、公开谴责、限制开仓、强行平仓、取消会员资格的处罚：

（一）以欺骗手段获取会员资格或者在资格变更中具有违规情形；

（二）有重大变更事项或者会员经营状况和财务状况发生重大变化，未按照规定的期限和要求向交易所书面报告，或者未按照规定的期限和要求向交易所报送财务报表等有关材料；

（三）任用不具备资格的期货从业人员；

（四）违反交易所会员联系人制度规定；

（五）不按照规定缴纳各种费用、不履行会员义务；

（六）拒不配合交易所稽查；

（七）违反交易所会员管理规定的其他情形。

第十九条 会员或者客户具有下列违反交易管理规定情形之一的，责令改正，并根据情节轻重给予谈话提醒、书面警示、通报批评、公开谴责、限制开仓、强行平仓、取消会员资格、宣布为市场禁止进入者的处罚：

（一）接受不符合规定条件的单位或者个人委托；

（二）违规办理开户手续；

- （三）违反交易编码管理规定；
- （四）违反交易所席位管理规定；
- （五）窃取商业秘密或者破坏交易所系统；
- （六）违反交易所交易管理规定的其他情形。

上述违规行为同时构成违约的，应当按照相关协议中关于违约责任条款的约定，向交易所支付惩罚性违约金。没有违规所得或者违规所得不满10万元的，支付50万元以下惩罚性违约金；违规所得10万元以上的，支付违规所得1倍以上5倍以下惩罚性违约金。

会员有本条所列行为的，交易所可以给予责任人暂停从事交易所期货业务的处罚；情节严重的，取消其从事交易所期货业务的资格。

第二十条 会员具有下列欺诈客户行为之一的，责令改正，并根据情节轻重给予谈话提醒、书面警示、通报批评、公开谴责、限制开仓、强行平仓、取消会员资格、宣布为市场禁止进入者的处罚：

- （一）向客户做获利保证或者不按照规定向客户出示风险说明书；
- （二）在经纪业务中与客户约定分享利益、共担风险；
- （三）不按照规定接受客户委托或者不按照客户委托内容擅自进行期货交易；
- （四）隐瞒重要事项或者使用其他不正当手段，诱骗客户发出交易指令；
- （五）向客户提供虚假成交回报；

（六）未将客户交易指令下达到交易所；

（七）交易所规定的其他欺诈客户的行为。

上述违规行为同时构成违约的，依照本办法第十九条第二款的规定处理。

会员有本条所列行为的，对责任人依照本办法第十九条第三款的规定处理。

第二十一条 全面结算会员、特别结算会员有下列行为之一的，责令改正，并根据情节轻重给予谈话提醒、书面警示、通报批评、公开谴责、限制开仓、强行平仓、取消会员资格、宣布为市场禁止进入者的处罚：

（一）不按照规定接受交易会员委托或者不按照交易会员委托内容擅自进行期货交易；

（二）未将交易会员的交易指令下达到期货交易所；

（三）向交易会员提供虚假成交回报；

（四）违反交易所交易管理规定的其他行为。

上述违规行为同时构成违约的，依照本办法第十九条第二款的规定处理。

全面结算会员、特别结算会员有本条所列行为的，对责任人依照本办法第十九条第三款的规定处理。

第二十二条 会员或者客户有下列影响期货交易价格行为之一的，责令改正，并根据情节轻重给予书面警示、通报批评、公开谴责、限制开仓、强行平仓、取消会员资格、宣布为市场禁止进入者的处罚：

（一）单独或者合谋，集中资金优势、持仓优势或者利

用信息优势联合或者连续买卖合约，操纵期货交易价格；

（二）蓄意串通，按照事先约定的时间、价格和方式相互进行期货交易，影响期货交易价格或者期货交易量；

（三）以自己为交易对象，自买自卖，影响期货交易价格或者期货交易量；

（四）为影响期货市场行情囤积相关现货；

（五）不以成交为目的或者明知申报的指令不能成交，仍恶意或者连续输入交易指令企图影响期货价格，扰乱市场秩序、转移资金或者进行利益输送；

（六）利用内幕信息或者国家秘密进行期货交易或者泄露内幕信息影响期货交易；

（七）通过其他方式影响期货交易价格的行为。

上述违规行为同时构成违约的，依照本办法第十九条第二款的规定处理。

会员有本条所列行为的，对责任人依照本办法第十九条第三款的规定处理。

第二十三条 会员或者客户在进行套期保值额度申请和交易时，有欺诈或者违反交易所规定行为的，交易所所有权不受理套期保值申请或者取消已批准的套期保值额度，并视情节轻重，给予谈话提醒、书面警示、通报批评、取消会员资格、宣布为市场禁止进入者的处罚；对已使用套期保值额度建仓的会员或者客户，交易所还有权采取强行平仓，并依照本办法第十九条第二款的规定处理。

第二十四条 会员具有下列违反结算管理规定行为之

一的，责令改正，并根据情节轻重给予谈话提醒、书面警示、通报批评、公开谴责、限制开仓、强行平仓、取消会员资格、宣布为市场禁止进入者的处罚：

- （一）未将自有资金与客户资金分户存放；
- （二）未对客户保证金实行分账管理；
- （三）无正当理由拖延客户出入金；
- （四）向客户收取的交易保证金低于规定标准；
- （五）允许客户在保证金不足时开仓交易；
- （六）挪用或者擅自允许他人挪用客户资金或者套用不同账户资金；
- （七）任用不具备期货从业人员资格的员工办理结算交割业务；
- （八）未按照规定向客户提供有关成交结果、资金结算报表；
- （九）未按照规定设立结算部门；
- （十）未实行当日无负债结算制度；
- （十一）违反期货保证金安全存管监控机构有关规定；
- （十二）未按照规定提取、管理和使用风险准备金；
- （十三）伪造、涂改或者未按照规定保存期货交易、结算、交割资料；
- （十四）违反交易所结算管理规定的其他行为。

上述违规行为同时构成违约的，依照本办法第十九条第二款的规定处理。

会员有本条所列行为的，对责任人依照本办法第十九条

第三款的规定处理。

第二十五条 结算会员具有下列违反结算管理规定行为之一的，责令改正，并根据情节轻重给予谈话提醒、书面警示、通报批评、公开谴责、限制开仓、强行平仓、取消会员资格、宣布为市场禁止进入者的处罚：

- （一）未按时足额缴纳保证金；
- （二）交易结算会员私下为交易会员进行结算；
- （三）未按照规定向交易所足额缴纳结算担保金；
- （四）任用不具备结算交割员资格的人员办理结算交割员业务；

- （五）结算交割员未按照规定办理结算交割员业务的。

上述违规行为同时构成违约的，依照本办法第十九条第二款的规定处理。

结算会员有本条所列行为的，对责任人依照本办法第十九条第三款的规定处理。

第二十六条 全面结算会员、特别结算会员受托为交易会员结算，具有下列违反结算管理规定行为之一的，责令改正，并根据情节轻重给予谈话提醒、书面警示、通报批评、公开谴责、限制开仓、强行平仓、取消会员资格、宣布为市场禁止进入者的处罚：

- （一）违反规定受托为不符合规定条件的交易会员进行结算；

- （二）未与交易会员签订委托结算协议，或者未将委托结算协议向交易所报备，自行为交易会员进行结算的；

- （三）未对交易会员保证金实行分账管理；
- （四）允许交易会员在保证金不足的情况下进行开仓交易；
- （五）向交易会员收取的最低结算准备金低于交易所规定标准；
- （六）向交易会员收取的保证金低于交易所保证金标准的；
- （七）挪用交易会员保证金，或者违规划转交易会员保证金的；
- （八）未对交易会员执行当日无负债结算的；
- （九）向交易会员收取结算担保金的；
- （十）在协议有效期间，擅自终止为交易会员结算的；
- （十一）违反中国证监会和交易所规定的其他行为。

上述违规行为同时构成违约的，依照本办法第十九条第二款的规定处理。

全面结算会员、特别结算会员有本条所列行为的，对责任人依照本办法第十九条第三款的规定处理。

第二十七条 结算交割员具有下列行为之一的，给予谈话提醒、书面警示、通报批评处罚；情节严重的，给予暂停结算交割员资格或者取消结算交割员资格的处罚：

- （一）采取虚假、欺骗和不正当手段骗取结算交割员资格；
- （二）伪造、涂改、借用结算交割员证件；
- （三）未按照规定办理结算交割员业务。

第二十八条 期货保证金存管银行未履行法定或者约定义务的，责令改正，交易所对其处以谈话提醒、书面警示、通报批评、公开谴责、暂停或者终止交易所期货保证金存管业务的处罚。

期货保证金存管银行的违规行为同时构成违约的，依照本办法第十九条第二款的规定处理。

第二十九条 会员或者客户具有下列违反风险控制管理规定行为之一的，责令改正，并根据情节轻重给予谈话提醒、书面警示、通报批评、公开谴责、限制开仓、强行平仓、取消会员资格、宣布为市场禁止进入者的处罚。

（一）利用分仓等手段，规避交易所的持仓限制，超量持仓；

（二）未按照大户持仓报告制度及时向交易所履行申报义务，或者作虚假报告、隐瞒不报；

（三）会员未按照规定采取强行平仓措施；

（四）违反风险警示制度有关要求；

（五）违反交易所风险控制制度的其他行为。

上述违规行为同时构成违约的，依照本办法第十九条第二款的规定处理。

会员有本条所列行为的，对责任人依照本办法第十九条第三款的规定处理。

第三十条 会员、客户、信息服务机构、期货保证金存管银行及期货市场其他参与者具有下列违反信息管理办法规定行为之一的，责令改正，并根据情节轻重给予谈话提醒、

书面警示、通报批评、公开谴责、强行平仓、限制开仓、取消会员资格、宣布为市场禁止进入者的处罚：

（一）会员未将交易所发布的即时行情和公告信息等市场信息及时在营业场所公布；

（二）未经交易所授权，擅自发布、传输和传播交易所信息；

（三）未经交易所授权，将交易信息出售或者转让他人，或者以任何方式再转接到其他地方；

（四）未经交易所授权，向其他机构传输交易信息，供其进行再传播或者增值开发；

（五）未经交易所授权，将交易信息用于信息经营协议载明用途之外；

（六）未经交易所授权，擅自对交易信息进行增值开发或者未履行约定的增值开发成果备案义务；

（七）发现传输或者传播的交易信息内容有错误，未按照规定处理；

（八）不履行保密义务，擅自公开不宜公开的信息；

（九）故意制造、散布虚假或者误导性信息；

（十）违反交易所信息管理办法规定的其他行为。

上述违规行为构成违约行为的，依照本办法第十九条第二款的规定处理。

有本条所列行为的，对责任人依照本办法第十九条第三款的规定处理。

第三十一条 会员、客户、期货保证金存管银行及期货

市场其他参与者违反本办法规定，有下列行为之一的，责令改正，给予谈话提醒、书面警示、通报批评、限制开仓、取消会员资格、宣布为市场禁止进入者的处罚：

（一）故意规避或者拒绝、阻挠交易所依法对期货交易相关行为进行监督检查；

（二）进行虚假性、误导性或者遗漏重要事实的申报、陈述、解释或者说明；

（三）提供虚假的文件、资料或者信息。

第三十二条 被交易所宣布为市场禁止进入者的，自宣布生效之日起20个交易日内了结持仓、交易业务和相关债权债务。

被中国证监会或者其他期货交易所宣布为市场禁止进入者的，在市场禁止进入期限内不得从事本交易所的期货业务。

第三十三条 交易所工作人员违反有关规定的，按照法律、行政法规、规章和交易所内部规章制度处理。

第三十四条 有多种违规行为的，分别定性，数罚并用，多次违规的，从重或者加重处罚。

第四章 裁决与执行

第三十五条 交易所对违规行为调查核实后，事实清楚、证据确凿的，依照交易所章程、交易规则及本办法规定予以裁决。

第三十六条 交易所做出裁决，应当制作处理决定书。
处理决定书应当包括下列内容：

- （一）当事人的姓名或者名称、住所；
- （二）违规事实和证据；
- （三）处理或者处罚的种类和依据；
- （四）处理或者处罚决定的履行方式和期限；
- （五）申请复议的途径和期限；
- （六）做出处理决定的日期。

第三十七条 处理决定书应当送达当事人，并同时分送有关协助执行部门。处理决定书可以邮寄送达，邮件寄出后，市内3日、市外7日视为送达；当事人非会员的，可以由会员送达。

按照中国证监会的规定需要抄报违规处理情况的，同时抄报中国证监会。

第三十八条 处理决定书自送达之日起生效。

当事人对处理决定书不服的，可以于处理决定书生效之日起10日内向交易所书面申请复议一次，复议期间不停止决定的执行。

第三十九条 交易所应当于收到复议申请书之日起30日内做出复议决定，复议决定为终局决定。

第四十条 处理决定中包括惩罚性违约金的，当事人应当在处理决定书生效之日起5日内将惩罚性违约金如数缴纳至交易所指定的银行账户。逾期不缴付的，当事人是结算会员的，交易所从结算会员专用资金账户中划付。当事人不是

结算会员的，有关结算会员应当协助交易所划拨其在该结算会员处的资金。

对会员工作人员的惩罚性违约金，由会员代缴。

第五章 纠纷调解

第四十一条 会员、客户、期货保证金存管银行及期货市场其他参与者之间发生期货交易纠纷的，可以自行协商解决，也可以提请交易所调解。

第四十二条 交易所的调解机构是交易所董事会下设的调解委员会，其常设办事机构设在交易所监查部门。

第四十三条 调解应当在事实清楚、责任明确的基础上依据国家有关期货交易的法律、行政法规、规章和交易所的规章制度进行。

第四十四条 当事人向调解委员会提出调解申请，应当从其知道或者应当知道其合法权益被侵害之日起30日内提出。

第四十五条 当事人申请调解应当符合下列条件：

- （一）有调解申请书；
- （二）有具体的事实、理由和请求；
- （三）属于调解委员会的受理范围。

第四十六条 当事人向调解委员会申请调解，应当提交书面申请和有关材料。

调解申请书应当写明下列事项：

（一）当事人的姓名、性别、年龄、职业、工作单位和住所，或者单位名称、住所和法定代表人或者负责人的姓名、职务；

（二）请求调解的事实、理由及要求；

（三）有关证据。

第四十七条 当事人根据有关规定负有举证的责任。调解委员会认为必要时，可以调查收集证据。

第四十八条 调解委员会应当在查明事实，分清是非和当事人自愿的基础上调解，促使当事人相互谅解，达成协议。

第四十九条 经调解达成的协议应当记录在案，并制作调解书，由双方当事人签收后生效。

第五十条 调解书应当写明下列内容：

（一）双方当事人的名称、住所、法定代表人或者负责人的姓名及职务；

（二）争议的事项和请求；

（三）协议结果。

第五十一条 调解委员会应当在受理调解后30日内结案；到期未结案的，调解委员会应当向当事人说明理由。双方当事人要求继续调解的，调解委员会应当继续调解。一方要求终止调解的，应当终止调解。

第五十二条 调解不成的，当事人可以依法提请仲裁机构仲裁或者向人民法院提起诉讼。

第六章 附 则

第五十三条 本办法未作规定的违规行为处理，适用交易所其他相关规则的规定。

第五十四条 本办法所称“以上”、“以下”均含本数。

第五十五条 本办法由交易所负责解释。

第五十六条 本办法自2007年6月27日起实施。