

关于各个交易所实施申报费收费的合约上频繁报撤单异常交易行为认定有关事项的通知

尊敬的客户：

您好！根据上期所、能源交易中心、大商所、郑商所、广期所相关通知，自 2024 年 10 月 25 日（即 10 月 24 日晚连续交易）起，在实施申报费收费的合约上，频繁报撤单异常交易行为认定有关事项如下：

上期所：在实施申报费收费的合约上，由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）产生的频繁报撤单行为构成异常交易行为，由其他交易指令产生的频繁报撤单行为不构成异常交易行为。

能源交易中心：在实施申报费收费的合约上，由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）产生的频繁报撤单行为构成异常交易行为，由其他交易指令产生的频繁报撤单行为不构成异常交易行为。

大商所：实施申报费的合约上由非附加立即全部成交否则自动撤销（FOK）或立即成交剩余指令自动撤销（FAK）属性的限价指令产生的频繁报撤单行为不构成异常交易行为。

郑商所：在实施申报费收费的合约上，未附加立即成交剩余指令自动撤销（FAK）、立即全部成交否则自动撤销（FOK）属性的限价指令产生的频繁报撤单行为不构成异常交易行为。

广期所: 在实施申报费的合约上, 由非附加立即全部成交否则自动撤销 (FOK) 和立即成交剩余指令自动撤销 (FAK) 属性的限价指令产生的频繁报撤单行为不构成异常交易行为。

特此通知。

国新国证期货有限责任公司

2024年7月22日