

重庆市金融工作办公室 关于印发《重庆市交易场所风险管理 指引（试行）》的通知

渝金发〔2014〕5号

各区县（自治县）金融办（金融工作管理部门），各交易场所：

为进一步加强交易场所风险管理，指导交易场所强化风险控制，根据《重庆市人民政府关于进一步加强交易场所监督管理的意见》（渝府发〔2013〕44号）和《重庆市交易场所监督管理实施细则（试行）》等规范性文件规定，我办制定了《重庆市交易场所风险管理指引（试行）》，现印发给你们，请按照执行。执行中出现的问题，请及时反馈我办。

重庆市金融工作办公室

2014年4月3日

重庆市交易场所风险管理指引（试行）

第一章 总 则

第一条 为进一步加强交易场所风险管理，指导交易场所强化风险控制，根据《重庆市人民政府关于进一步加强交易场所监督管理的意见》（渝府发〔2013〕44号，以下简称《意见》）和《重庆市交易场所监督管理实施细则（试行）》（以下简称《实施细则》）等规范性文件规定，制定本指引。

第二条 重庆市金融工作办公室（以下简称市金融办）按照“明确职责、合规经营、有效防范、及时处置”的原则，督促交易场所建立和完善风险控制制度，防范和化解市场风险。

第三条 交易场所应建立与所从事交易的业务性质、规模和复杂程度相适应的风险控制制度和体系，根据交易品种、交易方式和交易规则等具体情况，对不同类别的风险进行有效的识别、度量、防范和处置，满足风险控制的实际需要。

第四条 本指引适用于经市政府批准在我市行政区域内设立的，从事权益类、合约类交易的交易机构及分支机构，仅从事车辆、房地产等实物交易的交易场所除外。

第二章 风控体系

第五条 交易场所应当对风险进行动态评价，完善内设机构、

人员配置、内部管理制度等风险控制体系。

第六条 交易场所应当设立风险控制部门（或职责相当的部门），加强风险控制制度建设，开展异常情况处理、违约处理、争议处理、风险处置和应急处理等有关风险控制工作。

第七条 交易场所应当配备3名以上风险控制人员，专职从事交易场所风险控制工作，并及时向高级管理层和市金融办反馈风险信息。

交易场所高级管理人员、风险控制人员应当了解所从事的产品交易风险，参加相关业务培训，提高风险控制能力。

第八条 交易场所应当制定完善财务会计、内部控制制度等内部管理制度，加强工作人员管理，采取有效措施防范道德风险。

第九条 交易场所应当明确有关交易、结算、交割等环节的审核、评估、批准以及交易信息系统等的操作权限、程序和行为规范，有效防范工作人员违规操作风险。

第三章 风控措施

第十条 交易场所应当制定完善交易商、代理商、经纪商等业务管理制度，严格准入标准，加强日常管理。

第十一条 交易场所应当制定完善投资者管理制度，明确投资者准入条件，落实交易风险揭示，加强投资者教育，引导投资者正确认识市场风险。

第十二条 交易场所及其交易商、代理商、经纪商等为投资者（客户）提供开户、销户服务，应当由投资者（客户）提供合法、真实的意思表示、身份证明和联系方式等资料。

第十三条 交易场所应当提示投资者（客户）妥善保管其账户和密码，约定账户、密码及其他客户身份识别依据的保管责任和义务，明确密码重置等操作程序。

第十四条 交易场所实行价格涨跌幅限制，根据市场风险状况，交易场所可以按照交易规则中的约定设定和调整每一个交易品种的涨跌幅限制比例。

对连续3个交易日达到涨跌幅限制的交易品种，交易场所应当及时采取合法、有效的措施降低交易风险。

第十五条 交易场所应当实行风险履约金（风险准备金）制度或者采取其他合法、有效的措施，保障交易正常进行，促进合约履行。

第十六条 交易场所实行大户持单报告制度，可以根据市场风险状况，制定持单报告标准、资料和程序等事项。

第十七条 交易场所实行持单总量限制等制度，应当根据市场实际情况限定每一交易品种的总量上限。

第十八条 交易场所实行单一持单限制等制度，应当明确规定投资者（客户）对某一品种单边持单的最大数量或限制单一投

资者（客户）持单不得高于市场总体持单量的一定比例。

第十九条 交易场所应当实行交易账户监测制度，对有异常交易行为的账户进行动态跟踪，监控恶意刷单、过度投机等行为。

第二十条 交易场所实行交易结算资金银行存管等资金管理制度。受托资金存管机构应当认真履行资金保管义务，及时向交易场所通报资金异动情况并按照约定采取风险控制措施。

第二十一条 交易场所应当实行资金账户监控制度，根据资金账户监管协议，每日实时掌握交易主体（客户）的资金情况，对高频率、大额的资金出入等情形进行跟踪和警示。

第二十二条 交易场所实行每日结算制度，应当在每日结算时与结算机构逐笔对账，及时发现和纠正账目错误。

第二十三条 交易场所实行强制履约制度，应当事前约定强制履约、强制协议转让等有关条款，明确采取强制履约或强制协议转让等措施时需满足的触发条件和执行的标准程序等内容。

第二十四条 交易场所设立具有兑付、回购等属性的交易品种，应当采取合格第三方担保等措施并报经市金融办核准。

第二十五条 商品合约类交易场所实行价格偏离跟踪制度，交易场所要按照交易规则中规定的方式采集、计算、比较和跟踪价格等市场信息，建立 5 个以上不同场所或企业的价格采样点。

商品合约类交易场所应当跟踪连续 3 个交易日的平均结算价

与按照采样价格计算的市场平均价之间的价格偏离程度（以下简称商品价格偏离程度），采取相应的风险控制措施。

第二十六条 商品合约类交易场所应当明确实物商品、仓单等的交收申报方式、交收制度、实物交收流程，以及出现交收违约时违约方需承担的违约责任和相应的赔付方式。

第二十七条 商品合约类交易场所出现大幅剧烈价格波动或商品价格偏离程度过高时，可以根据事前约定组织交易主体采取现货交收、场外协议交收等措施抑制过度投机，促进价格回归。

第二十八条 商品合约类交易场所实行供应商资质审核、有货申报等制度，应当指定专业的商品质检机构，制定规范的标准仓库管理规则和货物出入管理流程，明确交收、仓储过程中各方的责任和义务。

权益类和其他合约类交易场所实行产品发行审核制度，应当采取适当措施对出让方资质和交易标的进行审查，由有关部门出具文件或专业的第三方机构提供专项评估、评级等服务。

第二十九条 交易场所应当落实安全生产有关规定，做好防火、防盗、社会治安以及其他灾害风险的防范和应对工作。

第三十条 交易场所应当制定完善交易信息系统安全稳定性保障制度，严格自有机房管理，加强网络信息安全保护，采取网络数据备份、设置备用电源和多线路网络接入服务等措施，防范

交易信息系统风险。

第四章 违约与争议处理

第三十一条 交易场所应当制定完善违约处理办法和交易争议处理制度，明确对交易主体违反合同约定的处理及交易争议处理的程序、部门和人员安排等事项。

第三十二条 交易场所违约处理办法应当明确日常检查与调查、临时处置措施、违约处理措施、裁决与执行等内容。

第三十三条 交易场所调查、认定和处理违约行为，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。

第三十四条 交易主体具有下列侵害投资者合法权益行为之一的，交易场所应当采取违约处理措施；涉嫌犯罪的，移送司法机关处理：

（一）代理签名、伪造或篡改投资者（客户）资料，假冒投资者（客户）；

（二）未按照规定向投资者（客户）揭示风险；

（三）代客交易、代客理财或者违规使用他人账户进行交易；

（四）作出获利保证或者在经纪业务中与投资者（客户）约定分享利益、共担风险；

（五）隐瞒重要事项或者使用其他不正当手段，诱骗投资者

(客户)发出交易指令;

(六)进行内幕交易、欺诈投资者(客户)、恶意套取手续费等费用以及违反《实施细则》第三十三条的其他行为。

(七)其他侵害投资者(客户)合法权益的行为。

第三十五条 交易场所交易争议处理制度应当明确争议前提、争议处理规则、举证责任和法律救济安排等内容。

第三十六条 交易场所参与主体之间发生争议,经争议处理程序或协商无法达成一致的,可以由交易场所组织调解或者直接依法提请仲裁或诉讼。

交易场所参与主体之间发生争议,当事人不愿意调解、调解不成或者当事人不履行调解协议的,应当依法提请仲裁或诉讼。

第三十七条 交易场所可以按照交易规则中的约定,采取设立争议调解委员会等措施,组织调解在交易活动中发生的争议。

第五章 信息披露

第三十八条 交易场所应当建立健全信息披露制度。交易场所应当根据法律、法规和国务院、市政府的有关规定以及交易规则等的约定,及时、公平地披露信息,并保证所披露的信息真实、准确、完整,不得有虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

第三十九条 交易场所应当指定专人负责信息披露工作。交易场所董事、监事、高级管理人员应当保证信息披露内容的真实、

准确和完整，没有虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并在有关信息披露内容中载明免责声明事项。

第四十条 交易场所应当每日披露交易行情、价格及变化情况等信息。

第四十一条 交易场所应当向交易主体履行以下告知义务：

- （一）提示不得代客交易、不得代客理财；
- （二）提示妥善保管账户和密码；
- （三）提示定期查看账户资金余额。
- （四）市金融办规定的其他事项。

第四十二条 交易场所应当以临时公告、风险警示公告等方式披露以下事项：

- （一）变更法定代表人、高级管理人员或分支机构负责人；
- （二）变更联系方式、住所、分支机构营业场所或其他交易场所基本信息；
- （三）变更交易时间、交易方式、交易品种及交易特性指标。
- （四）交易场所出现经营困难或严重经营风险。
- （五）修改章程、交易规则、重大管理制度和风险控制制度。
- （六）某一交易品种价格异常波动，或者商品价格偏离程度超过 15%。
- （七）采取风险警示措施、启动风险处置预案或突发事件应

急预案；

（八）交易场所拟采取技术性停牌、临时停市、暂缓进入交易等措施。

（九）交易规则中约定的其他披露事项。

第四十三条 交易场所按月向市金融办和所在区县金融办报告自有货币资金、成交量、成交金额、出入资金、价格涨跌幅度和商品价格偏离程度等事项。

第六章 风险处置

第四十四条 交易场所应当制定完善风险处置制度和应急管理制度，采取合法、有效的措施妥善处置风险。

第四十五条 交易场所应当明确风险处置和应急管理的部门职责、人员安排、措施和程序等，将风险处置预案和突发事件应急预案等报市金融办备案，并抄送所在区县金融办和市级有关行业主管部门。

第四十六条 交易场所出现《实施细则》规定的重大事项、风险情形以及交易场所无法处置的风险时，应当在当日内向市金融办、所在区县金融办和市级有关行业主管部门报告。

第四十七条 交易场所出现以下风险情形的，应当采取技术性停牌等风险控制措施：

（一）某一交易品种连续3个交易日达到涨跌幅限制的；

(二) 连续 3 次出现违规代理操作等情形，未采取合法、有效的措施督促违规主体改正且经市金融办检查属实的；

(三) 商品价格偏离程度超过 20% 的；

(四) 某一交易品种持单总量超过该品种总量上限的；

(五) 交易场所出现严重的交易争议或其他情形，导致重大集体上访或群体性事件的；

(六) 出现成交量异常、交易价格异常等情形，可能出现严重的结算、交割危机的；

(七) 市金融办规定的其他风险情形。

第四十八条 交易场所应当明确交易异常情况及其处理程序。出现下列情形之一，交易场所应当根据实际情况采取技术性停牌、临时停市、暂缓进入交收或其他约定的措施，按照交易异常情况处理程序进行处置：

(一) 发生突发性事件或意外事件；

(二) 出现不可抗力因素可能导致交易无法正常进行；

(三) 交易信息系统技术故障导致交易不能正常进行的；

(四) 出现严重的异常交易行为或情况；

(五) 交易规则中约定的其他交易异常情况。

技术性停牌或临时停市等原因消除后，交易场所应当及时恢复交易。

第四十九条 交易场所应当明确异常交易行为的触发条件、认定标准和调查程序，约定相应的处置措施，及时采取合法、有效的措施对认定为异常交易行为的进行处置。

第五十条 交易场所认定交易主体异常交易行为的，可以单独或者同时采取要求有关交易主体报告情况、谈话提醒、书面警示、发布风险警示公告和其他约定处理方法中的一种或者多种风险警示措施。

第五十一条 出现下列情形之一的，交易场所可以认定交易主体出现异常交易行为：

- （一）交易主体资金异常；
- （二）交易主体账户、持单异常或多次频繁恶意刷单；
- （三）多次或连续进行高买低卖的交易，或单次高买低卖交易金额较大的；
- （四）在同一价位或相近价位大量或频繁进行回转交易的；
- （五）通过计算机程序自动批量申报下单，影响交易场所正常交易秩序或者交易信息系统安全的；
- （六）在计算相关交易标的参考价格或结算价格的特定时间，通过拉抬、打压或锁定等手段，影响相关交易标的参考价格或结算价格的；
- （七）交易主体涉嫌违约；

- (八) 交易场所接到涉及交易主体的投诉经查属实的；
- (九) 交易主体涉及司法调查；
- (十) 交易规则中约定的其他异常交易行为。

第七章 监督管理

第五十二条 市金融办采取非现场监管和现场检查相结合的监管手段，加强对交易场所风险控制状况的日常监管。

第五十三条 交易场所制定、修改本指引规定的各项风险控制制度，应以适当方式公示并报市金融办备案。

第五十四条 市金融办采取查阅、复制交易场所保存的有关交易信息、资料（涉及秘密或隐私的除外），要求资金存管机构、中介服务机构等单位 and 人员配合取证，要求交易场所参与主体申报、陈述、解释、说明有关情况等方式，对交易场所风险控制情况进行现场检查。

第五十五条 市金融办对交易场所以下风险控制情况进行重点抽查：

- (一) 交易主体开户、销户等资料的合规性；
- (二) 交易主体资金存管、交易明细和资金流水对应情况；
- (三) 交易记录等各种原始凭证以及登记、存管、结算和交收服务等数据资料的保存情况；
- (四) 信息披露义务的履行情况；

- (五) 商品合约类交易场所的交收仓库建设及仓储情况；
- (六) 交易信息系统安全稳定性情况；
- (七) 有关风险控制制度的制定、完善和落实情况；
- (八) 风险防范、交易违约处理、争议处理和风险处置情况；
- (九) 交易场所及工作人员依法合规经营和履行职责情况。
- (十) 市金融办规定的其他事项。

第五十六条 交易场所违反法律、法规和国务院、市政府的有关规定以及《实施细则》、本指引有关风险控制要求的，市金融办采取约见谈话、发警示函、取消违规交易品种、停止违规交易行为、责令其限期改正等监管措施；逾期未改正的，市金融办采取撤销交易品种核准或移交相关部门依法处理等措施。

第八章 附 则

第五十七条 本指引由市金融办负责解释。

第五十八条 本指引自 2014 年 4 月 15 日起实施。