

# 上海石油天然气交易中心有限公司

## 风险控制管理办法

### (试行)

#### 第一章 总 则

**第一条** 为了加强上海石油天然气交易中心(以下简称“交易中心”)现货交易风险管理,维护交易各方的合法权益,保证交易中心交易的正常进行,根据《上海石油天然气交易中心现货交易管理办法(试行)》制定本办法。

**第二条** 交易中心现货交易风险管理实行保证金制度、价格变化幅度和交易量限制制度、风险警示制度等。

**第三条** 交易中心、交易商、指定结算银行及其工作人员必须遵守本办法。

#### 第二章 保证金制度

**第四条** 交易中心实行保证金制度。保证金由指定结算银行实行第三方监管。保证金的标准由交易中心按照国家有关规定制定。

**第五条** 交易中心有权根据市场情况,调整保证金比例。

交易中心决定调整保证金标准应及时公告。

#### 第三章 价格变化幅度及交易量限制制度

**第六条** 交易中心实行价格变化区间限制制度,由交易中心根据

交易产品前一交易日结算价格确定交易产品的当日最大价格波动幅度。

**第七条** 交易品种的价格区间为上一交易日结算价的一定变化区间内，超出该区间的申报视为无效申报。该变化区间标准由交易中心根据交易品种的不同而设定，交易中心可以根据市场情况调整各产品挂牌价区间限制的标准。

**第八条** 当某一产品在价格区间的上限价格或下限价格申报时，成交原则实行“价格优先、时间优先”的原则。

**第九条** 交易商挂牌时，应该设定单个交易商最大交易量和最小交易量。

#### **第四章 风险警示制度**

**第十条** 交易中心实行风险警示制度。当交易中心认为必要时，可以分别采取或同时采取要求交易商报告情况、谈话提醒、书面警示、公开谴责、发布风险警示公告等措施中的一种或多种，以警示和控制风险。

**第十一条** 出现下列情形之一的，交易中心可以要求交易商报告情况，或约见交易商谈话，提醒风险：

- （一）挂牌价格与市场预期明显异常；
- （二）交易商交易行为异常；
- （三）交易商交易量明显异常；
- （四）交易商涉嫌违规、涉及司法调查或诉讼案件；
- （五）交易中心认定的其他情形。

交易中心要求交易商报告情况的，交易商应当按照交易中心要求的时间、内容和方式如实报告。

交易中心实施谈话提醒的，交易商应当按照交易中心要求的时间、地点和方式认真履行。

**第十二条** 发生下列情形之一的，交易中心可以发布书面警示、公开谴责或向全体交易商发出风险提示函：

- （一）国内外市场出现异常变化；
- （二）交易商涉嫌严重违规、涉及重大司法调查或诉讼案件；
- （三）交易商交易存在较大风险；
- （四）交易中心认定的其他异常情形。

## **第五章 异常情况处理**

**第十三条** 在交易过程中，当出现以下情形之一的，交易中心可以宣布市场交易进入异常情况，采取紧急措施化解风险：

（一）包括但不限于洪水、地震及其他自然灾害、战争、骚乱、火灾、突发停电等不可抗力或计算机系统故障等不可归责于交易中心的原因导致交易无法正常进行；

（二）交易商出现结算、交收危机，对市场正在产生或者将产生重大影响；

（三）有证据证明交易商违反交易中心交易规则及其实施细则并且对市场正在产生或者即将产生重大影响；

（四）交易中心规定的其他情况。

出现前款第（一）项异常情况时，交易中心可以采取调整开市收市时间、暂停交易的紧急措施；出现前款第（二）、（三）、（四）项异

常情况时，交易中心可以决定采取调整开市收市时间、暂停交易、调整交易保证金比例、限制交收申报、限制出金等紧急措施。

**第十四条** 交易中心宣布进入异常情况并决定暂停交易时，一般暂停交易的期限不超过 3 个交易日。

**第十五条** 交易中心宣布市场交易进入异常情况并决定采取紧急措施前将予以公告。因异常情况交易中心采取的相应措施造成的损失，交易中心不承担责任。

## 第六章 附 则

**第十六条** 本办法解释权属于上海石油天然气交易中心有限公司。

**第十七条** 本办法自 2015 年 7 月 1 日起实施。