

深圳排放权交易所 异常情况处理实施细则 (暂行)

二〇一四年十二月

目 录

第一章	总则	3
第二章	异常情况	4
第三章	预防机制	9
第四章	处置原则和控制措施	11
第五章	处理流程	13
第六章	奖惩制度	17
第七章	附则	18

第一章 总则

第一条 为了维护碳市场交易秩序，保护会员的合法权益，有效控制深圳排放权交易所（以下简称本所）市场风险，防范各种突发风险及异常情况的出现，妥善处置交易异常情况，维护市场稳定，保障碳市场安全、稳定、有效运行，根据《深圳经济特区碳排放管理若干规定》、《深圳市碳排放权交易管理暂行办法》等法律法规以及《深圳排放权交易所现货交易规则（暂行）》等业务规则，制定本细则。

第二条 本细则所称异常情况是指导致或可能导致本所碳排放权交易全部或者部分不能正常进行（以下简称“交易不能进行”）的情形。

第三条 引发交易异常情况的原因包括市场操纵、不可抗力、意外事件、技术故障等。

第四条 本细则适用于本所运营过程中各个环节发生的各种异常事件，以及不可抗拒的突发事件。

第五条 本所以对异常情况的管理工作以预防为主，预防和应急处置相结合。

第二章 异常情况

第六条 异常情况包括以下情形：

- （一）在交易过程中发生操纵交易价格的异常事件；
- （二）因不可抗力引发的突发事件；
- （三）因意外事件引发的异常事件；
- （四）交易系统被非法入侵、交易环节出现操作失误等技术故障造成的异常事件；
- （五）政府主管部门规定的其他情形。

异常情况分为交易过程中的异常事件和其他异常事件。

第七条 交易过程中可能出现的异常事件包括：

- （一）价格异常，指在市场行情较平稳、清淡时，价格突然出现剧烈波动，在较短的时间内价格突然出现剧烈波动；
- （二）交易异常，指由于各种原因造成本所或者本所会员无法实现正常交易的现象；
- （三）成交异常，指会员的成交违反本所规定，或者有成交量异常增加、不能成交等现象；
- （四）资金异常，指交易系统中资金在较短的时间内有较大的变化或各种资金之间的逻辑出现差异等现象；
- （五）出入金异常，指不能通过第三方存管银行实现正常的出入金，或者长期未使用的账户或资金量较小的账户突

然出现大量入金，或者账户交易量较小，但却频繁出入金等现象；

（六）系统操作异常，指对整个交易系统的操作没有按照既定的规则进行或者按照错误的参数对交易系统进行操作的现象；

（七）其他交易过程中出现的异常情况。

第八条 交易过程中的价格异常包括：

（一）交易错误价格没有完全过滤，造成报价错误的异常情况；

（二）在正常的交易时段，交易品种报价无故停滞的异常情况；

（三）交易系统下单报价与成交价格有不合理差异的异常情况；

（四）本所、会员端的报价以及成交明细出现差异；

（五）其他价格异常情况。

第九条 交易过程中的交易异常包括：

（一）本所、会员端因交易所系统故障等原因造成的异常情况；

（二）信息中心机房服务器系统故障等原因造成的异常情况；

（三）IC 接入网络故障造成的异常情况；

（四）本所、会员端因交易所系统故障，无法实现正常

的登录、监控和查询的异常情况；

（五）本所、会员端相应数据显示不正常的异常情况；

（六）其他交易异常情况。

第十条 交易过程中的成交异常包括：

（一）会员应该成交的单据不能成交；

（二）会员大幅度波动恶意成交单据；

（三）其他成交异常情况。

第十一条 交易过程中的资金异常包括：

（一）本所、会员端资金权益出现差异的异常情况；

（二）管理端通过不同途径查询到的资金情况出现差异的异常情况；

（三）其他资金异常情况。

第十二条 交易过程中的出入金异常包括：

（一）在本所及存管银行规定的时间不能实现正常的出入金；

（二）出入金由于各种原因造成冲正而不能实现正常的出入金；

（三）出入金方式不符合本所、存管银行规定的方式不能实现出入金；

（四）其他出入金异常情况。

第十三条 交易过程中的系统操作异常包括：

（一）本所、会员工作人员人为错误操作或延迟操作造

成的异常情况；

（二）存管银行人为操作失误或系统故障等原因导致与交易所资金业务往来发生异常情况；

（三）其他系统操作异常情况。

第十四条 其他异常事件包括：

（一）不可抗力，指本所市场所在地或全国其他部分区域出现或者根据灾情预警可能出现严重自然灾害，包括台风、火灾、洪水、地震等；或者本所市场所在地或全国其他部分区域出现或者根据预警可能出现重大公共卫生事件或社会安全事件等情形，包括罢工、骚乱、恐怖威胁或者活动等；

（二）意外事件，指本所市场交易地发生火灾或电力供应出现故障等情形；

（三）技术故障，指由于交易系统被非法入侵或者人为破坏等原因导致本所交易、通信系统中的网络、硬件设备、应用软件等无法正常运行；

（四）其它突发事件；

第十五条 根据异常情况造成的后果严重程度以及对本所整体运行的影响，本所将异常情况分为以下四个等级：

异常情况等级	定义	描述
高风险	已经或预计对本所运作产生严重影响的突发异	本所运行全面中断，本所整体业务运作影响严重，

	常情况。	陷入中断或混乱。
中风险	已经或预计对本所运作产生较大影响的突发异常情况。	本所部分业务运作中断，本所整体业务运作影响较大，局部中断或混乱。
低风险	已经或预计对本所运作产生较小影响的突发异常情况。	本所部分功能运作异常，但对正常运作影响较小，本所运作整体有序和可持续。
微风险	已经或预计对本所运作不产生影响的突发异常情况。	本所正常运作不受影响。

本所根据异常情况的不同等级按照不同流程采取不同的处理措施。

第三章 预防机制

第十六条 本所业务部门工作人员以及主管领导的通讯工具应当 24 小时开机，确保信息的畅通。

第十七条 为了避免以及防范突发异常情况，本所采取双岗、双人的系统管理授权复核机制，降低出现异常情况的机率。

第十八条 本所交易部门和信息管理部门等应当互相配合，维护交易系统的稳定运行；在交易过程中工作人员不脱岗、不脱节，随时、及时关注交易风险。

第十九条 实时监控交易过程中的异常情况。交易时间内交易部门应当设置专人专岗对异常交易实施实时监控，包括以下重要指标：

- （一）开休市状态；
- （二）交易时间、市场时间以及节假日情况；
- （三）手续费标准、报价点差标准、大宗交易限额标准等；
- （四）会员总资金量；
- （五）总持仓量、总盈亏额；
- （六）每一家会员的持仓、资金情况；
- （七）行情软件、行情发布系统；

（八）其他未列出的需要重点监控的指标。

第二十条 信息管理部门的工作人员应当实时监控以下重要指标：

（一）本所交易、通信系统中的网络、硬件设备、应用软件等的运行情况；

（二）本所交易、通信系统中的监控软件运行情况。

第四章 处置原则和控制措施

第二十一条 本所对于异常情况的处置遵循以下原则：

（一）预防为主，制度先行，预案周密，资源保证，演练评估的原则；

（二）整合资源，统一指挥，分级负责，整体作战，令行禁止的原则；

（三）最短时间，最小代价，快速反应，果断处置的原则；

（四）因情施策，区别对待的原则。

第二十二条 本所严格执行异常情况汇报制度，及时上报异常情况。当异常情况发生时，本所监控人员应当及时上报本部门负责人及分管领导，与本所相关部门沟通，必要时经本所领导同意向主管部门汇报，向会员通报相关情况。

第二十三条 本所监控人员发现异常情况后，应当及时上报领导，并提出合理化建议，经领导同意后采取相应措施，有效处置、排除异常情况。

第二十四条 本所应对异常情况的处理方式及措施如下：

（一）发布警示及提示公告；

（二）限制交易；

（三）盘中休市；

- (四) 调整交易参与方的配额最大持有量限制;
- (五) 调整涨跌幅限制;
- (六) 调整开收市时间;
- (七) 暂缓进行资金、配额交割;
- (八) 临时停牌;
- (九) 暂停交易;
- (十) 启动应急办公场所和系统设备;
- (十一) 其他方式。

第二十五条 对于第七条规定的交易过程中的异常事件,本所可以采取警示提示、盘中休市、调整开收市时间、限制交易、暂停交易、限制出金等紧急措施中的一种或多种。

第二十六条 对于第十四条规定的其他异常事件,本所可以采取警示提示、调整开收市时间、暂停交易、临时停市、启动备份办公场所和备份系统设备等紧急措施中的一种或多种。

第二十七条 对于微风险事件,本所原则上一个小时内解决;对于低风险事件,原则上三个小时内解决;对于中风险原则上一天内解决;对于高风险事件,原则上三天内解决。由于突发的异常情况导致的临时停市,原则上最长不得超过三个交易日。如果需要延长休市时间,应当征得主管部门的同意。

第五章 处理流程

第二十八条 本所对异常情况的识别遵循以下程序：

（一）首先由业务部门对已经发生的突发异常情况进行初步查证，确定异常情况的具体情形，并初步调查发生异常情况的原因；

（二）业务部门将相应的异常情形及时报告本所风控稽核部，同时报告至其他相关部门要求协助进行异常情形的识别和原因调查；

（三）本所风控稽核部及其他部门应当及时开展联合调查，确认异常情况的具体情形，调查并分析引发异常情况的原因，并对异常情况的风险等级和解决措施提出建议。

业务部门以外的人员发现异常情况的，应当第一时间通报业务部门，由业务部门按照本识别程序进行处理。

第二十九条 本所对异常情况的报告遵循以下程序：

（一）微风险事件

由事件发生部门对事件进行预判、分析，在自身能力范围内进行先期处置，并在第一时间向本部门负责人汇报。

（二）低风险事件

1. 事件发生部门对事件进行预判、分析，在自身能力范围内进行先期处置，并在第一时间向本部门负责人汇报。

2. 部门负责人立即通过手机和邮件方式，将情况向分管领导汇报。

（三）中风险事件

1. 由事件发生部门对事件进行预判、分析，在自身能力范围内进行先期处置，并在第一时间向本部门负责人汇报。

2. 部门负责人立即通过手机和邮件方式，将事件具体情况向分管领导汇报。

3. 分管领导立即通过手机和邮件方式，将事件具体情况，向主管领导汇报。

（四）高风险事件

1. 由事件发生部门对事件进行预判、分析，在自身能力范围内进行先期处置，并在第一时间向本部门负责人汇报。

2. 部门负责人立即通过手机和邮件方式，将事件具体情况向分管领导汇报。

3. 分管领导立即通过手机和邮件方式，将事件具体情况，向主管领导汇报。

4. 主管领导立即向董事会和主管部门汇报。

第三十条 本所对异常情况的决策遵循以下程序：

（一）微风险事件和低风险事件

1. 工作人员汇报的同时提出个人以及部门内所有工作人员协商后的处理意见，听取本部门负责人的决策；

2. 本部门负责人无权决策的事件及时向分管领导汇报，

并提出处理建议，听取分管领导决策；

3. 现场工作人员按照领导的决策制定紧急处理的策略与方案，并及时执行，对异常情况采取补救以及紧急处理措施，避免不良影响以及造成损失进一步扩大。

（二）中风险事件和高风险事件

1. 本所立即成立事件处理工作小组，由主管领导担任组长，分管领导担任副组长，成员由本所相关职能部门负责人组成，根据本所内部岗位职责进行分工合作。

2. 工作小组确定异常事件后，根据事件性质和事态严重程度，及时组织召开会议，决定实施应急控制措施，及时开展处置工作。

3. 工作小组应按照不同的事件性质和事态严重程度，报告董事会，或者相关政府主管部门。

第三十一条 异常情况处理结束后，本所应当尽快消除异常情况的负面影响，恢复正常交易秩序，并将处理结果及时告知会员以及其他相关的市场参与者。必要时应当向政府主管部门报告。

第三十二条 本所应当在异常情况处理结束后一周内，对异常情况以及异常情况的处理过程、措施和结果进行分析和总结，对异常情况的起因、性质、影响、责任、经验教训以及后续完善等问题进行调查评估，评估异常情况的处理效果，并相应完善相关管理制度。

第三十三条 异常情况发生部门和风控稽核部均应对本次事件进行详细记载，特别注明异常情况发生、处置及完成的精确时间、造成此异常情况的原因、原因分析、处理结果、防范措施、责任人、协助部门等重点要素，不断完善和补充风险数据库信息。

第六章 奖惩制度

第三十四条 异常情况监督管理工作实行领导负责制和责任追究制。

第三十五条 对于迟报、瞒报、谎报、和漏报异常情况或者应急管理工作中有其它失职、渎职行为的，本所以对有关责任人给予处分。

第三十六条 本所以对在异常情况监督管理工作中做出贡献的部门和个人给予表彰和奖励。

第七章 附则

第三十七条 本细则由本所负责解释和修订。

第三十八条 本细则自发布之日起实施。