





首页 (<http://www.zyfgl.com>) - 期货 (<http://www.zyfgl.com/index.php?m=content&c=index&a=lists&catid=7>)

## CME市场规则

以下是一些芝商所交易相关的监管规则，所有交易芝商所产品的投资者必须遵守这些规则。中文翻译版的规则仅供参考，如与英文版有任何出入，以英文版为准。

(参见所有芝商所市场监管通告-英文版) (<https://www.cmegroup.com/market-regulation/rulebook.html#cat=advisorynotices%3AAdvisory+Notices&pageNumber=1&searchLocations=%2Fcontent%2Fcmegro>)

交易规则	规则概述
规则 524 - TAS、TAM、BTIC以及TACO交易	<p>结算价交易 (Trading at Settlement, "TAS") 允许各方以当天尚未知的期货结算价的一个上下差异值进行交易。</p> <p>市场基准价交易(Trading at Marker, "TAM")允许各方以当天尚未知的市场基准价(此基准价由交易所确定)的一个上下差异值进行交易。</p> <p>指数收盘基差交易 (Basis Trade at Index Close, "BTIC") 允许各方按合格的期货合约尚未知标的现货指数收盘价的差价 (基差) 进行交易。</p> <p>现货开盘基差交易 (Basis Trade at Cash Open, "TACO") 允许各方按合格的期货合约尚未知标的现货指数特别开盘价 (Special Opening Price/Quotation,"SOQ") 的差价 (基差) 进行交易。</p> <p>基差(Basis)必须以相关期货合约可允许的价格跳动单位为准。若为BTIC或TACO的大宗交易，其商定的基差必须是公平合理(Fair and Reasonable)的，而需要考虑的因素包括融资率、预期股息收入和距离标的期货合约到期日的时长等。</p> <p>关于合格按TAS、TAM、BTIC或TACO交易定价之特定产品、合约月份和价差资料已包含在各交易所规则手册第5章结尾处。从此链接亦可参阅有关列表 (<a href="https://www.cmegroup.com/trading/trade-at-settlement-outright-calendar-spread-availability.html">https://www.cmegroup.com/trading/trade-at-settlement-outright-calendar-spread-availability.html</a>)。</p>
规则 432.G - 账户间非法资金转移	<p>在交易所上执行并清算的所有交易必须具有真实的交易意图(bona fide transactions)。为了将资金从一个账户转移到另一个账户而预先安排的交易是被明令禁止的。市场监管部将会审核任何有迹象显示为了在交易双方的账户间转移权益而预先安排的配对交易(paired, round turn transactions)，而任何违反规则 432.G的行为将会导致纪律处分。</p>
规则 418 - 接受交易所管辖	<p>任何人直接或通过中介机构于交易所上或根据交易所规则发起或执行交易，以及此类交易的受益人，等明确接受交易所的管辖，并同意接受及遵守交易相关的规则，包括但不限于配合和参与任何调查与纪律程序的要求。任何会就此种交易收取佣金或费用的期货佣金商、介绍经纪商、经纪商代理人或任何担任类似角色的外国人亦明确同意接受交易所的管辖。</p> <p>市场参与者必须注意，CME、CBOT、NYMEX及COMEX的市场准入以遵守规则418为条件。</p>

名称	档案标题	点击下载
规则 418接受交易所管辖	 规则418接受交易所管辖 ( <a href="http://www.zyfgl.com/uploadfile/2018/1031/20181031054349844.pdf">http://www.zyfgl.com/uploadfile/2018/1031/20181031054349844.pdf</a> )	下载档案 ( <a href="http://www.zyfgl.com/uploadfile/2018/1031/20181031">http://www.zyfgl.com/uploadfile/2018/1031/20181031</a> )
规则 432账户间非法资金转移	 规则432账户间非法资金转移 ( <a href="http://www.zyfgl.com/uploadfile/2018/1031/20181031054257323.pdf">http://www.zyfgl.com/uploadfile/2018/1031/20181031054257323.pdf</a> )	下载档案 ( <a href="http://www.zyfgl.com/uploadfile/2018/1031/20181031">http://www.zyfgl.com/uploadfile/2018/1031/20181031</a> )
规则 524TAS和TAM交易	 规则524TAS和TAM交易 ( <a href="http://www.zyfgl.com/uploadfile/2018/1031/20181031054210919.pdf">http://www.zyfgl.com/uploadfile/2018/1031/20181031054210919.pdf</a> )	下载档案 ( <a href="http://www.zyfgl.com/uploadfile/2018/1031/20181031">http://www.zyfgl.com/uploadfile/2018/1031/20181031</a> )
规则 526大宗交易	 规则526大宗交易 ( <a href="http://www.zyfgl.com/uploadfile/2018/1031/20181031054145161.pdf">http://www.zyfgl.com/uploadfile/2018/1031/20181031054145161.pdf</a> )	下载档案 ( <a href="http://www.zyfgl.com/uploadfile/2018/1031/20181031">http://www.zyfgl.com/uploadfile/2018/1031/20181031</a> )

 <b>中阳金融集团</b> ZHONG YANG FINANCIAL GROUP 见的即决罚款		点击下载
告违规的即决罚款	( <a href="http://www.zyfgl.com/uploadfile/2018/1031/20181031054009861.pdf">http://www.zyfgl.com/uploadfile/2018/1031/20181031054009861.pdf</a> )	下载档案 <span>online</span> ( <a href="http://www.zyfgl.com/uploadfile/2018/1031/20181031054009861.pdf">http://www.zyfgl.com/uploadfile/2018/1031/20181031054009861.pdf</a> )
规则 531、533不同受益人同时买卖订单禁止与客户订单成交	 规则531、533不同受益人同时买卖订单禁止与客户订单成交 ( <a href="http://www.zyfgl.com/uploadfile/2018/1031/20181031053914642.pdf">http://www.zyfgl.com/uploadfile/2018/1031/20181031053914642.pdf</a> )	下载档案 ( <a href="http://www.zyfgl.com/uploadfile/2018/1031/20181031053914642.pdf">http://www.zyfgl.com/uploadfile/2018/1031/20181031053914642.pdf</a> )
规则 532禁止披露订单	 规则532禁止披露订单 ( <a href="http://www.zyfgl.com/uploadfile/2018/1031/20181031053824893.pdf">http://www.zyfgl.com/uploadfile/2018/1031/20181031053824893.pdf</a> )	下载档案 ( <a href="http://www.zyfgl.com/uploadfile/2018/1031/20181031053824893.pdf">http://www.zyfgl.com/uploadfile/2018/1031/20181031053824893.pdf</a> )
规则 534禁止洗售交易	 规则534禁止洗售交易 ( <a href="http://www.zyfgl.com/uploadfile/2018/1031/20181031053735148.pdf">http://www.zyfgl.com/uploadfile/2018/1031/20181031053735148.pdf</a> )	下载档案 ( <a href="http://www.zyfgl.com/uploadfile/2018/1031/20181031053735148.pdf">http://www.zyfgl.com/uploadfile/2018/1031/20181031053735148.pdf</a> )
规则 536B人工自动交易指示符 (FIX 标签 1028)	 规则536B人工自动交易指示符 (FIX 标签 1028) ( <a href="http://www.zyfgl.com/uploadfile/2018/1031/20181031053555223.pdf">http://www.zyfgl.com/uploadfile/2018/1031/20181031053555223.pdf</a> )	下载档案 ( <a href="http://www.zyfgl.com/uploadfile/2018/1031/20181031053555223.pdf">http://www.zyfgl.com/uploadfile/2018/1031/20181031053555223.pdf</a> )
规则 536B订单路由前端审计要求	 规则536B订单路由前端审计要求 ( <a href="http://www.zyfgl.com/uploadfile/2018/1031/20181031052613590.pdf">http://www.zyfgl.com/uploadfile/2018/1031/20181031052613590.pdf</a> )	下载档案 ( <a href="http://www.zyfgl.com/uploadfile/2018/1031/20181031052613590.pdf">http://www.zyfgl.com/uploadfile/2018/1031/20181031052613590.pdf</a> )
规则 538相关头寸互换	 规则538相关头寸互换 ( <a href="http://www.zyfgl.com/uploadfile/2018/1031/20181031052529645.pdf">http://www.zyfgl.com/uploadfile/2018/1031/20181031052529645.pdf</a> )	下载档案 ( <a href="http://www.zyfgl.com/uploadfile/2018/1031/20181031052529645.pdf">http://www.zyfgl.com/uploadfile/2018/1031/20181031052529645.pdf</a> )
规则 559、560以及562持仓限额和责任水平	 规则559、560以及562持仓限额和责任水平 ( <a href="http://www.zyfgl.com/uploadfile/2018/1031/20181031052420324.pdf">http://www.zyfgl.com/uploadfile/2018/1031/20181031052420324.pdf</a> )	下载档案 ( <a href="http://www.zyfgl.com/uploadfile/2018/1031/20181031052420324.pdf">http://www.zyfgl.com/uploadfile/2018/1031/20181031052420324.pdf</a> )
规则 539执行前沟通	 规则539执行前沟通 ( <a href="http://www.zyfgl.com/uploadfile/2018/1031/20181031051916733.pdf">http://www.zyfgl.com/uploadfile/2018/1031/20181031051916733.pdf</a> )	下载档案 ( <a href="http://www.zyfgl.com/uploadfile/2018/1031/20181031051916733.pdf">http://www.zyfgl.com/uploadfile/2018/1031/20181031051916733.pdf</a> )
规则 561每日提交大额交易商所有/控制权报告及未平仓合约数	 规则561每日提交大额交易商所有/控制权报告及未平仓合约数 ( <a href="http://www.zyfgl.com/uploadfile/2018/1031/20181031051737106.pdf">http://www.zyfgl.com/uploadfile/2018/1031/20181031051737106.pdf</a> )	下载档案 ( <a href="http://www.zyfgl.com/uploadfile/2018/1031/20181031051737106.pdf">http://www.zyfgl.com/uploadfile/2018/1031/20181031051737106.pdf</a> )
规则 573在CME Globex开市前的输入委托	 规则573在CME Globex开市前的输入委托 ( <a href="http://www.zyfgl.com/uploadfile/2018/1031/20181031050143745.pdf">http://www.zyfgl.com/uploadfile/2018/1031/20181031050143745.pdf</a> )	下载档案 ( <a href="http://www.zyfgl.com/uploadfile/2018/1031/20181031050143745.pdf">http://www.zyfgl.com/uploadfile/2018/1031/20181031050143745.pdf</a> )

 <b>中阳金融集团</b> ZHONG YANG FINANCIAL GROUP		点击下载
Globex订单都要有操作人ID（标签50 ID；TAG 50 ID） (http://www.zyfgl.com/uploadfile/2018/1031/20181031045847939.pdf)		下载档案 <b>online</b> (http://www.zyfgl.com/uploadfile/2018/1031/20181031045847939.pdf)
有CME Globex 订单都要有操作人ID（标签50 ID；TAG 50 ID）		
规则575禁止扰乱市场行为（更新） (http://www.zyfgl.com/uploadfile/2020/0824/20200824015028283.pdf)	 规则575禁止扰乱市场行为（更新） (http://www.zyfgl.com/uploadfile/2020/0824/20200824015028283.pdf)	下载档案 (http://www.zyfgl.com/uploadfile/2020/0824/20200824015028283.pdf)



中阳资本证监会中央编号：BLG119  
中阳证券证监会中央编号：BGT529  
香港交易所参与者编号：B02011

客服热线  
+852 31070731

在线咨询

地址：香港干諾道西118號1101室  
邮箱：CS@zyzq.com.hk  
传真：(852) 2836 3825  
风险声明 (/index.php?m=content&c=index&a=show&catid=54&id=16)  
隐私声明 (/index.php?m=content&c=index&a=show&catid=54&id=17)

©2016 中阳金融集团 All rights reserved.