附件1

修订说明

为了保障上海国际能源交易中心（以下简称上期能源）在出现不可抗力等情况时能够有效采取相关紧急措施，化解风险，保护投资者权益，上期能源拟对《上海国际能源交易中心风险控制管理细则》进行修订，增加一章 “异常情况处理”，主要内容为：

一是明确了上期能源可以采取紧急措施化解风险的情形，包括地震、水灾、火灾等不可抗力或者计算机系统故障等原因导致交易、结算、交割、行权与履约等业务无法正常进行；出现结算、交割、行权与履约危机，对市场正在产生或者即将产生重大影响；期货价格出现同方向连续涨跌停板,有根据认为会员、境外特殊参与者、境外中介机构或者客户违反能源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；以及上期能源规定的其他情形。

二是明确了上期能源在发生计算机系统故障等情况下可以采取的紧急措施及程序，其中，总经理可以采取的紧急措施包括采取调整开市闭市时间，暂停交易，调整交易时间，暂停挂牌新合约，调整相关合约最后交易日、到期日、交割日、交收日等日期，调整标准仓单相关业务，调整期权行权、履约及相关对冲业务，调整资产作为保证金业务，调整强行平仓制度、保证金调整方式、涨跌停板幅度，调整合约结算价、交割结算价，调整相关费用收取标准及结算时间，调整结算数据发送方式以及取消盘后相关业务等；董事会可以决定采取的紧急措施包括调整开市闭市时间、暂停交易、调整涨跌停板幅度、提高保证金标准、限期平仓、强行平仓、限制出金、强制减仓、限制交易等。

三是增加规定上期能源宣布异常情况、采取紧急措施前应当报告中国证监会。