

重庆联合产权交易所 碳排放交易风险管理办法（试行）

第一条 为有效控制碳排放交易风险，防范违规交易行为，保障正常的市场秩序，根据《温室气体自愿减排交易管理暂行办法》、《重庆市碳排放权交易管理暂行办法》、《重庆联合产权交易所碳排放权交易细则》等规章、规范性文件和业务规则，制定本办法。

第二条 重庆联合产权交易所（以下简称“交易所”）从交易制度安排、交易行为监管、交易异常情况处理、交易纠纷处理等方面建立风险预防和控制体系。

第三条 交易所对交易产品实行涨跌幅限制，涨跌幅比例由交易所设置和调整，报主管部门备案后执行。

第四条 交易所实行全额资金及权益交易。交易参与者申报卖出权益，不得超过其交易账户的可交易权益余额；交易参与者申报买入交易产品，金额不得超过其交易账户的可用资金余额。

第五条 交易所对交易中的下列事项，予以重点监控：

- （一）涉嫌内幕交易、操纵市场等违法违规行为；
- （二）权益买卖的时间、数量、方式等受到法律、行政法规、部门规章和规范性文件及本所业务规则等相关规定限制的行为；

(三) 可能影响交易价格或者交易量的异常交易行为;

(四) 交易所认为需要重点监控的其他事项。

第六条 可能影响交易价格或者交易量的异常交易行为包括:

(一) 可能对交易价格产生重大影响的信息披露前,大量买入或者卖出相关权益;

(二) 大量或者频繁进行互为对手方的交易,涉嫌关联交易或市场操纵;

(三) 频繁申报或频繁撤销申报,影响交易价格或其他交易参与人的交易决定;

(四) 巨额申报,影响交易价格或明显偏离市场成交价格;

(五) 大量或者频繁进行高买低卖交易;

(六) 交易所认为需要重点监控的其他异常交易行为。

第七条 交易所定期和不定期监督对交易参与者开展的业务活动进行检查,及时发现交易参与者违规或异常交易行为。

第八条 交易所发现交易参与者、结算银行及市场其他参与者在从事相关业务时涉嫌违规,情况复杂且重大的,

应当进行专项调查，必要时可以采取相应措施防止违规行为后果扩大。

第九条 交易各方应当配合交易所进行相关调查，及时、真实、准确、完整的提供有关文件和资料。

第十条 对重点监控事项中情节严重的行为，交易所可以视情况采取以下措施：

- （一）口头或书面警告；
- （二）要求相关方提交书面承诺；
- （三）约见谈话；
- （四）限制相关交易账户；
- （五）冻结相关交易账户；
- （六）上报主管部门处理。

第十一条 发生下列交易异常情况之一，导致部分或全部交易不能进行的，交易所可决定技术性停牌或临时停市：

- （一）不可抗力；
- （二）意外事件；
- （三）技术故障；
- （四）交易所认定的其他异常情况。

第十二条 交易所认为可能发生严重影响交易正常进行的异常情况，可以决定技术性停牌或临时停市。

第十三条 交易所对技术性停牌或临时停市决定予以公告。

第十四条 技术性停牌或临时停市原因消除后，交易所可以决定恢复交易。

第十五条 因交易异常情况导致交易所采取相应措施所造成的损失，交易所不承担责任。

第十六条 交易双方发生交易纠纷，影响或可能影响市场正常交易的，应及时向交易所报告。

第十七条 交易所应按相关规定对交易参与者报告的纠纷进行记录、调解，或采取其他必要措施处理，防止交易纠纷影响市场秩序。

第十八条 交易所认为必要的，可以采取谈话提醒、发布书面警示和风险警示公告等措施，以警示和化解风险。

第十九条 出现下列情形之一的，交易所可约见交易参与者谈话提醒风险，并要求其报告情况：

- （一） 权益价格出现异常；
- （二） 交易参与者交易异常；
- （三） 交易参与者权益持有异常；
- （四） 交易参与者资金异常；
- （五） 交易参与者涉嫌违规、违约；
- （六） 交易所接到涉及交易参与者的投诉；
- （七） 交易参与者涉及司法调查；

(八) 交易所认定的其他情况。

第二十条 交易所发现交易参与人有违规嫌疑、交易行为有较大风险的，可对交易参与者发出书面风险警示。

第二十一条 发生下列情形之一的，交易所可发出风险警示公告，向全体交易参与者警示风险：

- (一) 交易价格出现异常；
- (二) 交易参与者涉嫌违规、违约；
- (三) 交易参与者交易存在较大风险；
- (四) 交易所认定的其他情形。

第二十二条 本办法由交易所负责解释。

第二十三条 本办法自发布之日起施行。