

深圳排放权交易所有限公司文件

深排交总字〔2022〕59号

关于印发《深圳排放权交易所有限公司 交易异常情况处理实施细则》的通知

各部门：

为维护碳市场交易秩序，有效控制公司市场风险，防范各种突发风险及交易异常情况的出现，妥善处置交易异常情况，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，结合公司实际情况，制定了《深圳排放权交易所有限公司交易异常情况处理实施细则》，已经公司党支委会和总经办会审议通过，现予以正式印发，请遵照执行。

特此通知。

深圳排放权交易所有限公司
2022年12月30日



深圳排放权交易所有限公司

交易异常情况处理实施细则

第一章 总则

第一条 为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有限公司（以下简称公司）市场风险，防范各种突发风险及交易异常情况的出现，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 本细则所称交易异常情况是指导致或可能导致公司碳排放权交易全部或者部分不能正常进行的情形。

第三条 公司对交易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 交易异常情况

第四条 引发交易异常情况的原因包括不可抗力、意外事件、技术故障等。

第五条 引发交易异常情况的不可抗力是指公司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。

第六条 引发交易异常情况的意外事件是指公司所在地发生火灾或电力供应出现故障等情形。

第七条 引发交易异常情况的技术故障是指：

（一）公司交易、通信系统中的网络、硬件设备、应用软件等无法正常运行；

（二）公司交易、通信系统在运行、软件系统及相关程序升级、硬件设备更新、上线时出现意外；

（三）公司交易、通信系统被非法侵入或遭受其他人为破坏等情形。

第八条 交易不能正常进行是指无法正常开始交易、无法连续交易、交易结果异常、交易无法正常结束等情形。

第九条 无法正常开始交易是指：

（一）公司交易、通信系统在开市前无法正常启动；

（二）前一交易日的日终清算交收处理未按时完成或虽已完成但清算交收数据出现重大差错而导致无法正确交易；

（三）10%以上的交易参与人因系统故障无法正常接入公司交易系统等情形。

第十条 无法连续交易是指：

（一）公司交易、通信系统出现 30 分钟以上中断；

(二) 公司行情发布系统出现 30 分钟以上中断;

(三) 10%以上交易参与人无法正常发送交易申报、接收实时行情或成交回报;

(四) 10%以上的产品中断交易等情形。

第十一条 交易结果异常是指交易结果出现严重错误、行情发布出现错误等可能严重影响整个市场正常交易的情形。

第十二条 交易无法正常结束是指收市处理无法正常结束等可能对市场造成重大影响的情形。

第十三条 根据交易异常情况造成的后果严重程度以及对公司整体运行的影响，公司将交易异常情况分为以下四个等级：

交易异常情况等级	定义	描述
高风险	已经或预计对公司运作产生严重影响的突发交易异常情况。	公司运行全面中断，公司整体业务运作影响严重，陷入中断或混乱。
中风险	已经或预计对公司运作产生较大影响的突发交易异常情况。	公司部分业务运作中断，公司整体业务运作影响较大，局部中断或混乱。
低风险	已经或预计对公司运作产生较小影响的突发交易异常情况。	公司部分功能运作异常，但对正常运作影响较小，公司运作整体有序和可持续。

微风险	已经或预计对公司运作不产生影响的突发交易异常情况。	公司正常运作不受影响。
-----	---------------------------	-------------

公司根据交易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

第十四条 公司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。

第十五条 公司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、及时关注交易异常情况风险。

第十六条 交易部门每日实时监控可能发生的交易异常情况。实时监控指标包括：

- （一）开市、收市情况；
- （二）交易参与者人登录情况；
- （三）交易情况；
- （四）行情发布情况；
- （五）交易结果情况；
- （六）其他未列出的需要重点监控的指标。

第十七条 信息管理部门的工作人员应当实时监控以下重要指标：

- （一）公司交易、通信系统中的网络、硬件设备、应用软件

等的运行情况；

(二) 公司交易、通信系统中的软硬件安全设备运行情况。

第四章 处置原则和控制措施

第十八条 公司对于交易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。

第十九条 公司严格执行交易异常情况汇报制度，及时上报交易异常情况。当交易异常情况发生时，公司监控人员应当及时上报本部门负责人及分管领导，与公司相关部门沟通，必要时经公司领导同意向主管部门汇报，向会员通报相关情况。

第二十条 公司监控人员发现交易异常情况后，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、排除交易异常情况。

第二十一条 交易异常情况出现后，公司将及时向市场公告，并可视情况需要单独或者同时采取以下应对措施：

(一) 调整开收市时间；

(二) 产品临时停牌；

(三) 暂停交易；

- (四) 盘中休市;
- (五) 暂缓进行交收结算;
- (六) 启动应急办公场所和系统设备;
- (七) 其他经主管部门批准的处置方式。

第二十二条 公司采取第二十一条规定措施的,应及时报告主管部门。原因消除后,应及时恢复交易,并向市场公告。

第二十三条 对于微风险事件,公司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。由于突发的交易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

第二十四条 公司对交易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交易异常情况进行初步查证,确定交易异常情况的具体情形,并初步调查发生交易异常情况的原因;

(二)业务部门将相应的交易异常情形及时报告公司风控部门,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)公司风控部门及其他部门应当及时开展联合调查,确认交易异常情况的具体情形,调查并分析引发交易异常情况的原因,并对交易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交易异常情况的，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。

第二十五条 公司对交易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。

第二十六条 公司对交易异常情况的决策遵循以下程序：

（一）低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，对交易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. 公司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，成员由公司相关职能部门负责人组成，根据公司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。

第二十七条 交易异常情况处理结束后，公司应当尽快消除

交易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。

第二十八条 公司应当在交易异常情况处理结束后一周内，对交易异常情况以及交易异常情况的处理过程、措施和结果进行分析和总结，对交易异常情况的起因、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，评估交易异常情况的处理效果，并相应完善相关管理制度。

第二十九条 交易异常情况发生部门和风控部门均应对本次事件进行详细记载，特别注明交易异常情况发生、处置及完成的精确时间、造成此交易异常情况的原因、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 责任追究

第三十条 对于迟报、漏报、瞒报和谎报交易异常情况或者应急管理工作中有其它失职、渎职行为的，公司根据其违规违纪情节，对直接责任人员、相关部门负责人和分管领导分别给予相应处分：

（一）情节轻微，未造成影响或损失的，予以诫勉谈话，可以免于或不予处分；

（二）情节轻微，造成一般影响或较小损失的，给予通报批评或警告处分；

(三)情节较重,造成较大影响或损失的,给予记过、记大过或降级处分;

(四)情节严重,造成重大影响或损失的,给予撤职或解除劳动关系处分。

第三十一条 关于处分等级及认定、处分标准等参照《深圳交易集团有限公司员工奖惩管理办法(试行)》执行。

第七章 附则

第三十二条 本细则由公司负责解释和修订。

第三十三条 本细则自发布之日起实施,《深圳排放权交易所异常情况处理实施细则(暂行)》(CEEX-2014-W-005(V1.0))及《深圳排放权交易所异常情况报告实施细则(暂行)》(CEEX-2017-N-032(V1.0))同时废止。

