



团 体 标 准

T/CGCC 70—2022

大宗商品电子交易 异常事件监测规范

Electronic trading of bulk commodities—
Abnormal event monitoring specification

2022-08-10 发布

2022-09-01 实施

中国商业联合会 发 布
中国标准出版社 出 版

目 次

前言	I
引言	II
1 范围	1
2 规范性引用文件	1
3 术语和定义	1
4 总体要求	2
5 交易异常事件的类型及异常指标	3
6 异常监测参数	6
7 异常强度	8
8 账户相关异常的监测	9
9 交易用户行为模式异常的监测	10
10 账户规则化异常的监测	11
11 监测日志	13
12 异常事件的人工复查	13
13 数据保密管理	13
附录 A（规范性） 监测时的采样数据	14
附录 B（规范性） 异常指标及异常强度的计算公式	16
附录 C（规范性） 异常事件记录信息	18

前 言

本文件按照 GB/T 1.1—2020《标准化工作导则 第1部分：标准化文件的结构和起草规则》的规定起草。

请注意本文件的某些内容可能涉及专利。本文件的发布机构不承担识别专利的责任。

本文件由北京金网安泰信息技术有限公司提出。

本文件由中国商业联合会归口。

本文件起草单位：北京金网安泰信息技术有限公司、上海交通大学、复旦大学、商业科技质量中心、牡丹国际商品交易中心有限公司、临沂国际商品交易中心有限公司、包头稀土产品交易所有限公司、南方小麦交易市场有限公司、国能互通内蒙古网络科技有限公司、武汉陆羽国际茶业交易中心有限公司、恩施硒资源国际交易中心有限公司、大连商品交易登记结算有限公司、江西省联交运登记结算中心有限公司。

本文件主要起草人：关键、肖燕林、李想、李仪浩、易平、刘晓东、唐泽宇、吕智慧、林俊雄、祁永星、潘军、刘丽欣、付元虎、宋宪余、王元浩、陈秀昆、许宗琦、包银锋、谢永军、饶顺、万俊辉、胡礼杰、向桂君、王刚、刘祖国、黄莉、毕晓峰、刘景红、王立荣、王軻菲。

引 言

大宗商品交易具有交易数量大、价格波动大、交易风险大、影响辐射广等特点,交易风险往往对交易主体和市场造成严重威胁,极易引发系统性风险。为预防系统性风险的发生,确保市场安全,需要采取有效方法对市场交易行为进行监测,甄别其中的异常事件,做到早发现、早预警、早处理。

本文件针对大宗商品电子交易过程中账户级别存在的隐性异常事件的监测工作提出规范,旨在通过对交易异常事件的监测,提高交易平台的风险防范、识别和处理能力,最大程度地保障交易参与各方和交易平台的合法权益,维护市场的规范和稳定。

大宗商品电子交易 异常事件监测规范

1 范围

本文件规定了大宗商品电子交易异常事件监测的总体要求,以及异常监测参数、异常强度、异常事件的监测与判定、监测日志、异常事件的人工复查、数据保密管理等内容,给出了异常事件的类型及异常指标。

本文件适用于大宗商品电子交易过程中不易发现的隐性异常事件监测的程序设计、开发和应用。
针对本文件未涉及的其他异常事件进行的监测工作,可参考本文件。

2 规范性引用文件

下列文件中的内容通过文中的规范性引用而构成本文件必不可少的条款。其中,注日期的引用文件,仅该日期对应的版本适用于本文件;不注日期的引用文件,其最新版本(包括所有的修订单)适用于本文件。

T/CGCC 63—2022 大宗商品电子交易 敏感信息脱敏和加密规范

T/CGCC 64—2022 大宗商品电子交易 敏感数据存储和使用规范

3 术语和定义

T/CGCC 63—2022 界定的以及下列术语和定义适用于本文件。

3.1

交易平台 trading platform

为企业及个人提供交易、资金结算以及交收等相关服务的电子商务平台。

注:在本文件中专指大宗商品交易平台。

[来源: T/CGCC 63—2022,3.1]

3.2

交易用户 customer

在交易平台(3.1)参与交易或其他相关业务,并接受相关服务的企业用户或个人用户。

[来源: T/CGCC 63—2022,3.2]

3.3

交易账号 customer ID

由交易平台(3.1)为交易用户(3.2)分配,作为关联该交易用户(3.2)在交易平台(3.1)内所有相关信息的交易用户(3.2)唯一标识。

[来源: T/CGCC 63—2022,3.3]

3.4

账户 account

由交易平台(3.1)为交易用户(3.2)开立,作为交易用户(3.2)在交易平台(3.1)上实施交易行为的主体。