

关于调整沪深 300 股指期权交易限额有关事项的通知

2020-06-18

各会员单位：

为进一步发挥期权产品功能，维护市场平稳运行，根据《中国金融期货交易所风险控制管理办法》有关规定，中国金融期货交易所（以下简称交易所）就调整沪深 300 股指期权交易限额有关事项通知如下：

自 2020 年 6 月的第四个星期一（2020 年 6 月 22 日）起，客户该期权品种日内开仓交易的最大数量为 200 手，单个月份期权合约日内开仓交易的最大数量为 100 手，单个深度虚值合约日内开仓交易的最大数量为 30 手。

深度虚值合约是指同一月份合约中，行权价格高于上一交易日合约标的指数收盘价的第十个及以上的看涨期权合约和行权价格低于上一交易日合约标的指数收盘价的第十个及以下的看跌期权合约。日内开仓交易的最大数量是指客户某一交易日某一品种、某一月份合约或某一合约上的买开仓数量与卖开仓数量之和。

套期保值交易、做市交易的开仓数量不受此限。具有实际控制关系的账户组开仓数量合并计算，其标准与单个客户相同。客户单日在多个合约上达到交易所处理标准的，按照一次认定。

客户第一次出现违反上述规定的情形，交易所将对其采取限制开仓 5 个交易日的措施。第二次出现，交易所将对其采取限制开仓 10 个交

易日的措施。第三次及以上出现，交易所将对其采取限制开仓 1 个月的措施。情节严重的，按《中国金融期货交易所违规违约处理办法》的有关规定处理。

交易所可以根据市场情况对本通知规定的具体标准、实施时间、相关措施等进行调整。

特此通知。

中国金融期货交易所

2020 年 6 月 18 日