

关于股指期货和期权合约交易限额的通知

中金所发〔2022〕73号

各会员单位：

为进一步规范股指期货、股指期权合约交易行为，根据《中国金融期货交易所风险控制管理办法》，现将股指期货、股指期权合约交易限额相关管理要求通知如下：

一、交易限额标准

自2022年12月19日交易时起，在沪深300、中证500、中证1000、上证50股指期货上，客户某一合约日内开仓交易的最大数量为500手。套期保值等风险管理交易的开仓数量不受此限。

自2022年12月19日交易时起，在沪深300、中证1000、上证50股指期权上，客户某一期权品种日内开仓交易的最大数量为200手，某一月份期权合约日内开仓交易的最大数量为100手，某一深度虚值合约日内开仓交易的最大数量为30手。套期保值等风险管理交易、做市交易的开仓数量不受此限。

日内开仓交易的最大数量是指客户某一交易日在某一品种、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。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。

一组实际控制关系账户的开仓数量合并计算，其标准与单个客户相同。客户单日在同一品种上多次达到交易所处理标准的，按照一次认定。

二、处理措施

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风险控制管理办法》《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、相关措施等进行调整。

本通知自 2022 年 12 月 19 日起实施,《关于股指期货、股指期货期权合约交易限额的通知》(中金所发〔2022〕39 号)同时废止。

特此通知。

中国金融期货交易所

2022 年 12 月 14 日