

关于进一步调整上证 50ETF 期权持仓限额管理有关事项的通知

上证发〔2016〕35 号

各市场参与人：

为有效发挥期权产品的市场功能，保障期权市场平稳运行，根据《上海证券交易所股票期权试点交易规则》、《上海证券交易所、中国证券登记结算有限责任公司股票期权试点风险控制管理办法》的有关规定，上海证券交易所（以下简称本所）决定自 2016 年 8 月 8 日起，进一步调整上证 50ETF 期权持仓限额管理。现将有关事项通知如下：

一、将单日开仓限额调整为单日买入开仓限额。单日买入开仓限额为总持仓限额的 2 倍，最大不超过 1 万张。

二、期权经营机构将投资者权利仓持仓限额提高到 2000 张以上（不含 2000 张）的，应当在调整的前一交易日填报《股票期权持仓限额报备表》（附件），向本所进行备案。备案材料应由期权经营机构期权业务部门负责人签字，并加盖部门公章。

本通知发布前，期权经营机构已将投资者权利仓持仓限额提高到 2000 张以上（不含 2000 张）的，应当在 2016 年 8 月 13 日前向本所提交《股票期权持仓限额报备表》。

三、期权经营机构应当根据本通知的规定，尽快将持仓限额的管理要求通知客户，及时调整客户的持仓限额标准，并做好相应的前端控制和管理工作的。

四、本通知自 2016 年 8 月 8 日起实施。除本通知规定事项外，上证 50ETF 期权持仓限额管理具体事宜按照本所《关于上证 50ETF 持仓限额调整有关事项的通知》（上证发〔2015〕44 号）的规定执行。

本所于 2015 年 9 月 7 日发布的《关于加强上证 50ETF 持仓限额管理有关事项的通知》（上证发〔2015〕74 号）同时废止。

上海证券交易所

二〇一六年八月五日