

上海证券交易所期权工作小组文件

上证期函〔2015〕模 4107 号

关于期权全真模拟交易环境 进行持仓额度调整演练的通知

各市场参与人：

为了检验各期权经营机构客户持仓限额前端控制能力，上海证券交易所拟在全真模拟交易环境中进行调整持仓额度演练，调整后的持仓限额设置自 2015 年 1 月 19 日起生效，具体调整如下。

同一标的持仓限额设置（单位：张）

单个账户				期权经营机构
个人（A 账户）		机构（不含做市商）		经纪
总持仓限额	权利仓持仓限额	总持仓限额	权利仓持仓限额	总持仓限额
100	50	100	50	500 万

同一合约品种当日买入开仓限额设置（单位：张）

单个账户

个人 (A 账户)	机构（不含做市商）
200	200

请各期权经营机构按照上述调整要求做好持仓限额前端控制及相关管理。参与 ETF 期权策略应用大赛客户的上述参数也按本通知一并调整。

上海证券交易所期权工作小组

二〇一五年一月十五日

