

中证网讯（记者 王辉）中国金融期货交易所（以下简称中金所）12月18日晚间发布通知，正式发布关于沪深300股指期权合约上市交易的有关事项。相关内容显示，12月23日沪深300股指期权首批上市合约月份为2020年2月（IO2002）、2020年3月（IO2003）、2020年4月（IO2004）、2020年6月（IO2006）、2020年9月（IO2009）和2020年12月（IO2012）。各合约挂盘基准价由交易所结合沪深300股指期权做市商报价等因素确定，并在合约上市交易前一交易日公布。

通知还显示，沪深300股指期权合约限价指令的每次最大下单数量为20手。沪深300股指期权合约的保证金调整系数为10%，最低保障系数为0.5。同一客户某一月份沪深300股指期权合约单边持仓限额为5000手（在不同会员处持仓合并计算）。沪深300股指期权合约的手续费标准为每手15元，行权（履约）手续费标准为每手2元。交易所暂不收取沪深300股指期权合约的申报费。沪深300股指期权做市商可以在交易日9:30-15:00，通过会员向交易所申请双向期权持仓自动对冲平仓，自动对冲平仓暂不收取手续费，申请后持续有效。做市商也可以在上述时间申请取消自动对冲平仓。做市商所有月份沪深300股指期权合约单边持仓限额为60000手。做市商所有月份沪深300股指期货合约单边持仓限额为20000手。交易所将加强做市商梯队建设和精细化管理。

此外，本次中金所还公布了沪深300股指期权做市商、询价限制和交易限额的相关事项。沪深300股指期权上市初期实施交易限额制度。自沪深300股指期权上市首日至2020年3月的第3个星期五（2020年3月20日），客户该品种日内开仓交易的最大数量为50手，单个月份期权合约日内开仓交易的最大数量为20手，深度虚值合约日内开仓交易的最大数量为10手。自2020年3月的第4个星期一（2020年3月23日）至6月的第3个星期五（2020年6月19日），客户该品种日内开仓交易的最大数量为100手，单个月份期权合约日内开仓交易的最大数量为50手，深度虚值合约日内开仓交易的最大数量为20手。