监管服务事项办事指南

**期权持仓限额业务办理**

目录

[一、事项名称 1](#_Toc652)

[二、规则依据 1](#_Toc16541)

[三、受理部门 1](#_Toc13745)

[四、办理部门 1](#_Toc28110)

[五、办理时限 1](#_Toc20442)

[六、申请材料清单 1](#_Toc22844)

[（一）投资者报备提高单个品种持仓限额 1](#_Toc632)

[（二）投资者套期保值持仓限额申请 2](#_Toc31435)

[（三）证券公司自营套期保值持仓限额申请 3](#_Toc10543)

[（四）特定产品持仓限额申请 4](#_Toc15769)

[（五）经纪业务总持仓限额申请 4](#_Toc12424)

[七、材料接收 5](#_Toc32006)

[八、办理流程 5](#_Toc3968)

[九、办理结果 5](#_Toc4643)

[十、咨询途径 5](#_Toc12537)

[十一、办理地点和时间 5](#_Toc8554)

[附件 6](#_Toc26027)

## 一、事项名称

期权持仓限额业务办理

## 二、规则依据

《股票期权交易试点管理办法》

《深圳证券交易所股票期权试点交易规则》

《深圳证券交易所 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》

《深圳证券交易所股票期权试点持仓限额管理业务指引》

## 三、受理部门

深圳证券交易所衍生品部

## 四、办理部门

深圳证券交易所衍生品部

## 五、办理时限

正式受理申请后10个交易日内。补充材料期间不计入本所办理期限内。

## 六、申请材料清单

### （一）投资者报备提高单个期权合约品种持仓限额

投资者确有需要提高单个品种持仓限额的，应经过委托的期权经营机构向本所提交报备申请，并提交下列书面材料：

1. 个人投资者提交经本人签字的持仓限额报备表（附件1）；机构投资者提交加盖单位公章的申请书及持仓限额报备表（附件1）。

2. 个人投资者需提供账户信息、有效身份证明复印件；机构投资者需提供账户信息、单位的授权委托书、授权委托人（代理人）身份证复印件和单位营业执照复印件等。

3. 期权经营机构出具的客户持仓限额调整意见书。客户持仓限额调整意见书需经经营机构股票期权经纪业务负责人签字，并加盖经营机构公章。

4. 期权经营机构出具的客户在最近1个月的日均持仓量、限仓额度、买入额度使用情况等材料。

5. 已在沪市开通的衍生品合约账户及持仓限额的证明材料（如有）。已开立沪市衍生品合约账户的投资者，若在多个期权经营机构开立有效沪市合约账户且进行过交易，提供半年以内交割单、对账单等证明材料。

### （二）投资者套期保值持仓限额申请

投资者进行套期保值交易需要申请提高持仓限额的，应通过委托的期权经营机构向本所提交申请，提交下列书面申请材料：

1. 个人投资者提交经本人签字的套期保值专用账户报备表（附件2）及持仓限额调整申请表（附件3）；机构投资者提交加盖单位公章的申请书、套期保值专用账户报备表（附件2）及持仓限额调整申请表（附件3）。

2. 个人投资者需提供账户信息、有效身份证明复印件；机构投资者需提供账户信息、单位的授权委托书、授权委托人（代理人）身份证复印件和单位营业执照复印件等。

3. 期权经营机构出具的客户持仓限额调整意见书。客户持仓限额调整意见书需经期权经营机构股票期权经纪业务负责人签字，并加盖期权经营机构或其授权部门公章。

4. 套期保值方案。

5. 最近30个交易日与其套期保值方案相关的现货及期货市场交易、风险管理情况。

6. 最近30个交易日的自有资产证明。

7. 最近30个交易日额度使用情况说明。

8. 本所要求的其他材料。

### （三）证券公司自营套期保值持仓限额申请

证券公司自营业务因进行套期保值交易需要申请提高持仓限额的，应当向本所提交下列书面申请材料：

1. 加盖证券公司公章的申请书；

2. 经分管期权自营业务的公司高级管理人员及首席风控官（或合规总监）签字，并加盖证券公司公章的套期保值专用账户报备表（附件2）及持仓限额调整申请表（附件4）；

3. 套期保值方案；

4. 最近30个交易日与其套期保值方案相关的现货或期货市场交易情况、风险管理情况；

5. 最近30个交易日的自有资产证明（附件5）；

6. 最近30个交易日额度使用情况说明；

7. 本所要求的其他材料。

### （四）特定产品持仓限额申请

特定产品因产品需要申请调整持仓限额的，应通过委托的期权经营机构向本所提交申请，提交下列书面申请材料：

1. 产品发行人提交加盖单位公章的申请书、产品专用账户报备表（附件6）及持仓限额调整申请表（附件7）；

2. 产品发行人需提供产品账户信息、发行人的授权委托书、授权委托人（代理人）身份证复印件和发行人营业执照复印件和产品备案文件等；

3. 期权经营机构出具的特定产品持仓限额调整意见书，该意见书需经期权经营机构股票期权经纪业务负责人签字，并加盖期权经营机构或其授权部门公章；

4. 产品方案、资产规模、投资策略情况；

5. 本所要求的其他材料。

### （五）经纪业务总持仓限额申请

期权经营机构因经纪业务需要提高持仓限额的，应向本所提交下列书面申请材料：

1. 加盖期权经营机构公章的申请书；

2. 经期权经营机构分管期权经纪业务的公司高级管理人员及首席风控官（或合规总监）签字，并加盖期权经营机构公章的持仓限额调整申请表（附件8）；

3. 最近30个交易日全体客户数量、额度使用情况等说明；

4. 本所要求的其他材料。

## 七、材料接收

本所期权业务专区受理申请，书面材料需为PDF文件。

## 八、办理流程

1. 期权经营机构通过本所期权业务专区提交申请材料。

2. 本所在收到申请后，按照《深圳证券交易所股票期权试点持仓限额管理业务指引》的规定办理业务。

3. 申请人未按要求提交文件的，应当补充材料。补充材料期间不计入本所办理期限内。

4. 本所办理完成后，将办理结果反馈期权经营机构。

## 九、办理结果

期权经营机构可通过本所期权业务专区查看办理结果。

## 十、咨询途径

陈先生 电话：0755-8866 8860 邮箱：hjchen@szse.cn

王女士 电话：0755-8866 8570 邮箱：zywang@szse.cn

## 十一、办理地点和时间

**（一）办理地点**

1. 业务申请通过深交所期权业务专区网上提交

2. 办公地址：深圳市福田区深南大道2012号深圳证券交易所19楼1902室

**（二）办理时间**

1. 深交所期权业务专区系统运营时间为7×24小时

2. 办公时间：周一至周五 8:30-11:30；13:30-17:00

## 附件：

1. 股票期权单个品种持仓限额报备表
2. 股票期权套期保值专用账户报备表
3. 股票期权持仓限额调整申请表（投资者）
4. 股票期权持仓限额调整申请表（自营）
5. 股票期权持仓限额调整相关资产报备表
6. 股票期权产品账户报备表
7. 股票期权持仓限额调整申请表（特定产品）
8. 股票期权持仓限额调整申请表（经纪业务）

附件1：股票期权单个品种持仓限额报备表

|  |
| --- |
| **深圳证券交易所股票期权单个品种持仓限额报备表** |
| 申请人名称 |  |
| 深市A股证券账户 |  | 衍生品合约账户 |  |
| 申请人联系人 |  | 联系人电话 |  |
| 投资经理 | *（如有）* | 投资经理电话 | *（如有）* |
| 开户机构名称 |  | 开户机构结算账户 |  |
| 开户机构联系人 |  | 开户机构联系人电话 |  |
| 申请用途 |  |
| 合约品种持仓限额调整 | 单个合约品种 | 目前持仓限额 | 拟申请持仓限额 |
| 权利仓持仓限额 | 总持仓限额 | 单日买入开仓限额 | 权利仓持仓限额 | 总持仓限额 | 单日买入开仓限额 |
|  |  |  |  |  |  |  |
| 沪市合约品种持仓限额 | 单个合约品种 |  | 合约账户1 | 合约账户2 | 合约账户3 | 合约账户4 | 合约账户5 |
|  | 权利仓持仓限额 |  |  |  |  |  |
| 总持仓限额 |  |  |  |  |  |
| 单日买入开仓限额 |  |  |  |  |  |
| 签字及公章 | 申请人签字： |
| 营业部经办人签字： |
| 期权经营机构经纪业务负责人签字： |
| 期权经营机构单位公章： |

附件2：股票期权套期保值专用账户报备表

|  |
| --- |
| **深圳证券交易所股票期权套期保值专用账户报备表** |
| 申请人名称 |  |
| 深市A股证券账户 |  | 对应衍生品合约账户 | *（已开立）* |
| 申请人联系人 |  | 联系人电话 |  |
| 投资经理 | *（如有）* | 投资经理电话 | *（如有）* |
| 开户机构名称 |  | 开户机构结算账户 |  |
| 开户机构联系人 |  | 开户机构联系人电话 |  |
| **申请人声明事项**1.提供的文件内容完整并且真实；2.将依据报备的用途与内部控制程序从事期权交易；3.遵守期权交易相关法律法规，绝不以不当手段干扰期权与相关现货市场运作，并且了解深圳证券交易所在履行监管时，对发现的异常情况有权依据《深圳证券交易所股票期权试点交易规则》及相关规定采取相应措施以维护市场秩序；4.同意深圳证券交易所在申请人从事期权交易期间，可以依据相关规定要求申请人就有关事项限期提出书面说明或者补充文件，申请人不会规避或者拒绝。 |
| **申请人（或管理人）签字：****申请人盖章：** |
| **期权经营机构对申请人材料真实性的声明事项：**我公司保证申请人向贵所提供的各项证明材料均属实，同意向交易所提交相关申请，并在运作中按照深圳证券交易所的有关规定执行。 |
| **期权经营机构负责人（或被授权人）签字： 期权经营机构盖章：** |

附件3：股票期权持仓限额调整申请表（投资者）

|  |
| --- |
| **深圳证券交易所股票期权持仓限额调整申请表（投资者）** |
| 申请人信息 | 名称 |  |
| 联系方式 |  |
| 电子邮箱 |  |
| 深市A股证券账户 |  |
| 衍生品合约账户 |  |
| 申请用途 | □现货多头套期保值□现货空头套期保值□期权套期保值□备兑开仓 |
| 合约品种持仓限额调整 | 单个合约品种 | 目前持仓限额 | 拟申请持仓限额 |
| 权利仓持仓限额 | 总持仓限额 | 单日买入开仓限额 | 权利仓持仓限额 | 总持仓限额 | 单日买入开仓限额 |
|  |  |  |  |  |  |  |
| 签字及公章 | 申请人签字： |
| 营业部经办人签字： |
| 期权经营机构经纪业务负责人签字： |
| 期权经营机构单位公章： |

附件4：股票期权持仓限额调整申请表（自营）

|  |
| --- |
| **深圳证券交易所股票期权持仓限额调整申请表（自营）** |
| 申请人信息 | 公司名称 |  |
| 开通深市期权自营业务时间 | 年 月 日 |
| 联系人姓名 |  |
| 联系人联系方式 |  |
| 联系人邮箱 |  |
| 深市A股证券账户 |  | 结算账户（自营） |  |
| 衍生品合约账户 | *（如有）* |
| 申请用途 | □现货多头套期保值□现货空头套期保值□期权套期保值□备兑开仓 |
| 合约品种持仓限额调整 | 单个合约品种 | 目前持仓限额 | 拟申请持仓限额 |
| 权利仓持仓限额 | 总持仓限额 | 单日买入开仓限额 | 权利仓持仓限额 | 总持仓限额 | 单日买入开仓限额 |
|  |  |  |  |  |  |  |
| 签字及公章 | 自营部门负责人签字 |
| 首席风控官（或合规总监）签字： |
| 法定代表人签字： |
| 期权经营机构单位公章： |
| 附情况说明 |  |

附件5：股票期权持仓限额调整自有资产证明

|  |
| --- |
| **深圳证券交易所股票期权持仓限额调整自有资产证明** |
| **一、基本信息** |
| 填报日期 |  | 申请人名称 |  |
| 套期保值交易对应的深市A股证券账户 |  |
| **二、资产信息** |
| 现货多头套期保值填写 | 现货空头套期保值填写 |
| 申请人最近30 个交易日持有合约标的数量对应合约数量（张） | “申请人最近30个交易日持有合约标的数量对应的合约数量大于该合约品种权利仓持仓限额的情形”出现的次数 | 申请人最近30个交易日合约标的融券余额对应的合约数量（张） | “申请人最近30个交易日合约标的融券余额对应的合约数量大于该合约品种权利仓持仓限额的情形”出现的次数 |
|  |  |  |  |
| 备兑开仓套期保值填写 |
| 申请人最近30个交易日持有合约标的数量对应的合约数量（张） | “申请人最近30个交易日持有合约标的数量对应的合约数量大于该合约品种总持仓限额的情形”出现的次数 |
|  |  |
| 期权合约间套期保值填写 |
| 申请人最近30个交易日日均持有的权利仓数量（张） | 申请人最近30个交易日日均均非备兑义务仓数量（张） | 申请人最近30个交易日日均持有的权利仓数量占该合约品种权利仓限额的比例 | 申请人最近30个交易日日均非备兑义务仓数量占该合约品种权利仓限额的比例 |
|  |  |  |  |

附件6：股票期权产品账户报备表

|  |
| --- |
| **深圳证券交易所股票期权产品账户报备表** |
| 申请人名称 |  |
| 深市A股证券账户 |  | 对应衍生品合约账户 | *（已开立）* |
| 产品联系人 |  | 联系人电话 |  |
| 投资经理 | *（如有）* | 投资经理电话 | *（如有）* |
| 开户机构名称 |  | 开户机构结算账户 |  |
| 开户机构联系人 |  | 开户机构联系人电话 |  |
| **申请人声明事项**1.提供的文件内容完整并且真实；2.将依据报备的用途与内部控制程序从事期权交易；3.遵守期权交易相关法律法规，绝不以不当手段干扰期权与相关现货市场运作，并且了解深圳证券交易所在履行监管时，对发现的异常情况有权依据《深圳证券交易所股票期权试点交易规则》及相关规定采取相应措施以维护市场秩序；4.同意深圳证券交易所在申请人从事期权交易期间，可以依据相关规定要求申请人就有关事项限期提出书面说明或者补充文件，申请人不会规避或者拒绝。 |
| **申请人签字：****申请人盖章：** |
| **期权经营机构对申请人材料真实性的声明事项：**我公司保证申请人向贵所提供的各项证明材料均属实，同意向交易所提交相关申请，并在运作中按照深圳证券交易所的有关规定执行。 |
| **期权经营机构负责人（或被授权人）签字： 期权经营机构盖章：** |

附件7：股票期权持仓限额调整申请表（特定产品）

|  |
| --- |
| **深圳证券交易所股票期权持仓限额调整申请表（特定产品）** |
| 申请人信息 | 产品发行人名称 |  |
| 产品名称 |  |
| 联系方式 |  |
| 电子邮箱 |  |
| 深市A股证券账户 |  |
| 衍生品合约账户 |  |
| 申请用途 |  |
| 合约品种持仓限额调整 | 单个合约品种 | 目前持仓限额 | 拟申请持仓限额 |
| 权利仓持仓限额 | 总持仓限额 | 单日买入开仓限额 | 权利仓持仓限额 | 总持仓限额 | 单日买入开仓限额 |
|  |  |  |  |  |  |  |
| 签字及公章 | 申请人签字： |
| 营业部经办人签字： |
| 期权经营机构经纪业务负责人签字： |
| 期权经营机构单位公章： |

附件8：股票期权持仓限额调整申请表（经纪业务）

|  |
| --- |
| **深圳证券交易所股票期权持仓限额调整申请表（经纪业务）** |
| 申请人信息 | 公司名称 |  |
| 开通期权经纪业务时间 |  年 月 日 |
| 联系人姓名 |  |
| 联系人联系方式 |  |
| 联系人邮箱 |  |
| 结算账号（经纪） |  |
| 合约品种持仓限额调整 | 单个合约品种 | 目前总持仓限额 | 拟申请总持仓限额 |
|  |  |  |
| 签字及公章 | 经纪部门负责人签字 |
| 首席风控官（或合规总监）签字： |
| 法定代表人签字： |
| 期权经营机构单位公章： |
| 附情况说明 |  |