声　明

目录

第一章　总体要求 …… 1
1
1
1
第二章　制度与流程准备 …… 2
2
2
第三章　交易业务指南 …… 3
3
3
4
4
第四章　行权业务指南 …… 5
5
9
10
13
14
第五章　期权结算 …… 18
18
18
18
18
20
21
第六章　监查（风控）业务指南 …… 22
22
24
附件 …… 28
28
29

第一章　总体要求

一、制度和流程

二、技术系统

三、开通业务权限

第二章　制度与流程准备

一、内部制度

二、风险管理业务流程

第三章　交易业务指南

一、交易指令

FOK　　FAK

二、合约挂牌与增挂

1.

2020　7　31

“　　”

“

”

2020　11　17　　CU2111

RU2111　AU2212　　CU2111

RU2111　AU2212

CU2111　RU2111　AU2212

2.

“

”

三、交易时间

9:00-11:30　　13:30-15:00

四、期权询价

1

2

3　　60

4

5

6

第四章　行权业务指南

一、交易所行权履约处理

2020　7　31

2021　11　16　CU2211

AU2212　CU2211　AU2212

CU2211　AU2212

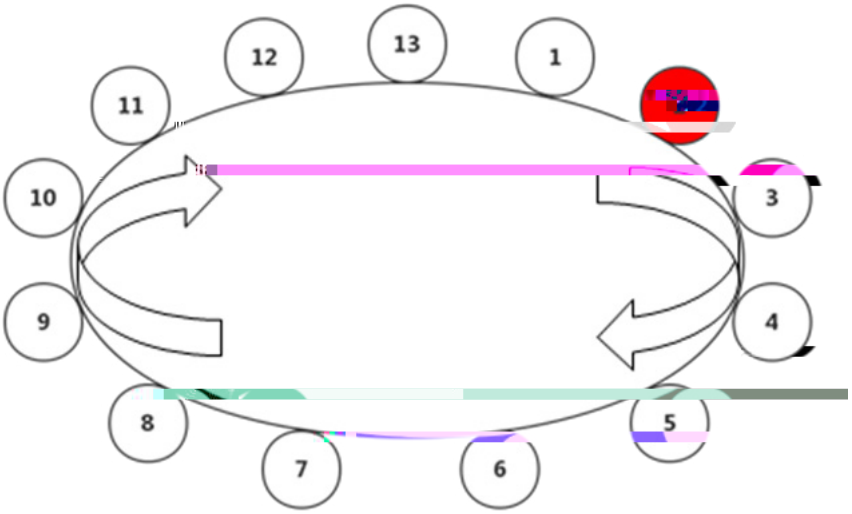
15:30

15:30

27 ÷ 13=2　1　　1　　2

1　　2

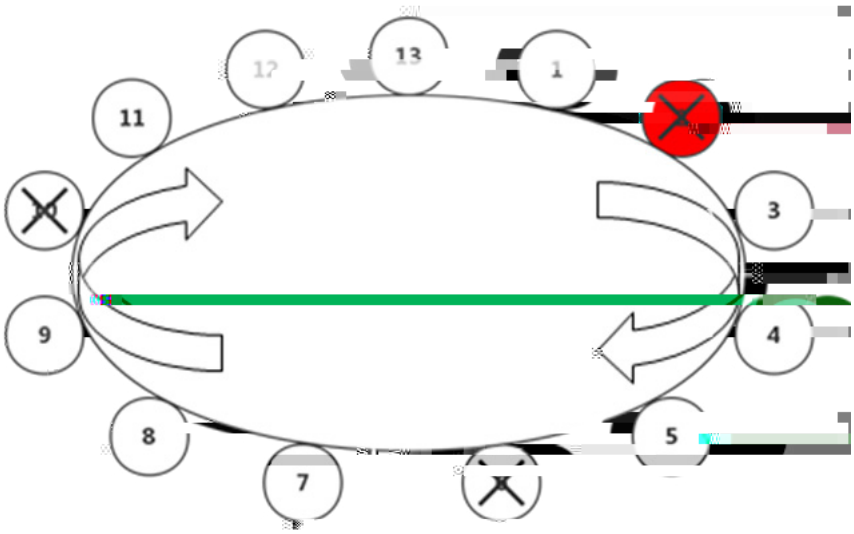
图 2 确定序列起点与终点



13 ÷ 5=2　3　　3　　3

13 ÷ 3　4　　3

图 3 剔除多余持仓后形成的序列

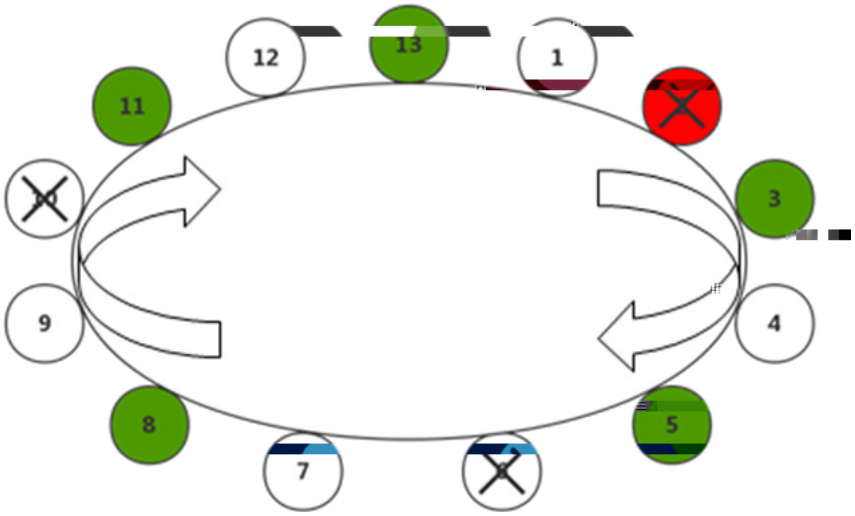


2

3 5

10/5=2 4

图 4 行权配对结果



1. 15:30

2. 15:30

1. 15:30

2. 15:30

二、期货公司行权履约处理

15:30

“ ”

“ ”

三、行权时间、方式与处理顺序

15:30

AU2008C284

1	AU2008C284	7		
2	AU2008C284	4		

3

2 4

四、注意问题

“ ” “ ”

“ ” “ ” “ ” “ ”

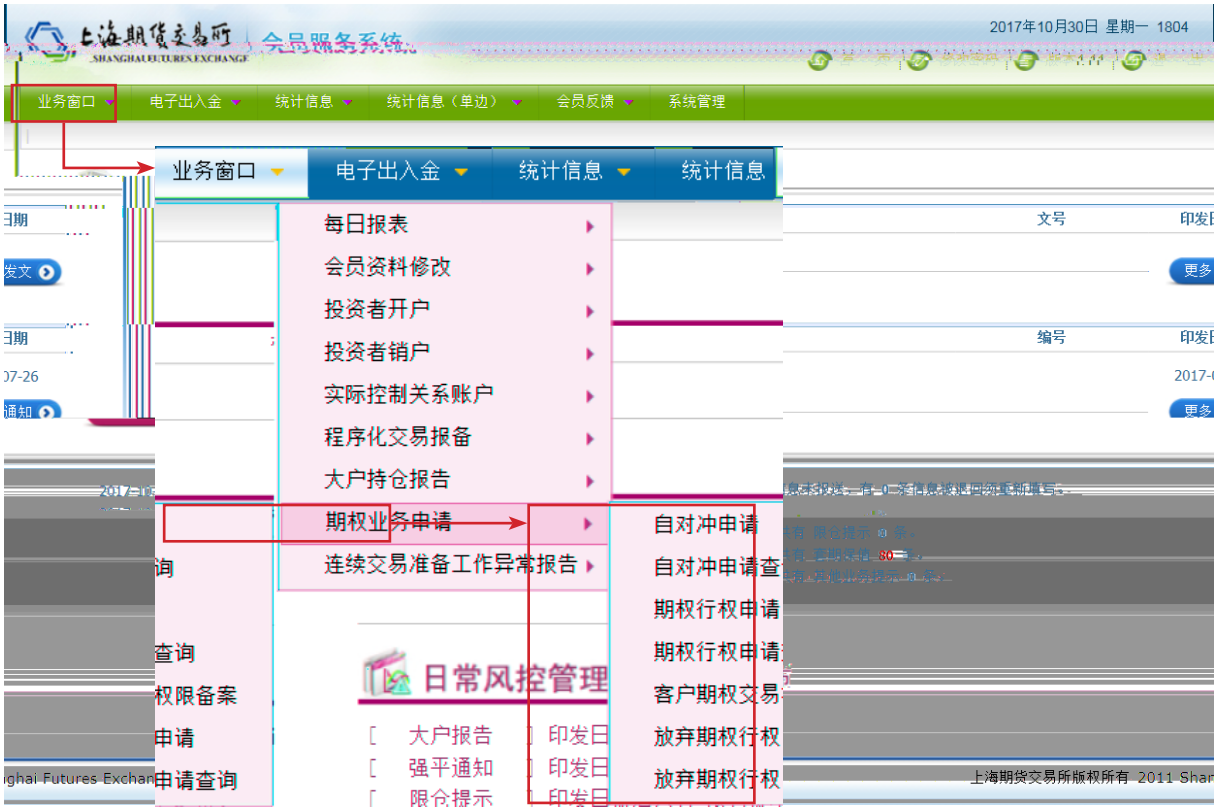
15:30

五、会员服务系统界面

“ ”→“ ” “

”

上海期货交易所会员服务系统首页



“ ” “ ”

1 “ ” “ ”

“ ” “ ” “ ”

“ ” “ ”

“ ” “ ” “ ”

2 “ ” CSV

3 “ ” Excel

4

自对冲申请操作界面

“ ” “ ”

1 “ ” “ ”

2 “ ” CSV

3 “ ” Excel

4

行权申请操作界面

“ ” “

”

1 “ ” “ ”

2 “ ” CSV

3 “ ” Excel

4

放弃行权申请操作界面

1

2

1

2

3

4

AU2101 AU2102 AU2103 AU2104 AU2106 AU2108 AU2110 AU2112 AU2108

AU2108

AU2108C280 AU2108C284 AU2108P288

σ_1 σ_2 σ_3 σ_1 σ_2 σ_3 σ σ AU2108

AU2108

AU2106 AU2110

AU2106

AU2104 AU2112

AU2108

=Max –

=Max –

五、结算风险管理

1

2

3

1

2

3

4

六、其他注意事项

第六章　监查（风控）业务指南

一、期权风险管理业务指南

1

2

1 × + - 1/2 ×

2 × + 1/2 ×

3

Max - 0 ×

Max - 0 ×

1

×

2 = + ×

= Max - ×

3

5

1

2

3

+

+

4.

5

80%

二、期权异常交易业务指南

1

2

3

4

5

1

1 5

2 500

3 300

50

2

3

4

5 FOK

FAK

6

7

1

1

2

3

1

2

1

2

3

3

3

1

2

3

4

1

4

3

1

2

10

3

6

5

1

4

2

4

3 4

3 2 3 4

1

2

3

1

2

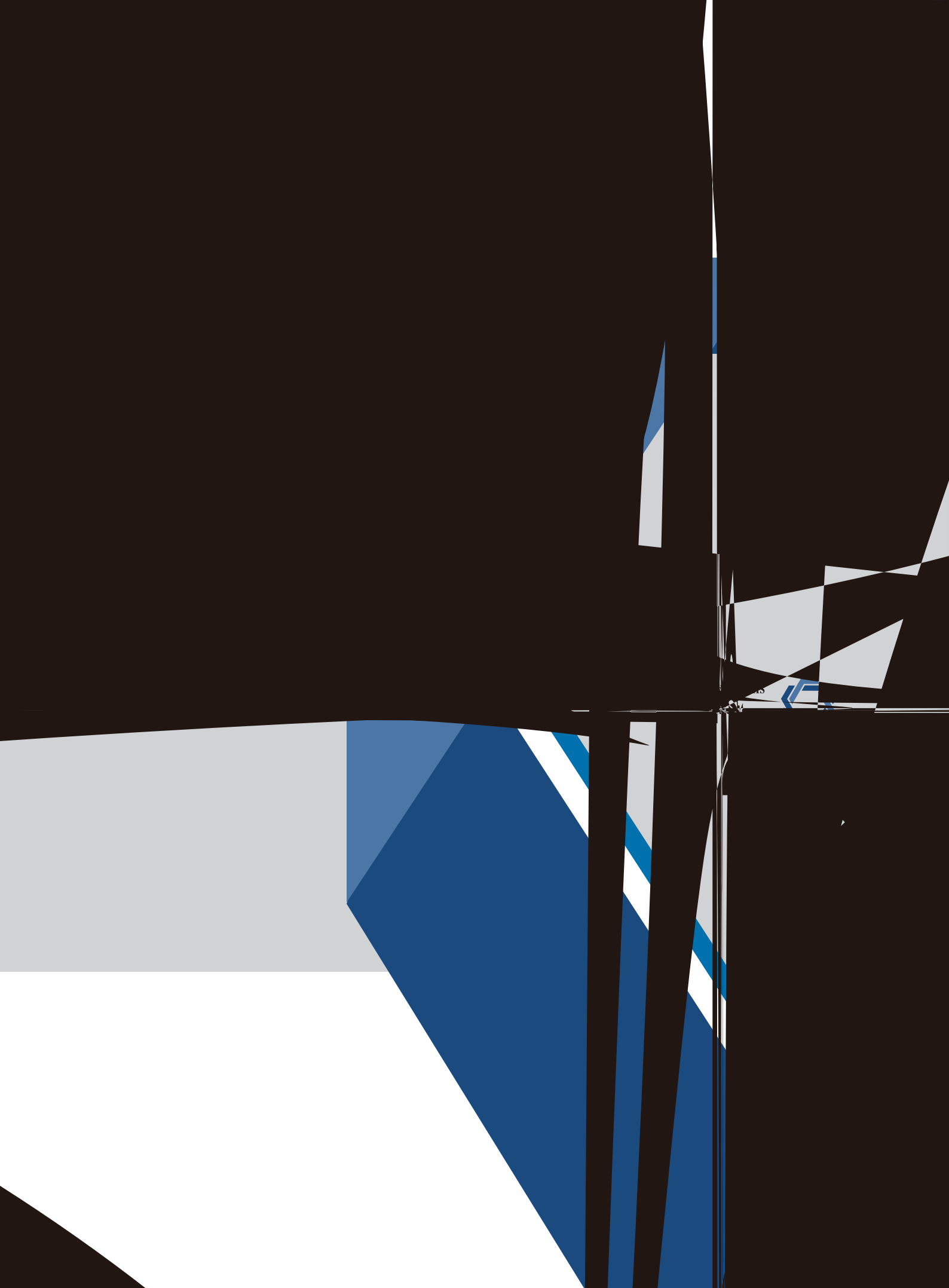
3

4

附件

客户大户报告表

第一部分：申报人信息							
/						○ ○	
						○ ○	
		○ ○					

非期货公司会员大户报告表

<table>
<tr><td colspan="8">第一部分：申报人信息</td></tr>
<tr><td colspan="2"></td><td colspan="2"></td><td colspan="2"></td><td colspan="2"></td></tr>
<tr><td colspan="2">/</td><td colspan="2"></td><td colspan="2"></td><td colspan="2">○
○</td></tr>
<tr><td colspan="8"></td></tr>
<tr><td colspan="2"></td><td colspan="2"></td><td colspan="2"></td><td colspan="2"></td></tr>
<tr><td colspan="8"></td></tr>
<tr><td></td><td></td><td></td><td></td><td></td><td></td><td></td><td></td></tr>
<tr><td colspan="2"></td><td colspan="2"></td><td colspan="2"></td><td colspan="2"></td></tr>
<tr><td colspan="2"></td><td colspan="2"></td><td colspan="2"></td><td colspan="2"></td></tr>
<tr><td colspan="2"></td><td colspan="2"></td><td colspan="2"></td><td colspan="2">○ ○</td></tr>
<tr><td colspan="2"></td><td colspan="2">○ ○</td><td colspan="2"></td><td colspan="2"></td></tr>
<tr><td colspan="8">○ ○</td></tr>
<tr><td colspan="8">○ ○</td></tr>
<tr><td colspan="8">第二部分：申报人承诺</td></tr>
<tr><td colspan="8"></td></tr>
</table>