

300 股指期货合约 交易细则

(2013年8月30日实施 2014年9月1日第一次修订
2015年4月10日第二次修订 2015年8月3日第三次修订)

第一章 总则

第一条 为规范中国金融期货交易所(以下简称交易所)上市
沪深 300 股指期货合约的交易行为,根据《期货交易管理条例》
及《中国金融期货交易所交易细则》制定本细则。

第二条 交易所、会员、客户、期货保证金存管银行及
期货市场对其他会员上市业务遵守本细则。

第三条 本细则未规定的,按照交易所相关业务规则的规定执行。

第二章 合约

第四条 本合约的合约标的为中证指数有限公司编制和
发布的沪深 300 指数。

第五条 本合约的合约乘数为每点人民币 300 元。股指
期货合约价值为股指期货指数点乘以合约乘数。

第六条 本合同以指数点报价。

第七条 本合同的最小变动价位为 0.2 指数点，合约交易报价指数点为 0.2 点的整数倍。

第八条 本合同的合约月份为 3 月、6 月、9 月、12 月。季月是指 3 月、6 月、9 月、12 月。

第九条 本合同的交割月份为 3 月、6 月、9 月、12 月。如果因节假日或者因异常情况等原因未交易的，以下一交易日为最后交易日和交割日。

第十条 本合同的合约代码为 IF。

第三章 交易业务

第十一条 本合同的交易单位为手，合约交易以手为

第十二条 为 1 手。本合同交易指令申报数量最小为 1 手，申报数量不得超过 50 手。申报数量不得超过 100 手。

第十三条 本合同采用集合竞价和连续竞价两种交易方式。

第十四条 集合竞价时间为 9:10-9:15，其中 9:10-9:14 为指令申报时间，9:14-9:15 为指令撮合时间。

连续竞价时间为每个交易日 9:15-11:30（第一节）和 13:00-15:15（第二节），最后交易日连续竞价时间为 9:15-11:30（第一节）和 13:00-15:00（第二节）。

第四章 结算业务

第十四条 本合约的当日结算价为合约最后一小时成交价格按照成交量的加权平均价。计算结果保留至小数点后一位。

~~第十五条~~ 本合约以当日结算价作为计算当日盈亏的依据。具体计算公式如下：

当日盈亏 = { (卖出成交价 - 当日结算价) × 卖出量 - (当日结算价 - 买入成交价) × 买入量 } + (上一交易日结算价 - 当日结算价) × (上一交易日卖出持仓量 - 上一交易日买入持仓量) × 合约乘数

第十六条 本合约的手续费标准由交易所另行规定。

第十七条 ~~本合约的交易结算价为最后交易日结算价最后 2 分钟内的加权平均价。~~

第十八条 本合约采用现金交割方式。

第十九条 ~~本合约的交割手续费标准按交割金额的万分之二。~~

第五章 风险管理

第二十条 本合约的最低交易保证金标准为合约价值

的 8%。

本合约的每日价格最大波动限制是指其每日价格涨跌停板幅度，为上一交易日结算价的 $\pm 10\%$ 。

季月合约上市首日涨跌停板幅度为挂盘基准价的 $\pm 20\%$ 。
上市首日无成交的，下一交易日继续执行前一交易日的涨跌停板幅度。

本合约最后交易日涨跌停板幅度为上一交易日结算价的 $\pm 20\%$ 。

第二十二条 本合约实行持仓限额制度。

(一) 进行投机交易的客户某一合约单边持仓限额为 5000 手；

对于持仓量超过持仓限额的客户，交易所将按照《期货交易所管理办法》有关规定处理。
持仓量超过持仓限额的客户，交易所将按照《期货交易所管理办法》有关规定处理。
边总持仓量的 25%。

规定执行。

第六章 附则

第二十三条

融期货交易所违规违约处理办法》有关规定处理。

第二十四条 本细则由交易所负责解释。

第二十五条 本细则自 2015 年 8 月 3 日起施行。