

中国期货业协会文件

中期协字〔2020〕127号

关于进一步明确权益类场外衍生品 标的范围的通知

各期货公司及风险管理公司：

为进一步促进风险管理公司场外衍生品业务规范发展，引导行业合规经营，现对权益类场外衍生品标的范围作进一步明确，具体通知如下：

一、风险管理公司开展场外期权业务挂钩标的应当具有充分的现货交易基础，市场竞争充分，具备公允的市场定价，流动性良好等，适宜进行场外期权交易，不得挂钩私募基金、资管计划等私募产品。

二、风险管理公司开展场外期权业务个股标的范围不得超出融资融券标的当期名单，股票指数标的范围为沪深交易所、中证指数公司、深圳证券信息有限公司公布的符合证券业协会相关规

定的指数标的。

三、风险管理公司开展场外期权业务个股标的应进行实时动态调整，不得新开和展期被交易所实行风险警示、发布暂停上市或终止上市风险提示、进入终止上市程序的个股为标的的场外期权合约。

四、风险管理公司不得开展融资类收益互换业务。

五、风险管理公司应当建立场外衍生品数据报送工作机制，健全数据报送、核实验证、报告补正等工作流程，配备专岗人员，明确对数据报送工作负直接责任和负管理责任的人员。

六、《关于进一步加强风险管理公司场外衍生品业务自律管理的通知》（中期协字〔2018〕118号）第七条同时废止。

特此通知。

