

中国金融期货交易所风险控制管理办法 PDF转换可能丢失图片或格式，建议阅读原文

https://www.100test.com/kao_ti2020/303/2021_2022__E4_B8_AD_E5_9B_BD_E9_87_91_E8_c80_303159.htm 中国金融期货交易所风险控制管理办法(中金所办字〔2007〕44号 2007年6月27日)

第一章 总则 第一条 为加强期货交易风险管理，保护期货交易当事人的合法权益，保障中国金融期货交易所（以下简称交易所）期货交易的正常进行，根据《中国金融期货交易所交易规则》，制定本办法。

第二条 交易所风险管理实行保证金制度、价格限制制度、持仓限额制度、大户持仓报告制度、强行平仓制度、强制减仓制度、结算担保金制度和风险警示制度。

第三条 交易所、会员和客户应当遵守本办法。

第二章 保证金制度 第四条 交易所实行保证金制度。保证金分为结算准备金和交易保证金。

第五条 股指期货合约最低交易保证金标准为10%。期货交易过程中，出现下列情形之一的，交易所可以根据市场风险状况调整交易保证金标准，并向中国证券监督管理委员会（以下简称中国证监会）报告：（一）期货交易出现涨跌停板单边无连续报价（以下简称单边市）；（二）遇国家法定长假；（三）交易所认为市场风险明显变化；（四）交易所认为必要的其他情形。

第六条 交易所调整期货合约交易保证金标准的，在当日结算时对该合约的所有持仓按照调整后的交易保证金标准进行结算。

第七条 结算准备金的管理适用《中国金融期货交易所结算细则》的有关规定。

第三章 价格限制制度 第八条 交易所实行价格限制制度。价格限制制度分为熔断制度与涨跌停板制度。熔断与涨跌停板幅度由交易所设定，交易所可以根据市场风险状况调整期

货合约的熔断与涨跌停板幅度。100Test 下载频道开通，各类
考试题目直接下载。详细请访问 www.100test.com