

股票期权非交易指令

股票期权非交易指令包含：证券锁定与解锁指令、行权指令/撤消行权指令、公司申请转处置证券账户指令，详见如下：

1、证券锁定与解锁指令

在交易时段，投资者可以将已持有的证券（含当日买入，仅限标的证券）锁定作为备兑开仓的保证金，由交易所进行锁定（当日有效），亦可解锁。当证券余额不足时，将返回失败。

交易所交易系统接到投资者指令后，优先锁定当日买入的证券份额（锁定之前买入的），再锁定申购的 ETF 份额或赎回的成份股份额；优先解锁非当日买入的证券份额，再解锁申购的 ETF 份额或赎回的成份股份额。解锁的当日买入证券当日仍不能卖出，但可用于申购/赎回 ETF。

优先进行非当日备兑持仓的平仓，释放被锁定的合约标的，对非当日备兑持仓的平仓增加可解锁的“非当日买入”合约标的额度。

2、行权指令/撤消行权指令

行权日行权时间为期权合约行权日的 9:15 至 9:25、9:30-11:30、13:00 至 15:30，可进行上述各类指令委托。

由公司进行前端控制，累计委托数量不超过当时持仓数

量。

行权申报可多次申报，行权数量累计计算，可撤销行权委托。行权日买入的期权，当日可以行权。行权指令申报当日有效，当日可以撤销。

同一合约有效行权累计数量如果超过当日该账户该合约净持仓数量，按净持仓数量计算。行权交割为 E+1 日（被分配行权的投资者可于 E+1 日买入标的证券）。

3、公司申请转处置证券账户指令

对认沽期权的义务方，如被指派行权且在交割日部分或全部行权款项由公司垫付的，公司可以在 9:15-9:25，9:30—11:30,13:00—15:30 向交易所交易系统申报会员申请转处置证券账户指令，申报内容：客户账户、期权合约编码、标的证券代码、证券数量（股/份）、处置证券账户、处理类别（被行权垫付划入/行权垫付划入/划回）等内容。交易系统不进行有效性检查，由中国结算上海分公司进行有效性检查，并进行相关处理。公司对划入证券处置账户的证券进行处置后，如有剩余或客户已补足资金，应及时通过交易系统发出指令申请将部分或全部划入的证券划回客户证券账户，划出至该客户账户的数量应不超过与该客户相关的划入数量。