

# 国海良时期货合规简报

合规稽核部主办

思·深远 谋·发展 创·未来

期货之路 合规与您同行!

年第 期 总第 期

# 本期导航

---

P3

:

---

P8

---

P15

50ETF

---

P23

## 第一部分 合规工作动态

2015

3 22

2015

2016









## 第二部分 行业监管政策资讯

7

6

2016 2 5

13

13



489

2016 1

1 24

300

666



300

3 25

3 30

2016

100

<

>



# 第三部分 合规工作问答

## 50ETF

2015 2 9

50ETF

2015

50ETF

	50ETF (510050)	
	10000	
	4	
	50ETF	50ETF
	2 2	2.485 2.50
	9:15-9:25	9:30-11:30 13:00-15:00
	9:15-9:25	14:57-15:00

	0.0001
--	--------

	9:15	9:25	9:30	11:30	
13:00	15:30				1
					2
					-
					3

			50ETF			
3	0.05		2.485			
3 5	0.1			2.50	3	
5 10	0.25				0.05	2.50
10 20	0.5					
20 50	1		2.55	2.60	2.40	2.45
50 100	2.5					
100	5					

	$= \frac{* 1+}{* - + *}$
	$= \frac{*}{*}$






50ETF

50ETF

~ À û à


	1
	2
	3
	4
	1
	2
	3
	4
	5
	6
	15
	5

	1
	2
	3
	4
	1
	2
	3

	3
--	---

	<table border="1" style="width: 100%; border-collapse: collapse;"> <tr> <td style="width: 10%;">1</td> <td style="width: 40%;"></td> <td style="width: 10%; text-align: center;">6</td> <td style="width: 10%;"></td> <td style="width: 10%; text-align: center;">2</td> <td style="width: 10%;"></td> <td style="width: 10%;"></td> </tr> <tr> <td>2</td> <td></td> <td></td> <td style="text-align: center;">6</td> <td></td> <td style="text-align: center;">6</td> <td style="text-align: center;">A</td> </tr> <tr> <td>3</td> <td></td> <td></td> <td></td> <td></td> <td style="text-align: center;">6</td> <td></td> </tr> <tr> <td></td> <td></td> <td style="text-align: center;">A</td> <td></td> <td></td> <td></td> <td style="text-align: right;">20%</td> </tr> </table>	1		6		2			2			6		6	A	3					6				A				20%																					
1		6		2																																														
2			6		6	A																																												
3					6																																													
		A				20%																																												
	<table border="1" style="width: 100%; border-collapse: collapse;"> <tr> <td style="width: 10%;">1</td> <td style="width: 40%;"></td> <td style="width: 10%;"></td> <td style="width: 10%;"></td> <td style="width: 10%;"></td> <td style="width: 10%;"></td> <td style="width: 10%;"></td> </tr> <tr> <td>2</td> <td></td> <td></td> <td></td> <td></td> <td></td> <td></td> </tr> <tr> <td>3</td> <td></td> <td></td> <td></td> <td></td> <td></td> <td></td> </tr> <tr> <td>4</td> <td></td> <td></td> <td></td> <td></td> <td></td> <td style="text-align: right;">20%</td> </tr> <tr> <td></td> <td></td> <td style="text-align: center;">A</td> <td></td> <td></td> <td></td> <td></td> </tr> <tr> <td></td> <td></td> <td></td> <td></td> <td></td> <td style="text-align: center;">1</td> <td></td> </tr> <tr> <td></td> <td></td> <td></td> <td></td> <td style="text-align: center;">4</td> <td></td> <td></td> </tr> </table>	1							2							3							4						20%			A										1						4		
1																																																		
2																																																		
3																																																		
4						20%																																												
		A																																																
					1																																													
				4																																														

A

(  
)

