

附件

中证 500ETF 期权合约基本条款

合约标的	嘉实中证 500 交易型开放式指数证券投资基金（证券代码：159922）
合约类型	认购期权和认沽期权
合约单位	10000 份
合约到期月份	当月、下月及随后两个季月
行权价格	9 个（1 个平值合约、4 个虚值合约、4 个实值合约）
行权价格间距	3 元或以下为 0.05 元，3 元至 5 元（含）为 0.1 元，5 元至 10 元（含）为 0.25 元，10 元至 20 元（含）为 0.5 元，20 元至 50 元（含）为 1 元，50 元至 100 元（含）为 2.5 元，超过 100 元的为 5 元
行权方式	到期日行权（欧式）
交割方式	实物交割（本所业务规则另有规定的除外）
到期日	到期月份的第四个星期三（遇法定节假日、本所休市日顺延）
行权日	同到期日，行权指令提交时间为 9:15-11:30、13:00-15:30
交收日	行权日次一交易日
交易时间	上午 9:15-9:25（开盘集合竞价时间）、9:30-11:30 下午 13:00-15:00（14:57-15:00 为收盘集合竞价时间）
买卖类型	买入开仓、买入平仓、卖出开仓、卖出平仓、备兑开仓、备兑平仓以及本所业务规则规定的其他买卖类型
最小报价单位	0.0001 元

申报单位	1 张或其整数倍
涨跌停价格 计算公式	<p>合约涨跌停价格=合约前结算价格±最大涨跌幅</p> <p>认购期权最大涨幅=max { 合约标的前收盘价×0.5%, min[(2×合约标的前收盘价-行权价格), 合约标的前收盘价]×10% }</p> <p>认购期权最大跌幅=合约标的前收盘价×10%</p> <p>认沽期权最大涨幅=max { 行权价格×0.5%, min[(2×行权价格-合约标的前收盘价), 合约标的前收盘价]×10% }</p> <p>认沽期权最大跌幅=合约标的前收盘价×10%</p>
开仓保证金 最低标准	<p>认购期权义务仓开仓保证金=[合约前结算价+max (12%×合约标的前收盘价-认购期权虚值, 7%×合约标的前收盘价)]×合约单位</p> <p>认沽期权义务仓开仓保证金=min[合约前结算价+max (12%×合约标的前收盘价-认沽期权虚值, 7%×行权价格), 行权价格]×合约单位</p>
维持保证金 最低标准	<p>认购期权义务仓维持保证金=[合约结算价+max (12%×合约标的收盘价-认购期权虚值, 7%×合约标的收盘价)]×合约单位</p> <p>认沽期权义务仓维持保证金=min[合约结算价+max (12%×合约标的收盘价-认沽期权虚值, 7%×行权价格), 行权价格]×合约单位</p>