

附件：

深圳证券交易所股票期权试点

合约条款管理指引

第一条 为了规范深圳证券交易所（以下简称本所）股票期权（以下简称期权）合约条款管理，根据《深圳证券交易所股票期权试点交易规则》《深圳证券交易所 中国证券登记结算有限责任公司股票期权试点风险控制管理办法》及其他有关规定，制定本指引。

第二条 本指引所称合约条款，主要包括合约简称、合约编码、合约代码、合约标的、合约类型、到期月份、合约单位、行权价格、行权方式、交割方式等。

第三条 在本所上市交易的股票、交易型开放式基金以及经中国证券监督管理委员会（以下简称中国证监会）批准的其他证券品种，可以作为期权合约的标的物（以下简称合约标的）。

第四条 合约代码包含合约标的、合约类型、到期月份、行权价格等要素。期权合约的合约代码共有 20 位，具体组成为：第 1 至第 6 位为标的证券代码；第 7 位为 C（Call）或者 P（Put），分别表示认购期权或者认沽期权；第 8、9 位表示到期年份的后两位数字，第 10、11 位表示到期月份（分别用 01 至 12 代替）；第 12 位

为“ M”，代表月合约序列；第 13 至 18 位表示期权行权价格，保留三位小数。第 19 位为合约版本号，首次调整改为“ A”，再次调整改为“ B”，依此类推。预留第 20 位。

第五条 合约简称与合约代码相对应，由合约标的简称、合约类型、到期月份、行权价格等要素组成。

第六条 合约编码用于唯一识别和记录期权合约。期权合约编码由 8 位数字构成，合约标的为交易型开放式基金的，从 90000001 至 91999999 按顺序对挂牌合约进行编码；合约标的为股票的，从 92000001 至 99999999 按顺序对挂牌合约进行编码。

第七条 合约类型包括认购期权和认沽期权。

第八条 合约到期月份为当月、下月及随后两个季月，共 4 个月份同时挂牌交易。

第九条 合约标的为交易型开放式基金的，每张期权合约对应 10000 份基金份额。合约标的为股票的，每张期权合约对应 1000 股股票。

第十条 本所以期权合约标的前一交易日收盘价为基准，确立平值期权行权价格，再依照行权价格间距依序加挂新行权价格合约，使得行权价格高于（低于）平值行权价格的期权合约至少达到 4 个。

第十一条 行权价格间距根据期权合约标的收盘价格分区间设置，其收盘价与行权价格间距的对应关系为：

（一）合约标的为交易型开放式基金的，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;

(二) 合约标的为股票的,2元或以下为0.1元,2元至5元(含)为0.25元,5元至10元(含)为0.5元,10元至20元(含)为1元,20元至50元(含)为2.5元,50元至100元(含)为5元,超过100元的为10元。

第十二条 期权合约采用到期日行权方式。

第十三条 期权合约采用实物交割方式。本所另有规定的除外。

第十四条 期权合约到期日为到期月份的第四个星期三,遇法定节假日、本所休市日的,顺延至次一交易日。

第十五条 本指引由本所负责解释。

第十六条 本指引自发布之日起施行。