

沪深 300ETF 期权基本合约条款

| | |
|--------|---|
| 合约标的 | 华泰柏瑞沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金 (证券简称：沪深 300ETF，证券代码：510300) |
| 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，100 元以上为 5 元 |
| 行权方式 | 到期日行权 (欧式) |
| 交割方式 | 实物交割 (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 (遇法定节假日顺延) |
| 行权日 | 同合约到期日，行权指令提交时间为 9:15-9:25， 9:30-11:30，13:00-15:30 |
| 交收日 | 行权日次一交易日 |