**附件**

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 |