

关于调整上证 50ETF 期权合约行权价格数量及交易

单笔申报最大数量的通知

为进一步满足投资者风险管理需要、更好地发挥期权市场经济功能,根据《上海证券交易所股票期权试点交易规则》的有关规定,上海证券交易所决定调整上证 50ETF 期权合约行权价格数量及交易单笔申报最大数量。现将有关事项通知如下:

一、调整上证 50ETF 期权合约初始行权价格数量为 9 个,包括依据行权价格间距选取的最接近上证 50 交易型开放式指数证券投资基金(以下简称 50ETF)前收盘价的基准行权价格(最接近 50ETF 前收盘价的行权价格存在 2 个时,取价格较高者为基准行权价格),以及依据行权价格间距依次选取的 4 个高于和 4 个低于基准行权价格的行权价格。50ETF 收盘价格发生变化,导致行权价格高于(低于)基准行权价格的期权合约少于 4 个时,按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)基准行权价格的期权合约达到 4 个。

二、调整上证 50ETF 期权交易限价申报的单笔申报最大数量为 30 张,市价申报的单笔申报最大数量为 10 张。

三、本通知自 2018 年 1 月 2 日起实施。

特此通知。

宏信证券有限责任公司

二〇一八年一月二日