

关于上证 50ETF 期权合约调整的公告

上证公告（2018）36 号

根据华夏基金管理有限公司公告，上证 50 交易型开放式指数证券投资基金（以下简称上证 50ETF）将于 2018 年 12 月 3 日分红。根据《上海证券交易所股票期权试点交易规则》（以下简称《交易规则》）的有关规定，上海证券交易所（以下简称“上交所”）将于同日对上证 50ETF 期权合约品种（以下简称上证 50ETF 期权）所有未到期合约进行相应调整，并重新挂牌新的上证 50ETF 期权合约。现将有关事项公告如下：

一、未到期合约的调整安排

（一）合约交易代码的第 12 位由“M”调整为“A”，其他位保持不变。

（二）合约简称中的行权价格调整为新行权价格，同时将标志位调整为“A”（原来无标志位）。

（三）行权价格、合约单位按照《交易规则》第十三条规定的公式进行如下调整：

序号	原行权价格	调整后行权价格	原合约单位	调整后合约单位
1	2.2	2.156	10000	10202
2	2.25	2.205	10000	10202
3	2.3	2.254	10000	10202
4	2.35	2.303	10000	10202
5	2.4	2.352	10000	10202
6	2.45	2.401	10000	10202
7	2.5	2.45	10000	10202
8	2.55	2.5	10000	10202
9	2.6	2.549	10000	10202
10	2.65	2.598	10000	10202
11	2.7	2.647	10000	10202
12	2.75	2.696	10000	10202
13	2.8	2.745	10000	10202

14	2.85	2.794	10000	10202
15	2.9	2.843	10000	10202
16	2.95	2.892	10000	10202

(四) 合约前结算价按照《交易规则》第七十三条规定的公式进行调整。

二、重新挂牌新的上证 50ETF 期权合约

按照《交易规则》第十二条规定，上交所于 2018 年 12 月 3 日对除息后的上证 50ETF 重新挂牌 2018 年 12 月、2019 年 1 月、3 月和 6 月等 4 个到期月份，1 个平值、4 个实值、4 个虚值等 9 个行权价格，认购和认沽等两种类型，共 72 个上证 50ETF 期权合约。

三、特别提醒事项

(一) 未到期的上证 50ETF 期权合约发生调整的，交易与结算按照调整后的合约条款进行。

(二) 12 月 3 日进行备兑开仓的投资者，应当按照调整后的合约单位提交足额备兑备用证券。

(三) 12 月 3 日，已有备兑开仓的投资者应当按照调整后的合约单位及时补足备兑备用证券或对不足部分自行平仓。12 月 3 日日终，中国证券登记结算有限责任公司（以下简称中国结算）将根据调整后的合约单位和投资者备兑开仓的持仓情况，对投资者证券账户中相应数量的合约标的进行备兑交割锁定。

(四) 12 月 3 日日终，经中国结算备兑交割锁定后仍出现备兑证券数量不足的，投资者应当根据与期权经营机构的约定，在次一交易日规定时间内提交备兑锁定指令补足备兑备用证券或对不足部分自行平仓，逾期未补足或未完成自行平仓的，将被强行平仓。

(五) 上证 50ETF 期权发生调整的合约，上交所不再对其加挂新到期月份与行权价格的合约。另外，如出现调整后合约的持仓数量日终为零的情形，上交所将于下一交易日对该合约予以摘牌。

上交所提醒各期权经营机构和广大投资者密切关注上证 50ETF 期权合约调整事宜，并做好各项调整准备。

特此公告。

宏信证券有限责任公司
二〇一八年十一月三十日