

附件

## 创业板 ETF 期权合约基本条款

合约标的	易方达创业板交易型开放式指数证券投资基金（证券代码：159915）
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，超过 100 元的为 5 元
行权方式	到期日行权（欧式）
交割方式	实物交割（本所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、本所休市日顺延）
行权日	同到期日，行权指令提交时间为 9:15-11:30、13:00-15:30
交收日	行权日次一交易日
交易时间	上午 9:15-9:25（开盘集合竞价时间）、9:30-11:30 下午 13:00-15:00（14:57-15:00 为收盘集合竞价时间）
买卖类型	买入开仓、买入平仓、卖出开仓、卖出平仓、备兑开仓、备兑平仓以及本所业务规则规定的其他买卖类型
最小报价单位	0.0001 元

<b>申报单位</b>	1 张或其整数倍
<b>涨跌停价格 计算公式</b>	<p>合约涨跌停价格=合约前结算价格±最大涨跌幅</p> <p>认购期权最大涨幅=<math>\max\{\text{合约标的前收盘价}\times 0.5\%, \min[(2\times\text{合约标的前收盘价}-\text{行权价格}), \text{合约标的前收盘价}]\times 20\%\}</math></p> <p>认购期权最大跌幅=<math>\text{合约标的前收盘价}\times 20\%</math></p> <p>认沽期权最大涨幅=<math>\max\{\text{行权价格}\times 0.5\%, \min[(2\times\text{行权价格}-\text{合约标的前收盘价}), \text{合约标的前收盘价}]\times 20\%\}</math></p> <p>认沽期权最大跌幅=<math>\text{合约标的前收盘价}\times 20\%</math></p>
<b>开仓保证金 最低标准</b>	<p>认购期权义务仓开仓保证金=<math>[\text{合约前结算价}+\max(12\%\times\text{合约标的前收盘价}-\text{认购期权虚值}, 7\%\times\text{合约标的前收盘价})]\times\text{合约单位}</math></p> <p>认沽期权义务仓开仓保证金=<math>\min[\text{合约前结算价}+\max(12\%\times\text{合约标的前收盘价}-\text{认沽期权虚值}, 7\%\times\text{行权价格}), \text{行权价格}]\times\text{合约单位}</math></p>
<b>维持保证金 最低标准</b>	<p>认购期权义务仓维持保证金=<math>[\text{合约结算价}+\max(12\%\times\text{合约标的收盘价}-\text{认购期权虚值}, 7\%\times\text{合约标的收盘价})]\times\text{合约单位}</math></p> <p>认沽期权义务仓维持保证金=<math>\min[\text{合约结算价}+\max(12\%\times\text{合约标的收盘价}-\text{认沽期权虚值}, 7\%\times\text{行权价格}), \text{行权价格}]\times\text{合约单位}</math></p>