

沪深 300 股指期权合约

(征求意见稿)

合约标的物	沪深 300 指数
合约乘数	每点人民币 100 元
合约类型	看涨期权、看跌期权
报价单位	指数点
最小变动价位	0.2 点
每日价格最大波动限制	上一交易日沪深 300 指数收盘价的 $\pm 10\%$
合约月份	当月、下 2 个月及随后 3 个季月
行权价格	行权价格覆盖沪深 300 指数上一交易日收盘价上下浮动 10%对应的价格范围 对当月与下 2 个月合约：行权价格 ≤ 2500 点时，行权价格间距为 25 点；2500 点 $<$ 行权价格 ≤ 5000 点时，行权价格间距为 50 点；5000 点 $<$ 行权价格 ≤ 10000 点时，行权价格间距为 100 点；行权价格 > 10000 点时，行权价格间距为 200 点 对随后 3 个季月合约：行权价格 ≤ 2500 点时，行权价格间距为 50 点；2500 点 $<$ 行权价格 ≤ 5000 点时，行权价格间距为 100 点；5000 点 $<$ 行权价格 ≤ 10000 点时，行权价格间距为 200 点；行权价格 > 10000 点时，行权价格间距为 400 点
行权方式	欧式
交易时间	9:30-11:30, 13:00-15:00
最后交易日	合约到期月份的第三个星期五，遇国家法定假日顺延
到期日	同最后交易日
交割方式	现金交割
交易代码	看涨期权：IO 合约月份-C-行权价格 看跌期权：IO 合约月份-P-行权价格
上市交易所	中国金融期货交易所