

上海證券交易所

衍生品业务部发〔2016〕3号

关于上证50ETF期权合约分红调整的提醒通知

各市场参与人：

2016年11月11日华夏基金管理有限公司发布《上证50交易型开放式指数证券投资基金利润分配公告》，上证50交易型开放式指数证券投资基金（证券简称为“50ETF”，证券代码为“510050”）将进行分红，除息日为11月29日。根据《上海证券交易所股票期权试点交易规则》，上证50ETF期权合约将于11月29日对50ETF所有未到期合约进行合约调整，并重新挂牌新的期权合约，现将有关事项通知如下。

一、合约调整涉及的相关事项

（一）合约条款的调整。50ETF期权合约的合约单位、行权价格、合约交易代码和合约简称相应调整如下：

1、新合约单位= $[\text{原合约单位} \times 11\text{月}28\text{日}50\text{ETF}\text{收盘价}] / [11\text{月}28\text{日}50\text{ETF}\text{收盘价} - \text{现金红利}(\text{即每份}0.053\text{元})]$

2、新行权价格= $\text{原行权价格} \times \text{原合约单位} / \text{新合约单位}$

调整后的合约单位，按照四舍五入原则取整数；调整后的行权价

格，按照四舍五入的原则取小数，保留 3 位小数。

3、合约交易代码的第 12 位由“M”调整为“A”，表示期权合约发生首次调整，第 13 至 17 位的行权价格不变，仍为原行权价格。

4、合约简称中的行权价格调整为新行权价格，并把最后的标志位调整为“A”（原来无标志位）。

（二）交易结算事宜的调整。50ETF 期权合约发生上述调整后，交易与结算按照调整后的合约条款进行。11 月 29 日，涨跌停价格和开仓保证金均以调整后的合约单位、前结算价格作为计算依据。其中，调整后的合约前结算价格=原合约结算价格×原合约单位/新合约单位。日终，中国结算按照调整后的合约单位及行权价格计算并收取维持保证金、锁定备兑证券。

（三）备兑持仓事宜。11 月 29 日，投资者持有的期权合约备兑持仓可能会因为合约调整而发生备兑证券不足的情况，投资者需要按新合约单位计算并补足备兑证券。若未及时补足，期权经营机构应依据相关约定及时强行平仓。若仍未及时补足或平仓，中国结算将按相关规则进行强行平仓。

（四）合约加挂、摘牌事宜。50ETF 期权合约发生上述调整后，本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，本所于下一交易日对该合约予以摘牌。

二、挂牌新的期权合约

11 月 29 日，本所将按照 50ETF 分红后除权除息价格重新挂牌新

的各个月份合约，新挂合约包括认购、认沽两种类型，四个到期月份（2016年12月、2017年1月、3月和6月），五个行权价格（1个平值、2个实值、2个虚值），共40个合约。新挂合约的合约单位均为10000，合约交易代码的第12位为“M”，合约简称的最后无标志位。

三、期权经营机构应及时提醒客户50ETF分红及50ETF期权合约调整事宜，向客户做好解释工作，并重点关注备兑持仓客户，提醒客户在规定时间内准备好足额的备兑证券，保障本次50ETF期权合约调整工作的顺利进行。

特此通知。

上海证券交易所衍生品业务部

2016年11月11日

衍生品业务部

