**关于嘉实沪深300ETF期权合约调整的公告**

根据嘉实基金管理有限公司公告，嘉实沪深300交易型开放式指数证券投资基金（以下简称嘉实沪深300ETF）将以2020年9月11日为权益登记日进行分红。根据《深圳证券交易所股票期权试点交易规则》（以下简称《交易规则》）有关规定，深圳证券交易所（以下简称本所）将于2020年9月14日对嘉实沪深300ETF期权合约品种（以下简称嘉实沪深300ETF期权）所有未到期合约进行相应调整，并重新挂牌新的嘉实沪深300ETF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）合约代码的第19位调整为“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”。

（三）行权价格、合约单位按照《交易规则》第3.4条规定的公式进行如下调整：

合约单位调整：

|  |  |  |
| --- | --- | --- |
| 序号 | 原合约单位 | 调整后合约单位 |
| 1 | 10000 | 10330 |

行权价格调整：

|  |  |  |
| --- | --- | --- |
| 序号 | 原行权价格 | 调整后行权价格 |
|  | 3.200 | 3.098 |
|  | 3.300 | 3.195 |
|  | 3.400 | 3.292 |
|  | 3.500 | 3.388 |
|  | 3.600 | 3.485 |
|  | 3.700 | 3.582 |
|  | 3.800 | 3.679 |
|  | 3.900 | 3.776 |
|  | 4.000 | 3.872 |
|  | 4.100 | 3.969 |
|  | 4.200 | 4.066 |
|  | 4.300 | 4.163 |
|  | 4.400 | 4.260 |
|  | 4.500 | 4.356 |
|  | 4.600 | 4.453 |
|  | 4.700 | 4.550 |
|  | 4.800 | 4.647 |
|  | 4.900 | 4.744 |
|  | 5.000 | 4.840 |
|  | 5.250 | 5.082 |
|  | 5.500 | 5.325 |
|  | 5.750 | 5.567 |
|  | 6.000 | 5.809 |

（四）合约前结算价按照《交易规则》第3.4条规定的公式进行调整。

**二、重新挂牌新的嘉实沪深300ETF期权合约**

按照《交易规则》第3.3条规定，本所于2020年9月14日对除息后的嘉实沪深300ETF重新挂牌2020年9月、2020年10月、2020年12月、2021年3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个嘉实沪深300ETF期权合约。

**三、特别提醒事项**

（一）未到期的嘉实沪深300ETF期权合约调整后成为非标准合约，其交易与结算按照调整后的合约条款进行。

（二）9月14日，对非标准合约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证券。

（三）9月14日，持有非标准合约备兑仓的投资者，应当按照调整后的合约单位及时补足备兑证券或对不足部分自行平仓。

（四）9月14日日终，中国证券登记结算有限责任公司深圳分公司（以下简称中国结算深圳分公司）将根据调整后的合约单位和投资者备兑持仓情况，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。备兑交割锁定后仍出现备兑证券数量不足的，中国结算深圳分公司按未锁定差额计算需转普通仓数量，并收取相应维持保证金。

（五）本所不再对非标准合约加挂新到期月份与行权价格的合约。另外，如出现非标准合约的持仓数量日终为零的情形，本所将于下一交易日对该合约予以摘牌。

本所提醒各期权经营机构和广大投资者注意投资风险，密切关注嘉实沪深300ETF期权合约调整事宜，并做好各项调整准备。

特此公告

深圳证券交易所

2020年9月11日