**附件**

**上海期货交易所黄金期货期权合约**

**（征求意见稿）**

|  |  |
| --- | --- |
| 合约标的物 | 黄金期货合约（1000克） |
| 合约类型 | 看涨期权，看跌期权 |
| 交易单位 | 1手黄金期货合约 |
| 报价单位 | 元（人民币）/克 |
| 最小变动价位 | 0.02元/克 |
| 涨跌停板幅度 | 与黄金期货合约涨跌停板幅度相同 |
| 合约月份 | 与上市标的期货合约相同 |
| 交易时间 | 上午9:00-11:30下午13:30-15:00及交易所规定的其他时间 |
| 最后交易日 | 标的期货合约交割月前第一月的倒数第五个交易日，交易所可以根据国家法定节假日等调整最后交易日 |
| 到期日 | 同最后交易日 |
| 行权价格 | 行权价格覆盖黄金期货合约上一交易日结算价上下浮动1.5倍当日涨跌停板幅度对应的价格范围。行权价格≤200元/克，行权价格间距为2元/克；200元/克＜行权价格≤400元/克，行权价格间距为4元/克；行权价格＞400元/克，行权价格间距为8元/克 |
| 行权方式 | 欧式。到期日买方可以在15:30之前提交行权申请、放弃申请 |
| 交易代码 | 看涨期权：AU-合约月份-C-行权价格  看跌期权：AU-合约月份-P-行权价格 |
| 上市交易所 | 上海期货交易所 |