|  |
| --- |
| **关于玉米期权上市交易有关事项的通知**  |
| 大商所发〔2019〕30号 |
|  |
| 各会员单位及相关主体：[中国证监](http://undefined)[会已](http://undefined)[正式批准大连商品交易所（以下简称](http://undefined)“本所”）开展[玉米期权交](http://undefined)易。为确保玉米期权上市交易平稳运行，现将有关事项通知如下：一、上市交易时间[玉米期权合约自](http://undefined)2019年1月28日（星期一）起上市交易，上市当日8:55-9:00集合竞价，9:00开盘，交易时间与玉米期货合约一致，不进行夜盘交易。二、上市交易合约月份首批上市交易的玉米期权合约月份为2019年5月、7月、9月、11月和2020年1月，[对应的标的期货为](http://undefined)C1905、C1907、C1909、C1911和C2001，共5个期权合约系列。 三、挂盘基准价本所根据BAW美式期货期权定价模型计算新上市期权合约的挂盘基准价。模型中的利率取一年期定期存款基准利率，为1.5%，波动率取标的期货合约90天的历史波动率。新上市合约的挂盘基准价于上市前一个交易日结算后，通过会员服务系统随结算数据一同发布，[也可通过本所网站查询](http://undefined)。四、交易指令期权合约上市初期本所仅提供限价指令和限价止损（盈）指令，每次最大下单数量为100手。五、行权与履约[在每个交易日的交易时间以及到期日的](http://undefined)15:00-15:30，客户可以提交“行权”、“双向期权持仓对冲平仓”、“行权后双向期货持仓对冲平仓”和“履约后双向期货持仓对冲平仓”申请。在到期日的交易时间以及到期日的15:00-15:30客户可以提交“取消期权自动行权申请”。六、持仓限额管理期权合约与期货合约不合并限仓。非期货公司会员和客户持有的某月份期权合约中所有看涨期权的买持仓量和看跌期权的卖持仓量之和、看跌期权的买持仓量和看涨期权的卖持仓量之和，在上市初期分别不超过10000手。具有实际控制关系的账户按照一个账户管理。 七、相关费用玉米期权合约交易手续费标准为0.6元/手；玉米期权行权（履约）手续费标准为0.6元/手；本所可以根据市场情况对手续费标准进行调整并公布。八、期权交易权限开通投资者可以根据《大连商品交易所期权投资者适当性管理办法》向期货公司申请开通期权交易权限，期权交易权限不区分品种，已经开通期权交易权限的投资者可以直接参与玉米期权交易。九、合约询价本所期权交易实行做市商制度。非期货公司会员和客户可以在非主力合约系列的期权合约上向做市商询价。非主力合约系列的期权合约是指除主力合约系列以外的所有期权合约，主力合约系列以本所网站及会员服务系统发布为准。询价请求应当指明期权合约代码，对同一期权合约的询价时间间隔不应低于60秒。请各会员单位及相关主体做好玉米期权上市的各项准备工作，注意风险防范，确保市场平稳运行。特此通知。 大连商品交易所 2019年1月21日 |