

### 附件 3：交易所通知

## 关于液化石油气期权合约上市交易有关事项的通知

大商所发〔2020〕129 号

各会员单位：

中国证监会已正式批准大连商品交易所（以下简称“本所”）开展液化石油气期权交易。为确保液化石油气期权合约上市交易后的平稳运行，现将液化石油气期权合约上市交易有关事项通知如下：

### 一、上市交易时间

液化石油气期权合约自液化石油气期货合约正式挂牌交易后下一交易日上市，交易时间与液化石油气期货合约交易时间一致。

### 二、上市交易合约

首批上市交易合约为以 PG2011、PG2012、PG2101、PG2102 和 PG2103 期货合约为标的的液化石油气期权合约。

### 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，波动率根据液化石油气现货历史波动率及期现货市场运行特点等因素确定。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。

#### 四、交易指令

液化石油气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。液化石油气期权合约的交易指令每次最大下单数量与液化石油气期货合约交易指令每次最大下单数量相同，即 1,000 手。

#### 五、行权与履约

在每个交易日的交易时间以及到期日的 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

液化石油气期权合约与液化石油气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 8,000 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

液化石油气期权合约交易手续费标准为 1 元/手；液化石油气期权行权（履约）手续费标准为 1 元/手。

#### 八、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。同一交易编码在一个期权品种上每日询价次数不能超过 500 次。

请各会员单位做好液化石油气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

2020 年 3 月 25 日