

关于推出期权对锁等组合策略保证金优惠的通知

大商所发〔2020〕237号

各会员单位：

为进一步提升资金使用效率、降低期权交易成本，我所将于2020年6月24日结算时起新增期权对锁、买入垂直价差、卖出垂直价差、买入期权期货组合策略保证金优惠。请各会员单位务必于2020年6月24日前将交易、结算系统升级到支持上述期权组合策略的版本，以免影响会员单位交易结算等业务的正常进行。为支持上述新业务，自2020年6月24日结算时起，会员服务系统结算文件中将开始提供“保证金优惠参数表”及“保证金优惠参数表（兼容版）”两版文件。系统升级和结算文件使用详情请与相关系统供应商确认。

特此通知。

附件：组合优惠参数及有关业务说明.docx

大连商品交易所

2020年6月18日