

关于聚丙烯、聚氯乙烯和线型低密度聚乙烯期权上市交易有关事项的通知

大商所发〔2020〕256号

各有关单位：

中国证监会已批准大连商品交易所（以下简称“本所”）组织开展聚丙烯、聚氯乙烯和线型低密度聚乙烯（以下简称“三个化工品”）期权交易，现将有关事项通知如下：

一、上市交易时间

三个化工品期权自2020年7月6日（星期一）起上市交易，当日8:55-9:00集合竞价，9:00开盘。7月6日（星期一）当晚起，三个化工品期权开展夜盘交易，其交易时间与标的期货一致。

二、上市交易合约

首批上市交易三个化工品期权合约对应标的合约月份为2020年9月（PP2009、V2009、L2009）、2020年10月（PP2010、V2010、L2010）、2020年11月（PP2011、V2011、L2011）、2020年12月（PP2012、V2012、L2012）、2021年1月（PP2101、V2101、L2101）、2021年2月（PP2102、V2102、L2102）、2021年3月（PP2103、V2103、L2103）、2021年4月（PP2104、V2104、L2104）、2021年5月（PP2105、V2105、L2105）和2021年6月（PP2106、V2106、L2106），共10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，波动率取标的期货合约90天的历史波动率。新上市三个化工品期权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

三个化工品期权上市初期本所仅提供限价指令和限价止损（盈）指令。三个化工品期权交易指令每次最大下单数量与标的期货交易指令每次最大下单数量相同，均为1000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

三个化工品期权与标的期货分开限仓。非期货公司成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，分别不超过标的期货合约一般月份的最低持仓限额。其中，聚丙烯期权不超过20000手，聚氯乙烯期权不超过20000手，线型低密度聚乙烯期权不超过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

三个化工品期权交易手续费标准均为0.5元/手；三个化工品期权行权（履约）手续费标准均为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做市商持续报价合约上向做市商询价。做市商持续报价合约指主力合约系列中临近且大于等于上一交易日结算价的 8 个行权价格和临近且小于上一交易日结算价的 7 个行权价格对应的期权合约。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上限为 500 次。

特此通知。

大连商品交易所
2020 年 6 月 29 日