

大连商品交易所文件

大商所发〔2023〕153号

关于乙二醇期权和苯乙烯期权上市交易有关事项的通知

各有关单位：

中国证监会已同意大连商品交易所（以下简称“大商所”）乙二醇期权和苯乙烯期权注册，现将有关事项通知如下：

一、上市交易时间

乙二醇期权和苯乙烯期权自2023年5月15日（周一）起上市交易。上市当日8:55-9:00集合竞价，9:00开盘。5月15日（周一）当晚，乙二醇期权和苯乙烯期权开展夜盘交易。之后，乙二醇期权和苯乙烯期权交易时间与标的期货一致。

二、上市交易合约

首日挂牌的乙二醇期权和苯乙烯期权合约月份分别从EG2307、EB2307开始。乙二醇期权首日挂牌10个合约月份，分别为EG2307、EG2308、EG2309、EG2310、EG2311、EG2312、

EG2401、EG2402、EG2403、EG2404；苯乙烯期权首日挂牌 10 个合约月份，分别为 EB2307、EB2308、EB2309、EB2310、EB2311、EB2312、EB2401、EB2402、EB2403、EB2404。

三、挂牌基准价

根据 BAW 美式期权定价模型计算乙二醇期权和苯乙烯期权合约的挂牌基准价，模型中的利率取最新的一年期定期存款基准利率，波动率取标的期货合约 90 天历史波动率。新上市乙二醇期权和苯乙烯期权合约的挂牌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，也可通过大商所网站（www.dce.com.cn）查询。

四、交易指令

可以使用限价指令和限价止损（盈）指令开展乙二醇期权和苯乙烯期权交易，每次最大下单数量与标的期货相同。

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

乙二醇期权持仓限额为 8000 手，苯乙烯期权持仓限额为 12000 手。乙二醇期权和苯乙烯期权与标的期货分开限仓。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，分别不得超过期权品种的持仓限额。具有实际控制关系的持仓合并计算。

七、相关费用

乙二醇期权和苯乙烯期权交易手续费为 0.5 元/手，行权（履约）手续费为 1 元/手。

八、做市商制度及合约询价

乙二醇期权和苯乙烯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以大商所网站发布为准。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 200 次。

请各有关单位做好乙二醇期权和苯乙烯期权上市交易准备工作，加强风险防范，确保市场平稳运行。

特此通知。

大连商品交易所

2023 年 4 月 19 日

