

# 关于碳酸锂期货、期权上市交易有关事项的通知

尊敬的客户：

您好，中国证监会已同意广州期货交易所碳酸锂期货、期权注册。现将碳酸锂期货、期权合约上市交易有关事项通知如下：

## 一、上市交易时间

碳酸锂期货合约自 2023 年 7 月 21 日（星期五）起上市交易。

碳酸锂期权合约自 2023 年 7 月 24 日（星期一）起上市交易。

交易时间：每周一至周五（北京时间 法定节假日除外）9:00～10:15，10:30～11:30 和 13:30～15:00，及交易所规定的其他时间。

## 二、上市交易合约

碳酸锂期货：首批上市交易合约为 LC2401、LC2402、LC2403、LC2404、LC2405、LC2406 和 LC2407。

碳酸锂期权：首批上市交易合约为以 LC2401、LC2402、LC2403、LC2404、LC2405、LC2406 和 LC2407 期货合约为标的的碳酸锂期权合约。

## 三、交易指令

碳酸锂期货合约支持下列指令：限价指令、市价指令、市价止损（盈）指令、限价止损（盈）指令和套利交易指令。

碳酸锂期权合约上市初期仅提供限价指令和限价止损（盈）指令。碳酸锂期权合约的交易指令每次最大下单数量为 100 手。

## 四、交易保证金水平及涨跌停板幅度

### 1、交易所标准

上市首日，碳酸锂期货合约交易保证金水平为合约价值的 9%，涨跌停板幅度为挂牌基准价的 14%。如合约有成交，则下一交易日起，交易保证金水平为合约价值的 9%，涨跌停板幅度为上一交易日结算价的 7%；如合约无成交，则下一交易日继续按照上市首日的交易保证金水平和涨跌停板幅度执行。关于交易保证金水平和涨跌停板幅度的其他规定，按照《广州期货交易所风险管理办法》执行。

## 2、公司保证金收取标准

公司默认收取的保证金比例为在交易所保证金比例基础上加 4%（上市首日所有客户该品种的公司保证金比例为 21%）。

## 五、交易手续费

碳酸锂期货合约交易手续费为成交金额的万分之二点四，双边收取交易手续费。

碳酸锂期权合约交易手续费标准为 9 元/手，双边收取交易手续费；碳酸锂期权行权（履约）手续费标准为 9 元/手。

## 六、行权与履约

在每个交易日的交易时间以及到期日的 15:00 前，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 15:00 前，客户可以提交“取消期权自动行权申请”。

## 七、合约询价

期权交易实行做市商制度。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。

八、其它未提及的相关事项请关注交易所官网通知。

国新国证期货有限责任公司

2023 年 7 月 18 日