

关于挂牌烧碱期权有关事项的公告

〔2023〕87号

中国证监会已同意郑州商品交易所（以下简称郑商所）烧碱期权注册。现将烧碱期权挂牌有关事项公告如下：

一、上市交易时间

烧碱期权自2023年9月15日（星期五）起上市交易，当日20:55—21:00为集合竞价时间。

二、上市交易合约

首日上市交易合约为标的月份2405、2406的烧碱期权系列合约。

三、挂牌基准价

郑商所根据期权定价模型计算各期权合约基准价。其中波动率参数参考烧碱现货价格历史波动率等因素综合确定，利率参数取一年期贷款市场报价利率（LPR）。挂牌基准价于9月15日结算后在郑商所网站“交易数据”栏目公布。

四、最大下单数量

限价指令的每次最大下单数量为100手，市价指令的每次最大下单数量为2手。

五、持仓限额

非期货公司会员和客户所持有的按单边计算的某月份烧碱期权合约投机持仓限额为3000手，投机与套利持仓之

和不得超过投机持仓限额的 2 倍。

烧碱期权做市商持仓限额为 10000 手。

六、手续费收取标准

烧碱期权交易手续费标准为 2.0 元/手，免收日内平今仓交易手续费。行权（履约）手续费收取标准与期权交易手续费相同，行权（履约）后新建期货持仓不收取手续费。

七、询价限制

非期货公司会员和客户可以向做市商询价，对同一期权合约的询价时间间隔不得小于 60 秒。

烧碱期权合约最优买卖报价价差小于等于下表差价时，不得询价。

申报买价（元/吨）	价差（元/吨）
申报买价 < 50	2
$50 \leq$ 申报买价 < 100	7
$100 \leq$ 申报买价 < 150	12
$150 \leq$ 申报买价 < 250	15
$250 \leq$ 申报买价	20

特此公告。

郑州商品交易所

2023 年 9 月 8 日