

关于挂牌短纤、纯碱、锰硅、硅铁、尿素及 苹果期权合约有关事项的公告

〔2023〕110号

中国证监会已同意郑州商品交易所（以下简称郑商所）短纤、纯碱、锰硅、硅铁、尿素及苹果期权注册，现将挂牌有关事项公告如下：

一、上市交易时间

短纤、纯碱、锰硅、硅铁、尿素及苹果期权自2023年10月20日（星期五）起上市交易，当日8:55-9:00为集合竞价时间。

二、上市交易合约

首日挂牌合约包括标的月份为2401及2402的短纤期权合约，标的月份为2401、2402、2403、2404、2405、2406、2407、2408及2409的纯碱期权合约，标的月份为2401、2402、2403及2405的锰硅期权合约，标的月份为2401、2402及2403的硅铁期权合约，标的月份为2401、2402、2403及2405的尿素期权合约，标的月份为2401、2403及2405的苹果期权合约。

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，

波动率参数根据短纤、纯碱、锰硅、硅铁、尿素及苹果期货合约历史波动率等因素确定，利率参数取一年期贷款市场报价利率（LPR）。挂牌基准价于10月19日结算后在郑商所网站“交易数据”栏目公布。

四、夜盘交易时间

10月20日当晚起，短纤、纯碱期权合约开展夜盘交易，交易时间与短纤、纯碱期货合约一致。锰硅、硅铁、尿素、苹果期权合约无夜盘交易。

五、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。

六、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短纤、硅铁、尿素期权合约投机持仓限额均为10000手，纯碱期权合约投机持仓限额为20000手，锰硅期权合约投机持仓限额为30000手，苹果期权合约投机持仓限额为1000手，投机与套利持仓之和不得超过投机持仓限额的2倍。

短纤、硅铁、尿素期权做市商持仓限额均为20000手，纯碱期权做市商持仓限额为40000手，锰硅期权做市商持仓限额为30000手，苹果期权做市商持仓限额为3000手。

七、手续费收取标准

短纤、纯碱、锰硅、硅铁期权交易手续费收取标准为0.5

元/手，尿素、苹果期权交易手续费收取标准为1元/手，均免收日内平今仓交易手续费。短纤、纯碱、锰硅、硅铁、尿素及苹果期权行权（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。

八、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。

短纤、纯碱、锰硅、硅铁、尿素及苹果期权合约最优买卖报价价差小于等于下表价差时，不得询价。

品种	申报买价（元/吨）	价差（元/吨）
短纤期权	申报买价 < 50	5
	50 ≤ 申报买价 < 150	7
	150 ≤ 申报买价 < 350	18
	350 ≤ 申报买价 < 500	35
	500 ≤ 申报买价	40
纯碱期权	申报买价 < 50	2
	50 ≤ 申报买价 < 100	7
	100 ≤ 申报买价 < 150	12
	150 ≤ 申报买价 < 250	15
	250 ≤ 申报买价	20
锰硅期权	申报买价 < 100	10
	100 ≤ 申报买价 < 200	14

	$200 \leq \text{申报买价} < 400$	24
	$400 \leq \text{申报买价} < 800$	40
	$800 \leq \text{申报买价}$	64
硅铁期权	申报买价 < 100	10
	$100 \leq \text{申报买价} < 200$	14
	$200 \leq \text{申报买价} < 400$	24
	$400 \leq \text{申报买价} < 800$	40
	$800 \leq \text{申报买价}$	64
尿素期权	申报买价 < 50	2
	$50 \leq \text{申报买价} < 100$	7
	$100 \leq \text{申报买价} < 150$	12
	$150 \leq \text{申报买价} < 250$	15
	$250 \leq \text{申报买价}$	20
苹果期权	申报买价 < 100	12
	$100 \leq \text{申报买价} < 200$	14
	$200 \leq \text{申报买价} < 500$	24
	$500 \leq \text{申报买价} < 1000$	50
	$1000 \leq \text{申报买价}$	80

特此公告。

郑州商品交易所

2023年10月13日