

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 ≤ 申报买价 < 400	24
	400 ≤ 申报买价 < 800	40
	800 ≤ 申报买价	64
硅铁期权	申报买价 < 100	10
	100 ≤ 申报买价 < 200	14
	200 ≤ 申报买价 < 400	24
	400 ≤ 申报买价 < 800	40
	800 ≤ 申报买价	64
尿素期权	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
苹果期权	申报买价 < 100	12
	100 ≤ 申报买价 < 200	14
	200 ≤ 申报买价 < 500	24
	500 ≤ 申报买价 < 1000	50
	1000 ≤ 申报买价	80

特此公告。

郑州商品交易所
2023年10月13日