

# 关于挂牌红枣、玻璃期权合约有关事项的公告

[2024] 67号

中国证监会已同意郑州商品交易所（以下简称郑商所）红枣、玻璃期权注册，现将挂牌有关事项公告如下：

## 一、上市交易时间

红枣、玻璃期权自 2024 年 6 月 21 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 2409、2412 及 2501 的红枣期权合约，标的月份为 2409、2410 及 2501 的玻璃期权合约。

## 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，波动率参数根据红枣、玻璃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 6 月 20 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

6 月 21 日当晚起，玻璃期权合约开展夜盘交易，交易时间与玻璃期货合约一致。红枣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红枣期权合

约投机持仓限额为 600 手，玻璃期权合约投机持仓限额为 20000 手，投机与套利持仓之和不得超过投机持仓限额的 2 倍。

红枣期权做市商的持仓限额为 1500 手，玻璃期权做市商的持仓限额为 40000 手。

## 七、手续费收取标准

红枣期权交易手续费收取标准为 1 元/手，玻璃期权交易手续费收取标准为 0.5 元/手，均免收日内平今仓交易手续费。红枣、玻璃期权行权（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。

红枣、玻璃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）
红枣期权	申报买价 < 150	15
	150 ≤ 申报买价 < 300	21
	300 ≤ 申报买价 < 600	36
	600 ≤ 申报买价 < 1200	60
	1200 ≤ 申报买价	96
玻璃期权	申报买价 < 25	2
	25 ≤ 申报买价 < 75	3.5
	75 ≤ 申报买价 < 125	9
	125 ≤ 申报买价 < 200	12.5
	200 ≤ 申报买价	16

特此公告。

郑州商品交易所  
2024 年 6 月 11 日