

大连商品交易所文件

大商所发〔2024〕365号

关于鸡蛋、玉米淀粉和生猪期权上市交易有关事项的通知

各有关单位：

中国证监会已同意大连商品交易所（以下简称“大商所”）鸡蛋、玉米淀粉和生猪期权注册，现将上市交易有关事项通知如下：

一、上市交易时间

鸡蛋、玉米淀粉和生猪期权自2024年8月23日（周五）起上市交易。当日8:55-9:00集合竞价，9:00开盘。8月23日（周五）当晚，玉米淀粉期权开展夜盘交易。

二、上市交易合约

首日挂牌的鸡蛋、玉米淀粉和生猪期权合约月份分别从JD2501、CS2501和LH2501开始。鸡蛋期权首日挂牌合约月份分别为JD2501、JD2502、JD2503、JD2504、JD2505、JD2506、

JD2507。玉米淀粉期权首日挂牌合约月份分别为 CS2501、CS2503、CS2505、CS2507。生猪期权首日挂牌合约月份分别为 LH2501、LH2503、LH2505、LH2507。

三、挂牌基准价

根据 BAW 美式期权定价模型计算鸡蛋、玉米淀粉和生猪期权合约的挂牌基准价，模型中的利率取最新的一年期定期存款基准利率，波动率取标的期货合约历史波动率。挂牌基准价于上市前一个交易日结算后，通过会员服务系统随结算数据一同发布，也可通过大商所网站（www.dce.com.cn）查询。

四、交易指令

鸡蛋、玉米淀粉和生猪期权交易可以使用限价指令和限价止损（盈）指令，每次最大下单数量与标的期货相同。

五、行权与履约

在每个交易日的交易时间以及到期日的 15:00-15:30，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。在到期日的交易时间以及到期日的 15:00-15:30，客户可以提交“取消期权自动行权申请”。

六、持仓限额

鸡蛋期权持仓限额为 400 手，玉米淀粉期权持仓限额为 15000 手，生猪期权持仓限额为 125 手。鸡蛋、玉米淀粉和生猪期权与标的期货分开限仓。非期货公司会员和客户持有的某月

份期权合约中所有看涨期权的买持仓量和看跌期权的卖持仓量之和、看跌期权的买持仓量和看涨期权的卖持仓量之和，分别不得超过期权品种的持仓限额。具有实际控制关系的持仓合并计算。

七、组合保证金

自 2024 年 8 月 23 日结算时起，鸡蛋期权 2501 合约月份、玉米淀粉期权 2501 合约月份及生猪期权 2501 合约月份的合约参与组合保证金优惠。

八、相关费用

鸡蛋期权交易手续费为 0.5 元/手，玉米淀粉期权交易手续费为 0.2 元/手，生猪期权交易手续费为 1.5 元/手。鸡蛋、玉米淀粉和生猪期权行权（履约）手续费收取标准与期权交易手续费相同。

鸡蛋期权套期保值交易手续费为 0.25 元/手，玉米淀粉期权套期保值交易手续费为 0.1 元/手，生猪期权套期保值交易手续费为 0.75 元/手。

自 2024 年 10 月 25 日交易时（即 10 月 24 日晚夜盘）起对鸡蛋、玉米淀粉和生猪期权合约收取申报费，适用对象及收费标准与我所已上市期权品种一致（见下表）。申报费按日收取，期权合约申报费按合约月份统计。

表：鸡蛋、玉米淀粉和生猪期权申报费收费标准表

期权品种	收费标准：元/笔				
	信息量 ≤4000 笔	4000 笔< 信息量 ≤8000 笔； OTR≤2	4000 笔<信 息量≤8000 笔； OTR>2	信息量> 8000 笔； OTR≤2	信息量> 8000 笔； OTR>2
鸡蛋期权、 玉米淀粉期权、 生猪期权	0	0	1	2	5

合约申报费=∑（客户或者非期货公司会员当日在合约上各档位信息量×该档位收费标准）。

信息量=报单笔数+撤单笔数；报单成交比（OTR）=信息量/有成交报单笔数-1。

同一客户在不同期货公司会员处开立多个交易编码的，或者具有实际控制关系的客户和非期货公司会员，报单笔数、撤单笔数、有成交报单笔数等指标合并计算。

九、做市商制度及合约询价

鸡蛋、玉米淀粉和生猪期权交易实行做市商制度。非期货公司会员和客户可以在非做市商持续报价合约上向做市商询价，做市商持续报价合约以大商所网站发布为准。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上限为 200 次。

请各有关单位做好鸡蛋、玉米淀粉和生猪期权上市交易准备工作，加强风险防范，确保市场平稳运行。

特此通知。

大连商品交易所

2024年8月9日