

关于挂牌瓶片期权合约有关事项的公告

[2024] 176号

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

一、上市交易时间

瓶片期权自 2024 年 12 月 27 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 2503、2504 及 2505 的瓶片期权合约。

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，波动率参数根据瓶片期现货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 12 月 26 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

12 月 27 日当晚起，瓶片期权合约开展夜盘交易，交易时间与瓶片期货合约一致。

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瓶片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。

瓶片期权做市商的持仓限额为 10000 手。

七、手续费收取标准

瓶片期权交易手续费收取标准为 1 元/手，免收日内平今仓交易手续费。瓶片期权行权（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。

瓶片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。

申报买价（元/吨）	价差（元/吨）
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<600	35
600≤申报买价	48

特此公告。

郑州商品交易所
2024年12月18日