

# 大连商品交易所玉米期权仿真交易 业务提示

为确保仿真环境玉米期权的平稳运行，现将有关事项通知如下：

## 一、合约月份

1、3、5、7、9、11月

## 二、交易时间

每周一至周五上午 9:00-11:30，下午 13:30-15:00，以及交易所规定的其他时间。

## 三、行权价格

行权价格范围覆盖玉米期货合约上一交易日结算价上下浮动 1.5 倍当日涨跌停板幅度对应的价格范围。行权价格  $\leq 1000$  元/吨，行权价格间距为 10 元/吨； $1000$  元/吨  $<$  行权价格  $\leq 3000$  元/吨，行权价格间距为 20 元/吨；行权价格  $> 3000$  元/吨，行权价格间距为 40 元/吨。

## 四、交易指令

提供限价指令和限价止损（盈）指令，每次最大下单数量为 100 手。

## 五、挂盘基准价

根据 BAW 美式期货期权定价模型计算新上市期权合约的挂盘基准价。模型中的利率取一年期定期存款基准利率为

1.5%，波动率取期货合约 90 天的历史波动率。

## 六、最后交易日和到期日

最后交易日为标的期货合约交割月份前一个月的第 5 个交易日，期权到期日同最后交易日。

## 七、行权与履约

客户在每个交易日的交易时间以及到期日 15:00-15:30，可以通过会员单位提供的交易终端提交行权或取消自动行权申请；客户办理如下业务，应当委托会员通过本所会员服务系统提交申请：

业务类型	申请时间
行权后双向期货持仓对冲平仓申请	交易时间以及到期日 15:00-15:30
履约后双向期货持仓对冲平仓申请	交易时间
双向期权持仓对冲平仓申请	交易时间以及到期日 15:00-15:30

## 八、涨跌停板幅度

与玉米期货合约涨跌停板幅度相同。

## 九、持仓限额管理

期权合约与期货合约不合并限仓。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，分别不超过 10000 手。具有实际控制关系的账户按照一个账户管理。

## 十、相关费用

玉米期权合约交易手续费标准为 0.6 元/手；玉米期权行

权（履约）手续费标准为 0.6 元/手。

## 十一、合约询价

玉米期权仿真交易实行做市商制度。非期货公司会员和客户可以在非主力合约系列的期权合约上向做市商询价，非主力合约系列的期权合约是指除主力合约系列以外的所有期权合约，主力合约系列以会员服务系统发布为准。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。

## 十二、仿真交易联系方式

技术运维中心 0411-84807179

清算部 0411-84806136

监察部 0411-84808791

交易部 0411-84808268（做市商业业务）

0411-84808532