

关于挂牌红枣、玻璃期权合约有关事项的公告

尊敬的客户：

根据郑州商品交易所通知《关于挂牌红枣、玻璃期权合约有关事项的公告》（〔2024〕67号），红枣、玻璃期权自2024年6月21日（星期五）起上市交易，现就有关事项通知如下：

一、交易时间

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

我公司红枣期权交易手续费收取标准为 5 元/手，玻璃期权交易手续费收取标准为 2.5 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

请各位投资者密切关注市场变化，有效管理账户风险，理性投资，谨慎运作。

特此通知。

兴业期货有限公司
二〇二四年六月十二日