

关于烧碱期货、烧碱期权上市交易的通知

尊敬的客户：

根据郑州商品交易所“关于挂牌烧碱期货有关事项的公告”、“关于挂牌烧碱期权有关事项的公告”及“关于发布烧碱期货、期权合约及期货业务细则的公告”等相关通知，烧碱期货和期权自 2023 年 9 月 15 日起在郑州商品交易所上市交易，现将烧碱期货和期权上市交易有关事项通知如下：

一、上市时间

烧碱期货自 2023 年 9 月 15 日（星期五）起上市交易。上市当日集合竞价时间为上午 8:55—9:00，交易时间为 9:00—11:30 和 13:30—15:00。9 月 15 日当晚起开展夜盘交易，夜盘交易时间为 21:00—23:00。

烧碱期权自 2023 年 9 月 15 日（星期五）起上市交易，当日 20:55—21:00 为集合竞价时间。

二、上市交易合约

首批上市交易的烧碱期货合约 SH2405、SH2406、SH2407、SH2408 和 SH2409。

首日上市交易的烧碱期权合约标的月份 2405、2406 的烧碱期权系列合约。

三、烧碱期权挂盘基准价

郑商所根据期权定价模型计算各期权合约基准价。其中波动率参数参考烧碱现货价格历史波动率等因素综合确定，利率参数取一年期贷款市场报价利率（LPR）。挂牌基准价于 9 月 15 日结算后在郑商所网站“交易数据”栏目公布。

四、烧碱期权最大下单数量

烧碱期权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。

五、烧碱期权持仓限额

非期货公司会员和客户所持有的按单边计算的某月份烧碱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。

烧碱期权做市商持仓限额为 10000 手。

六、上市当日涨跌停板幅度和交易保证金

根据《郑州所期货交易风险控制管理办法》有关规定，烧碱期货合约交易保证金标准为 9%，涨跌停板幅度为±7%，烧碱期货合约上市当日涨跌停板幅度为合约挂牌基准价的±14%。我公司收取客户交易对烧碱期货合约的最低保证金比例为：上市当日交易所保证金比例+10%，日常交易所保证金+7%。

七、交易手续费

我公司按照成交金额的万分之四收取烧碱期货交易手续费。按照 8 元/手收取烧碱期权交易、行权（履约）手续费。客户参与烧碱期货和期权交易的，视为同意公司手续费收取标准。

八、烧碱期权询价限制

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。

烧碱期权合约最优买卖报价价差小于等于下表差价时，不得询价。

申报买价（元/吨）	价差（元/吨）
申报买价<50	2
50≤申报买价<100	7
100≤申报买价<150	12
150≤申报买价<250	15
250≤申报买价	20

九、行权与履约

在每个交易日的交易时间以及到期日的 15:00-15:15，客户可以通过交易客户端自行提交行权申请。

在到期日的交易时间以及到期日的 15:00-15:15，客户可以通过交易客户端自行提交放弃行权申请。

当客户不能通过交易客户端提交上述申请时，可通过电话委托、

书面等应急方式向所在营业部提交上述申请。

本公司在交易所规定基础上，适当提前到期日申请时间，以保证顺利完成客户批量申请操作，客户于到期日超过 15:15 向本公司提交上述申请的，客户应自行承担由此造成的全部损失。行权履约时间及要求发生变更的，请及时关注公司官网公告、通知。

到期日行权时，客户应充分考虑行权所需的资金（包括行权手续费和相应期货合约持仓的交易保证金等），在账户中备留足额资金，若出现行权资金不足，应在到期日 15:00 前补足，以确保行权顺利进行。若到期日结算时期权持仓符合期货交易所自动行权条件，但经本公司审核客户资金不足时，公司有权根据客户资金状况向交易所提交批量部分放弃、批量全部放弃行权申请，客户需承担由此产生的全部后果。

十、期权交易权限开通

客户应联系本公司分支机构及 IB 营业部办理期权交易权限开通手续，并提供相关证明材料。本公司依据证监会、郑商所及公司期权适当性管理相关要求对客户进行适当性评估通过后，方能为其开通期权交易权限。期权交易权限开通流程以及适当性具体标准详见公司官网。

已经开通郑商所期权交易权限的客户可以直接参与烧碱期权交易。

十一、风险揭示

客户在开通期权交易前，应当全面了解有关期权交易的法律法规、交易所及本公司有关期权业务的规则和适当性要求，并确信已做好足够的风险评估与财务安排，全面评估自身的经济实力、产品认知能力、风险控制能力、生理及心理承受能力（仅对自然人客户而言）等，审慎决定是否参与期权业务，避免遭受难以承受的损失。

十二、业务规则及信息查询渠道

客户可至郑商所及公司官网查询“关于挂牌烧碱期货有关事项的公告”、“关于挂牌烧碱期权有关事项的公告”及“关于发布烧碱期货、期权合约及期货业务细则的公告”等相关通知。客户应密切关注郑商所及本公司官网关于烧碱期货及期权业务相关通知、公告，及时

了解最新信息。

客户对公司官网相关通知、公告存在任何疑义，可以咨询所在营业部或拨打公司热线电话。热线电话：95531/400-8888588

特此通知。

东海期货有限责任公司

2023 年 9 月 14 日