

关于鸡蛋、玉米淀粉和生猪期权上市交易的通知

各位客户：

根据大连商品交易所（以下简称“大商所”）《关于鸡蛋、玉米淀粉和生猪期权上市交易有关事项的通知》及《关于发布鸡蛋、玉米淀粉和生猪期货期权合约的公告》，鸡蛋、玉米淀粉和生猪期权合约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。上市当日 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。之后，鸡蛋、玉米淀粉和生猪期权交易时间与标的期货一致。

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、挂盘基准价

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

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

五、持仓限额管理

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。

六、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。

七、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”、“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 15:00-15:15，客户可以通过交易客户端自行提交“取消期权自动行权申请”。

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。

八、相关费用

客户可在首次参与鸡蛋、玉米淀粉和生猪期权交易前与公司协商手续费标准，未协商的，按照我公司标准收取手续费（见下表 1）。客户参与鸡蛋、玉米淀粉和生猪期权交易的，视为同意公司手续费收取标准。

表 1：鸡蛋、玉米淀粉和生猪期权公司手续费收费标准表

期权品种	收费标准：元/手		
	交易手续费	套保交易手续费	行权（履约）手续费
鸡蛋期权	2	1	2
玉米淀粉期权	0.8	0.4	0.8
生猪期权	6	3	6

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大商所已上市期权品种一致（见下表 2）。申报费按日收取，期权合约申报费按合约月份统计。

表 2：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=Σ（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、期权交易权限开通

客户可以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、大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。

已经开通大商所期权交易权限的客户可以直接参与鸡蛋、玉米淀粉和生猪期权交易。

十、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。

十一、业务规则及信息查询渠道

客户可至大商所及公司官网查询。

根据大连商品交易所（以下简称“大商所”）《关于鸡蛋、玉米淀粉和生猪期权上市交易有关事项的通知》及《关于发布鸡蛋、玉米淀粉和生猪期货期权合约的公告》。客户应密切关注大商所及本公司官网关于鸡蛋、玉米淀粉和生猪期权业务相关通知、公告，及时了解最新信息。

客户对公司官网期权业务相关通知、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 转 2/400-8888588。

特此通知。

东海期货有限责任公司

2024 年 8 月 20 日