

关于多晶硅期货、多晶硅期权合约上市交易的通知

各位客户：

根据广州期货交易所（以下简称“广期所”）《关于多晶硅期货合约上市交易有关事项的通知》、《关于多晶硅期权合约上市交易有关事项的通知》《关于发布多晶硅期货和多晶硅期权合约及相关规则的通知》等相关通知，多晶硅期货合约自2024年12月26日（星期四）起上市交易。多晶硅期权合约自2024年12月27日（星期五）起上市交易。现将有关事项通知如下：

一、上市交易时间

多晶硅期货合约自2024年12月26日（星期四）起上市交易。

交易时间：每周一至周五（北京时间国家法定假日和交易所公告的休市日除外）9:00~10:15，10:30~11:30和13:30~15:00，及交易所规定的其他时间。。

多晶硅期权合约自2024年12月27日（星期五）起上市交易，交易时间与多晶硅期货合约交易时间一致。

二、上市交易合约

多晶硅期货首批上市交易合约为PS2506、PS2507、PS2508、PS2509、PS2510、PS2511和PS2512。

多晶硅期权首批上市交易合约为以PS2506、PS2507、PS2508、PS2509、PS2510、PS2511和PS2512期货合约为标的的多晶硅期权合约。

三、挂牌基准价

多晶硅期货新合约的挂牌基准价由交易所于上市前另行通知。

多晶硅期权根据BAW美式期货期权定价模型计算新上市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，波动率根据多晶硅现货历史波动率及期现货市场运行特点等因素确定。新上市合约的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，也可通过广州期货交易所官网查询。

四、交易指令

多晶硅期货合约支持下列指令：限价指令、市价指令、市价止损

(盈)指令、限价止损(盈)指令和套利交易指令。

多晶硅期权合约上市初期仅提供限价指令和限价止损(盈)指令。多晶硅期权合约的交易指令每次最大下单数量为 100 手。

五、交易保证金水平及涨跌停板幅度

上市首日,我公司确定客户交易多晶硅期货合约交易保证金水平为合约价值的 20%,涨跌停板幅度为挂牌基准价的 14%。如合约有成交,则下一交易日起,交易保证金水平为合约价值的 14%,涨跌停板幅度为上一交易日结算价的 7%;如合约无成交,则下一交易日继续按照上市首日的交易保证金水平和涨跌停板幅度执行。关于交易保证金水平和涨跌停板幅度的其他规定,按照《广州期货交易所风险管理办法》执行。

六、相关费用

客户可在首次参与多晶硅期货和多晶硅期权交易前与公司协商手续费标准,未协商的我公司按照成交金额的万分之 4 收取多晶硅期货合约交易手续费;按照 8 元/手收取多晶硅期权合约的交易手续费和行权(履约)手续费。

七、申报费

多晶硅期货、期权按日、按合约收取申报费

品种	信息量(笔)	OTR \leq 2	OTR $>$ 2
多晶硅 期货/期权	信息量 \leq 4000	0 元/笔	0 元/笔
	4000 < 信息量 \leq 8000	0 元/笔	1 元/笔
	信息量 $>$ 8000	2 元/笔	5 元/笔

信息量=下单、撤单、询价等交易指令笔数之和。

报单成交比(OTR)=信息量/有成交下单笔数-1。若客户或非期货公司会员某日在某合约月份上有信息量但无成交,则当日在该合约月份上其报单成交比(OTR)视为大于 2。

八、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。

九、期权交易权限开通

客户可以联系本公司分支机构及 IB 营业部办理广期所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、广期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。

已开通广期所期权权限的客户自动具有多晶硅期权交易权限。

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

客户可至广期所及公司官网查询《关于多晶硅期货合约上市交易

有关事项的通知》、《关于多晶硅期权合约上市交易有关事项的通知》
《关于发布多晶硅期货和多晶硅期权合约及相关规则的通知》等相关通知。客户应密切关注广期所及本公司官网关于多晶硅期货、多晶硅期权业务相关通知、公告，及时了解最新信息。

客户对公司官网期货期权业务相关通知、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；4008-588-588

特此通知。

东海期货有限责任公司

2024 年 12 月 23 日