附件2

**菜籽粕期权仿真交易参数**

|  |  |
| --- | --- |
| **项目** | **参数值** |
| 期权定价初始波动率 | 17% |
| 期权定价利率 | 4.35% |
| 期权交易手续费 | 0.8元/手（当日开平仓减半） |
| 行权（履约）手续费 | 0.8元/手 |
| 行权后期货开仓手续费 | 0元/手 |
| 期权限价单最大下单量 | 100手 |
| 期权市价单最大下单量 | 2手 |
| 客户期权限仓数量 | 20000手 |
| 非经纪会员期权限仓数量 | 20000手 |

注：菜籽粕期货仿真合约、规则及参数与实盘一致。