附件2

动力煤期权仿真交易参数

|  |  |
| --- | --- |
| **项目** | **参数值** |
| 期权定价初始波动率 | 16% |
| 期权定价利率 | 一年期贷款市场报价利率（LPR） |
| 期权交易手续费 | 1.5元/手（当日开平仓减半） |
| 行权（履约）手续费 | 1.5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 |
| 客户期权持仓限额 | 30000手 |
| 非期货公司会员期权持仓限额 | 30000手 |

注：动力煤期货仿真合约、规则及参数与实盘一致。