附件1

干制红枣期权合约（仿真用）

|  |  |
| --- | --- |
| 合约标的物 | 干制红枣期货合约 |
| 合约类型 | 看涨期权、看跌期权 |
| 交易单位 | 1手干制红枣期货合约 |
| 报价单位 | 元（人民币）/吨 |
| 最小变动价位 | 1元/吨 |
| 涨跌停板幅度 | 与干制红枣期货合约涨跌停板幅度相同 |
| 合约月份 | 标的期货合约中的连续两个近月，其后月份在标的期货合约结算后持仓量达到5000手（单边）之后的第二个交易日挂牌 |
| 交易时间 | 上午9:00—11:30，下午13:30—15:00，以及交易所规定的其他交易时间 |
| 最后交易日 | 标的期货合约交割月份前两个月最后一个日历日之前（含该日）的倒数第3个交易日，以及交易所规定的其他日期 |
| 到期日 | 同最后交易日 |
| 行权价格 | 行权价格覆盖标的期货合约上一交易日结算价上下浮动1.5倍当日涨跌停板幅度对应的价格范围。行权价格≤10000元/吨，行权价格间距为100元/吨；10000元/吨＜行权价格≤20000元/吨，行权价格间距为200元/吨；行权价格＞20000元/吨，行权价格间距为400元/吨 |
| 行权方式 | 美式。买方可在到期日前任一交易日的交易时间提交行权申请；买方可在到期日15:30之前提交行权申请、放弃申请 |
| 交易代码 | 看涨期权：CJ-合约月份-C-行权价格看跌期权：CJ-合约月份-P-行权价格 |
| 上市交易所 | 郑州商品交易所 |

干制红枣期权仿真交易参数

|  |  |
| --- | --- |
| **项目** | **参数值** |
| 期权定价初始波动率 | 22.48% |
| 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元/手 |
| 行权（履约）手续费  | 1元/手 |
| 平今仓手续费 | 0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 | 600手 |
| 非期货公司会员期权持仓限额 | 600手 |