

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