

附件 5

## 大连商品交易所生猪期货期权合约 (征求意见稿)

合约标的物	生猪期货合约
合约类型	看涨期权、看跌期权
交易单位	1 手 (16 吨) 生猪期货合约
报价单位	元 (人民币) /吨
最小变动价位	2.5 元/吨
涨跌停板幅度	与标的期货合约涨跌停板幅度相同
合约月份	1、3、5、7、9、11 月
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一个月的第 12 个交易日, 交易所可以根据国家法定节假日调整最后交易日
到期日	同最后交易日

行权价格	<p>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。</p> <p>最近六个自然月对应的期权合约：行权价格<math>\leq</math>10000 元/吨，行权价格间距为 100 元/吨；10000 元/吨<math>&lt;</math>行权价格<math>\leq</math>20000 元/吨，行权价格间距为 200 元/吨；行权价格<math>&gt;</math>20000 元/吨，行权价格间距为 400 元/吨。</p> <p>第七个及随后自然月对应的期权合约：行权价格<math>\leq</math>10000 元/吨，行权价格间距为 200 元/吨；10000 元/吨<math>&lt;</math>行权价格<math>\leq</math>20000 元/吨，行权价格间距为 400 元/吨；行权价格<math>&gt;</math>20000 元/吨，行权价格间距为 800 元/吨</p>
行权方式	美式。买方可以在到期日之前任一交易日的交易时间，以及到期日 15:30 之前提出行权申请
交易代码	<p>看涨期权：LH-合约月份-C-行权价格</p> <p>看跌期权：LH-合约月份-P-行权价格</p>
上市交易所	大连商品交易所