

附件 2

郑州商品交易所白糖期权合约

(2024 年 10 月 30 日郑州商品交易所第八届理事会第二十次会议审议通过，自 2025 年 3 月 3 日起施行)

|        |                                                                                                                                                                         |
|--------|-------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
| 合约标的物  | 白糖期货合约                                                                                                                                                                  |
| 合约类型   | 看涨期权、看跌期权                                                                                                                                                               |
| 交易单位   | 1 手（10 吨）白糖期货合约                                                                                                                                                         |
| 报价单位   | 元（人民币）/吨                                                                                                                                                                |
| 最小变动价位 | 0.5 元/吨                                                                                                                                                                 |
| 涨跌停板幅度 | 与白糖期货合约涨跌停板幅度相同                                                                                                                                                         |
| 合约月份   | 常规期权：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<br>系列期权：在标的期货合约交割月份前四个月第一个交易日挂牌                                                                           |
| 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                                                                                                                               |
| 最后交易日  | 常规期权：标的期货合约交割月份前一个月第 15 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<br>系列期权：标的期货合约交割月份前两个月第 15 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 $\leq$ 3000 元/吨，行权价格间距为 50 元/吨；3000 元/吨 $<$ 行权价格 $\leq$ 10000 元/吨，行权价格间距为 100 元/吨；行权价格 $>$ 10000 元/吨，行权价格间距为 200 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  | <p>常规期权：看涨期权为 SR—合约月份—C—行权价格，看跌期权为 SR—合约月份—P—行权价格</p> <p>系列期权：看涨期权为 SR—合约月份—MS—C—行权价格，看跌期权为 SR—合约月份—MS—P—行权价格</p> |
| 上市交易所 | 郑州商品交易所                                                                                                           |