

附件 2

大连商品交易所纯苯期货期权合约 (征求意见稿)

合约标的物	纯苯期货合约
合约类型	看涨期权、看跌期权
交易单位	1 手 (30 吨) 纯苯期货合约
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	与标的期货合约涨跌停板幅度相同
合约月份	1、2、3、4、5、6、7、8、9、10、11、12 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 ≤ 4000 元/吨, 行权价格间距为 50 元/吨; 4000 元/吨 $<$ 行权价格 ≤ 8000 元/吨, 行权价格间距为 100 元/吨; 行权价格 > 8000 元/吨, 行权价格间距为 200 元/吨。</p>

	第七个及随后自然月对应的期权合约：行权价格 ≤ 4000 元/吨，行权价格间距为 100 元/吨；4000 元/吨 $<$ 行权价格 ≤ 8000 元/吨，行权价格间距为 200 元/吨；行权价格 > 8000 元/吨，行权价格间距为 400 元/吨
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	看涨期权：BZ-合约月份-C-行权价格 看跌期权：BZ-合约月份-P-行权价格
上市交易所	大连商品交易所