

# 关于挂牌白糖期权合约有关事项的通告

(2017)2 号

郑州商品交易所（以下简称郑商所）定于 2017 年 4 月 19 日挂牌交易白糖期权合约。现将有关事项通知如下：

## 一、挂牌合约月份

首日挂牌的白糖期权标的期货合约为：SR707、SR709、SR711、SR801、SR803、SR805、SR807、SR809。

## 二、挂牌基准价

郑商所根据期权定价模型计算各期权合约基准价。其中，波动率参数根据白糖期货历史波动率等因素确定，利率参数为 4.35%。挂牌基准价于 4 月 18 日结算后在郑商所网站“交易数据”栏目公布。

## 三、夜盘交易时间

4 月 19 日当晚起，白糖期权开展夜盘交易。夜盘交易时间为 21:00-23:30。

## 四、最大下单数量

限价指令的每次最大下单数量为 20 手，市价指令的每次最大下单数量为 2 手。

## 五、持仓限额

非期货公司会员和客户所持有的按单边计算的某月份期权合约投机持仓限额为 200 手，投机、套利与套期保值持仓之和，不得超过期权合约投机持仓限额的 3 倍。

做市商持仓限额为 10000 手。

## 六、询价限制

对同一期权合约的询价时间间隔不得小于 60 秒。

期权合约最优买卖报价差小于等于下表价差时，不得询价。

申报买价（元/吨）	价差（元/吨）
50 以下	8
50 及以上，小于 100	10
100 及以上，小于 200	20
200 及以上，小于 300	30
300 及以上，小于 500	50
500 及以上	75

特此通告。

郑州商品交易所

2017 年 4 月 6 日