

大连商品交易所期权交易细则

（草案修订稿）

第一章 总则

第一条 为规范期权交易，保护期权交易当事人的合法权益和社会公众利益，根据《大连商品交易所章程》和《大连商品交易所交易规则》，制定本细则。

第二条 大连商品交易所（以下简称交易所）根据公开、公平、公正和诚实信用的原则组织期权交易。

第三条 本细则适用于交易所内的一切期权交易活动，交易所、会员、客户、交易所指定期货保证金存管银行及其工作人员应当遵守本细则。

第四条 本细则未明确规定的，按照交易所现行业务规则有关规定执行。

第二章 期权合约

第五条 期权合约，是指由期货交易所统一制定的、规定买方有权在将来某一时间以特定价格买入或者卖出标的期货合约的标准化合约。

第六条 期权合约的主要条款包括：合约名称、合约代码、交易单位、报价单位、最小变动价位、涨跌停板、交易时间、执行价格、执行价格间距、执行方式、最后交易日和到期日。

期权合约的附件与期权合约具有同等法律效力。

第七条 期权合约的交易单位为“手”，期权交易必须以“一手”

的整数倍进行，不同交易品种每手合约标的期货合约数量，在该品种的期权合约中载明。

第八条 最小变动价位是指该期权合约单位价格涨跌变动的最小值。

第九条 涨跌停板是指期权合约在一个交易日中的交易价格不得高于或者低于规定的涨跌幅度，超过该涨跌幅度的报价将被视为无效，不能成交。

第十条 执行价格是指由期权合约规定的，买方有权在将来某一时间买入或者卖出标的期货合约的价格。

第十一条 执行价格间距是指具有相同标的期货合约的同一类型期权合约，相邻两个执行价格之间的差。执行价格是执行价格间距的整数倍。

每个交易日，可交易期权合约的执行价格范围，至少应当覆盖其标的期货合约下一交易日停板幅度额的价格范围。交易所可以根据市场情况调整价格范围。

第十二条 到期日是指期权合约买方能够行使权利的最后交易日。

第十三条 执行方式分为美式、欧式以及交易所规定的其他方式。美式执行方式中，买方在合约到期日及其之前任一交易日均可行使权利；欧式执行方式中，买方只可在合约到期日当天行使权利。

第十四条 期权合约以人民币计价，计价单位为元。

第三章 交易业务

第十五条 期权交易是指在交易所内集中进行期权合约的买卖活

动。

第十六条 权利金是期权买方为获得期权执行权利所付给期权卖方的金额，即期权合约的价格。

第十七条 期权的开盘价是指某一期权合约开市前五分钟内经集合竞价产生的成交价格。集合竞价未产生成交价格的，以开市后竞价交易第一笔成交价为开盘价。第一笔成交价格按第十八条规定确定，此时前一成交价为上一交易日收盘价，新上市期权合约前一成交价为挂盘基准价。

期权的收盘价是指期权合约当日交易的最后一笔成交价格。无成交期权合约当日收盘价为当日结算价。

期权的最高价、最低价、最新价、涨跌、最高买价、最低卖价、申买量、申卖量、成交量、持仓量等行情信息的规定与期货相同。

第十八条 期权合约了结方式为平仓、执行和放弃。

平仓是指客户买入或者卖出与其所持合约的品种、数量、月份、类型和执行价格相同但交易方向相反的合约，了结期权持仓的方式。

执行是指期权买方行使权利而使期权合约转换成期货合约的期权合约了结方式。

放弃是指期权合约到期，买方未申请行使权利的期权合约了结方式。

第十九条 客户进行期权交易，使用与期货交易相同的交易编码。没有交易编码的客户，需按期货交易的规定申请交易编码。

第二十条 期权交易指令的种类：

（一）限价指令：指按限定价格或者更好价格成交的指令。

（二）市价指令：指自动以涨（跌）停板价格参与交易的买（卖）指令。

（三）市价止损（盈）指令：指当市场价格触及客户预先设定触发价格时，指令立即转为市价指令。

（四）限价止损（盈）指令：指当市场价格触及客户预先设定触发价格时，指令立即转为限价指令。

（五）组合交易指令：交易所对指定期权合约提供组合交易指令，指令类型和交易方式由交易所确定并提前公布；

（六）交易所规定的其他指令。

黄大豆 1 号、黄大豆 2 号、豆粕、豆油、棕榈油、线型低密度聚乙烯、聚氯乙烯和焦炭期权合约的交易指令每次最大下达数量为 1000 手，玉米期权合约的交易指令每次最大下达数量为 2000 手。

第二十一条 市价指令和限价指令可以附加立即全部成交否则自动撤销和立即成交剩余指令自动撤销两种指令属性。

第二十二条 交易所交易系统自动将买卖申报指令以价格优先、时间优先的原则进行排序，当买入价大于、等于卖出价则自动撮合成交。同一交易编码同一期权合约持仓平仓顺序按开仓时间先开先平。

当某期权合约以涨（跌）停板价格申报时，成交撮合原则实行平仓优先和时间优先的原则，交易所强行平仓申报单优先其他平仓申报单。

第二十三条 开盘集合竞价在某期权合约每一交易日开市前 5 分

钟内进行，其中前 4 分钟为期权合约买、卖指令申报时间，后 1 分钟为集合竞价撮合时间。

第二十四条 集合竞价采用最大成交量原则，即以此价格成交能够得到最大成交量。高于集合竞价产生的价格的买入申报全部成交；低于集合竞价产生的价格的卖出申报全部成交；等于集合竞价产生的价格的买入或者卖出申报，至少有一方申报量完全成交。若有多个价位满足最大成交量原则，则开盘价取与前一交易日结算价最近的价格；新上市期权合约开盘价取与挂盘基准价最近的价格。

第二十五条 开盘集合竞价中的未成交申报单自动参与开市后竞价交易。

第二十六条 开市后撮合成交价等于买入价(bp)、卖出价(sp)和前一成交价(cp)三者中居中的一个价格。即：

当 $bp \geq sp \geq cp$ ，则最新成交价=sp；

当 $bp \geq cp \geq sp$ ，则最新成交价=cp；

当 $cp \geq bp \geq sp$ ，则最新成交价=bp。

第二十七条 期权合约挂盘遵循以下原则：

（一）新上市期货合约成交后，相应期权合约于下一交易日上市交易。

（二）期权合约上市交易后，交易所在每个交易日闭市后，将根据其标的期货合约的结算价格，按照期权合约涨跌停板和执行价格间距的规定，挂盘新执行价格的期权合约。

（三）期权合约挂盘基准价由交易所确定并提前公布。挂盘基准

价是确定新上市期权合约第一个交易日涨（跌）停板的依据。

第二十八条 交易所可根据市场情况，在期货合约新上市时，对该合约为标的的期权合约的执行价格间距进行调整。

第四章 结算业务

第二十九条 各会员的期权交易与期货交易共用一个专用账户。

第三十条 期权交易的买方支付权利金，不交纳交易保证金；期权交易的卖方收取权利金，应当交纳交易保证金。

第三十一条 交易所根据会员当日成交期权合约数量按交易所规定的标准计收交易手续费，期权买方执行和期权卖方履约后交易所分别收取执行手续费和履约手续费，交易所所有权对手续费标准进行调整。

第三十二条 期权当日结算价是指某一期权合约当日成交价按照成交量的加权平均价。当日无成交价格的，以交易所确定的期权定价模型计算的權利金理论价格作为当日结算价。期权定价模型由交易所确定并公布。

若某期权合约因当日成交不活跃或者其他原因造成当日结算价格不合理的，交易所可以对结算价进行调整。

第三十三条 每日期权交易结束后，交易所按当日结算价结算所有期权卖方的交易保证金，收取期权买卖双方的手续费等费用。

第三十四条 期权卖方（买方）开仓时，按照成交价收取（支付）权利金；同时，交易所按上一交易日结算时该期权合约保证金标准计算收取期权卖方开仓交易保证金，首日上市的期权合约取按该期权合约挂盘价及其标的期货合约上一交易日结算价计算的保证金标准。

期权卖方（买方）收取（支付）权利金 $=\sum$ （卖出（买入）开仓

价×卖出（买入）期权合约成交量）；

第三十五条 期权买方（卖方）平仓时，按照平仓价收取（支付）权利金；同时，期权卖方所平期权合约的交易保证金划入其结算准备金账户。

期权买方（卖方）平仓收取（支付）权利金=Σ（卖出（买入）平仓价×卖出（买入）平仓期权合约成交量）。

第五章 执行与履约

第三十六条 期权买方可在闭市前通过交易系统下达期权执行指令或者撤销已下达的期权执行指令。

第三十七条 期权的卖方有履约义务。履约是指当期权买方提出执行期权时，期权卖方有义务按合约规定的执行价格买入或者卖出一定数量的标的期货合约。

第三十八条 每日闭市后，交易所为下达执行指令的期权买方按照持仓时间最长的原则选择卖方进行配对。

第三十九条 期权执行后，买卖双方的期权合约持仓相应减少。买方和卖方按照执行价格建立相应的期货合约持仓，按照当日期货合约结算价进行结算，但不影响标的期货合约结算价。

（一）看涨期权执行时，期权买方按执行价格获得期货多头持仓，卖方按同一执行价格获得期货空头持仓。

（二）看跌期权执行时，期权买方按执行价格获得期货空头持仓，卖方按同一执行价格获得期货多头持仓。

第四十条 根据期权合约执行价格与前一交易日标的期货合约结算价的高低，期权合约分为平值期权、实值期权和虚值期权。

平值期权是指执行价格等于前一交易日标的期货合约结算价的期权合约。

实值期权是指看涨期权（看跌期权）的执行价格低于（高于）前一交易日的期货合约结算价的期权合约。

虚值期权是指看涨期权（看跌期权）的执行价格高于（低于）前一交易日的期货合约结算价的期权合约。

第四十一条 每日闭市后，交易所根据期权买方持仓情况和闭市时的结算准备金余额判断期权是否被执行。

（一）实值期权或者平值期权执行时，期权买方结算准备金账户中的结算准备金余额应当满足相应的期货合约上一交易日规定的交易保证金。

（二）虚值期权提出执行时，期权买方结算准备金账户中的结算准备金余额应当满足相应的期货合约上一交易日规定的交易保证金，并能弥补虚值额。

（三）期权执行建立的期货合约持仓与原期货合约持仓合并计算，其数量不得超过期货合约持仓限额；否则，期权执行申请按时间优先顺序部分执行或不予执行。

（四）期权买方结算准备金余额不足时，按结算准备金余额和时间优先顺序部分执行或不予执行。

第四十二条 期权合约的到期日闭市后，所有未提出执行申请和提出申请但未予执行的期权合约，按买方自动放弃权利处理，释放卖方相应的期权交易保证金并划入其结算准备金账户。

第六章 风险管理

第四十三条 期权卖方交易保证金的收取标准为下列两者中较大者：

（一）权利金+标的期货合约交易保证金 $-1/2$ *期权虚值额；

(二) 权利金+ $1/2$ *标的期货合约交易保证金。

看涨期权的虚值额=Max (期权合约执行价格-标的期货合约当日结算价, 0);

看跌期权的虚值额=Max (标的期货合约当日结算价-期权合约执行价格, 0)。

第四十四条 针对期权交易不同的持仓组合, 交易所可规定不同的交易保证金收取标准。持仓组合类别和交易保证金标准由交易所另行公布。

第四十五条 期权交易实行涨跌停板制度, 期权合约涨跌停板幅度同标的期货合约。

如果某期权合约权利金结算价小于等于下一个交易日涨跌停板幅度, 那么下一个交易日该期权合约最低报价为最小变动价位。

第四十六条 涨(跌)停板单边无连续报价是指某一期权合约在某一交易日收盘前 5 分钟内出现只有停板价位的买入(卖出)申报、没有停板价位的卖出(买入)申报, 或者一有卖出(买入)申报就成交、但未打开停板价位的情况。

如果某期权合约权利金结算价小于等于下一个交易日涨跌停板幅度, 那么下一个交易日收市时即使该期权合约出现前款定义情形, 交易所也不将其视为涨(跌)停板单方无连续报价。

第四十七条 若某期权合约连续三个交易日出现同方向涨跌停板单边无连续报价, 交易所将进行强制减仓, 强制减仓方法与期货相同; 有根据认为该连续同方向涨跌停板单边无连续报价为会员或者客户

违反交易所相关业务规则的交易行为引发，则按第五十条有关规定处理。

第四十八条 期权交易实行限仓制度。限仓是指交易所规定会员或者客户可以持有的，按单边计算的某一月份期权合约投机头寸的最大数量。

第四十九条 期权合约在其交易过程中的不同阶段分别适用不同的持仓限额，该阶段的时间划分与标的期货合约相同。

会员和客户持有的某一期货合约相应的所有执行价格看涨期权的买持仓量和看跌期权的卖持仓量合计不得超过同阶段标的期货合约买持仓限额；会员和客户持有的某一期货合约相应的所有执行价格看跌期权的买持仓量和看涨期权的卖持仓量合计不得超过同阶段标的期货合约卖持仓限额。

第五十条 交易所实行期权交易大户报告制度，具体规定与期货交易相同，大户报告表见附表。

第五十一条 当会员、客户出现下列情形之一时，交易所所有权对其持仓进行强行平仓：

- （一）会员结算准备金余额小于零，并未能在规定时限内补足的；
- （二）持仓量超出其限仓规定的；
- （三）因违规受到交易所强行平仓处罚的；
- （四）根据交易所的紧急措施应予强行平仓的；
- （五）其他应予强行平仓的。

第五十二条 强行平仓的执行原则：

强行平仓前先由会员自己执行，时限除交易所特别规定外，一律为开市后 10：15 前。若时限内会员未执行完毕，则由交易所强制执行。因结算准备金小于零而被要求强行平仓的，在保证金补足至最低结算准备金余额前，禁止相关会员的开仓交易。

（一）由会员单位执行的强行平仓头寸的确定

1. 属五十一条第（一）、（二）项的强行平仓，其需强行平仓头寸由会员单位自行确定，只要强行平仓结果符合交易所规定即可。

2. 属五十一条第（三）、（四）、（五）项的强行平仓，其需强行平仓头寸由交易所确定。

（二）由交易所执行的强行平仓头寸的确定

1. 属第五十一条第（一）项的强行平仓，该会员所有客户按交易保证金等比例平仓原则进行强行平仓：

平仓比例 = 会员应追加交易保证金 / 会员交易保证金总额 × 100%；

客户应平仓释放交易保证金 = 该客户交易保证金总额 × 平仓比例。

其客户需要强行平仓的头寸由交易所按先投机后保值，在投机或者保值里，再按上一交易日结算时的合约持仓量由大到小顺序选择每个客户平仓合约；当期货合约与期权合约持仓量相等时，按先期货、后期权原则选择平仓合约；期货合约持仓量相同时，按期货合约代码由小到大（依次按品种代码字母顺序、合约月份时间顺序）、合约代码相同时先平买卖持仓量较大的持仓方向的持仓、买卖持仓量相等先

买后卖选择平仓合约；期权合约持仓量相等时，先卖后买，然后依次按期货合约代码由小到大、执行价格由低到高、先看涨期权后看跌期权的顺序选择平仓合约。

若多个会员需要强行平仓的，按追加保证金由大到小的顺序，先平需要追加保证金大的会员。

2. 属第五十一条第（二）项的强行平仓：

（1）若系客户超仓，则按上一个交易日结算时期权合约总持仓量由大到小、期权合约持仓量相等时按照执行价格由低到高、执行价格相等时先看涨期权后看跌期权的顺序，确定平仓合约对该客户超仓头寸进行强行平仓；若客户在多个会员处有持仓，则按 10：15 时该客户在会员处持仓量由大到小选择会员强行平仓；若系多个客户超仓，先选择超仓量大的客户作为强行平仓的对象。

（2）若系一个会员超仓，其需强行平仓头寸由交易所先按会员超仓数量与会员投机持仓数量的比例确定有关客户的平仓数量，再按客户超仓的方法对每个客户进行强行平仓；若系多个会员超仓，其需强行平仓头寸按会员超仓量由大到小顺序，先选择超仓量大的会员作为强行平仓的对象。

（3）若系会员和客户同时超仓，则先对超仓的客户进行平仓，再按会员超仓的方法平仓。

3. 属第五十一条第（三）、（四）、（五）项的强行平仓，强行平仓头寸由交易所根据涉及的会员和客户具体情况确定。

若会员同时满足第五十一条第（一）、（二）项情况，交易所先按

第（二）项情况确定强行平仓头寸，再按第（一）项情况确定强行平仓头寸。

第五十三条 强行平仓的执行：

（一）通知。

交易所以“强行平仓通知书”（以下简称通知书）的形式向有关会员下达强行平仓要求。通知书除交易所特别送达以外，通过会员服务系统随当日结算数据发送，有关会员可以通过会员服务系统获得。

（二）执行及确认。

1. 开市后，有关会员应当首先自行平仓，直至达到平仓要求；
2. 超过会员自行平仓时限而未执行完毕的，剩余部份由交易所直接执行强行平仓，强行平仓买（卖）委托价格为当日涨（跌）停板价；
3. 强行平仓执行完毕后，由交易所记录执行结果并存档；
4. 强行平仓结果随当日成交记录发送，有关会员可以通过会员服务系统获得。

第五十四条 强行平仓的价格通过市场交易形成。

第五十五条 如因价格涨跌停板或者其他市场原因而无法在当日完成全部强行平仓的，交易所根据结算结果，对该会员或者客户做出相应的处理。

第五十六条 由于价格涨跌停板限制或者其他市场原因，有关持仓的强行平仓只能延时完成的，因此发生的亏损，仍由直接责任人承担；未能完成平仓的，该持仓持有者应当继续对此承担持仓责任。

第五十七条 由会员单位执行的强行平仓产生的盈利仍归直接责任人；由交易所执行的强行平仓产生的盈亏相抵后的盈利部分予以罚没；因强行平仓发生的亏损由直接责任人承担。直接责任人是客户的，强行平仓后发生的亏损，由该客户开户所在期货公司会员先行承担后，自行向该客户追索。

第五十八条 在期权交易过程中，当出现以下情形之一的，交易所可以宣布进入异常情况，采取紧急措施化解风险：

（一）地震、水灾、火灾等不可抗力或者计算机系统故障等不可归责于交易所的原因导致交易无法正常进行；

（二）会员出现结算风险，对市场正在产生或者将产生重大影响；

（三）期权价格出现同方向连续同方向涨跌停板单边无连续报价，有根据认为会员或者客户违反交易所相关业务规则以及其他有关规定并且对市场正在产生或者即将产生重大影响；

（四）交易所规定的其他情况。

出现前款第（一）项异常情况时，交易所总经理可以采取调整开市收市时间、暂停交易的紧急措施；出现前款第（二）、（三）、（四）项异常情况时，理事会可以决定采取调整开市收市时间、暂停交易、调整涨跌停板幅度、调整交易保证金、暂停开新仓、限期平仓、强行平仓、限制出金等紧急措施。

第五十九条 在棕榈油期权交易过程中，因战争、社会动荡、自然灾害等因素对棕榈油进口正在产生或者即将产生重大影响时，交易所可以宣布进入异常情况，交易所总经理可以采取调整开市收市时间、

暂停交易、终止交易的紧急措施。终止交易当日结算时，棕榈油各期权合约全部持仓按照上一交易日结算价进行平仓。

第六十条 交易所宣布异常情况并决定采取紧急措施前应当报告中国证监会。

对棕榈油期权合约采取终止交易紧急措施的，应当经中国证监会批准。

第六十一条 交易所宣布进入异常情况并决定暂停交易时，暂停交易的期限不得超过 3 个交易日，但经中国证监会批准延长的除外。

第六十二条 发生技术故障，存在下列情形时，交易所不承担责任：

- （一）因不可抗力引发的技术故障；
- （二）非因交易所过错引发的技术故障；
- （三）法律、法规、规定的其他免责情形。

第六十三条 交易所实行风险警示制度。当交易所认为必要时，可以分别或者同时采取要求报告情况、谈话提醒、发布风险提示函等措施中的一种或者多种，以警示和化解风险。

第六十四条 出现下列情形之一的，交易所可以对指定的会员高管人员或者客户谈话提醒风险，或者要求会员或者客户报告情况：

- （一） 期权价格出现异常；
- （二） 会员或者客户交易行为异常；
- （三） 会员或者客户持仓异常；
- （四） 会员资金异常；

- (五) 会员或者客户涉嫌违规、违约；
- (六) 交易所接到涉及会员或者客户的投诉；
- (七) 会员涉及司法调查；
- (八) 交易所认定的其他情况。

交易所要求会员或者客户报告情况的，会员和客户应当按照交易所要求的时间、内容和方式如实报告。

交易所通过电话提醒的，会员或客户应当按照交易所要求的时间、地点和方式认真履行。如果采取电话提醒方式，应当保留电话录音；通过当面谈话的，应当保存谈话记录。

第六十五条 会员或者客户有违规嫌疑、交易和持仓有较大风险的，交易所可以对会员或者客户发出风险提示函。

第六十六条 发生下列情形之一的，交易所可以向全体或者部分会员和客户发出风险提示函：

- (一) 期货交易出现异常；
- (二) 期权交易出现异常；
- (三) 交易所认定的其他异常情况

第七章 信息管理

第六十七条 期权交易信息是指在交易所期权交易活动中所产生的期权交易行情、交易数据统计资料、交易所发布的各种公告信息以及中国证监会指定披露的其他相关信息。

第六十八条 期权交易信息所有权属交易所，由交易所统一管理和发布，交易所可以独立、与第三方合作或委托第三方对期权交易信

息进行经营管理。未经交易所许可，任何机构和个人不得将之用于商业用途。

第六十九条 交易所根据有关规定发布即时、延时、每日、每周和每月期权交易行情信息，每月、每年的交易统计信息，以及法律法规要求披露的其他交易信息。

第七十条 即时行情信息是指在交易时间内，与交易活动同步发布的交易行情信息；延时行情信息是指即时行情信息延迟一定时间后发布的交易行情信息。

期权交易即时/延时行情信息的内容主要有：合约代码、最新价、涨跌、成交量、持仓量、持仓量变化、申买价、申卖价、申买量、申卖量、结算价、开盘价、收盘价、最高价、最低价和前结算价。

第七十一条 每日行情信息在每个交易日结算后发布，其内容主要有：

（一）日行情：合约代码、开盘价、最高价、最低价、收盘价、前结算价、结算价、涨跌、成交量、持仓量、持仓量变化和执行量。

（二）所有合约、所有会员的当日成交量、买卖持仓量。

第七十二条 每周行情信息在每周最后一个交易日结算后发布，其内容主要有：合约代码、周开盘价、最高价、最低价、周收盘价、涨跌、持仓量及持仓量变化(本周末持仓量与上周末持仓量之差)、周末结算价、成交量和执行量。

第七十三条 每月行情信息在每月最后一个交易日结算后发布，其内容主要有：合约代码、月开盘价、最高价、最低价、月收盘价、

涨跌、持仓量及持仓量变化(本月末持仓量与上月末持仓量之差)、月末结算价、成交量和执行量。

第七十四条 交易所期权交易信息通过交易所互联网站、会员服务等系统，及交易所授权的公共媒体和信息商对外发布。

第七十五条 交易所、会员及相关机构和个人对不宜公开的交易、资金等信息负有保密义务。交易所因工作需要，可以向监管部门或其他相关单位提供相关信息，并执行相应的保密规定。

第七十六条 因不可抗力或不可归责于交易所的原因造成的信息传递中断，交易所不承担法律责任，但交易所应及时做出解释，并尽快使之恢复正常。

第七十七条 交易所、会员、信息经营机构和公共媒体以及个人，均不得发布虚假的或者带有误导性质的信息。

第七十八条 期权交易信息的传播、使用及监督管理，参照《大连商品交易所信息管理办法》第三、四章相关规定执行。

第八章 附 则

第七十九条 本细则解释权属于大连商品交易所。

第八十条 本细则自公布之日起实施。

附件：1. 各品种期权合约（草案）

2. 大连商品交易所期权合约客户大户报告表

附件 1:

豆粕期权合约（草案）

合约名称	豆粕期权合约
交易代码*	看涨期权（豆粕期货合约代码-C-执行价格） 看跌期权（豆粕期货合约代码-P-执行价格） MYMM-C(P)-EP
执行方式	美式
交易单位	1 手(10 吨)豆粕期货合约
报价单位	元（人民币）/吨
最小变动价位	0.5 元/吨
涨跌停板	标的期货合约当日涨跌停板幅度对应的涨跌额度
合约月份	1、3、5、7、8、9、11、12 月
交易时间	每周一至周五上午 9:00~11:30, 下午 13:30~15:00
执行价格	执行价格间距的整数倍
执行价格间距	50 元/吨
最后交易日	标的期货合约交割月份前一个月的第 15 个交易日
到期日	同最后交易日
交易手续费	不超过标的期货交易手续费
执行手续费	不超过标的期货交易手续费
上市交易所	大连商品交易所

注：*M 表示豆粕，YMM 表示合约月份，EP 表示执行价格。

聚乙烯期权合约（草案）

合约名称	聚乙烯期权合约
交易代码*	看涨期权（聚乙烯期货合约代码-C-执行价格） 看跌期权（聚乙烯期货合约代码-P-执行价格） LYYMM-C(P)-EP
执行方式	美式
交易单位	1 手(5 吨)聚乙烯期货合约
报价单位	元（人民币）/吨
最小变动价位	2.5 元/吨
涨跌停板	标的期货合约当日涨跌停板幅度对应的涨跌额度
合约月份	1、2、3、4、5、6、7、8、9、11、12 月
交易时间	每周一至周五上午 9:00~11:30, 下午 13:30~15:00
执行价格	执行价格间距的整数倍
执行价格间距	100 元/吨
最后交易日	标的期货合约交割月份前一个月的第 15 个交易日
到期日	同最后交易日
交易手续费	不超过标的期货交易手续费
执行手续费	不超过标的期货交易手续费
上市交易所	大连商品交易所

注：*L 表示聚乙烯，YYMM 表示合约月份。EP 表示执行价格。

附件 2:

大连商品交易所期权合约客户大户报告表

会员名称:

会员编号:

年 月 日

客户名称	客户编码	合约系列代码	买方向持仓		卖方向持仓		期货合约		建仓时间	持仓占用保证金	可动用资金	持仓意向	
			看涨期权	看跌期权	看涨期权	看跌期权	买持	卖持					
			买持仓	卖持仓	卖持仓	买持仓	仓量	仓量					
合计													
资金来源说明													
会员单位意见	会员单位盖章：												

大连商品交易所非期货公司会员大户报告表

年 月 日

合约 系列 代码	买方向持仓		卖方向持仓		期货合约		持仓 性质	建仓 时间	持仓占用 保证金	可动用 资金	持仓 意向
	看涨期权 买持仓	看跌期权 卖持仓	看涨期权 卖持仓	看跌期权 买持仓	买持 仓量	卖持 仓量					
合计											
资金 来源 说明											
会员 单位 意见	会员单位盖章： 负责人签字： 年 月 日										
交易 所 意见	交易所盖章： 负责人签字： 年 月 日										

大连商品交易所期货公司会员大户报告表

会员名称： 会员编号： 年 月 日

客户名称	客户编码	合约系列代码	买方向持仓		卖方向持仓		期货合约		建仓时间	持仓占用保证金	可动用资金	持仓意向
			看涨期权	看跌期权	看涨期权	看跌期权	买持	卖持				
			买持仓	卖持仓	卖持仓	买持仓	仓量	仓量				
合计												
资金来源说明												
会员单位意见	会员单位盖章： 负责人签字： 年 月 日											
交易所意见	交易所盖章： 负责人签字： 年 月 日											