

关于挂牌 PTA、甲醇期权合约有关事项的公告

(2019) 112 号

中国证券监督管理委员会已批准同意郑州商品交易所（以下简称郑商所）组织开展 PTA、甲醇期权交易，现将挂牌有关事项公告如下：

一、挂牌时间

PTA、甲醇期权合约自 2019 年 12 月 16 日（星期一）起挂牌交易，当日 8:55-9:00 为集合竞价时间。

二、挂牌合约月份

首日挂牌合约包括：标的月份为 2003、2004、2005、2007 及 2009 的 PTA 期权合约，标的月份为 2003、2004、2005 及 2009 的甲醇期权合约。

三、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 PTA、甲醇期货历史波动率等因素确定，利率参数取一年期贷款市场报价利率（LPR）。挂牌基准价于 12 月 13 日结算后在郑商所网站“交易数据”栏目公布。

四、夜盘交易时间

12 月 16 日当晚起，PTA、甲醇期权合约开展夜盘交易。PTA、甲醇期权合约夜盘交易时间与 PTA、甲醇期货合约相同。

五、最大下单数量

限价指令的每次最大下单数量为 100 手，市价指令的每次最大下单数量为 2 手。

六、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 PTA、甲醇期权合约投机持仓限额均为 30000 手，投机与套利持仓之和不得超过投机持仓限额的 2 倍。

做市商持仓限额均为 60000 手。

七、询价限制

非期货公司会员和客户可以向做市商询价，对同一期权合约的询价时间间隔不得小于 60 秒。

PTA 期权合约最优买卖报价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）
申报买价<50	8
50≤申报买价<100	10
100≤申报买价<200	20
200≤申报买价<300	30
300≤申报买价<500	50
500≤申报买价	75

甲醇期权合约最优买卖报价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）
-----------	---------

申报买价<50	5
50≤申报买价<150	15
150≤申报买价<250	25
250≤申报买价	36

特此公告。

郑州商品交易所

2019年12月10日