附件1

动力煤期权合约（仿真用）

|  |  |
| --- | --- |
| 合约标的物 | 动力煤期货合约 |
| 合约类型 | 看涨期权、看跌期权 |
| 交易单位 | 1手动力煤期货合约 |
| 报价单位 | 元（人民币）/吨 |
| 最小变动价位 | 0.1元/吨 |
| 涨跌停板幅度 | 与动力煤期货合约涨跌停板幅度相同 |
| 合约月份 | 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10000手（单边）之后的第二个交易日挂牌 |
| 交易时间 | 每周一至周五上午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 | 以动力煤期货前一交易日结算价为基准，按行权价格间距挂出6个实值期权、1个平值期权和6个虚值期权。行权价格≤500元/吨，行权价格间距为5元/吨；行权价格＞500元/吨，行权价格间距为10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 | 看涨期权：ZC-合约月份-C-行权价格看跌期权：ZC-合约月份-P-行权价格 |
| 上市交易所 | 郑州商品交易所 |