

## 关于原木期货、期权上市交易有关事项的通知

尊敬的客户：

根据大连商品交易所通知《关于原木期货上市交易有关事项的通知》（大商所发〔2024〕458号），《关于原木期权上市交易有关事项的通知》（大商所发〔2024〕459号），原木期货自2024年11月18日（星期一）起上市交易，原木期权自2024年11月19日（星期二）起上市交易，现就有关事项通知如下：

### 一、上市交易时间

原木期货自2024年11月18日（星期一）起上市交易。交易时间为9:00-11:30和13:30-15:00，以及交易所规定的其他交易时间。原木期货暂不开展夜盘交易。

原木期权自2024年11月19日（周二）起上市交易。当日8:55-9:00集合竞价，9:00开盘。原木期权暂不开展夜盘交易。

### 二、上市交易合约

原木期货首批上市交易合约为LG2507、LG2509、LG2511。

原木期权首批上市交易合约是以LG2507、LG2509、LG2511期货合约为基础的期权合约。

### 三、交易保证金标准和涨跌停板幅度

原木期货合约交易保证金标准为16%，涨跌停板幅度为

±6%。根据《大连商品交易所风险管理办法》有关规定，原木期货合约上市当日涨跌停板幅度为合约挂牌基准价的±12%。

#### 四、挂牌基准价

根据BAW美式期权定价模型计算原木期权合约的挂牌基准价，模型中的利率取最新的一年期定期存款基准利率，波动率参考原木现货价格历史波动率等因素综合确定。挂牌基准价于上市前一个交易日结算后，通过会员服务系统随结算数据一同发布，也可通过大商所网站（[www.dce.com.cn](http://www.dce.com.cn)）查询

#### 五、交易手续费

原木期货交易手续费收取标准为成交金额的万分之五，套期保值交易手续费收取标准为成交金额的万分之二点五。

原木期权公司交易手续费收取标准为5元/手，原木期权行权（履约）手续费收取标准与期权交易手续费相同。原木期权套期保值交易手续费收取标准为2.5元/手。

特此通知。

兴业期货有限公司

二〇二四年十一月十五日