

## 关于多晶硅期货、期权合约上市有关事项的通知

尊敬的客户：

根据广州期货交易所相关通知《关于多晶硅期货合约上市交易有关事项的通知》(广期所发[2024]354号)(附件1)、《关于多晶硅期权合约上市交易有关事项的通知》(广期所发[2024]355号)(附件2)，多晶硅期货合约自2024年12月26日(星期四)起上市交易，多晶硅期权合约自2024年12月27日(星期五)起上市交易。现就有关事项通知如下：

### 一、上市交易时间

多晶硅期货合约自2024年12月26日(星期四)起上市交易。交易时间：每周一至周五(北京时间 国家法定假日和交易所公告的休市日除外)9:00~10:15, 10:30~11:30和13:30~15:00, 及交易所规定的其他时间。

多晶硅期权合约自2024年12月27日(星期五)起上市交易，交易时间与多晶硅期货合约交易时间一致。

### 二、上市交易合约

多晶硅期货首批上市交易合约为PS2506、PS2507、PS2508、PS2509、PS2510、PS2511和PS2512。

多晶硅期权首批上市交易合约为以PS2506、PS2507、PS2508、PS2509、PS2510、PS2511和PS2512期货合约为标的的多晶硅期权合约。

### 三、交易指令

多晶硅期货合约支持下列指令：限价指令、市价指令、市价止损（盈）指令、限价止损（盈）指令和套利交易指令。

多晶硅期权合约上市初期仅提供限价指令和限价止损（盈）指令。多晶硅期权合约的交易指令每次最大下单数量为 100 手。

### 四、交易保证金水平及涨跌停板幅度

多晶硅期货合约交易保证金标准为 16%，合约涨跌停板幅度为上一交易日结算价的 7%，上市首日涨跌停板幅度为挂盘基准价的 14%。如合约有成交，则下一交易日起，交易保证金水平为合约价值的 16%，涨跌停板幅度为上一交易日结算价的 7%；如合约无成交，则下一交易日继续按照上市首日的交易保证金水平和涨跌停板幅度执行。关于交易保证金水平和涨跌停板幅度的其他规定，按照《广州期货交易所风险管理办法》执行。

### 五、挂牌基准价

根据 BAW 美式期货期权定价模型计算新上市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，波动率根据多晶硅现货历史波动率及期现货市场运行特点等因素确定。新上市合约的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，也可通过广州期货交易所官网查询。

## 六、交易手续费

多晶硅期货合约交易手续费为成交金额的万分之五。

多晶硅期权合约交易手续费标准为 10 元/手；多晶硅期权行权（履约）手续费标准为 10 元/手。

## 七、活跃期货合约标准

多晶硅期货的活跃期货合约标准为单边持仓量达到 2 万手以上（含）的合约。

多晶硅期权的活跃期权月份标准为标的期货合约单边持仓量达到 2 万手以上（含）的合约月份。

请各位投资者密切关注市场变化，有效管理账户风险，理性投资，谨慎运作。

特此通知。

兴业期货有限公司

二〇二四年十二月十六日