广州期货交易所工业硅期权

（征求意见稿）

|  |  |
| --- | --- |
| 合约标的物 | 工业硅期货合约 |
| 合约类型 | 看涨期权、看跌期权 |
| 交易单位 | 一手（5吨）工业硅期货合约 |
| 报价单位 | 元（人民币）/吨  |
| 最小变动价位 | 1元/吨 |
| 涨跌停板幅度 | 与工业硅期货合约涨跌停板幅度相同 |
| 合约月份 | 1、2、3、4、5、6、7、8、9、10、11、12月 |
| 交易时间 | 每周一至周五（北京时间 法定节假日除外）9:00～10:15，10:30～11:30，13:30～15:00，及交易所规定的其他时间 |
| 最后交易日 | 标的期货合约交割月份前一个月第5个交易日 |
| 到期日 | 同最后交易日 |
| 行权价格 | 行权价格覆盖工业硅期货合约上一交易日结算价上下浮动1.5倍当日涨跌停板幅度对应的价格范围。行权价格≤10000元/吨，行权价格间距为100元/吨；10000元/吨$<$行权价格≤30000元/吨，行权价格间距为200元/吨； 行权价格＞30000元/吨，行权价格间距为400元/吨。  |
| 行权方式 | 美式。买方可以在到期日之前任一交易日的交易时间，以及到期日15:30之前提出行权申请。 |
| 交易代码 | 看涨期权：SI－合约月份－C－行权价格看跌期权：SI－合约月份－P－行权价格 |
| 上市交易所 | 广州期货交易所 |

注1：交易代码中的第一个字母SI是工业硅期货的代码，中间的C（P）为看涨（跌）期权代码。

注2：日盘交易分三个交易小节，分别为第一节9:00～10:15、第二节10:30～11:30和第三节13:30～15:00。