

大连商品交易所豆粕期货期权合约

2017年4月10日星期一

东吴期货研究所

农产品组

王平 021-63123065

研究所办公地址：

上海市黄浦区西藏南路

1208号6楼

苏州市工业园区星阳街

5号东吴证券大厦8楼

期市有风险，投资需谨慎



一、豆粕期权标准合约

合约标的物	豆粕期货合约
合约类型	看涨期权/看跌期权
交易单位	1手(10吨)豆粕期货合约
报价单位	元(人民币)/吨
最小变动单位	0.5元/吨
涨跌停板幅度	与豆粕期货合约涨跌停板幅度相同
合约月份	1月,3月,5月,7月,8月,9月,11月,12月
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	期货交割月份前一个月的第 5 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	行权价格覆盖豆粕期货合约上一交易日结算价上下浮动 1.5 倍当日涨停板幅度对应的价格范围。 1. 行权价格 ≤ 2000 元/吨,行权价格间距为 25 元/吨; 2. 2000 元/吨 < 行权价格 ≤ 5000 元/吨,行权价格间距为 50 元/吨; 3. 行权价格 > 5000 元/吨,行权价格间距为 100 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: M-合约月份-C-行权价格 看跌期权: M-合约月份-P-行权价格
上市交易所	大连商品交易所

免责声明：

本报告由东吴期货制作及发布。报告是基于本公司认为可靠的且目前已公开的信息撰写，本公司力求但不保证该信息的准确性和完整性，所表述的意见并不构成对任何人的投资建议，投资者需自行承担风险。未经本公司事先书面授权，不得对本报告进行任何有悖原意的引用、删节、修改、及用于其它用途。

期市有风险，入市需谨慎。