

# 关于碳酸锂期权合约上市交易有关事项的通知

广期所发〔2023〕158号

各相关单位：

中国证监会已同意广州期货交易所碳酸锂期权注册，现将碳酸锂期权合约上市交易有关事项通知如下：

## 一、上市交易时间

碳酸锂期权合约自2023年7月24日（星期一）起上市交易，交易时间与碳酸锂期货合约交易时间一致。

## 二、上市交易合约

首批上市交易合约为以LC2401、LC2402、LC2403、LC2404、LC2405、LC2406和LC2407期货合约为基础的碳酸锂期权合约。

## 三、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，波动率根据碳酸锂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。

#### 四、交易指令

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

#### 五、行权与履约

在每个交易日的交易时间以及到期日的 15:00-15:30, 客户可以提交“行权”、“双向期权持仓对冲平仓”、“行权后双向期货持仓对冲平仓”和“履约后双向期货持仓对冲平仓”申请。

在到期日的交易时间以及到期日的 15:00-15:30, 客户可以提交“取消期权自动行权申请”。

客户办理行权申请、取消行权等业务的时间及渠道见下表：

业务类型	申请时间	申请渠道
期权行权申请	非到期日交易时间 到期日交易时间及 15:00-15:30	会员单位柜台系统、会员服务系统
行权前双向期权持仓对冲平仓申请	非到期日交易时间 到期日交易时间及 15:00-15:30	会员单位柜台系统、会员服务系统
行权后双向期货持仓对冲平仓申请	非到期日交易时间 到期日交易时间及 15:00-15:30	会员单位柜台系统、会员服务系统

履约后双向期货持仓对冲 平仓申请	非到期日交易时间  到期日交易时间及  15:00-15:30	会员单位柜台系统、会员服务系统
取消到期日自动行权申请	到期日交易时间及  15:00-15:30	会员单位柜台系统、会员服务系统

## 六、相关费用

碳酸锂期权合约交易手续费标准为 3 元/手，平今仓交易暂免收交易手续费；

碳酸锂期权行权（履约）手续费标准为 3 元/手。

## 七、期权交易权限开通

交易者可以根据《广州期货交易所期货交易者适当性管理办法》向期货公司申请开通期权交易权限。

## 八、合约询价

期权交易实行做市商制度。非期货公司会员和客户可以在非主力合约系列的期权合约上向做市商询价，非主力合约系列的期权合约是指除主力合约系列以外的所有期权合约，主力合约系列以会员服务系统发布为准。询价请求应当指明期权合约代码，对同一期权合约的询价时间间隔不应低于 60 秒。同一交易编码在一个期权品种上每日询价次数不能超过 500 次。

请各相关单位做好碳酸锂期权上市的各项准备工作，注意风险防范，确保市场平稳运行。

特此通知。

广州期货交易所

2023年7月14日