

大连商品交易所文件

大商所发〔2024〕342号

关于开展鸡蛋期权、玉米淀粉期权 和生猪期权全市场测试的通知

各会员单位和信息商：

为保障鸡蛋期权、玉米淀粉期权和生猪期权业务顺利推出，我所定于2024年7月27日（周六）在类生产环境开展全市场测试。现将有关事项通知如下：

一、测试前，请会员单位熟悉《鸡蛋期权、玉米淀粉期权和生猪期权全市场测试参数》（附件1）。请安排远程席位相关人员熟悉测试场景，做好数据准备。

二、测试时，请各单位根据《测试安排》（附件2）接入类生产环境，并按照规定完成测试内容。

三、测试后，请通过生产会服7.0系统反馈测试结果，样表见《测试反馈表（样表）》（附件3）。

请务必做好测试前后系统和数据的备份、恢复工作，确保下周一系统正常运行。

特此通知。

- 附件：1. 鸡蛋期权、玉米淀粉期权和生猪期权全市场测试参数
2. 测试安排
- 3.测试反馈表（样表）

大连商品交易所

2024年7月26日

附件 1

鸡蛋、玉米淀粉和生猪期权全市场测试参数

一、测试合约

大连商品交易所鸡蛋期货期权合约（草案）

合约标的物	鸡蛋期货合约
合约类型	看涨期权、看跌期权
交易单位	1 手（5 吨）鸡蛋期货合约
报价单位	元（人民币）/500 千克
最小变动价位	0.5 元/500 千克
涨跌停板幅度	与标的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	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	标的期货合约交割月份前一个月的第 12 个交易日，交易所可以根据国家法定节假日调整最后交易日
到期日	同最后交易日
行权价格	行权价格覆盖标的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。

	<p>最近六个自然月对应的期权合约：行权价格 ≤ 2000 元/500 千克，行权价格间距为 25 元/500 千克； 2000 元/500 千克 $<$ 行权价格 ≤ 4000 元/500 千克，行权价格间距为 50 元/500 千克；行权价格 > 4000 元/500 千克，行权价格间距为 100 元/500 千克。</p> <p>第七个及随后自然月对应的期权合约：行权价格 ≤ 2000 元/500 千克，行权价格间距为 50 元/500 千克； 2000 元/500 千克 $<$ 行权价格 ≤ 4000 元/500 千克，行权价格间距为 100 元/500 千克；行权价格 > 4000 元/500 千克，行权价格间距为 200 元/500 千克</p>
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	<p>看涨期权：JD-合约月份-C-行权价格</p> <p>看跌期权：JD-合约月份-P-行权价格</p>
上市交易所	大连商品交易所

大连商品交易所玉米淀粉期货期权合约（草案）

合约标的物	玉米淀粉期货合约
合约类型	看涨期权、看跌期权
交易单位	1 手（10 吨）玉米淀粉期货合约
报价单位	元（人民币）/吨
最小变动价位	0.5 元/吨

涨跌停板幅度	与标的期货合约涨跌停板幅度相同
合约月份	1、3、5、7、9、11月
交易时间	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	标的期货合约交割月份前一个月的第 12 个交易日，交易所可以根据国家法定节假日调整最后交易日
到期日	同最后交易日
行权价格	<p>行权价格覆盖标的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。</p> <p>最近六个自然月对应的期权合约：行权价格 ≤ 2000 元/吨，行权价格间距为 25 元/吨；2000 元/吨 $<$ 行权价格 ≤ 4000 元/吨，行权价格间距为 50 元/吨；行权价格 > 4000 元/吨，行权价格间距为 100 元/吨。</p> <p>第七个及随后自然月对应的期权合约：行权价格 ≤ 2000 元/吨，行权价格间距为 50 元/吨；2000 元/吨 $<$ 行权价格 ≤ 4000 元/吨，行权价格间距为 100 元/吨；行权价格 > 4000 元/吨，行权价格间距为 200 元/吨</p>
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	<p>看涨期权：CS-合约月份-C-行权价格</p> <p>看跌期权：CS-合约月份-P-行权价格</p>
上市交易所	大连商品交易所

大连商品交易所生猪期货期权合约（草案）

合约标的物	生猪期货合约
合约类型	看涨期权、看跌期权
交易单位	1手（16吨）生猪期货合约
报价单位	元（人民币）/吨
最小变动价位	2.5元/吨
涨跌停板幅度	与标的期货合约涨跌停板幅度相同
合约月份	1、3、5、7、9、11月
交易时间	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	标的期货合约交割月份前一个月的第 12 个交易日，交易所可以根据国家法定节假日调整最后交易日
到期日	同最后交易日
行权价格	<p>行权价格覆盖标的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。</p> <p>最近六个自然月对应的期权合约：行权价格 ≤ 10000 元/吨，行权价格间距为 100 元/吨；10000 元/吨 $<$ 行权价格 ≤ 20000 元/吨，行权价格间距为 200 元/吨；行权价格 > 20000 元/吨，行权价格间距为 400 元/吨。</p> <p>第七个及随后自然月对应的期权合约：行权价格</p>

	≤10000 元/吨，行权价格间距为 200 元/吨；10000 元/吨 < 行权价格 ≤20000 元/吨，行权价格间距为 400 元/吨；行权价格 > 20000 元/吨，行权价格间距为 800 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：LH-合约月份-C-行权价格 看跌期权：LH-合约月份-P-行权价格
上市交易所	大连商品交易所

二、挂牌合约月份

挂牌的鸡蛋、玉米淀粉和生猪期权对应标的合约月份从 2411（JD2411、CS2411 和 LH2411）开始，向后覆盖标的期货所有已上市交易的合约月份。

三、交易指令

提供限价指令和限价止损（盈）指令，每次最大下单数量与标的期货相同。

四、交易时间

与本次测试时间一致。

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，波动率取标的期货合约历史波动率。

六、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”。

七、持仓限额管理

鸡蛋期权持仓限额为 400 手，玉米淀粉期权持仓限额为 15000 手，生猪期权持仓限额为 125 手。鸡蛋、玉米淀粉和生猪期权与标的期货分开限仓。非期货公司会员和客户持有的某月份期权合约中所有看涨期权的买持仓量和看跌期权的卖持仓量之和、看跌期权的买持仓量和看涨期权的卖持仓量之和，分别不得超过期权合约的持仓限额。具有实际控制关系的账户按照一个账户管理。

八、组合保证金

鸡蛋期权 2501 合约月份、玉米淀粉期权 2501 合约月份及生猪期权 2501 合约月份的合约参与组合保证金优惠。

九、相关费用

鸡蛋期权交易手续费为 0.5 元/手，玉米淀粉期权交易手续费为 0.2 元/手，生猪期权交易手续费为 1.5 元/手。鸡蛋期权、玉米淀粉期权和生猪期权行权（履约）手续费收取标准与期权交易手续费相同。

鸡蛋期权套期保值交易手续费为 0.25 元/手，玉米淀粉期权套期保值交易手续费为 0.1 元/手，生猪期权套期保值交易手续费为 0.75 元/手。

十、合约询价

鸡蛋、玉米淀粉和生猪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做市商持续报价合约上向做市商询价，做市商持续报价合约以大商所网站发布为准。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上限为 200 次。

附件 2

测试安排

一、参加测试人员

远程席位和信息商相关人员。

二、测试安排

(一) 测试计划

本次测试使用类生产环境，测试的基本情况如下：

测试日期	基础数据	模拟交易日
2024年7月27日	7月25日结算后	7月26日和7月29日

(二) 测试时间安排

时间	内容	备注	
模拟第一个交易日			
8:50:00 前	会员、信息商接入系统，熟悉测试内容安排，准备测试	通过 FENS 登录交易系统	
8:55:00	夜盘	夜盘阶段只交易夜盘品种的期货期权合约	
8:59:00			集合竞价撮合
9:00:00			连续交易

9:30:00		连续交易暂停	
9:35:00	白盘	集合竞价申报	白盘阶段交易所有期货期权合约（不含鸡蛋期权、玉米淀粉期权和生猪期权）
9:39:00		集合竞价撮合	
9:40:00		连续交易	
10:00:00		连续交易暂停	
10:05:00		连续交易	
10:45:00		收市	
10:45-11:15		交易所结算	
11:15-12:00	会员单位通过类生产会服 7.0 系统下载测试结算数据。		<p>及时关注交易所技术群通知</p> <p>https://mtportal.dce.com.cn/gateway/auth/client/login</p> <p>gincert</p> <p>使用生产证书登录。</p>
模拟第二个交易日			
13:20:00前	会员、信息商接入系统，熟悉测试内容安排，准备测试		通过 FENS 登录交易系统
13:25:00	夜盘	集合竞价申报	夜盘阶段只交易夜盘品种的期货期权合约
13:29:00		集合竞价撮合	
13:30:00		连续交易	
13:40:00		连续交易暂停	
13:45:00	白盘	集合竞价申报	白盘阶段交易所有期货

13:49:00		集合竞价撮合	期权合约（包含鸡蛋期权、玉米淀粉期权和生猪期权）
13:50:00		连续交易	
14:45:00		连续交易暂停	
14:50:00		连续交易	
15:00:00		收市	
15:00-15:30	交易所结算		
15:30-16:00	会员单位通过类生产会服 7.0 系统下载测试结算数据。		<p>及时关注交易所技术群通知</p> <p>https://mtportal.dce.com.cn/gateway/auth/client/logincert</p> <p>使用生产证书登录。</p>
17:00 后	类生产会服 7.0 系统停止发送测试结算数据，开放生产会服 7.0 测试反馈表。		<p>https://bizportal.dce.com.cn/gateway/auth/client/logincert</p> <p>使用生产会服 7.0 系统填写本次测试反馈表</p>

三、测试接入参数

(一) 交易行情接入参数

1. DCE 交易 7.0 接口 FENS 地址:

FENS 地址	TCP 端口	类别	网关编号
10.93.249.1	7000	交易网关	1
10.93.249.2		辅助网关	2
		基本行情网关	3
		深度行情网关	4

2. DCE 交易 7.0 接口应急前置地址:

应急前置类型	地址范围	端口
交易网关	10.93.249.32-36	7100
辅助网关	10.93.249.1-3	7200
基本行情	10.93.249.133-136	7300
深度行情	10.93.249.141-142	7400

(二) DCE 会服 7.0 接入参数

服务	地址	端口
DCE 会服 7.0	10.93.36.21	443
		444

		446
		448
	10.93.36.22	443

DCE 会服 7.0 测试地址为

<https://mtportal.dce.com.cn/gateway/auth/client/logincert>，使用生产环境数字证书登录。

四、测试内容

序号	测试要求	交易日
1	<p>1.每席位鸡蛋、玉米淀粉和生猪期货各月份合约基本订单笔数分别不少于 200 笔、成交笔数分别不少于 10 笔，套利订单量分别不少于 20 笔。</p> <p>2.确保以上品种的所有合约均有正确委托单与正确成交单（包括套利订单），且相同订单不得连续超过 10 笔。</p>	7 月 26 日
2	<p>1.每席位鸡蛋、玉米淀粉和生猪期权各合约系列订单笔数不少于 200 笔、成交笔数不少于 50 笔（其中，套保成交各期权品种不少于 2 笔（如有上述品种套保资格）），行权不少于 10 笔，询价分别不少于 5 次；</p> <p>2.每席位鸡蛋、玉米淀粉和生猪期货各挂牌月</p>	7 月 29 日

<p>份合约基本订单笔数不少于 50 笔、成交笔数分别不少于 20 笔，套利订单量分别不少于 20 笔。</p> <p>3.确保以上期权的所有合约系列、期货的所有合约均有正确委托单与正确成交单（包括套利订单），且相同订单不得连续超过 10 笔。</p>	
--	--

五、注意事项

（一）测试前请根据测试接入指引开通网络策略。

（二）注意测试前备份以及测试后清理和恢复，避免生产环境发生故障。具体操作请咨询系统开发商。

（三）测试期间按照测试内容及时间安排进行操作。测试结束后，认真检查结果并填写测试反馈表。

六、测试期间联系方式

0411-84807930、84808717

附件 3

测试反馈表（样表）

会员情况			
会员名称			测试席位号
技术系统	姓名		电话
联系人	Email		
系统供应商	柜台：		
名称及系统	结算：		
版本	行情：		
交易部分			
类别	核对情况		备注
最小变动价位			
手续费			
保证金			
委托功能及速度			
撤单功能及速度			
成交回报及速度			
行情显示			
资金查询			
持仓查询			
委托查询			
成交查询			
行权			
组合申请/解锁			
结算部分			
交易中核对场上资金项目	核对情况		备注
上日结存			

当日入金			
当日出金			
平仓返还(保证金)			
平仓盈亏			
委托冻结保证金			
成交占用保证金			
可用资金			
结算参数检查项目	检查情况		备注
手续费参数表			
保证金参数表			
结算后核对项目	核对内容	核对情况	备注
资金结算表	表内各项数据		
	其它资金明细表		
每日资金变动表	表内各项数据		
平仓盈亏表	表内各项数据		
持仓表	持仓数量、盈亏、均价		
优惠组合持仓表	优惠持仓数量、交易保证金		
非优惠持仓表	非优惠持仓数量、交易保证金		
成交表	表内各项数据		
意见和建议:			