

关于合成橡胶期货和期权合约上市有关事项的通知

尊敬的客户：

根据上海期货交易所相关通知，合成橡胶期货合约自2023年7月28日（周五）起上市交易，合成橡胶期权合约自2023年7月28日（周五）晚上21:00起上市交易。现就有关事项通知如下：

一、挂牌合约

合成橡胶期货首批上市交易合约为BR2401、BR2402、BR2403、BR2404、BR2405、BR2406、BR2407。

合成橡胶期权首批上市交易合约为丁二烯橡胶期权首日挂牌BR2401、BR2402对应的期权合约。

二、挂盘基准价

合成橡胶期货各合约挂盘基准价由交易所在合约上市交易前一交易日公布。

合成橡胶期权由上期所在上市前一交易日公布。计算公式为二叉树期权定价模型，其中无风险利率取央行一年期存款利率，波动率以丁二烯橡胶现货价格90日历史波动率为基础进行确定。

三、交易保证金

合成橡胶期货合约的保证金比例为19%。

四、相关费用

合成橡胶期货合约交易手续费为成交金额的万分之零点五，平今仓交易暂免收交易手续费。

合成橡胶期货对客户信息量收取申报费，如下表所示。

表一：丁二烯橡胶期货申报费费率表

信息量 \ 报单成交比 OTR	OTR≤2	OTR>2
1笔≤信息量≤4000笔	0	0
4001笔≤信息量≤8000笔	0.01元/笔	0.02元/笔
8001笔≤信息量≤40000笔	0.05元/笔	0.1元/笔
40001笔≤信息量	1元/笔	2元/笔

注释：信息量=报单、撤单、询价等交易指令笔数之和。报单成交比（OTR）=（信息量/有成交的报单笔数）-1。有成交的报单笔数为0时，视其为1来计算OTR。上述信息量包括立即全部成交否则自动撤销指令（FOK）和立即成交剩余指令自动撤销指令（FAK）产生的报单和撤单笔数。

合成橡胶期权合约交易手续费标准为2.5元/手，平今仓交易暂免收交易手续费；行权（履约）手续费为2.5元/手；行权（履约）前期权自对冲手续费为2.5元/手，行权（履约）后期权自对冲暂免收手续费；

合成橡胶期权对客户信息量收取申报费，如下表所示。

表三：丁二烯橡胶期权申报费费率表

信息量 \ 报单成交比 OTR	OTR≤2	OTR>2
1笔≤信息量≤4000笔	0	0
4001笔≤信息量≤8000笔	0.01元/笔	0.02元/笔
8001笔≤信息量≤40000笔	0.05元/笔	0.1元/笔
40001笔≤信息量	1元/笔	2元/笔

注释：信息量=报单、撤单、询价等交易指令笔数之和。报单成交比（OTR）=（信息量/有成交的报单笔数）-1。有成交的报单笔数为0时，视其为1来计算OTR。上述信息量包括立即全部成交否则自动撤销指令（FOK）和立即成交剩余指令自动撤销指令（FAK）产生的报单和撤单笔数。

五、申报费

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
二〇二三年七月十九日