

附件 2

PTA 期权仿真交易参数

项目	参数值
期权定价初始波动率	10%
期权定价利率	4.35%
期权交易手续费	1 元/手（当日开平仓暂不减半）
行权（履约）手续费	1 元/手
行权后期货开仓手续费	0 元/手
期权限价单最大下单量	100 手
期权市价单最大下单量	20 手
客户期权限仓数量	25000 手
非经纪会员期权限仓数量	25000 手

注：PTA 期货仿真合约、规则及参数与实盘一致。