

# 关于中证 1000 股指期货和股指期权合约上市交易有关事项的通知

中金所发〔2022〕41 号

各会员单位：

中国证监会已正式批准中国金融期货交易所上市中证 1000 股指期货和股指期权合约。现将中证 1000 股指期货和股指期权合约上市交易有关事项通知如下：

## 一、上市交易时间

中证 1000 股指期货和股指期权合约自 2022 年 7 月 22 日（星期五）起上市交易。

## 二、上市交易合约和挂盘基准价

中证 1000 股指期货首批上市合约为 2022 年 8 月合约（IM2208）、2022 年 9 月合约（IM2209）、2022 年 12 月合约（IM2212）和 2023 年 3 月合约（IM2303）。

中证 1000 股指期权首批上市合约月份为 2022 年 8 月（M02208）、2022 年 9 月（M02209）、2022 年 10 月（M02210）、2022 年 12 月（M02212）、2023 年 3 月（M02303）和 2023 年 6 月（M02306）。

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。

### 三、交易指令每次最大下单数量

中证 1000 股指期货各合约限价指令的每次最大下单数量为 20 手，市价指令的每次最大下单数量为 10 手。

中证 1000 股指期权各合约限价指令的每次最大下单数量为 20 手。

### 四、交易保证金

中证 1000 股指期货各合约上市初期的交易保证金标准为 15%。

对沪深 300 股指期货、中证 500 股指期货、中证 1000 股指期货和上证 50 股指期货的跨品种双向持仓，按照交易保证金单边较大者收取交易保证金。

中证 1000 股指期权各合约的保证金调整系数为 15%，最低保障系数为 0.5。

### 五、持仓限额

同一客户某一月份中证 1000 股指期权合约单边持仓限额为 1200 手（在不同会员处持仓合并计算）。

### 六、相关费用

中证 1000 股指期货各合约的手续费标准暂定为成交金额的万分之零点二三，申报费为每笔 1 元。申报是指买入、卖出及撤销委托。

中证 1000 股指期货各合约的平今仓交易手续费标准为成交金额的万分之三点四五。

中证 1000 股指期货交割手续费至 2022 年 12 月 31 日止  
减半收取。

中证 1000 股指期权合约的手续费标准为每手 15 元，行  
权(履约)手续费标准为每手 2 元。交易所暂不收取中证 1000  
股指期权合约的申报费。

## 七、做市商

中证 1000 股指期权做市商可以在交易日 9:30-15:00，  
通过会员向交易所申请双向期权持仓自动对冲平仓，自动对  
冲平仓暂不收取手续费，申请后持续有效。做市商也可以在  
上述时间申请取消自动对冲平仓。做市商所有月份中证 1000  
股指期权合约单边持仓限额为 15000 手。做市商所有月份中  
证 1000 股指期货合约单边持仓限额为 4800 手。交易所将加  
强做市商梯队建设和精细化管理。

## 八、询价限制

客户对同一期权合约的询价时间间隔不得小于 60 秒。

期权合约最优买卖报价价差小于等于下表价差时，不得  
询价。

申报买价	当月合约报价价差	其余月份合约报价价差
小于 10 点	0.6 点	1 点
10 点或以上，小于 20 点	1 点	2 点
20 点或以上，小于 50 点	2.6 点	4 点
50 点或以上，小于 100 点	5 点	8 点
100 点或以上，小于 250 点	8 点	15 点
250 点或以上，小于 500 点	15 点	25 点
500 点或以上，小于 1000 点	30 点	50 点
1000 点或以上，小于 2000 点	60 点	100 点
2000 点或以上	120 点	200 点

交易所可以根据市场情况对本通知规定的具体标准、实施时间、相关措施等进行调整。中证 1000 股指期货和股指期权合约上市交易其他事项另行公布。

请各会员单位认真做好中证 1000 股指期货和股指期权合约上市交易的各项准备工作，严格控制市场风险，确保中证 1000 股指期货和股指期权平稳推出和安全运行。

特此通知。

中国金融期货交易所

2022 年 7 月 18 日