附件2

**中证1000 股指期权合约**

|  |  |
| --- | --- |
| 合约标的物 | 中证 1000 指数 |
| 合约乘数 | 每点人民币 100 元 |
| 合约类型 | 看涨期权、看跌期权 |
| 报价单位 | 指数点 |
| 最小变动价位 | 0.2 点 |
| 每日价格最大波动限制 | 上一交易日中证 1000 指数收盘价的±10% |
| 合约月份 | 当月、下 2 个月及随后 3 个季月 |
| 行权价格 | 行权价格覆盖中证1000指数上一交易日收盘价上下浮动 10%对应的价格范围 对当月与下 2 个月合约： 行权价格≤2500 点时，行权价格间距为 25 点；2500 点<行权价格≤5000 点时，行权价格间距为50 点；5000 点<行权价格≤10000 点时，行权价格间距为 100 点；行权价格>10000 点时, 行权价格间距为 200 点 对随后3个季月合约：行权价格≤2500 点时，行权价格间距为 50 点；2500 点<行权价格≤5000 点时，行权价格间距为 100 点；5000 点<行权价格≤10000 点时，行权价格间距为 200 点；行权价格>10000 点时, 行权价格间距为 400 点 |
| 行权方式 | 欧式 |
| 交易时间 | 9:30-11:30，13:00-15:00 |
| 最后交易日 | 合约到期月份的第三个星期五，遇国家法定假日顺延 |
| 到期日 | 同最后交易日 |
| 交割方式 | 现金交割 |
| 交易代码 | 看涨期权：MO 合约月份-C-行权价格看跌期权：MO 合约月份-P-行权价格 |
| 上市交易所 | 中国金融期货交易所 |