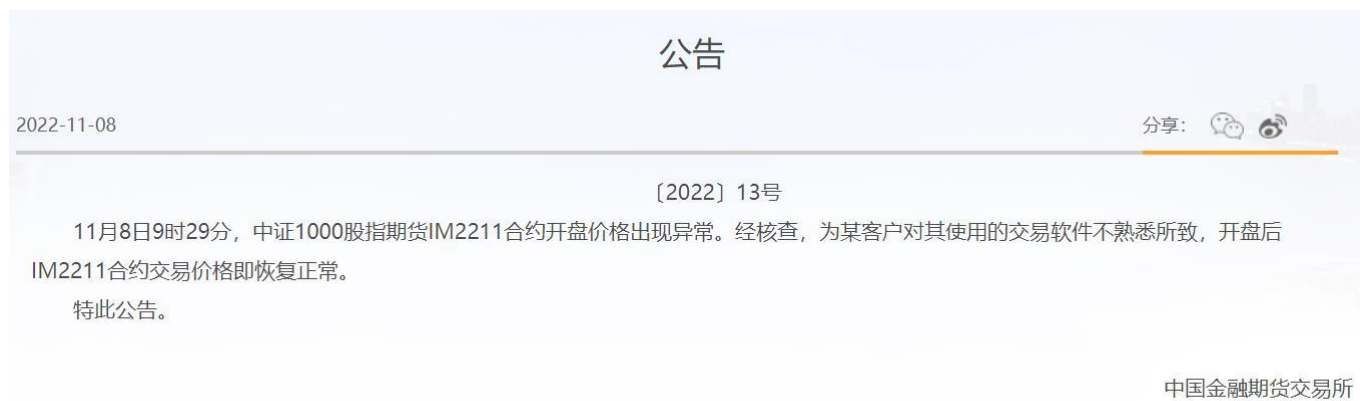


11月8日，中证1000股指期货
IM2211合约开盘价格出现异常一事，经监管核查，确定为乌龙指。

“经核查，为某客户对其使用的交易软件不熟悉所致，开盘后IM2211合约交易价格即恢复正常。”
当日下午，中国金融期货交易所（下称“中金所”）发布公告称。



当日早盘，IM2211合约以跌停价开盘，紧接着快速拉升，大幅收窄跌幅，之后盘中呈现平稳走势，截至收市报6707.6点，收跌0.14%，结算点位为6688.4点。

据第一财经了解，在上午9：29分
之时，也就是集合竞价
阶段，IM2211合约出现一笔83手的空单，报价为跌停价6045.4点。

这意味着，以卖者的平仓点位以及结算价来算的话，卖者此笔交易可能少赚了约1067万元【 $(6688.4 - 6045.4) * 83 * 200 = 10673800$ 】；以买方来看，一手则可能赚了12.86万元【 $(6688.4 - 6045.4) * 200 = 128600$ 】。

多位研究期指的人士认为，这可能是操作失误，从而出现了乌龙指。

09:29:00	6045.4	83	+443	空开	主动卖
09:30:00	6713.8↑	130	-8	空平	主动买
09:30:01	6715.8↑	84	+1	多开	主动买
2	6717.0↑	56	-20	空平	主动买
09:30:02	6716.6↓	53	-22	多平	主动卖
2	6716.6	45	-16	空平	主动买
09:30:03	6714.8↓	11	-3	多平	主动卖
2	6713.8↓	22	-12	多平	主动卖
09:30:04	6712.0↓	32	-30	多平	主动卖
2	6708.8↓	10	-8	多平	主动卖
09:30:05	6709.2↑	3	-1	多平	主动卖
2	6708.6↓	22	-19	多平	主动卖
09:30:06	6708.6	1	0	多换	主动买
2	6703.0↓	27	-6	多平	主动卖
09:30:07	6703.2↑	62	-33	多平	主动卖
2	6703.2	27	-11	空平	主动买
09:30:08	6698.4↓	16	-14	空平	主动买
2	6708.8↑	15	-13	空平	主动买

根据中证1000股指期货合约规则，集合竞价时间为每个交易日9:25~9:30，其中9:25~9:29为指令申报时间，9:29~9:30为指令撮合时间。

根据《中国金融期货交易所交易细则

》，集合竞价采用最大成交量原则，即以此价格成交能够得到最大成交量。高于集合竞价产生的价格的买入申报全部成交；低于集合竞价产生的价格的卖出申报全部成交；等于集合竞价产生的价格的买入或者卖出申报，根据买入申报量和卖出申报量的多少，按照少的一方的申报量成交。

这意味着，在8日中证1000股指期货集合竞价阶段，以跌停价成交的83手是最大的成交量。

“中证1000期货主力合约IM2211开盘成交了一笔83手跌停价6045.4的报单，很可能是报单失误造成的。”中信建投期货股指研究员对第一财经称，随后报价回归了正常，其他三个期限合约也正常运行，对市场影响有限，未来在做量化回测时要注意这种异常现象。

另一位期指分析师

也称，一般乌龙指都是至少几十手的量，可能是多单、空单一起平仓的指令出问题了，也可能是报单价格敲错了。

徽商期货期权部负责人李红霞

提示称，投资者在操作股票、期货、期权品种时，需要注意了解清楚交易时间、交易规则及交易撮合机制等，谨防发生操作风险，导致收益或者亏损超出预期。

今年7月22日，中证1000股指期货和期权相关合约在中金所挂牌上市。其中，中证1000股指期货是继沪深300股指期货、上证50股指期货、中证500股指期货之后上市的第四个股指期货品种。