



月度数据统计报告



中金所月度数据统计 2018年03月

一、当月各市场近一年月度成交量和月末持仓量

股指期货市场



国债市场



二、当月各产品近一年月度成交量和月末持仓量

沪深300指数期货



中证500指数期货



上证50指数期货



5年期国债期货



10年期国债期货



三、当月各产品成交额统计

产品	当月	占比	去年同期	同比	上月	环比	当年累计	去年同期	同比
IF	5953.54	29.16%	4451.49	33.74%	4405.84	35.13%	15756.56	9116.35	72.84%
IC	3667.76	17.96%	3911.35	-6.23%	2443.56	50.10%	9276.20	8371.47	10.81%
IH	3083.87	15.10%	1443.69	113.61%	2588.38	19.14%	8636.58	3119.34	176.87%
TF	1562.96	7.65%	2160.32	-27.65%	1664.50	-6.10%	5356.48	5658.87	-5.34%
T	6150.65	30.12%	12374.89	-50.30%	4833.33	27.25%	17862.44	32848.82	-45.62%
总计	20418.77	100%	24341.75	-16.12%	15935.60	28.13%	56888.27	59114.84	-3.77%

注：成交额：亿元(单边计算)

四、当月各产品成交量统计

产品	当月	占比	去年同期	同比	上月	环比	当年累计	去年同期	同比
IF	497126	25.04%	432841	14.85%	362954	36.97%	1282322	893813	43.47%
IC	303512	15.29%	305130	-0.53%	210264	44.35%	763748	664471	14.94%
IH	362397	18.26%	205208	76.60%	290567	24.72%	973826	443423	119.62%
TF	161689	8.15%	218779	-26.09%	173283	-6.69%	556700	572844	-2.82%
T	660265	33.26%	1290060	-48.82%	524892	25.79%	1932204	3429323	-43.66%
总计	1984989	100%	2452018	-19.05%	1561960	27.08%	5508800	6003874	-8.25%

注：成交量：手(单边计算)

五、当月各产品持仓量统计

产品	月末持仓	占比	去年同期	同比	上月	环比	月日均持仓	去年同期	同比	上月日均	环比
IF	42213	25.16%	51528	-18.08%	40101	5.27%	41034	50498	-18.74%	41076	-0.10%
IC	34750	20.71%	38678	-10.16%	30459	14.09%	31854	37779	-15.68%	30928	2.99%
IH	25704	15.32%	32821	-21.68%	22159	16.00%	23585	34986	-32.59%	23636	-0.22%
TF	19508	11.63%	18348	6.32%	19788	-1.41%	19312	16701	15.63%	23968	-19.43%
T	45594	27.18%	64502	-29.31%	41951	8.68%	43859	65854	-33.40%	48273	-9.14%
总计	167769	100%	205877	-18.51%	154458	8.62%	159644	205817	-22.43%	167881	-4.91%

注：持仓量：手(单边计算)

六、当月各产品最值统计

产品	最高成交量	日期	最高持仓量	日期	最高价	日期	最低价	日期
IF	30728	20180323	44181	20180323	4144.0	20180312	3680.0	20180323
IC	19683	20180315	34927	20180329	6295.8	20180312	5452.2	20180326
IH	21228	20180329	26915	20180329	2935.0	20180312	2607.6	20180329
TF	12612	20180323	20086	20180306	97.750	20180326	96.310	20180305
T	48052	20180323	48179	20180322	94.250	20180323	92.485	20180305

七、国债各产品交割数据统计

产品	交割量	交割金额	当年累计交割量	当年累计交割金额
TF	2025	199801.31	2025	199801.31
T	362	33366.50	362	33366.50
总计	2387	233167.80	2387	233167.80

注：1.交割量：手（单边计算） 2.交割金额：万元（单边计算）

指标说明

- 1.本报告约定：产品及市场的成交量、成交额、持仓量为单边数据。
- 2.单位：除特别说明，本报告中成交、持仓单位：手；金额指人民币金额。
- 3.统计范围：月度为选定月份交易数据，为方便比较，月报中增加截止上一年度同月的数据。
- 4.统计内容：包括中国金融期货交易所上市的所有产品。
- 5.舍入误差：本报告数字采用四舍五入方式计算。

地址：浦东世纪大道1600号陆家嘴商务广场6楼

邮编：200122

电话：021-5016-0666

传真：021-5016-0606

网址：www.cffex.com.cn

