



# 月度数据统计报告



# 中金所月度数据统计 2018年11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



### 2年期国债期货



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	8448.11	30.62%	4982.50	69.56%	7419.20	13.87%	67573.55	40248.73	67.89%
IC	4487.83	16.27%	3696.02	21.42%	3461.82	29.64%	37790.12	37661.37	0.34%
IH	3457.73	12.53%	2330.15	48.39%	3402.58	1.62%	31679.27	16737.57	89.27%
TS	159.53	0.58%	0.00	--	58.99	170.45%	626.25	0.00	--
TF	1426.20	5.17%	3862.01	-63.07%	958.18	48.85%	16803.73	25720.48	-34.67%
T	9606.30	34.82%	11521.97	-16.63%	5640.39	70.31%	77291.21	106053.94	-27.12%
总计	27585.70	100%	26392.66	4.52%	20941.15	31.73%	231764.12	226422.10	2.36%

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	876806	29.23%	407218	115.32%	780040	12.41%	6345781	3699662	71.52%
IC	504424	16.82%	288015	75.14%	408741	23.41%	3632382	3013558	20.53%
IH	468304	15.61%	268824	74.20%	461740	1.42%	4020064	2180601	84.36%
TS	7987	0.27%	0	--	2964	169.47%	31490	0	--
TF	144615	4.82%	401727	-64.00%	97711	48.00%	1725535	2634791	-34.51%
T	997330	33.25%	1244654	-19.87%	592086	68.44%	8175771	11165340	-26.78%
总计	2999466	100%	2610438	14.90%	2343282	28.00%	23931023	22693952	5.45%

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	63394	27.86%	41517	52.69%	64431	-1.61%	63663	42216	50.80%	60999	4.37%
IC	57155	25.11%	29756	92.08%	55403	3.16%	56169	29657	89.40%	52066	7.88%
IH	26532	11.66%	24192	9.67%	28964	-8.40%	26757	23879	12.05%	27536	-2.83%
TS	1059	0.47%	0	--	2917	-63.70%	2271	0	--	3092	-26.55%
TF	15844	6.96%	47727	-66.80%	18590	-14.77%	17638	53214	-66.85%	18259	-3.40%
T	63598	27.95%	62685	1.46%	71993	-11.66%	72501	69608	4.16%	61739	17.43%
总计	227582	100%	205877	10.54%	242298	-6.07%	238999	218573	9.35%	223689	6.84%

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	51784	20181102	67463	20181107	3307.8	20181102	3112.6	20181127
IC	30185	20181113	58651	20181113	4710.6	20181116	4124.4	20181130
IH	29334	20181102	29208	20181102	2560.0	20181102	2388.8	20181127
TS	972	20181129	3087	20181105	100.150	20181116	99.555	20181102
TF	9689	20181114	19021	20181114	100.145	20181130	97.365	20181102
T	58700	20181119	76438	20181114	97.195	20181119	95.400	20181102

### 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](http://www.cffex.com.cn)

