



# 月度数据统计报告



# 中金所月度数据统计 2018年12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 | 10704.22 | 36.34% | 4844.18  | 120.97% | 8448.11  | 26.71%  | 78277.77  | 45092.91  | 73.59%  |
| IC | 6092.53  | 20.68% | 3313.36  | 83.88%  | 4487.83  | 35.76%  | 43882.65  | 40974.73  | 7.10%   |
| IH | 3564.01  | 12.10% | 2266.59  | 57.24%  | 3457.73  | 3.07%   | 35243.28  | 19004.17  | 85.45%  |
| TS | 52.09    | 0.18%  | 0.00     | --      | 159.53   | -67.35% | 678.35    | 0.00      | --      |
| TF | 1161.41  | 3.94%  | 1798.81  | -35.43% | 1426.20  | -18.57% | 17965.14  | 27519.29  | -34.72% |
| T  | 7884.58  | 26.76% | 7276.97  | 8.35%   | 9606.30  | -17.92% | 85175.79  | 113330.91 | -24.84% |
| 总计 | 29458.85 | 100%   | 19499.91 | 51.07%  | 27585.70 | 6.79%   | 261222.97 | 245922.02 | 6.22%   |

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 | 1141044 | 34.80% | 401452  | 184.23% | 876806  | 30.14%  | 7486825  | 4101114  | 82.56%  |
| IC | 707861  | 21.59% | 267371  | 164.75% | 504424  | 40.33%  | 4340243  | 3280929  | 32.29%  |
| IH | 497195  | 15.16% | 262979  | 89.06%  | 468304  | 6.17%   | 4517259  | 2443580  | 84.86%  |
| TS | 2603    | 0.08%  | 0       | --      | 7987    | -67.41% | 34093    | 0        | --      |
| TF | 117359  | 3.58%  | 186543  | -37.09% | 144615  | -18.85% | 1842894  | 2821334  | -34.68% |
| T  | 812968  | 24.79% | 783641  | 3.74%   | 997330  | -18.49% | 8988739  | 11948981 | -24.77% |
| 总计 | 3279030 | 100%   | 1901986 | 72.40%  | 2999466 | 9.32%   | 27210053 | 24595938 | 10.63%  |

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 | 76320  | 29.50% | 38548  | 97.99%  | 63394  | 20.39% | 74572  | 39802  | 87.36%  | 63663  | 17.14%  |
| IC | 68531  | 26.49% | 28541  | 140.11% | 57155  | 19.90% | 66259  | 29306  | 126.09% | 56169  | 17.96%  |
| IH | 33774  | 13.06% | 20623  | 63.77%  | 26532  | 27.30% | 30567  | 21616  | 41.41%  | 26757  | 14.24%  |
| TS | 1033   | 0.40%  | 0      | --      | 1059   | -2.46% | 994    | 0      | --      | 2271   | -56.23% |
| TF | 15010  | 5.80%  | 46416  | -67.66% | 15844  | -5.26% | 15421  | 45650  | -66.22% | 17638  | -12.57% |
| T  | 64017  | 24.75% | 60987  | 4.97%   | 63598  | 0.66%  | 63579  | 60701  | 4.74%   | 72501  | -12.31% |
| 总计 | 258685 | 100%   | 195115 | 32.58%  | 227582 | 13.67% | 251393 | 197075 | 27.56%  | 238999 | 5.19%   |

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 | 77967 | 20181220 | 82534 | 20181220 | 3298.6  | 20181203 | 2953.8 | 20181225 |
| IC | 48346 | 20181220 | 71222 | 20181225 | 4528.0  | 20181204 | 3998.0 | 20181225 |
| IH | 35256 | 20181220 | 35419 | 20181220 | 2527.6  | 20181204 | 2254.0 | 20181225 |
| TS | 377   | 20181205 | 1060  | 20181203 | 100.475 | 20181224 | 99.720 | 20181203 |
| TF | 7587  | 20181213 | 17227 | 20181206 | 99.420  | 20181228 | 98.510 | 20181217 |
| T  | 62603 | 20181213 | 66964 | 20181204 | 97.775  | 20181228 | 96.240 | 20181217 |

## 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  |
|----|------|-----------|---------|-----------|
| TS | 316  | 64155.00  | 316     | 64155.00  |
| TF | 1945 | 195149.45 | 6296    | 626482.64 |
| T  | 1142 | 109481.14 | 2528    | 243261.90 |
| 总计 | 3403 | 368785.59 | 9140    | 933899.54 |

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

