



中金所月度数据统计



中金所月度数据统计 2024年07月

一、当月各市场近一年月度成交量和月末持仓量



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



中证1000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



30年期国债期货



沪深300指数期权



中证1000指数期权



上证50指数期权



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	20205.22	16.13%	19889.09	1.59%	17995.86	12.28%	148160.37	147898.58	0.18%
IC	18069.08	14.42%	14587.12	23.87%	17148.82	5.37%	143597.80	116425.69	23.34%
IM	33901.51	27.06%	13979.12	142.52%	28100.23	20.64%	233662.53	97519.81	139.61%
IH	7915.89	6.32%	9323.83	-15.10%	6976.37	13.47%	59530.38	69075.86	-13.82%
小计	80091.71	63.94%	57779.16	38.62%	70221.28	14.06%	584951.08	430919.93	35.74%
TS	11271.00	9.00%	13636.33	-17.35%	10347.52	8.92%	92600.20	101844.48	-9.08%
TF	10403.18	8.30%	10482.73	-0.76%	8194.35	26.96%	81848.82	76781.16	6.60%
T	12194.94	9.74%	15186.14	-19.70%	9677.27	26.02%	103633.87	105517.89	-1.79%
TL	10949.93	8.74%	2970.14	268.67%	7136.64	53.43%	63058.23	6835.19	822.55%
小计	44819.05	35.78%	42275.33	6.02%	35355.78	26.77%	341141.11	290978.73	17.24%
IO	73.30	0.06%	102.27	-28.32%	58.68	24.92%	598.28	634.56	-5.72%
MO	268.49	0.21%	88.40	203.73%	213.26	25.90%	1978.47	585.79	237.75%
HO	13.95	0.01%	30.40	-54.10%	12.17	14.61%	153.27	179.32	-14.53%
小计	355.75	0.28%	221.06	60.93%	284.11	25.22%	2730.02	1399.66	95.05%
总计	125266.50	100%	100275.56	24.92%	105861.18	18.33%	928822.21	723298.32	28.41%

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	1963325	10.54%	1706911	15.02%	1711968	14.68%	14325173	12356163	15.94%
IC	1887626	10.14%	1217875	54.99%	1678440	12.46%	14090449	9460059	48.95%
IM	3600673	19.34%	1077215	234.26%	2795716	28.79%	22918639	7308793	213.58%
IH	1108200	5.95%	1222066	-9.32%	969135	14.35%	8366874	8685304	-3.67%
小计	8559824	45.97%	5224067	63.85%	7155259	19.63%	59701135	37810319	57.90%
TS	552359	2.97%	672799	-17.90%	507969	8.74%	4556729	5041996	-9.62%
TF	999376	5.37%	1026200	-2.61%	790255	26.46%	7928640	7574328	4.68%
T	1156609	6.21%	1489033	-22.32%	923129	25.29%	9953399	10457678	-4.82%
TL	1002101	5.38%	301310	232.58%	660792	51.65%	5915559	698943	746.36%
小计	3710445	19.92%	3489342	6.34%	2882145	28.74%	28354327	23772945	19.27%
IO	1802517	9.68%	2190972	-17.73%	1473226	22.35%	13265166	13099226	1.27%
MO	3936838	21.14%	1385433	184.16%	3000271	31.22%	23307573	8538781	172.96%
HO	612558	3.29%	980212	-37.51%	536527	14.17%	5373279	5663256	-5.12%
小计	6351913	34.11%	4556617	39.40%	5010024	26.78%	41946018	27301263	53.64%
总计	18622182	100%	13270026	40.33%	15047428	23.76%	130001480	88884527	46.26%
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	241840	12.96%	243911	-0.85%	238712	1.31%	234373	215406	8.81%	241334	-2.88%
IC	256684	13.76%	282292	-9.07%	247216	3.83%	247510	279946	-11.59%	255226	-3.02%
IM	292918	15.70%	192081	52.50%	272425	7.52%	273147	177988	53.46%	265448	2.90%
IH	100941	5.41%	147054	-31.36%	110393	-8.56%	104225	140713	-25.93%	111264	-6.33%
小计	892383	47.84%	865338	3.13%	868746	2.72%	859254	814053	5.55%	873272	-1.61%
TS	66816	3.58%	57281	16.65%	61563	8.53%	62648	59214	5.80%	57822	8.35%
TF	146156	7.84%	126934	15.14%	131084	11.50%	133811	121570	10.07%	124043	7.87%
T	228800	12.27%	233362	-1.95%	207696	10.16%	210888	219817	-4.06%	194003	8.70%
TL	99685	5.34%	25206	295.48%	85055	17.20%	95375	22458	324.68%	78665	21.24%
小计	541457	29.03%	442783	22.28%	485398	11.55%	502722	423058	18.83%	454533	10.60%
IO	173119	9.28%	181097	-4.41%	160912	7.59%	170304	186645	-8.76%	176042	-3.26%
MO	192941	10.34%	99609	93.70%	184029	4.84%	200709	92525	116.92%	203663	-1.45%
HO	65512	3.51%	86244	-24.04%	64684	1.28%	63481	92259	-31.19%	73401	-13.51%
小计	431572	23.14%	366950	17.61%	409625	5.36%	434493	371428	16.98%	453107	-4.11%
总计	1865412	100%	1675071	11.36%	1763769	5.76%	1796470	1608539	11.68%	1780912	0.87%
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	122199	20240731	246193	20240709	3536.2	20240719	3331.0	20240730
IC	123161	20240731	259514	20240718	4998.4	20240701	4465.2	20240725
IM	220700	20240709	295238	20240709	4929.4	20240701	4303.0	20240725
IH	68863	20240719	114520	20240705	2447.0	20240719	2318.2	20240709
TS	40124	20240708	66816	20240731	102.268	20240731	101.806	20240708
TF	78246	20240708	147475	20240730	104.620	20240731	103.525	20240708
T	105912	20240701	228800	20240731	106.240	20240731	104.510	20240708

TL	97174	20240701	101897	20240719	111.750	20240731	107.230	20240708
IO	118997	20240719	187368	20240710	855.4	20240730	0.2	20240710
MO	287063	20240709	228236	20240717	2464.2	20240725	0.2	20240711
HO	42805	20240719	70494	20240710	561.0	20240730	0.2	20240703

七、期权各产品行权数据统计

产品	到期未平仓量	到期未行权量	行权量	当年累计到期未平仓量	当年累计到期未行权量	当年累计行权量
IO	53772	38962	14810	414728	331247	83481
MO	85118	68948	16170	560809	453202	107607
HO	22050	16430	5620	219858	176273	43585
总计	160940	124340	36600	1195395	960722	234673
注：到期未平仓量、到期未行权量、行权量：手（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

