



中金所月度数据统计



中金所月度数据统计 2024年09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	27295.68	17.49%	21899.79	24.64%	18245.89	49.60%	193701.94	199654.96	-2.98%
IC	21799.75	13.97%	16985.00	28.35%	16808.71	29.69%	182206.26	153081.74	19.03%
IM	36452.96	23.35%	17050.40	113.80%	30425.69	19.81%	300541.17	134187.32	123.97%
IH	10066.00	6.45%	9079.62	10.86%	6561.87	53.40%	76158.25	91086.01	-16.39%
小计	95614.38	61.25%	65014.81	47.07%	72042.17	32.72%	752607.63	578010.03	30.21%
TS	14864.34	9.52%	14895.83	-0.21%	19284.80	-22.92%	126749.34	133916.41	-5.35%
TF	12377.26	7.93%	11962.09	3.47%	16239.07	-23.78%	110465.15	103644.11	6.58%
T	15499.20	9.93%	16546.58	-6.33%	20841.29	-25.63%	139974.36	143808.58	-2.67%
TL	17142.35	10.98%	5139.13	233.57%	16791.84	2.09%	96992.42	16513.20	487.36%
小计	59883.15	38.36%	48543.63	23.36%	73157.00	-18.14%	474181.26	397882.31	19.18%
IO	187.42	0.12%	89.50	109.40%	60.83	208.10%	846.53	881.39	-3.95%
MO	356.26	0.23%	100.49	254.53%	214.23	66.29%	2548.96	837.51	204.35%
HO	52.27	0.03%	25.42	105.60%	12.65	313.27%	218.19	256.76	-15.02%
小计	595.95	0.38%	215.41	176.66%	287.71	107.14%	3613.68	1975.65	82.91%
总计	156093.49	100%	113773.85	37.20%	145486.88	7.29%	1230402.58	977867.99	25.83%

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	2652466	11.67%	1941439	36.62%	1826017	45.26%	18803656	16870887	11.46%
IC	2296692	10.10%	1484110	54.75%	1810401	26.86%	18197542	12623370	44.16%
IM	3907728	17.19%	1403329	178.46%	3302620	18.32%	30128987	10291145	192.77%
IH	1395430	6.14%	1190819	17.18%	937679	48.82%	10699983	11553293	-7.39%
小计	10252316	45.09%	6019697	70.31%	7876717	30.16%	77830168	51338695	51.60%
TS	726000	3.19%	736150	-1.38%	944039	-23.10%	6226768	6625209	-6.01%
TF	1178853	5.19%	1174188	0.40%	1554818	-24.18%	10662311	10203969	4.49%
T	1457339	6.41%	1625993	-10.37%	1969374	-26.00%	13380112	14206656	-5.82%
TL	1514179	6.66%	518425	192.07%	1507716	0.43%	8937454	1669790	435.24%
小计	4876371	21.45%	4054756	20.26%	5975947	-18.40%	39206645	32705624	19.88%
IO	2481936	10.92%	1880372	31.99%	1549496	60.18%	17296598	18157547	-4.74%
MO	4108187	18.07%	1551563	164.78%	3389707	21.20%	30805467	12232643	151.83%
HO	1016536	4.47%	833135	22.01%	559800	81.59%	6949615	8066695	-13.85%
小计	7606659	33.46%	4265070	78.35%	5499003	38.33%	55051680	38456885	43.15%
总计	22735346	100%	14339523	58.55%	19351667	17.49%	172088493	122501204	40.48%
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	294520	15.64%	260022	13.27%	241658	21.87%	248884	259970	-4.26%	228617	8.87%
IC	260397	13.83%	287710	-9.49%	250816	3.82%	251342	298757	-15.87%	244673	2.73%
IM	307438	16.32%	208869	47.19%	298351	3.05%	293260	211744	38.50%	277918	5.52%
IH	133355	7.08%	129636	2.87%	99943	33.43%	104867	132716	-20.98%	97828	7.20%
小计	995710	52.87%	886237	12.35%	890768	11.78%	898353	903187	-0.54%	849035	5.81%
TS	66370	3.52%	70477	-5.83%	54182	22.49%	66552	65222	2.04%	60760	9.53%
TF	131765	7.00%	117726	11.93%	118012	11.65%	130334	115027	13.31%	137938	-5.51%
T	202536	10.75%	195836	3.42%	205395	-1.39%	217969	194829	11.88%	222880	-2.20%
TL	85436	4.54%	40233	112.35%	86976	-1.77%	89883	38687	132.33%	105618	-14.90%
小计	486107	25.81%	424272	14.57%	464565	4.64%	504738	413765	21.99%	527196	-4.26%
IO	163127	8.66%	213746	-23.68%	171662	-4.97%	183120	216646	-15.48%	177094	3.40%
MO	167074	8.87%	121360	37.67%	219310	-23.82%	215799	127816	68.84%	213880	0.90%
HO	71424	3.79%	100694	-29.07%	59127	20.80%	65724	97598	-32.66%	64215	2.35%
小计	401625	21.32%	435800	-7.84%	450099	-10.77%	464643	442060	5.11%	455189	2.08%
总计	1883442	100%	1746309	7.85%	1805432	4.32%	1867734	1759013	6.18%	1831420	1.98%
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	376070	20240930	294520	20240930	4171.2	20240930	3110.0	20240918
IC	253379	20240927	274918	20240924	5902.8	20240930	4253.6	20240918
IM	420560	20240927	328523	20240926	5813.4	20240930	4138.2	20240918
IH	214499	20240930	133355	20240930	2905.2	20240930	2192.0	20240919
TS	60922	20240927	74559	20240925	102.548	20240925	102.130	20240930
TF	129544	20240927	146542	20240926	105.415	20240926	104.185	20240927
T	202325	20240927	228588	20240920	107.500	20240913	104.500	20240930

TL	219725	20240927	93809	20240926	116.000	20240924	107.920	20240930
IO	412407	20240927	223138	20240918	1356.6	20240930	0.2	20240919
MO	445539	20240927	266659	20240918	2645.6	20240918	0.2	20240919
HO	177184	20240927	79700	20240918	924.0	20240930	0.2	20240912

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	100869	79152	21717	586590	466483	120107
MO	121769	103091	18678	769280	631797	137483
HO	43505	35416	8089	294244	236938	57306
总计	266143	217659	48484	1650114	1335218	314896
注：到期未平仓量、到期未行权量、行权量：手（单边计算）						

八、国债期货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	760	156534.92	6284	1277936.74
TF	1630	172231.99	12257	1273790.26
T	5977	616364.24	10965	1130147.94
TL	2334	304216.47	5906	747601.25
总计	10701	1249347.62	35412	4429476.20
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

