



# 中金所月度数据统计



# 中金所月度数据统计 2023年09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



### 国债期货市场



### 股指期权市场

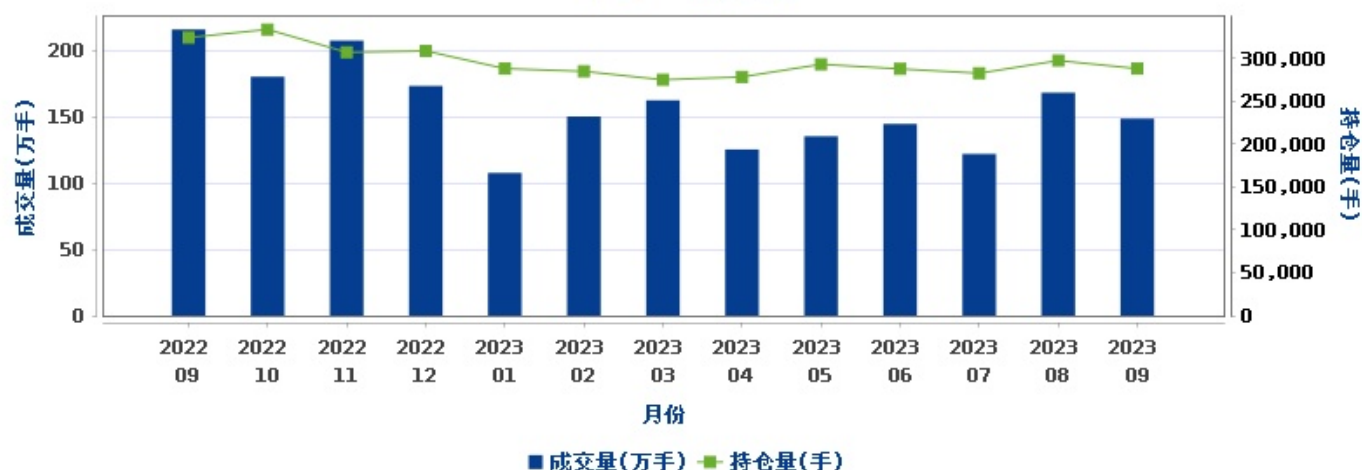


## 二、当月各产品近一年月度成交量和月末持仓量

### 沪深300指数期货



### 中证500指数期货



### 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	21899.79	19.25%	21872.26	0.13%	29856.59	-26.65%	199654.96	259043.22	-22.93%
IC	16985.00	14.93%	25925.28	-34.48%	19671.05	-13.65%	153081.74	255510.89	-40.09%
IM	17050.40	14.99%	15840.07	7.64%	19617.11	-13.08%	134187.32	32872.58	308.20%
IH	9079.62	7.98%	9607.54	-5.49%	12930.54	-29.78%	91086.01	95437.64	-4.56%
小计	65014.81	57.14%	73245.14	-11.24%	82075.29	-20.79%	578010.03	642864.34	-10.09%
TS	14895.83	13.09%	16331.86	-8.79%	17176.10	-13.28%	133916.41	86413.39	54.97%
TF	11962.09	10.51%	10475.69	14.19%	14900.87	-19.72%	103644.11	78518.28	32.00%
T	16546.58	14.54%	16128.32	2.59%	21744.11	-23.90%	143808.58	140494.70	2.36%
TL	5139.13	4.52%	0.00	--	4538.88	13.22%	16513.20	0.00	--
小计	48543.63	42.67%	42935.87	13.06%	58359.95	-16.82%	397882.31	305426.36	30.27%
IO	89.50	0.08%	118.42	-24.42%	157.33	-43.11%	881.39	1632.24	-46.00%
MO	100.49	0.09%	128.03	-21.51%	151.24	-33.56%	837.51	243.90	243.39%
HO	25.42	0.02%	0.00	--	52.01	-51.12%	256.76	0.00	--
小计	215.41	0.19%	246.45	-12.59%	360.58	-40.26%	1975.65	1876.14	5.30%
总计	113773.85	100%	116427.46	-2.28%	140795.82	-19.19%	977867.99	950166.84	2.92%

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	1941439	13.54%	1837638	5.65%	2573285	-24.55%	16870887	20407730	-17.33%
IC	1484110	10.35%	2155582	-31.15%	1679201	-11.62%	12623370	20619705	-38.78%
IM	1403329	9.79%	1223006	14.74%	1579023	-11.13%	10291145	2435878	322.48%
IH	1190819	8.30%	1187744	0.26%	1677170	-29.00%	11553293	11037912	4.67%
小计	6019697	41.98%	6403970	-6.00%	7508679	-19.83%	51338695	54501225	-5.80%
TS	736150	5.13%	807047	-8.78%	847063	-13.09%	6625209	4271741	55.09%
TF	1174188	8.19%	1029220	14.09%	1455453	-19.32%	10203969	7723994	32.11%
T	1625993	11.34%	1592609	2.10%	2122985	-23.41%	14206656	13957807	1.78%
TL	518425	3.62%	0	--	452422	14.59%	1669790	0	--
小计	4054756	28.28%	3428876	18.25%	4877923	-16.88%	32705624	25953542	26.02%
IO	1880372	13.11%	2033753	-7.54%	3177949	-40.83%	18157547	24378681	-25.52%
MO	1551563	10.82%	1365282	13.64%	2142299	-27.57%	12232643	2613923	367.98%
HO	833135	5.81%	0	--	1570304	-46.94%	8066695	0	--
小计	4265070	29.74%	3399035	25.48%	6890552	-38.10%	38456885	26992604	42.47%
总计	14339523	100%	13231881	8.37%	19277154	-25.61%	122501204	107447371	14.01%

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	260022	14.89%	178438	45.72%	267647	-2.85%	259970	176629	47.18%	258704	0.49%
IC	287710	16.48%	323873	-11.17%	297066	-3.15%	298757	318949	-6.33%	291448	2.51%
IM	208869	11.96%	100632	107.56%	213583	-2.21%	211744	87190	142.85%	200483	5.62%
IH	129636	7.42%	119849	8.17%	141309	-8.26%	132716	121325	9.39%	146337	-9.31%
小计	886237	50.75%	722792	22.61%	919605	-3.63%	903187	704092	28.28%	896972	0.69%
TS	70477	4.04%	59346	18.76%	55657	26.63%	65222	58626	11.25%	64483	1.15%
TF	117726	6.74%	129040	-8.77%	105523	11.56%	115027	128605	-10.56%	133572	-13.88%
T	195836	11.21%	194677	0.60%	185342	5.66%	194829	186910	4.24%	231574	-15.87%
TL	40233	2.30%	0	--	32851	22.47%	38687	0	--	29545	30.94%
小计	424272	24.30%	383063	10.76%	379373	11.84%	413765	374140	10.59%	459175	-9.89%
IO	213746	12.24%	157609	35.62%	245103	-12.79%	216646	157672	37.40%	227918	-4.95%
MO	121360	6.95%	60785	99.65%	136316	-10.97%	127816	49020	160.74%	118138	8.19%
HO	100694	5.77%	0	--	118927	-15.33%	97598	0	--	109946	-11.23%
小计	435800	24.96%	218394	99.55%	500346	-12.90%	442060	206692	113.87%	456002	-3.06%
总计	1746309	100%	1324249	31.87%	1799324	-2.95%	1759013	1284924	36.90%	1812149	-2.93%

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	151334	20230915	269842	20230911	3923.8	20230904	3678.2	20230922
IC	127669	20230911	318994	20230911	5845.2	20230904	5609.2	20230922
IM	110432	20230913	222129	20230913	6208.8	20230905	5894.2	20230922
IH	92538	20230915	143576	20230904	2624.2	20230904	2496.8	20230922
TS	48696	20230911	70477	20230928	101.365	20230901	100.970	20230911
TF	73546	20230906	119172	20230922	102.320	20230901	101.265	20230926
T	98732	20230904	202108	20230925	102.740	20230901	100.780	20230926

TL	35089	20230915	40468	20230927	101.090	20230901	97.280	20230926
IO	180814	20230915	254688	20230914	992.6	20230921	0.2	20230904
MO	143784	20230915	150667	20230914	1782.4	20230915	0.2	20230912
HO	75319	20230904	118071	20230901	686.2	20230915	0.2	20230904

## 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	106827	82782	24045	571528	446385	125143
MO	57440	47741	9699	315571	246632	68939
HO	55261	45023	10238	308837	253398	55439
总计	219528	175546	43982	1195936	946415	249521

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	3952	800916.02	6892	1396714.70
TF	2190	223639.91	3820	389921.41
T	3523	354780.88	9957	999180.70
TL	1223	135858.15	1563	171699.90
总计	10888	1515194.96	22232	2957516.71

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)

