



中金所月度数据统计



中金所月度数据统计 2023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

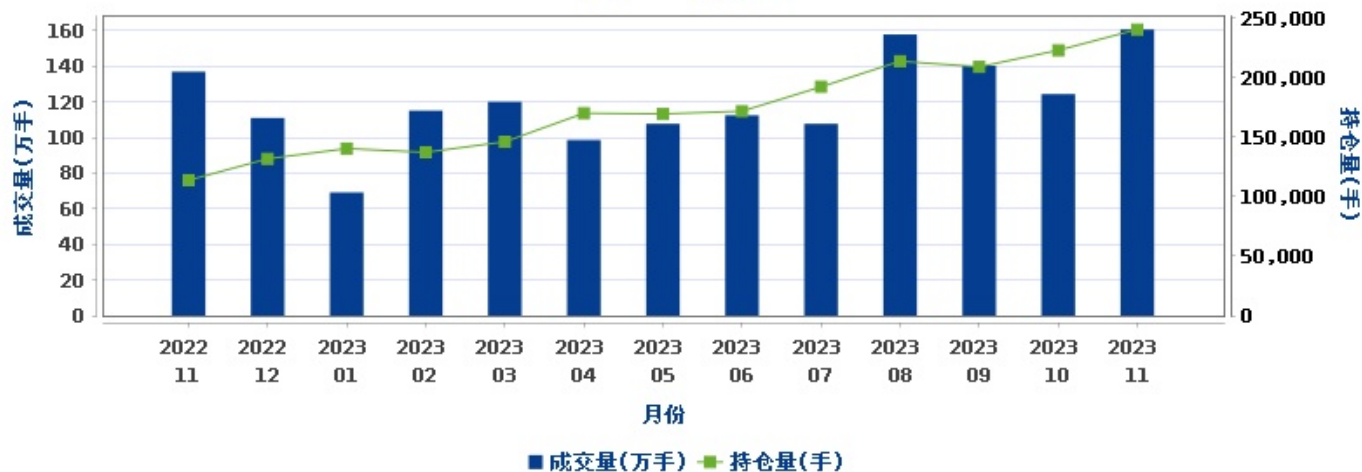
沪深300指数期货



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



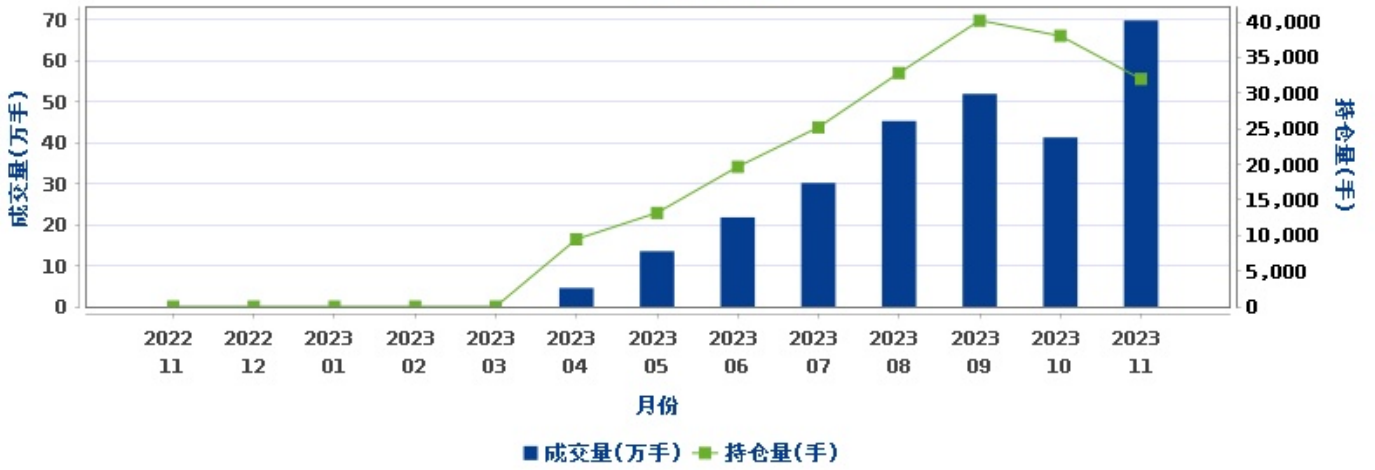
5年期国债期货



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	21013.96	15.96%	28285.52	-25.71%	18786.56	11.86%	239455.48	306515.83	-21.88%
IC	16698.24	12.69%	25307.86	-34.02%	14093.64	18.48%	183873.62	301949.11	-39.10%
IM	19492.30	14.81%	18026.52	8.13%	14611.51	33.40%	168291.12	65986.01	155.04%
IH	8033.32	6.10%	12769.08	-37.09%	7406.79	8.46%	106526.13	117072.51	-9.01%
小计	65237.83	49.56%	84388.98	-22.69%	54898.50	18.83%	698146.35	791523.46	-11.80%
TS	22824.44	17.34%	25182.21	-9.36%	16139.18	41.42%	172880.03	124176.23	39.22%
TF	15341.90	11.66%	19254.99	-20.32%	11370.79	34.92%	130356.80	106112.13	22.85%
T	21090.35	16.02%	30746.27	-31.41%	14376.10	46.70%	179275.04	182864.00	-1.96%
TL	6918.44	5.26%	0.00	--	4057.82	70.50%	27489.47	0.00	--
小计	66175.13	50.27%	75183.47	-11.98%	45943.89	44.03%	510001.33	413152.36	23.44%
IO	79.06	0.06%	174.29	-54.64%	85.28	-7.29%	1045.72	1934.94	-45.96%
MO	119.15	0.09%	123.43	-3.47%	95.39	24.91%	1052.05	495.25	112.43%
HO	20.87	0.02%	0.00	--	24.00	-13.04%	301.62	0.00	--
小计	219.08	0.17%	297.72	-26.41%	204.66	7.05%	2399.40	2430.19	-1.27%
总计	131632.04	100%	159870.17	-17.66%	101047.05	30.27%	1210547.08	1207106.01	0.29%

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	1956816	12.18%	2505097	-21.89%	1744680	12.16%	20572383	24635986	-16.49%
IC	1501653	9.35%	2071732	-27.52%	1283019	17.04%	15408042	24491129	-37.09%
IM	1607127	10.01%	1369844	17.32%	1243963	29.19%	13142235	5005456	162.56%
IH	1108724	6.90%	1699514	-34.76%	1011574	9.60%	13673591	13931142	-1.85%
小计	6174320	38.45%	7646187	-19.25%	5283236	16.87%	62796251	68063713	-7.74%
TS	1129935	7.04%	1246789	-9.37%	798685	41.47%	8553829	6139946	39.31%
TF	1505300	9.37%	1902935	-20.90%	1118018	34.64%	12827287	10445965	22.80%
T	2068364	12.88%	3064636	-32.51%	1415314	46.14%	17690334	18170779	-2.64%
TL	697539	4.34%	0	--	412331	69.17%	2779660	0	--
小计	5401138	33.63%	6214360	-13.09%	3744348	44.25%	41851110	34756690	20.41%
IO	1837839	11.44%	2970761	-38.14%	1900010	-3.27%	21895396	29483402	-25.74%
MO	1854507	11.55%	1565948	18.43%	1455250	27.44%	15542400	5627349	176.19%
HO	791505	4.93%	0	--	884961	-10.56%	9743161	0	--
小计	4483851	27.92%	4536709	-1.17%	4240221	5.75%	47180957	35110751	34.38%
总计	16059309	100%	18397256	-12.71%	13267805	21.04%	151828318	137931154	10.08%

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	268787	15.38%	195887	37.22%	266514	0.85%	270208	201251	34.26%	272774	-0.94%
IC	297124	17.00%	306736	-3.13%	300612	-1.16%	297884	314662	-5.33%	298488	-0.20%
IM	240277	13.75%	113638	111.44%	222781	7.85%	231884	116715	98.68%	219206	5.78%
IH	133831	7.66%	129343	3.47%	129997	2.95%	130956	124371	5.29%	133917	-2.21%
小计	940019	53.78%	745604	26.07%	919904	2.19%	930932	756999	22.98%	924384	0.71%
TS	61107	3.50%	40510	50.84%	72529	-15.75%	73424	70381	4.32%	75340	-2.54%
TF	95366	5.46%	101634	-6.17%	119123	-19.94%	119468	130104	-8.17%	118212	1.06%
T	169937	9.72%	179858	-5.52%	189302	-10.23%	199141	212175	-6.14%	194918	2.17%
TL	31989	1.83%	0	--	38060	-15.95%	39388	0	--	40294	-2.25%
小计	358399	20.51%	322002	11.30%	419014	-14.47%	431422	412659	4.55%	428764	0.62%
IO	212906	12.18%	170271	25.04%	211786	0.53%	208680	174910	19.31%	220233	-5.25%
MO	144071	8.24%	65042	121.50%	129855	10.95%	138069	68149	102.60%	124495	10.90%
HO	92372	5.29%	0	--	95743	-3.52%	90895	0	--	99893	-9.01%
小计	449349	25.71%	235313	90.96%	437384	2.74%	437644	243059	80.06%	444621	-1.57%
总计	1747767	100%	1302919	34.14%	1776302	-1.61%	1799998	1412717	27.41%	1797770	0.12%

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	111426	20231115	274578	20231123	3670.0	20231106	3483.0	20231129
IC	91945	20231115	304801	20231114	5686.0	20231115	5355.0	20231130
IM	87599	20231116	240277	20231130	6237.0	20231121	5774.4	20231102
IH	66712	20231121	139718	20231127	2485.6	20231106	2350.4	20231129
TS	68522	20231115	78507	20231115	101.142	20231117	100.740	20231127
TF	101372	20231123	127017	20231113	102.150	20231113	101.540	20231127
T	128808	20231122	217379	20231121	102.245	20231117	101.205	20231101

TL	45157	20231117	43170	20231113	99.780	20231117	97.900	20231101
IO	121301	20231115	229980	20231115	1213.8	20231129	0.2	20231114
MO	112936	20231114	151158	20231116	1897.4	20231102	0.2	20231113
HO	54526	20231117	100756	20231115	825.8	20231128	0.2	20231114

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	63689	50897	12792	723024	564946	158078
MO	41349	32080	9269	398281	310494	87787
HO	35583	28626	6957	393124	321389	71735
总计	140621	111603	29018	1514429	1196829	317600

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

