



中金所月度数据统计



中金所月度数据统计 2023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

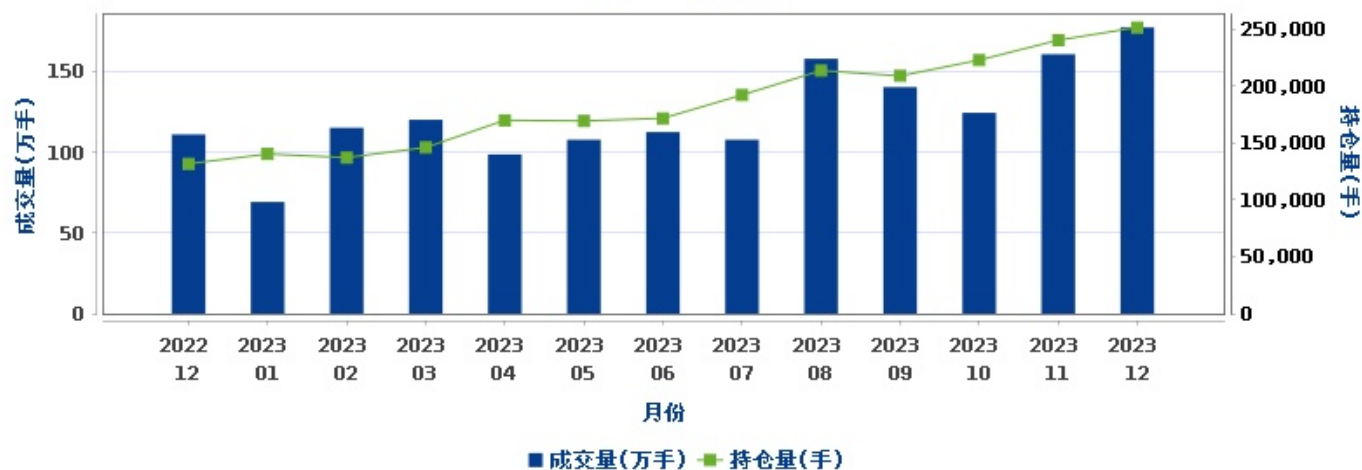
沪深300指数期货



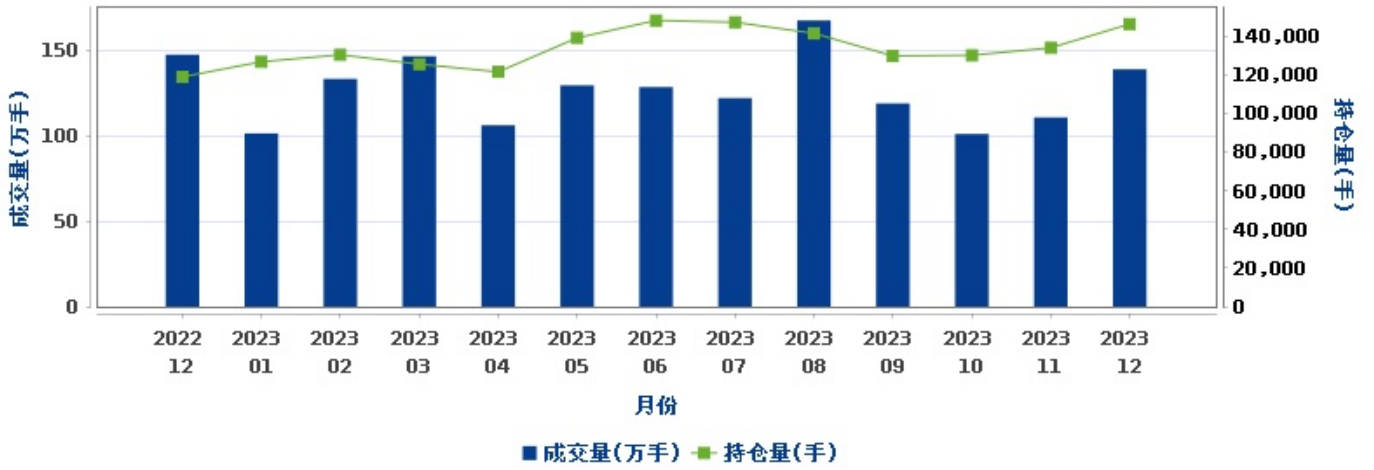
中证500指数期货



中证1000指数期货



上证50指数期货



2年期国债期货



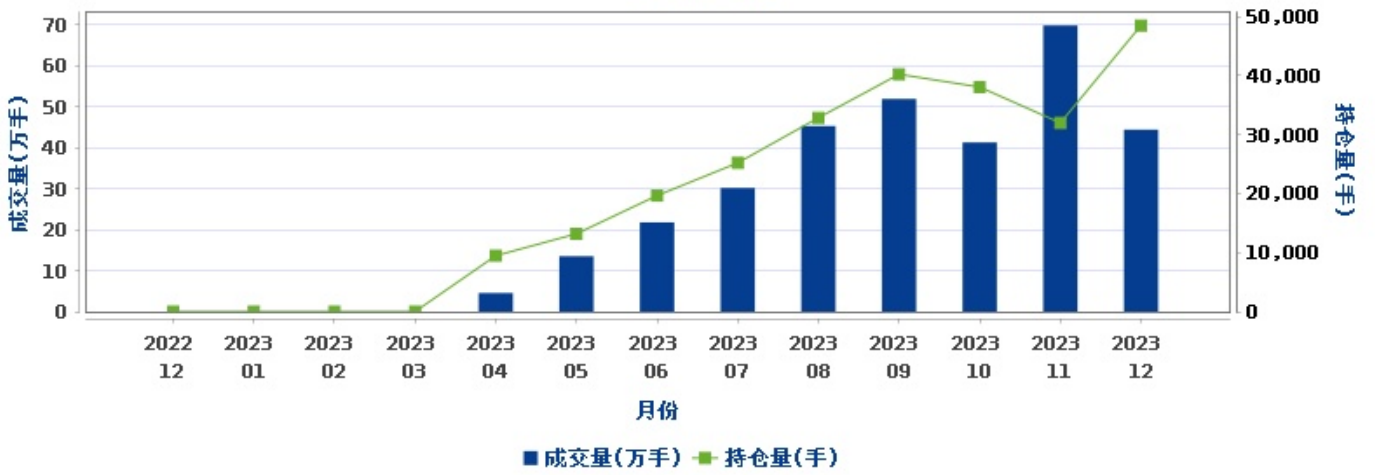
5年期国债期货



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	23651.08	19.52%	24922.37	-5.10%	21013.96	12.55%	263106.56	331438.21	-20.62%
IC	19101.47	15.77%	20939.63	-8.78%	16698.24	14.39%	202975.09	322888.74	-37.14%
IM	20810.02	17.18%	14369.79	44.82%	19492.30	6.76%	189101.15	80355.80	135.33%
IH	9532.28	7.87%	11797.67	-19.20%	8033.32	18.66%	116058.40	128870.18	-9.94%
小计	73094.85	60.33%	72029.47	1.48%	65237.83	12.04%	771241.20	863552.93	-10.69%
TS	17666.36	14.58%	20584.60	-14.18%	22824.44	-22.60%	190546.39	144760.83	31.63%
TF	11910.31	9.83%	12285.64	-3.06%	15341.90	-22.37%	142267.11	118397.77	20.16%
T	13725.75	11.33%	18142.65	-24.35%	21090.35	-34.92%	193000.79	201006.65	-3.98%
TL	4462.49	3.68%	0.00	--	6918.44	-35.50%	31951.96	0.00	--
小计	47764.92	39.43%	51012.89	-6.37%	66175.13	-27.82%	557766.25	464165.25	20.17%
IO	119.35	0.10%	120.12	-0.64%	79.06	50.96%	1165.07	2055.06	-43.31%
MO	135.59	0.11%	85.10	59.34%	119.15	13.80%	1187.64	580.34	104.64%
HO	36.92	0.03%	7.91	366.92%	20.87	76.92%	338.55	7.91	4181.28%
小计	291.86	0.24%	213.12	36.95%	219.08	33.22%	2691.25	2643.31	1.81%
总计	121151.63	100%	123255.48	-1.71%	131632.04	-7.96%	1331698.71	1330361.49	0.10%

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	2329783	14.11%	2113456	10.24%	1956816	19.06%	22902166	26749442	-14.38%
IC	1763789	10.68%	1729943	1.96%	1501653	17.46%	17171831	26221072	-34.51%
IM	1773017	10.74%	1110047	59.72%	1607127	10.32%	14915252	6115503	143.89%
IH	1390989	8.42%	1476547	-5.79%	1108724	25.46%	15064580	15407689	-2.23%
小计	7257578	43.95%	6429993	12.87%	6174320	17.54%	70053829	74493706	-5.96%
TS	873504	5.29%	1021583	-14.50%	1129935	-22.69%	9427333	7161529	31.64%
TF	1165659	7.06%	1219596	-4.42%	1505300	-22.56%	13992946	11665561	19.95%
T	1340138	8.12%	1818647	-26.31%	2068364	-35.21%	19030472	19989426	-4.80%
TL	443472	2.69%	0	--	697539	-36.42%	3223132	0	--
小计	3822773	23.15%	4059826	-5.84%	5401138	-29.22%	45673883	38816516	17.67%
IO	2303147	13.95%	2070066	11.26%	1837839	25.32%	24198543	31553468	-23.31%
MO	1980504	11.99%	1170114	69.26%	1854507	6.79%	17522904	6797463	157.79%
HO	1147728	6.95%	200627	472.07%	791505	45.01%	10890889	200627	5328.43%
小计	5431379	32.89%	3440807	57.85%	4483851	21.13%	52612336	38551558	36.47%
总计	16511730	100%	13930626	18.53%	16059309	2.82%	168340048	151861780	10.85%

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	273503	14.76%	197214	38.68%	268787	1.75%	274597	204484	34.29%	270208	1.62%
IC	291411	15.73%	308286	-5.47%	297124	-1.92%	294499	305036	-3.45%	297884	-1.14%
IM	251461	13.57%	131664	90.99%	240277	4.65%	245486	124777	96.74%	231884	5.87%
IH	146158	7.89%	118796	23.03%	133831	9.21%	143362	125762	13.99%	130956	9.47%
小计	962533	51.95%	755960	27.33%	940019	2.40%	957944	760059	26.04%	930932	2.90%
TS	71532	3.86%	44027	62.47%	61107	17.06%	64498	42889	50.38%	73424	-12.16%
TF	118543	6.40%	93502	26.78%	95366	24.30%	111217	99312	11.99%	119468	-6.91%
T	205045	11.07%	162940	25.84%	169937	20.66%	192980	164927	17.01%	199141	-3.09%
TL	48512	2.62%	0	--	31989	51.65%	40369	0	--	39388	2.49%
小计	443632	23.94%	300469	47.65%	358399	23.78%	409065	307128	33.19%	431422	-5.18%
IO	200244	10.81%	144486	38.59%	212906	-5.95%	206909	158100	30.87%	208680	-0.85%
MO	153484	8.28%	66250	131.67%	144071	6.53%	140252	63693	120.20%	138069	1.58%
HO	92835	5.01%	26284	253.20%	92372	0.50%	91940	8908	932.11%	90895	1.15%
小计	446563	24.10%	237020	88.41%	449349	-0.62%	439101	230701	90.33%	437644	0.33%
总计	1852728	100%	1293449	43.24%	1747767	6.01%	1806110	1297888	39.16%	1799998	0.34%

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	171725	20231215	291028	20231228	3511.0	20231201	3291.4	20231221
IC	119649	20231211	302167	20231211	5588.0	20231211	5150.2	20231227
IM	107225	20231211	258319	20231228	6110.8	20231201	5469.8	20231227
IH	107054	20231215	153203	20231228	2378.4	20231201	2222.4	20231218
TS	54917	20231214	73050	20231228	101.414	20231228	100.726	20231207
TF	86269	20231214	119357	20231221	102.685	20231228	101.560	20231207
T	82169	20231221	207601	20231227	103.075	20231228	101.685	20231207

TL	30449	20231226	48592	20231227	102.380	20231226	99.000	20231201
IO	175658	20231215	242949	20231214	1357.8	20231215	0.2	20231229
MO	135969	20231215	153484	20231229	2211.6	20231227	0.2	20231208
HO	100572	20231215	113631	20231214	936.4	20231215	0.2	20231208

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	102779	79079	23700	825803	644025	181778
MO	58831	48318	10513	457112	358812	98300
HO	58819	45337	13482	451943	366726	85217
总计	220429	172734	47695	1734858	1369563	365295

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	7530	1510332.11	14422	2907046.91
TF	3666	376504.58	7486	766425.96
T	6010	605350.45	15967	1604531.20
TL	929	100587.58	2492	272287.49
总计	18135	2592774.72	40367	5550291.56

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

