

期货风险管理公司风险控制指标基差价差风险系数表

序号	交易所	品种	代码	基差价差 风险系数	序号	交易所	品种	代码	基差价差 风险系数
1	上期所	铜	CU	0.5%	41	郑商所	纯碱	SA	5.5%
2		铝	AL	0.5%	42		甲醇	MA	2.0%
3		锌	ZN	0.5%	43		PTA	TA	1.5%
4		铅	PB	1.0%	44		尿素	UR	3.0%
5		镍	NI	1.0%	45		锰硅	SM	1.0%
6		锡	SN	0.5%	46		硅铁	SF	1.5%
7		不锈钢	SS	1.0%	47		短纤	PF	1.0%
8		螺纹钢	RB	1.5%	48		花生	PK	2.5%
9		热轧卷板	HC	1.0%	49		对二甲苯	PX	1.5%
10		线材	WR	6.0%	50		烧碱	SH	4.5%
11		黄金	AU	0.5%	51		瓶片	PR	1.0%
12		白银	AG	0.5%	52		丙烯	PL	1.0%
13		天然橡胶	RU	1.0%	53		黄大豆1号	A	1.5%
14		燃料油	FU	2.5%	54		黄大豆2号	B	2.0%
15		石油沥青	BU	1.5%	55		豆粕	M	3.0%
16		纸浆	SP	1.5%	56		豆油	Y	1.5%
17		氧化铝	AO	3.0%	57		棕榈油	P	2.0%
18		合成橡胶	BR	1.0%	58		玉米	C	1.5%
19		铸造铝合金	AD	1.0%	59		玉米淀粉	CS	2.0%
20		胶板印刷纸	OP	1.0%	60		鸡蛋	JD	4.0%
21	能源中心	原油	SC	1.5%	61	大商所	粳米	RR	20.0%
22		低硫燃料油	LU	1.5%	62		聚乙烯	L	1.0%
23		20号胶	NR	1.0%	63		聚氯乙烯	V	1.0%
24		国际铜	BC	2.0%	64		聚丙烯	PP	1.0%
25		上海出口集装箱结算运价指数(欧洲航线)	EC	17.50%	65		苯乙烯	EB	1.0%
26	郑商所	强麦	WH	20.0%	66		乙二醇	EG	1.5%
27		普麦	PM	20.0%	67		液化石油气	PG	2.5%
28		早籼稻	RI	20.0%	68		铁矿石	I	2.5%
29		晚籼稻	LR	20.0%	69		焦煤	JM	4.5%
30		粳稻	JR	20.0%	70		焦炭	J	3.5%
31		苹果	AP	4.5%	71	纤维板	FB	5.0%	
32		红枣	CJ	2.5%	72	胶合板	BB	12.5%	
33		棉花	CF	1.0%	73	生猪	LH	4.0%	
34		棉纱	CY	3.0%	74	原木	LG	2.5%	
35		白糖	SR	1.5%	75	纯苯	BZ	1.5%	
36		油菜籽	RS	5.5%	76	广期所	工业硅	SI	1.0%
37		菜籽油	OI	1.0%	77		碳酸锂	PS	4.0%
38		菜籽粕	RM	3.0%	78		多晶硅	PS	3.5%
39		动力煤	ZC	20.0%	79		铂	PT	1.5%
40		玻璃	FG	4.5%	80		钯	PD	2.0%

81	中金所	沪深 300 股指期货	IF	0.5%	87	中金所	10 年期国债	T	0.5%
82		上证 50 股指期货	IH	0.5%	88		30 年期国债	TL	0.5%
83		中证 500 股指期货	IC	1.0%	89	港交所	恒生指数期货	HSIF	0.5%
84		中证 1000 股指期货	IM	1.0%	90		恒生科技指数期货	HTIF	1.0%
85		2 年期国债	TS	0.5%	91	其它	其它品种	——	10.0%
86		5 年期国债	TF	0.5%					

说明：

1. 此表用于计算《期货风险管理公司风险控制指标管理办法（试行）》市场风险资本准备中的基差价差风险，不定期更新；
2. 各品种基差价差风险系数根据万得 2023 年 1 月至 2025 年 12 月三年区间的收盘价数据计算。