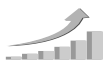


目 录

第一章 2022 年中国期货市场运行概况	(1)
第一节 期货市场总体运行情况	(1)
第二节 期货经营机构基本情况	(15)
第三节 中国期货市场对外开放情况	(22)
第二章 2022 年中国期货市场上市品种运行情况	(29)
第一节 上海期货交易所上市品种运行情况	(29)
第二节 郑州商品交易所上市品种运行情况	(86)
第三节 大连商品交易所上市品种运行情况	(139)
第四节 中国金融期货交易所上市品种运行情况	(197)
第五节 广州期货交易所上市品种运行情况	(214)
第三章 2022 年中国期货市场服务实体经济情况	(216)
第一节 服务实体经济总体概况	(216)
第二节 商品期货服务实体经济情况	(218)
第三节 金融期货服务宏观经济情况	(237)
第四节 场外市场服务实体经济情况	(240)
第五节 期货市场服务乡村振兴战略情况	(245)
第六节 期货市场服务中小微企业	(251)



第四章 2022 年中国期货市场监管及自律情况	(257)
第一节 期货市场监管概况	(257)
第二节 期货市场监测监控情况	(258)
第三节 期货市场法治建设情况	(259)
第四节 期货交易所自律监管情况	(266)
第五节 中国期货业协会自律管理情况	(274)
附 录	(277)
附录 1 2022 年全球期货及其他衍生品行业发展报告	(277)
第一节 全球期货及其他衍生品市场交易概况	(277)
第二节 全球期货及其他衍生品行业发展概况	(303)
附录 2 期货市场履行社会责任情况	(311)
第一节 投资者教育与投资者保护情况	(311)
第二节 职工教育培训情况	(325)
附录 3 2022 年中国期货市场大事记	(333)
附录 4 文件汇编	(337)
附录 5 统计数据	(354)
附录 6 机构名录	(505)
后 记	(527)

第一章

2022年中国期货市场运行概况

>>> 第一节 期货市场总体运行情况

一、宏观经济背景

2022年世界经济在经历2021年深度衰退的基础上大幅反弹后，增长动力明显不足。在宏观政策收紧、疫情形势起伏反复、俄乌冲突升级、重大气候灾害频发等短期因素的冲击下，发达国家消费者物价指数（CPI）持续大幅上涨、大国地缘政治经济博弈加剧、金融市场动荡加剧、美元指数急速攀升和大宗商品价格大幅涨落等相互交织，2022年世界经济增速明显下滑。国际货币基金组织数据显示，2022年世界GDP增速为3.4%，较2021年回落2.9个百分点。其中，发达经济体2022年GDP增速为2.7%，较2021年回落2.7个百分点；新兴市场与发展中经济体GDP增速为4.0%，较2021年回落2.9个百分点。

（一）世界经济与金融形势

1. 世界经济增长情况

2022年世界经济增速明显回落，主要经济体实际GDP大幅下滑。2022年美国GDP增长2.1%，较2021年回落3.8个百分点。欧元区GDP增长3.5%，较2021年回落1.9个百分点，其中，德国增速下滑至1.8%，法国增速下滑至2.6%，意大利增速下滑至3.7%。英国增速下滑至4.0%，加拿大增速下滑至3.4%，日本经济增速下滑至1.1%。

新兴市场和发展中经济体也出现了普遍的实际 GDP 回落。经济最活跃的亚洲新兴和发展中经济体 2022 年 GDP 增长 4.4%，较 2021 年回落 3.1 个百分点。其中，中国 GDP 增长率从 2021 年的 8.4% 下滑至 2022 年的 3.0%；印度 GDP 增长率从 9.1% 下滑至 6.8%；印度尼西亚 GDP 增长率在 2022 年实现增长，从 3.7% 提高至 5.3%。欧洲新兴市场和发展中经济体经济增速由 2021 年的 7.3% 回落至 2022 年的 0.8%，其中，俄罗斯 GDP 增长率从 5.6% 下滑至 -2.1%。拉丁美洲和加勒比地区 2022 年经济增速也在回落，该地区整体 GDP 增长率从 2021 年的 7.0% 下滑至 2022 年的 4.0%。中东和中亚地区 GDP 增长率实现增长，从 2021 年的 4.6% 提高到 2022 年的 5.3%^①。

2. 全球金融市场概况

2022 年，全球经济面临严峻挑战，通货膨胀压力持续存在且不断扩大，债务水平高企，金融市场动荡不安，保护主义盛行，国际制裁升级，世界经济增速下降，主要经济体增长放缓，全球大宗商品市场动荡加剧。

(1) 股市。2022 年，受世界经济增速放缓、美联储加息、俄乌冲突等因素的影响，全球主要股市收跌。

2022 年美股总体震荡下行，标准普尔 500 指数较年初下跌 19.95%，道琼斯工业平均指数下跌 9.40%（见图 1-1-1）。日本日经 225 指数全年震荡运行，年末收跌 10.95%；英国富时 100 指数震荡运行，全年微跌 0.71%；法国 CAC40 指数全年波动下行，年末收跌 10.30%；德国 DAX 指数震荡下行，全年下跌 13.09%；中国上证综指全年震荡下行，跌幅达 14.95%（见图 1-1-2）。

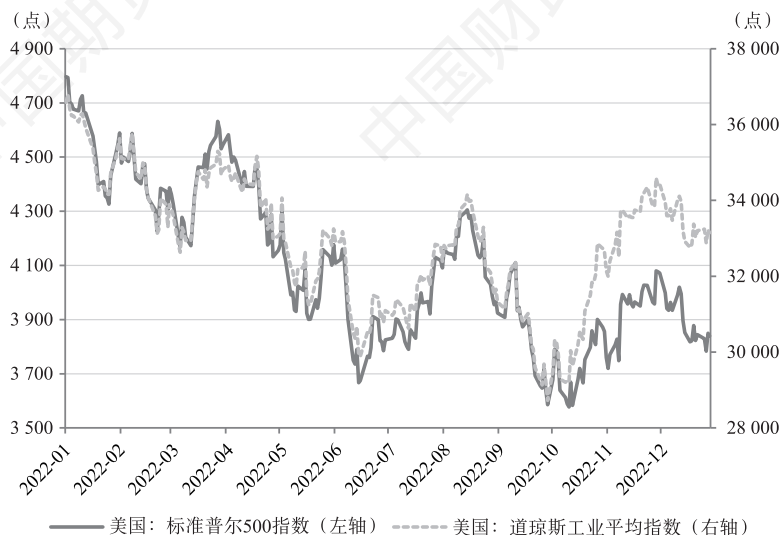


图 1-1-1 2022 年美国股市走势

数据来源：Wind 资讯。

^① 张宇燕主编；孙杰、姚枝仲副主编：《世界经济黄皮书：2023 年世界经济形势分析与预测》，社会科学文献出版社 2022 年 12 月出版。其中，世界经济增速已根据 IMF 报告更新至最新数据。

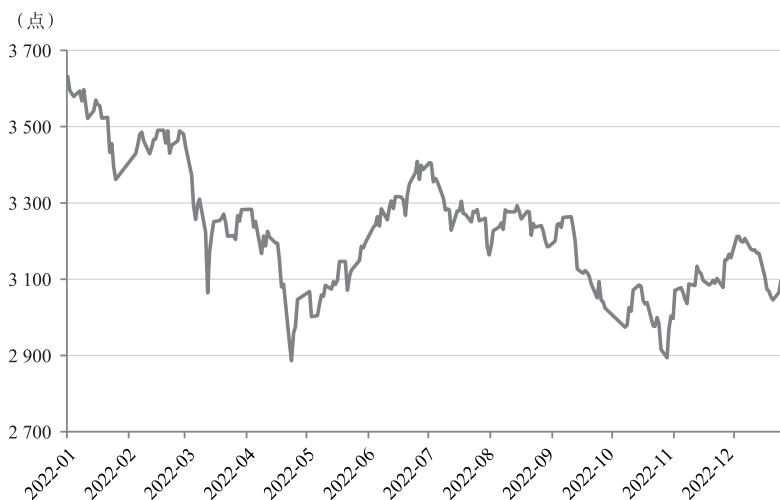


图 1-1-2 2022 年中国上证综合指数走势

数据来源：Wind 资讯。

(2) 债市。2022 年全球通货膨胀持续攀升，主要发达经济体长期国债收益率纷纷上行。2022 年末美国 10 年期国债收益率为 3.88%，较年初上涨 2.25 个百分点；英国 10 年期国债收益率为 3.80%，较年初上涨 2.69 个百分点；法国 10 年期国债收益率为 3.11%，较年初上涨 2.88 个百分点；德国 10 年期国债收益率为 2.53%，较年初上涨 2.74 个百分点，由负转正（见图 1-1-3）。中国 10 年期国债收益率总体呈震荡态势，年末较年初上涨 1.40%（见图 1-1-4）。



图 1-1-3 2022 年美欧国家 10 年期国债收益率

数据来源：Wind 资讯。



图 1-1-4 2022 年中国 10 年期国债收益率

数据来源：Wind 资讯。

(3) 汇市。2022 年，美联储持续紧缩货币政策，美元指数持续走高，四季度有所回落，全年上涨 7.56%（见图 1-1-5）。强势美元背景下，世界各主要货币相对美元普遍承压贬值。2022 年末欧元较美元全年贬值 5.26%，日元较美元贬值 13.70%（见图 1-1-6）。2022 年人民币兑美元汇率宽幅震荡，全年较美元贬值 9.17%（见图 1-1-7）。



图 1-1-5 2022 年美元指数走势

数据来源：Wind 资讯。



图 1-1-6 2022 年欧元、日元汇率走势

数据来源：Wind 资讯。



图 1-1-7 2022 年美元兑人民币走势

数据来源：Wind 资讯。

(4) 大宗商品市场。2022 年，受地缘政治局势、能源危机、美联储持续加息以及经济衰退担忧因素影响，全球大宗商品市场价格呈现反复波动的态势。标普高盛商品指数从 2022 年初的 2 823.22 点上涨至年末的 3 495.76 点，上涨 23.82%（见图 1-1-8）。其中，标普高盛的能源指数上涨显著，涨幅高达 38.85%；其次是农业指数，在 2022 年上涨 10.06%；贵金属保持平稳，微涨 0.40%；工业金属指数有所下跌，跌幅为 8.49%（见图 1-1-9）。



图 1-1-8 2022 年标普高盛商品指数走势

数据来源：Wind 资讯。



图 1-1-9 2022 年标普高盛商品分类指数走势

数据来源：Wind 资讯。

3. 发达国家及地区衍生品市场发展及监管政策^①

(1) 1 月 20 日，国际掉期与衍生工具协会（ISDA）召开中国衍生品会议。会

^① 中国期货市场监控中心：《全球衍生品简讯》。

上，国际掉期与衍生工具协会首席执行官致开幕词，肯定了《中华人民共和国期货和衍生品法》（以下简称《期货和衍生品法》）审议稿及其中的终止净额结算制度条款，并宣布将与中国政府、市场参与者和行业协会继续合作，实现净额结算制度的充分认可。

(2) 1月31日，美国商品期货交易委员会（CFTC）就互换数据报告规则修正案的合规日期发布无行动函。该无行动函将互换数据报告规则修正案的合规期限由2022年5月25日推迟到2022年12月5日，将其中关于“大宗交易”“实时公开发布互换交易和定价”两部分的合规期限由2023年5月25日推迟到2023年12月4日。在遵守先前生效法规的前提下，CFTC不建议在合规日期前采取执法行动。

(3) 3月4日，伦敦金属交易所（LME）宣布，自3月8日收盘起，上调铝、镍品种保证金要求，将铝、镍的保证金分别提高至10%、12.5%。3月7日，LME发布公告，宣布实施现货溢价限制和延期交割机制。3月8日，LME发布公告，暂停镍市场交易，取消3月8日凌晨0:00后的场外市场及LME select^①上执行的交易，并推迟3月9日所有到期的合约交割。3月14日，发布公告确认于3月16日8:00恢复镍合约的交易。3月16日，LME发布公告，通报由于系统错误，LME select 允许了少量交易在低于每日价格下限的情况下执行，并暂停在LME select 的镍交易，通知3月16日14:00恢复LME select 上的镍合约交易，并公告通知自3月17日起整个市场镍合约每日涨跌幅限制从5%上调至8%。

(4) 3月10日，美国商品期货交易委员会就衍生品清算组织（DCO）关于修订DCO注册要求申请向公众征求意见。加密货币交易所FTX等DCO希望修订相关注册要求，不通过期货经纪商（FCM）直接向市场参与者提供保证金产品的清算（非中介模式）^②。目前，共有15家DCO在欧盟委员会注册，大多采用中介模式，FTX采用清算完全抵押产品的非中介模式。

(5) 4月4日，英国金融行为监管局（FCA）、英格兰银行（BOE）、英国审慎监管局（PRA）等英国金融监管机构发布联合声明，表示将对伦敦金属交易所（LME）和LME清算所（LME Clear）镍市场运行及管理进行审查。具体为，FCA、BOE、PRA将分别负责对LME的治理及市场监督安排、LME Clear的治理和风险管理、参与LME市场的主要公司的治理和风险管理进行审查评估，以确定是否采取下一步措施。

(6) 7月26日，美国商品期货交易委员（CFTC）清算和风险部门（DCR）将上海清算所（SHCH）无行动函（No - Action Letter）的到期日由2022年7月31日延长至2023年7月31日。在到期日前，CFTC不会因SHCH未根据CEA注册为DCO而采取法律行动。信中指出，DCR不计划对此信函进一步延期。

① LME针对经纪公司之间对冲头寸而开发的一套电子交易系统。

② 中介模式：只有FCM是DCO的直接清算会员；非中介模式：所有市场参与者都是清算成员。



(7) 7月27日，美国商品期货交易委员会（CFTC）召开公开委员会会议^①，通过了《衍生品清算组织（DCO）治理要求的拟议规则》及《关于日本金融厅（JFSA）资本同等性监管认定申请的拟议行政令和意见征求》两项提案。第一项提案建议修改CFTC规则第39.24条DCO的治理要求，要求DCO建立风险管理委员会（RMC）及风险咨询小组（RWG）。第二项提案建议允许日本非银行互换交易商遵守日本监管法律下的资本充足率和财务报告要求来替代性满足美国《多得弗兰克法案》（Dodd-Frank）第七章的监管要求，但CFTC仍保留监管执法的权力。

(8) 8月1日，国际掉期与衍生工具协会（ISDA）发布有关《中华人民共和国期货和衍生品法》终止净额结算制度^②的法律意见书，承认中国法律框架对终止净额结算制度可执行性的实现。ISDA首席执行官表示，“终止净额结算意见的发布恰逢《期货和衍生品法》生效，是中国衍生品市场发展史上新的里程碑，将为全球企业与中国交易对手交易时获得所需的确定性。”

(9) 10月14日，欧洲证券及市场监管局（ESMA）发布《抵押品要求紧急措施最终报告》，以缓解天然气和电力市场中非金融交易对手（NFC）在欧盟中央对手方（CCP）清算时的流动性压力。一是扩大CCP合格抵押品池为期12个月，向清算成员的NFC提供无抵押商业银行担保，并向所有类型的交易对手方提供公共担保。二是澄清债券和商业票据可作为CCP抵押品。

(10) 10月20日，美国商品期货交易委员会（CFTC）发布2022年年度执法报告。2022年CFTC提起执法指控82次，通过和解或诉讼方式开出罚单超25亿美元，案件类型包括欺诈、记录保存、非法场外合约交易、未按规定注册、操纵、虚假报告、幌骗等。CFTC主席表示，面对前所未有的金融市场状况、新兴技术的干扰和散户投资者的增加，CFTC将坚定不移地实施强有力的执法行动，以确保市场公开、透明、公平且有竞争力。

(11) 10月26日，欧洲证券与市场管理局（ESMA）就德国联邦金融监管局（Bafin）限制散户投资者推广、分销和销售具有额外支付义务期货^③的决定表示支持。此外，ESMA鼓励各国主管机构（NCA）在国家层面对此类期货进行监控，以评估个人投资者是否面临Bafin认定的风险。

① CFTC组织框架由委员会委员、主席办公室和职能部门组成。委员会由3~5名委员组成，委员须由总统提名、参议院同意后任命，其中包括1名主席。委员会定期召开公开、非公开会议就重要监管问题进行磋商。此次召开的公开委员会会议是自新冠疫情发生以来的首次线下会议，也是2020年12月以来首次5名委员均出席的会议。

② 终止净额结算，是指金融衍生品交易双方在交易主协议中约定，在合约期内，若一方出现特定的违约或合约终止事件，另一方有权终止主协议项下所有未到期合约，每笔合约对应的债务和担保义务等转换为相互间的支付义务，按照协议约定的方式经冲抵轧差后计算出一笔净额，由净支付方转移给净收入方。

③ 有额外支付义务的期货在交易时无须缴纳全额保证金，仅需缴纳一定比例的保证金首付款，经纪商为投资者支付剩余保证金提供贷款。德国联邦金融监管局（Bafin）认为这类期货产品使散户面临巨大风险，在高速波动的市场环境下，可能导致无限损失。

（二）中国经济运行情况回顾

1. 整体经济运行情况^①

2022年，面对风高浪急的国际环境和艰巨繁重的国内改革发展稳定任务，各地区各部门坚持稳中求进工作总基调，高效统筹疫情防控和经济社会发展，有效应对内外部挑战，国民经济顶住压力持续发展，经济总量再上新台阶，就业物价总体稳定，人民生活持续改善，高质量发展取得新成效，经济社会大局和谐稳定。初步核算，2022年国内生产总值1210207亿元，按不变价格计算，比上年增长3.0%。分产业看，第一产业增加值88345亿元，比上年增长4.1%；第二产业增加值483164亿元，增长3.8%；第三产业增加值638698亿元，增长2.3%。分季度看，第一季度国内生产总值同比增长4.8%，第二季度增长0.4%，第三季度增长3.9%，第四季度增长2.9%。

2022年，我国高效统筹疫情防控和经济社会发展，因时因势优化调整防控措施，经济总量迈上新台阶，高质量发展取得新成效。一是全年粮食增产丰收，畜牧业生产稳定增长。全年全国粮食总产量68653万吨，比上年增加368万吨，增长0.5%。分品种看，稻谷产量20849万吨，下降2.0%；小麦产量13772万吨，增长0.6%；玉米产量27720万吨，增长1.7%；大豆产量2028万吨，增长23.7%。油料产量3653万吨，增长1.1%。全年猪牛羊禽肉产量9227万吨，比上年增长3.8%。其中，猪肉产量5541万吨，增长4.6%；禽肉产量2443万吨，增长2.6%。2022年末，生猪存栏45256万头，增长0.7%；全年生猪出栏69995万头，增长4.3%。二是工业生产持续发展，高技术制造业和装备制造业较快增长。全年全国规模以上工业增加值比上年增长3.6%，其中，高技术制造业、装备制造业增加值分别增长7.4%、5.6%。三是居民消费价格温和上涨，工业生产者价格涨幅回落。全年居民消费价格（CPI）比上年上涨2.0%。扣除食品和能源价格后的核心CPI上涨0.9%。全年工业生产者购进价格比上年增长6.1%。四是居民收入增长与经济增长基本同步，农村居民收入增长快于城镇。全年全国居民人均可支配收入36883元，比上年名义增长5.0%，扣除价格因素实际增长2.9%，与经济增长基本同步。其中，农村居民人均可支配收入20133元，比上年名义增长6.3%。五是货物进出口较快增长，贸易结构持续优化。全年货物进出口总额420678亿元，比上年增长7.7%。其中，出口239654亿元，增长10.5%；进口181024亿元，增长4.3%。进出口相抵，贸易顺差58630亿元。六是就业形势总体稳定，城镇调查失业率有所回落。全年城镇新增就业1206万人，超额完成1100万人的全年预期目标任务。

2. 期货和衍生品市场重要改革措施与政策调整

（1）国家重大改革方面。

①《中华人民共和国期货和衍生品法》审议通过。4月20日，党的十三届全国

^① 国家统计局：《2022年国民经济顶住压力再上新台阶》。



人大常委会第三十四次会议表决通过《中华人民共和国期货和衍生品法》。此法补齐了我国期货和衍生品领域的法律“短板”，为促进规范行业和市场发展，保护投资者权益，推动期货市场更好服务实体经济提供了强有力的法律保障。

②《中华人民共和国期货和衍生品法》正式实施。8月1日，《中华人民共和国期货和衍生品法》正式实施。该法共13章155条，重点围绕期货交易、结算与交割基本制度、期货交易者保护制度、期货经营机构与期货服务机构的监管、期货交易所和期货结算机构的运行、期货市场监督管理、法律责任等方面作出了规定。

③《中共中央 国务院关于做好2022年全面推进乡村振兴重点工作的意见》中央一号文件发布。2月22日，2022年中央一号文件提出全面推进乡村振兴重点工作，这是21世纪以来第19个指导“三农”工作的中央一号文件。文件指出，优化完善“保险+期货”模式，这是“保险+期货”连续七年写入中央一号文件。统计期内，共有65家期货公司累计开展“保险+期货”项目2421个，其中独立项目2152个（交易所支持409个），合作项目269个（交易所支持项目220个）。为大豆、玉米、生猪等17个品种提供了风险管理服务，累计承保货值537.13亿元，涉及现货数量共计765.81万吨。项目开展地点覆盖全国29个省市（自治区），累计覆盖252个地级市和868个县级市，共计覆盖农户171.22万户，覆盖农民专业合作社877个，家庭农场717个，涉农企业747个。

（2）金融深化改革方面。

①中国证监会、财政部联合发布《证券期货行政执法当事人承诺金管理办法》。1月1日，国务院制定公布了《证券期货行政执法当事人承诺制度实施办法》。该办法总体沿用了《和解金办法》的制度框架，并结合上位法和实践需要进行修改完善。该办法的出台，有利于加强投资者保护，使受损投资者利益得到更好赔付，有利于进一步提升监管效能，稳定市场秩序。

②中证1000股指期货和期权挂牌交易。7月22日，中证1000股指期货和期权在中国金融期货交易所正式挂牌交易。至此，中金所上市的金融衍生品数量增至9个。中证1000股指期货和期权上市，是金融期货市场更好服务全面深化资本市场改革的重要举措之一，将进一步完善金融期货与期权产品体系，逐步形成覆盖大、中、小盘股的风险管理产品序列。

③中国证监会修改、废止部分期货行业规章和规范性文件。8月12日，为做好《期货和衍生品法》的贯彻落实工作，中国证监会发布了《关于修改、废止部分证券期货规章的决定》《关于修改、废止部分证券期货规范性文件的决定》，决定对8部规章、14部规范性文件的部分条款予以修改，对1部规章、1部规范性文件予以废止。

④中国证监会拟修订《期货交易所管理办法》。9月16日，中国证监会表示，为切实做好《期货和衍生品法》贯彻落实工作，起草了《期货交易所管理办法（征求意见稿）》，并向社会公开征求意见。

⑤广州期货交易所正式开展工业硅期货和期权交易。12月22日、23日，工业

硅期货和期权合约在广州期货交易所正式挂牌交易。工业硅是硅能源产业的重要原料，属于绿色低碳品种。推出工业硅期货和期权，对于完善工业硅价格形成机制、提升市场主体风险管理能力和助力我国低碳经济发展具有积极意义，符合广州期货交易所服务绿色发展的定位。

（3）扩大对外开放方面。

①摩根士丹利申请设立期货公司获中国证监会受理。4月3日，中国证监会官网显示，摩根士丹利的《期货公司设立许可》被证监会接收材料。若顺利获批，摩根士丹利将成为第二家在华设立期货公司的外资金融机构。2022年1月，中期协官网公示的期货公司高管人员专业能力水平评价测试合格人员名单中，出现了三位摩根士丹利期货（中国）有限公司拟任高管的名字。

②中国证监会、财政部与美国监管机构签署审计监管合作协议。8月26日，中国证监会、财政部与美国公众公司会计监督委员会（PCAOB）签署审计监管合作协议。合作协议依据两国法律法规，尊重国际通行做法，按照对等互利原则，就双方对相关会计师事务所合作开展监管检查和调查活动作出了明确约定，形成了符合双方方法和监管要求的合作框架。合作协议的签署，是中美双方监管机构在解决审计监管合作这一共同关切问题上迈出的重要一步。

③QFII、RQFII 获准更多参与期货期权交易。9月2日，国内4家期货交易所相继发布公告，宣布即日起合格境外机构投资者（QFII）和人民币合格境外机构投资者（RQFII）可以参与相关期货、期权合约交易，此次共涉及黄金、白银、原油、PTA、甲醇、豆一、豆二、股指期权等41个期货、期权品种，这标志着中国期货市场对外开放进程的又一次加速。

④我国豆系期货及期权正式引入境外交易者。12月26日，根据《境外交易者和境外经纪机构从事境内特定品种期货交易管理暂行办法》（证监会令第116号）的有关规定，大连商品交易所的黄大豆1号、黄大豆2号、豆粕、豆油期货和期权正式作为境内特定品种引入境外交易者参与交易，这是境内期货交易所首次在全品种链条同步引入境外交易者。

二、期货市场总体运行情况

截至2022年底，国内期货和衍生品市场共有103个期货期权品种，包括72个期货品种和31个期权品种^①，2022年新上市2个期货品种^②和10个期权品种^③。

① 本节品种数量、成交持仓数据仅包括上海期货交易所、郑州商品交易所、大连商品交易所、中国金融期货交易所和广州期货交易所5家期货交易所的数据，统计不包含上海证券交易所和深圳证券交易所期权品种数据。

② 2022年新上市期货品种有工业硅期货和中证1000股指期货。

③ 2022年新上市期权品种有豆一期权、豆二期权、豆油期权、花生期权、菜籽油期权、工业硅期权、螺纹钢期权、白银期权、中证1000股指期货和上证50股指期货。

2022年，我国期货市场（含期权）累计成交67.68亿手^①（其中，期货成交63.42亿手，期权成交4.26亿手），较2021年减少7.46亿手，同比下降9.93%；累计成交金额534.93万亿元（其中，期货成交534.30万亿元，期权成交0.63万亿元），较2021年减少46.26万亿元，同比下降7.96%。

（一）商品期货、金融期货价格总体上行

2022年，我国大宗商品价格总体震荡上行。中证监控中国商品期货指数（CCIFMCCFI）^②全年收于1691.03点，同比上涨13.35%（见图1-1-10）。分板块来看，中证监控中国工业品期货指数（CCIFMCIFI）上涨10.78%，其中，能化期货指数上涨7.32%，钢铁期货指数上涨15.33%，建材期货指数下降3.79%；中证监控中国农产品期货指数（CCIFMCAFI）上涨13.21%，其中，油脂期货指数上涨8.33%，油脂油料期货指数上涨28.76%，软商品期货指数下跌10.20%，饲料期货指数上涨42.16%，粮食期货指数微涨0.44%，谷物期货指数上涨1.63%。

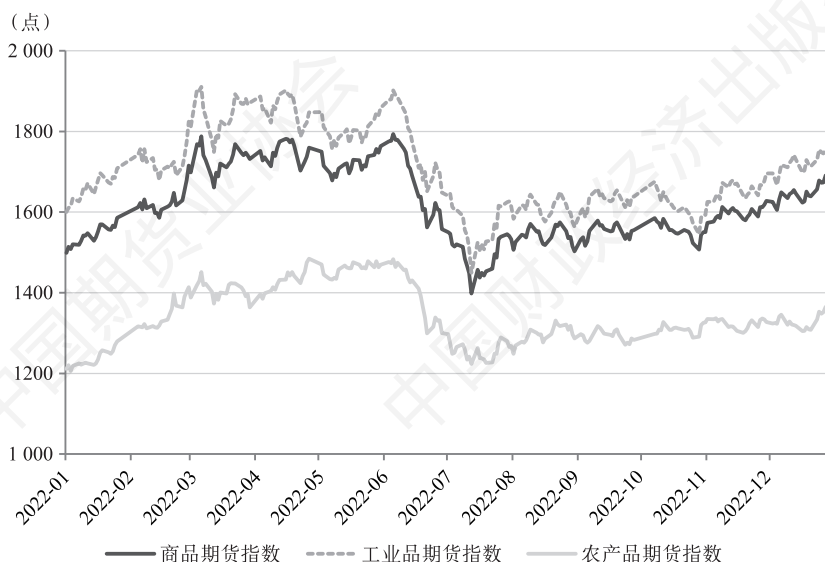


图 1-1-10 2022 年中证监控中国商品期货指数走势

数据来源：中证商品指数公司。

2022年，国内期货市场共有4个股指期货合约，新增中证1000股指期货，全年股指期货整体震荡下行。其中，沪深300股指期货、中证500股指期货和上证50

① 此成交数据不含期转现，数据来自中国期货业协会。

② 中证商品指数公司以国内交投活跃的商品期货品种为基础，根据品种的持仓金额设定权重，编制并发布了中证监控商品实时期货指数，包括中证监控中国商品期货指数、中证监控中国农产品期货指数和中证监控中国工业品期货指数，其中，工业品期货指数下辖子指数，包括能化期货指数、钢铁期货指数、建材期货指数，农产品期货指数下辖子指数，包括油脂期货指数、油脂油料期货指数、软商品期货指数、饲料期货指数、粮食期货指数和谷物期货指数。

股指期货下跌较多，跌幅分别为 21.52%、20.36% 和 19.30%；中证 1000 股指期货较上市首日下跌 9.64%（见图 1-1-11）。2022 年，国内期货市场共有 3 个国债期货品种，均微幅下跌，5 年期国债期货、10 年期国债期货和 2 年期国债期货分别下跌 0.73%、0.51% 和 0.19%（见图 1-1-12）。

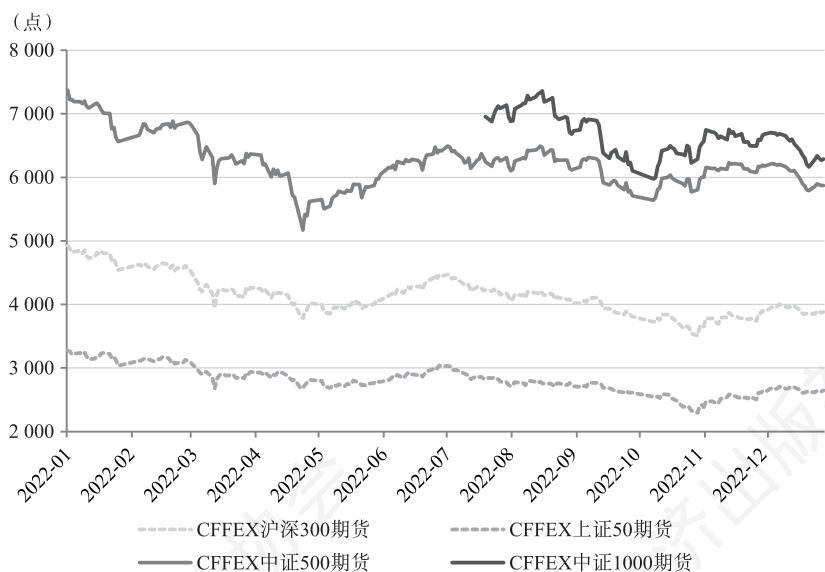


图 1-1-11 2022 年股指期货运行情况

数据来源：Wind 资讯。



图 1-1-12 2022 年国债期货运行情况

数据来源：Wind 资讯。

（二）市场成交量有所回落

2022年期货（含期权）市场成交较2021年有所下降，全年日均成交量2796.78万手（全市场成交、持仓均为单边统计，下同），同比下跌9.55%。其中，商品期货（含期权）日均成交量2734.03万手，同比下跌10.12%，金融期货（含期权）日均成交量62.75万手，同比上涨19.97%。成交量排名前5位的品种为PTA、螺纹钢、甲醇、纯碱和豆粕期货。品种间成交量分化明显，成交量前20名的品种占市场总成交量的70.97%^①。

（三）市场持仓量震荡上行

2022年期货（含期权）市场月末总持仓量总体震荡上行（见图1-1-13）。2022年，全市场日均持仓量3343.62万手，同比增长20.40%，其中，商品期货（含期权）日均持仓量3219.05万手，同比增长20.14%，金融期货（含期权）日均持仓量124.57万手，同比增长27.53%^②。

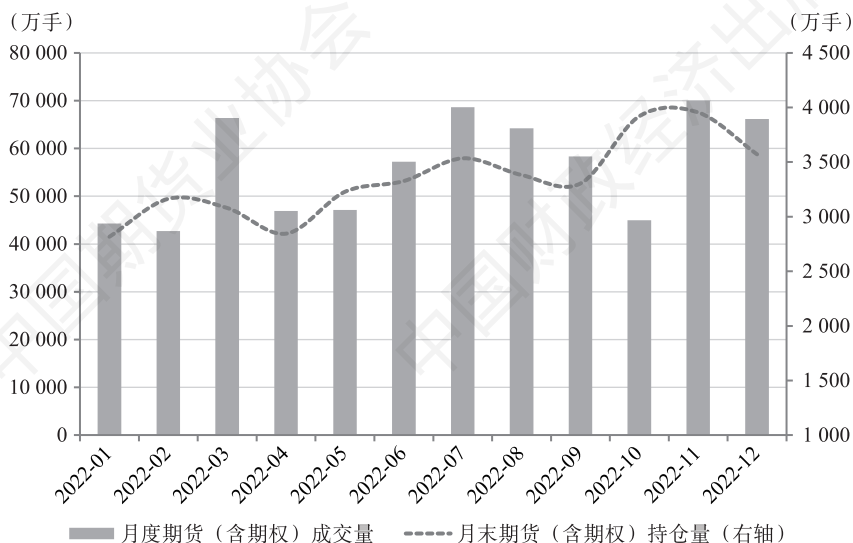


图1-1-13 2022年全市场期货（含期权）月度成交量、持仓量

数据来源：中国期货业协会。

① 数据来源：中国期货业协会。

② 数据来源：中国期货业协会。

>>> 第二节 期货经营机构基本情况

一、期货公司总体情况

(一) 机构概况

截至2022年末，期货公司共计150家，与2021年相同。150家期货公司均开展经纪业务，营业部数量是2174家；121家期货公司具备投资咨询业务资格，129家期货公司具备资产管理业务资格，与2021年相同；共有97家期货公司在中国期货业协会（以下简称“中期协”“协会”）备案设立了100家风险管理公司，其中99家风险管理公司完成备案试点业务。

表 1-2-1 近三年期货公司及营业部家数对比表

	2020年	2021年	2022年
公司（家）	149	150	150
营业部（家）	1951	2042	2174

截至2022年，A股上市公司有南华期货、瑞达期货、永安期货、弘业期货。H股上市的公司为中泰期货和弘业期货。在新三板挂牌的期货公司有13家，分别是创元期货、海航期货、紫金天风、华龙期货、大越期货、先融期货、迈科期货、渤海期货、福能期货、混沌天成、金元期货、长江期货、海通期货。

(二) 资本概况

截至2022年末，期货公司净资本1166.45亿元，同比增长13.59%（见图1-2-1）。

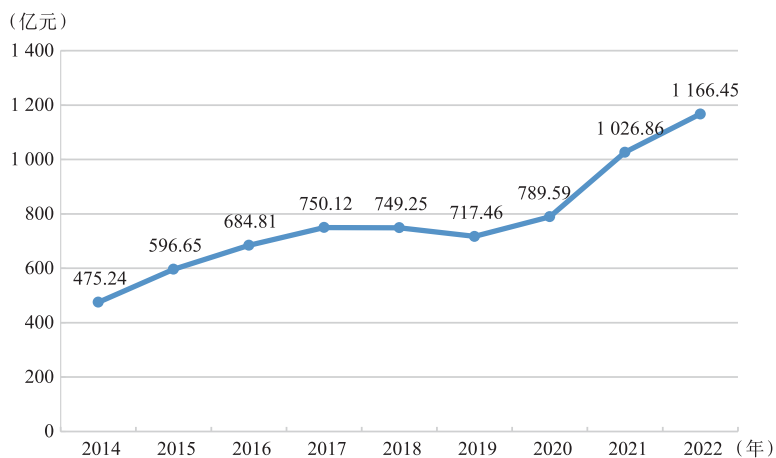


图 1-2-1 期货公司净资本本年度变化

2022 年期货公司净资本的分布情况如表 1-2-2 所示。其中，27 家期货公司的净资本超过 10 亿元。

表 1-2-2 2022 年期货公司净资本分布情况

净资本总额	2021 年		2022 年	
	公司数量（家）	占比（%）	公司数量（家）	占比（%）
超过 10 亿元	26	17.33	27	18.00
5 亿~10 亿元	48	32.00	49	32.67
2 亿~5 亿元	48	32.00	47	31.33
2 亿元及以下	28	18.67	27	18.00

（三）分类评级情况

根据中国证监会 2019 年 2 月发布的《期货公司分类监管规定》（2019 年 2 月 15 日修订），证监会以期货公司风险管理能力为基础，结合公司服务实体经济能力、市场竞争力、持续合规状况，来确定各期货公司的分类监管类别。

2022 年，全行业 150 家期货公司中，A 类期货公司总数为 54 家，其中 AA 级期货公司 18 家；B 类期货公司共 76 家；C 类期货公司 17 家；D 类期货公司 3 家（见表 1-2-3）。

表 1-2-3 最近 3 年期货公司分类结果情况对比

分类评价结果	2020 年		2021 年		2022 年	
	公司数量（家）	占比（%）	公司数量（家）	占比（%）	公司数量（家）	占比（%）
A 类 AA 级	19	12.75	17	11.41	18	12.00
A 类 A 级	21	14.09	22	14.77	36	24.00
B 类 BBB 级	41	27.52	34	22.82	37	24.67
B 类 BB 级	35	23.49	39	26.17	32	21.33
B 类 B 级	17	11.41	22	14.77	7	4.67
C 类 CCC 级	3	2.01	5	3.36	13	8.67
C 类 CC 级	8	5.37	3	2.00	1	0.66
C 类 C 级	1	0.67	2	1.34	3	2.00
D 类	4	2.68	5	3.36	3	2.00

具体来看，获评 AA 级的 18 家期货公司分别为国泰君安、银河期货、永安期货、中信期货、东证期货、华泰期货、南华期货、中粮期货、中信建投、申银万国、中泰期货、浙商期货、海通期货、广发期货、新湖期货、光大期货、招商期货、国投安信。

（四）风险监管指标状况^①

2017年10月1日，中国证监会实施了最新的《期货公司风险监管指标管理办法》，进一步提高了期货行业风险监管指标体系的适应性和有效性。经测算，各期货公司风险监管指标状况如下：

1. 净资本情况

截至2022年末，全国150家期货公司净资本1 166.45亿元，平均每家7.78亿元。149家期货公司净资本高于人民币3 000万元，其中，中信期货净资本最高，为86.51亿元。

2. 净资本与风险资本准备比例均高于100%

截至2022年末，全国150家期货公司风险资本准备为467.65亿元，全部期货公司的净资本与风险资本准备的比例范围在126.00%至17 099.38%之间，均满足净资本与风险资本准备比例高于100%的监管要求。

3. 净资本与净资产比例均高于20%

截至2022年末，全国150家期货公司净资产1 841.33亿元，总体净资本与净资产比例为63.35%。全部期货公司的净资本与净资产比例范围在28.00%至147.99%之间，均满足净资本与净资产的比例不得低于20%的监管要求。

4. 流动资产与流动负债的比例均高于100%

截至2022年末，全国150家期货公司的流动资产（扣除客户保证金）1 597.78亿元，流动负债（扣除客户权益）250.88亿元，流动资产与流动负债的比例为636.86%。所有期货公司流动资产与流动负债的比例范围全部在163.49%至6 145.85%之间，均满足流动资产与流动负债比例不低于100%的监管要求。

5. 期货公司负债与净资产比例情况

截至2022年末，全国150家期货公司负债（扣除客户权益）为347.32亿元，与净资产比例为18.86%。149家期货公司满足负债与净资产的比例不得高于150%的监管要求。

（五）从业人员情况

1. 从业人员总体数量继续增长

截至2022年12月31日，在协会注册的从业人员数量为77 866人，较2021年末增加7 572人，增幅为10.77%（见图1-2-2）。

^① 依照中国证监会2017年10月1日实施最新的《期货公司风险监管指标管理办法》，期货公司应当持续符合的风险监管指标标准为：“净资本不得低于人民币3 000万元；净资本与公司的风险资本准备的比例不得低于100%；净资本与净资产的比例不得低于20%；流动资产与流动负债的比例不得低于100%；负债与净资产的比例不得高于150%；规定的最低限额的结算准备金要求。”

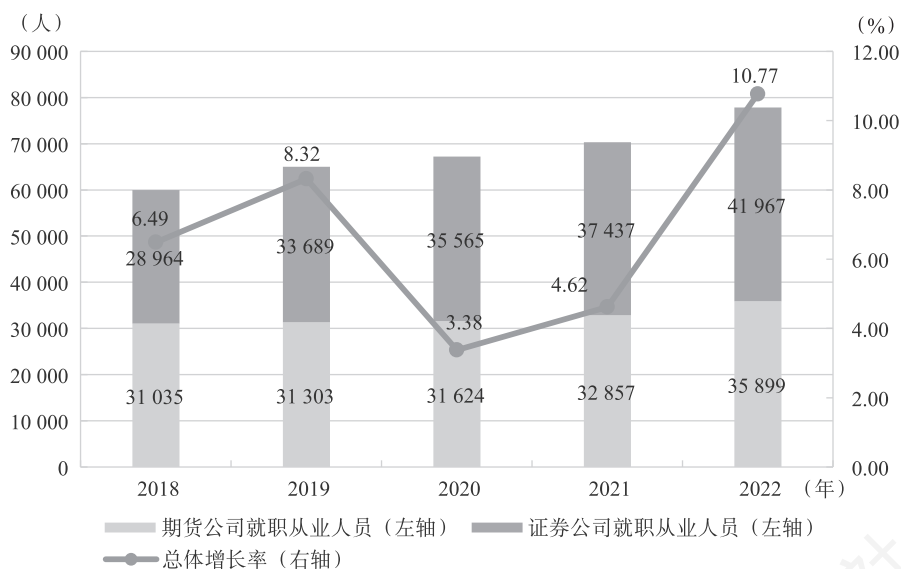


图 1-2-2 2018 年末至 2022 年末期货从业人员总体数量变化

2. 期货公司从业人数数量保持增长

截至 2022 年 12 月 31 日，在协会自律服务系统登记的期货公司员工总数为 36 898 人，包括 35 899 名从业人员和 999 名非从业人员。期货公司从业人数数量连续 3 年增长，较 2021 年末增加 3 042 人，增幅为 9.26%（见图 1-2-3）。

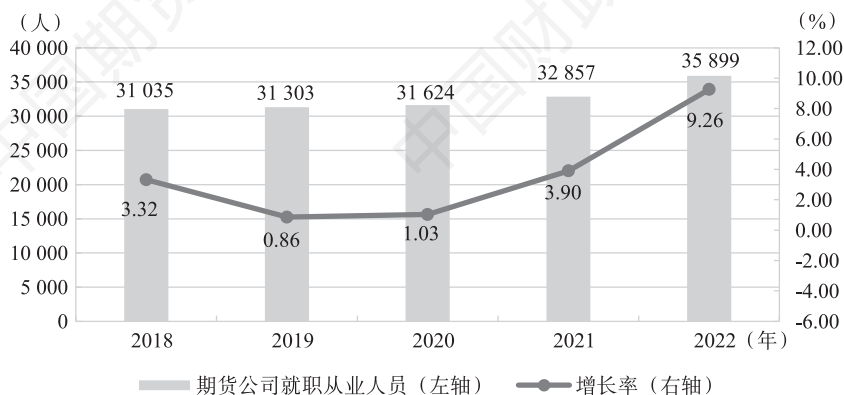


图 1-2-3 2018 年末至 2022 年末期货公司从业人数数量变化

3. 证券公司从业人数数量持续上升

截至 2022 年 12 月 31 日，证券公司从业人数数量为 41 967 人，较 2021 年末增加 4 530 人，增幅 12.10%。2022 年，证券公司从业人数数量延续了往年增长趋势，同比增幅较 2021 年的 5.27% 有所上升（见图 1-2-4）。

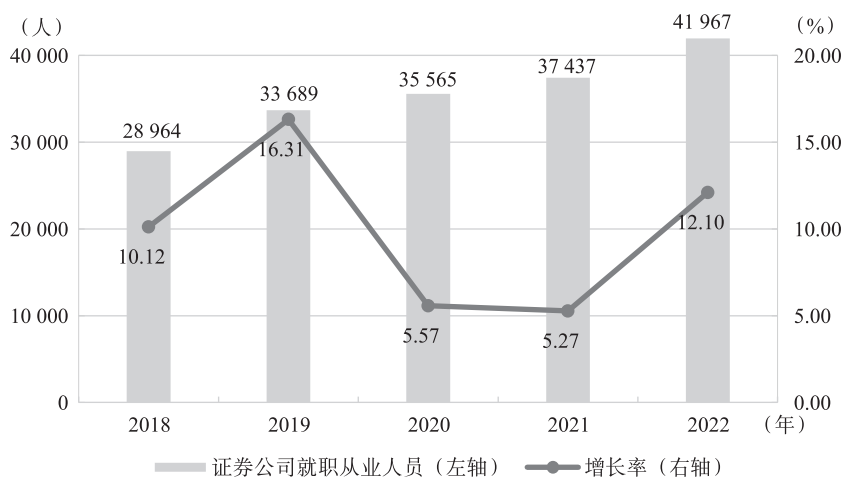


图 1-2-4 2018 年末至 2022 年末证券公司从业人数变化

4. 获得期货投资咨询业务从业资格人员情况

截至 2022 年 12 月 31 日，在期货公司从业人数中，共有 4 931 人获得期货投资咨询业务从业资格，占比为 13.74%（见图 1-2-5）。

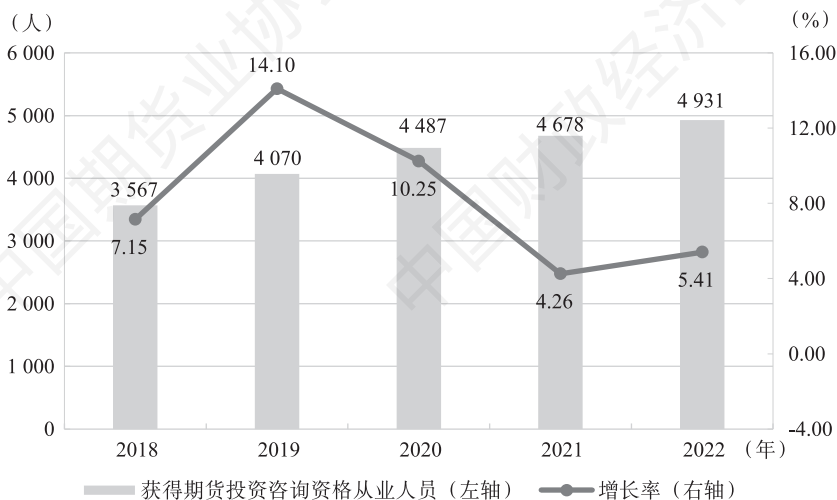


图 1-2-5 2018 年末至 2022 年末期货投资咨询业务人员数量变化

5. 外籍从业人员情况

截至 2022 年 12 月 31 日，共有 93 名外籍及港澳台地区人士在期货公司任职，其中美国 12 人，加拿大 5 人，澳大利亚 1 人，日本 1 人，新加坡 1 人，马来西亚 1 人，印度尼西亚 1 人，乌兹别克斯坦 1 人，巴拿马 1 人，港澳台地区 69 人。

二、期货公司业务发展情况

(一) 经纪业务

2022年全国期货公司经纪业务收入233.02亿元,同比下降22.33%(见图1-2-6),占营业收入总额的58.00%。期货公司代理交易额534.02万亿元,同比下降7.96%,代理交易总量70.46亿手,同比下降9.55%(见图1-2-7)。商品期货代理交易额400.77万亿元,同比下降13.20%,代理交易量66.10亿手同比下降10.51%,分别占全部份额的75.05%和93.81%。金融期货代理交易额133.24万亿元,代理交易量4.36亿手,同比分别增加12.51%和7.65%,分别占全部份额的24.95%和6.19%。

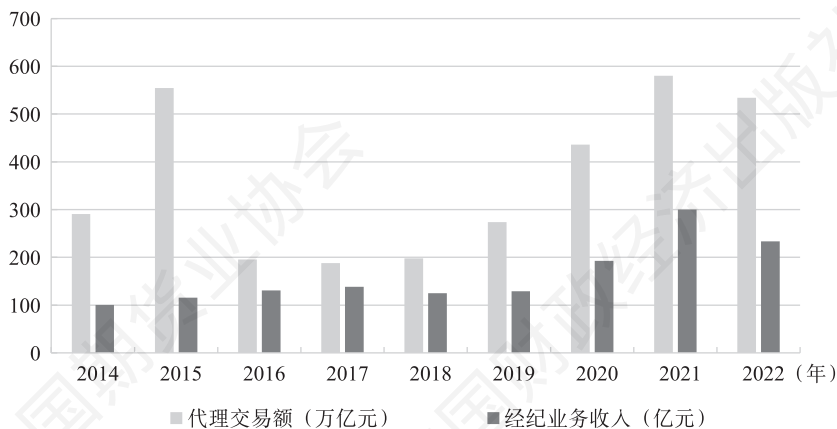


图 1-2-6 期货公司代理交易额、经纪业务收入年度变化

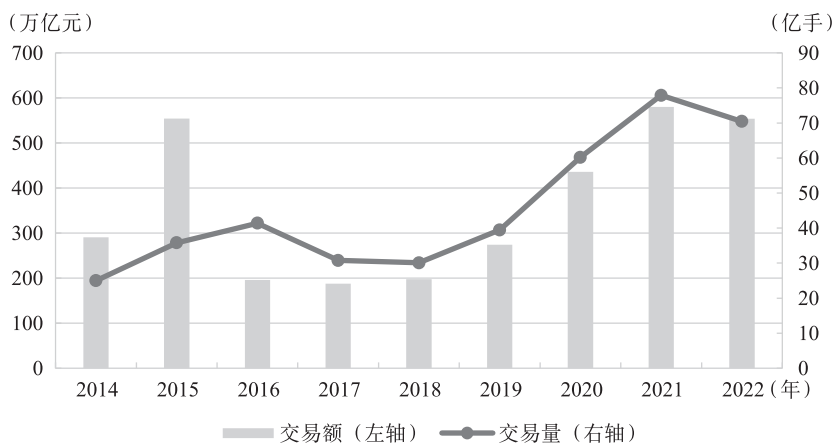


图 1-2-7 期货公司代理交易额和交易量年度变化

（二）投资咨询业务

2022年，64家期货公司投资咨询业务实现收入，共计1.15亿元，同比下降35.03%，占营业收入比重为0.29%。其中，该项业务收入超过1000万元的公司有3家（见表1-2-4）。

表1-2-4 2022年期货投资咨询业务收入情况

收入规模	2021年公司数量（家）	2022年公司数量（家）
1000万元及以上	4	3
500万元~1000万元	2	2
100万元~500万元	14	14
50万元~100万元	11	10
10万元~50万元	19	25
10万元以下	15	10

（三）资产管理业务

2022年，110家期货公司资产管理业务实现收入，共计10.04亿元，同比下降6.69%，该项业务收入超过1000万元的共有22家（见表1-2-5）。

表1-2-5 2022年期货公司资产管理业务收入情况

收入规模	2021年公司数量（家）	2022年公司数量（家）
1000万元及以上	29	22
500万元~1000万元	8	19
100万元~500万元	31	31
50万元~100万元	11	10
10万元~50万元	18	14
10万元以下	10	14

（四）风险管理业务

截至2022年末，共有100家风险管理公司通过协会备案，其中87家公司备案了仓单服务业务，94家公司备案了基差贸易业务，53家公司备案了合作套保业务，73家公司备案了场外衍生品业务，60家公司备案了做市业务。100家风险管理公司总资产1537.12亿元，同比增长23.46%；净资产404.07亿元，同比增长25.39%。全年业务收入2413.81亿元，同比下降8.17%；全年净利润11.54亿元，同比减少44.47%。

表 1-2-6 2021—2022 年风险管理公司场外衍生品业务新增变化情况

工具类型	名义本金			交易确认书		
	2022 年 1—12 月 累计新增（亿元）	2021 年 1—12 月 累计新增（亿元）	同比 （%）	2022 年 1—12 月 累计新增（笔）	2021 年 1—12 月 累计新增（笔）	同比 （%）
远期	2 111.80	984.71	114	38 303	18 825	103
互换	4 826.72	2 763.78	75	31 358	13 851	126
期权	13 531.84	12 573.89	8	166 537	161 697	3

注：数据仅限中国期货业协会统计范畴。

>>> 第三节 中国期货市场对外开放情况

一、中国期货市场对外开放总体情况

2022 年，中国证监会继续积极有序推进中国期货市场对外开放，在品种、机构等方面均呈现出良好态势。我国期货市场对外开放不断加深，期货业竞争力不断增强，相关期货品种价格的国际影响力有所提升。

一是大力推动期货品种国际化。2022 年，黄大豆 1 号、黄大豆 2 号、豆粕、豆油等 8 个油脂油料期货期权品种实现对外开放，截至 2022 年底，国际化品种数量增至 17 个，占上市品种的 15.5%。向合格境外机构投资者/人民币合格境外机构投资者（QFII/RQFII）新增开放 42 个商品期货、商品期权和股指期货品种。

二是多元化推动双向开放。支持期货公司境外子公司完成增资，2022 年，5 家期货公司的境外子公司完成增资 25.3 亿元港币和 1.6 亿元人民币，期货公司境外子公司资本实力逐步提升。截至 2022 年末，全国期货公司共设立 19 家境外子公司，其中 18 家位于中国香港，1 家位于新加坡，为境外实体企业提供综合金融服务的能力不断增强。

二、期货交易所对外开放情况

（一）上海期货交易所对外开放情况

1. 提升 20 号胶期货国际定价影响力

一是积极拓展期货价格运用场景，提升“上海胶”的国际定价影响力。2022 年，泰国联益集团、新加坡合盛农业集团、泰国泰华树胶、海胶集团、广垦橡胶等境内外头部天然橡胶生产企业以及韩国锦湖轮胎、双星集团等境内外知名轮胎企业

积极运用上期能源 20 号胶期货作为天然橡胶跨境贸易定价基准，挂钩实货贸易量近 140 万吨，货值逾 150 亿元人民币。

二是 2022 年 9 月 8 日发布 20 号胶期货月均价，为产业客户长协合同定价提供参考便利。

三是携手国家级平台提高期货信息传播度，2022 年 8 月 12 日，与中国天然橡胶协会在协会官网联合推出“期现手牵手 乡村振兴路”专栏，首批上线天然橡胶和 20 号胶期货合约价格月报和库存月报。

四是 2022 年 12 月 9 日上线 20 号胶品种保税标准仓单交易，促进 20 号胶品种的期货现货结合、场内场外协同、境内境外连通，与天然橡胶期货和期权、标准仓单交易、延伸仓单交易及 20 号胶期货天然橡胶衍生品市场体系。

2. 持续深化国际铜期货服务实体经济的功能

一是试点开展“一路铜行”项目，聚焦提升产业客户参与程度，鼓励会员单位更好服务实体企业。项目开展期间，国际铜期货累计成交量和持仓量有较大增长，产业客户持仓规模实现有效提升。

二是新批准 2 个注册品牌，批准 1 个注册品牌新增 2 个注册产地，可交割资源稳步拓展。

三是引入合格境外机构投资者和人民币合格境外机构投资者参与交易，投资者结构日益优化。

四是持续开展境内外市场培育，强化对龙头企业的“一对一”服务，国际铜期货的市场认知度和影响力稳步提升。

3. 低硫燃料油期货运行平稳

低硫燃料油期货方面，上期所与浙江国际油气交易中心联合研发编制的“中国舟山低硫燃料油保税船供报价”买方和卖方报价均已发布，成为首个以国内期货市场价格作为定价基础的人民币报价机制。

4. 国际合作及交流情况

一是加强与境外交易所合作关系。2022 年 7 月，上期所与马来西亚衍生品交易所签署合作谅解备忘录，为后续合作奠定了框架基础。

二是持续研究推进与境外交易所探索结算价授权合作模式，进一步加强上期所跨境务实合作。

三是参与世界交易所联合会（WFE）等国际组织的各类会员大会、行业会议。

5. 开展多种形式境外推广活动，提升境外交易者参与度

一是持续推进引入合格境外投资者（QFII）和人民币合格境外投资者（RQFII）相关工作。参加 QFII/RQFII 参与商品期货细则的讨论，并开展相关调研活动收集回复口径；开展合作办会活动，介绍 QFII/RQFII 参与商品期货市场的情况。目前已有 QFII/RQFII 完成在交易所开户并进行交易。

二是持续推行“大推广”工作机制。2022 年多次参加国际性会议并发言，包括



中日产业研究论坛、第三届中日资本市场论坛、中国—东盟金融合作与发展领袖论坛及2022年亚洲铜业周CEO峰会；自主举办了十余场境外推广活动，主要围绕上期所国际化进展、特定品种推广、QFII/RQFII准入等主题，覆盖新加坡、韩国、日本、英国等多个国家和地区，累计观看量逾1万人次；服务好期货公司及境外经纪机构等市场参与者，通过境外合作办会等形式开展合作市场推广十余场，回答境外投资者关注的各类问题，与百余家机构开展业务交流。

三是做好外事交流工作。线上会晤芝加哥商业交易所（CME）、新加坡交易所（SGX）、港交所（HKEx）等境外机构。

6. 获得国际重要奖项

参加期货期权世界（FOW）主办的“2022年度亚洲资本市场”评选活动，上期所荣获FOW“2022年度最佳中国交易所”奖项；参加Energy Risk评奖活动，原油期货荣获Energy Risk“2022年度最佳创新”奖项。

（二）郑州商品交易所对外开放情况

1. 持续提升PTA期货的国际影响力

2022年，郑商所通过举办系列化线上线下会议持续推动PTA期货国际化工作，不断提升PTA期货服务跨境聚酯产业链的能力。2022年底，约500个境外账户在PTA期货上开户，实现连续4年稳定增长。目前，PTA期货价格已成为国内PTA现货贸易的定价基准和产业链上下游国际贸易的重要定价参考。

2. 稳步推动国际化品种研发上市

与波罗的海交易所签署谅解备忘录，推进引入境外特殊参与者等工作，不断提升开放合作水平。干散货航运市场参与主体众多，现货国际化程度较高，我国通过巴拿马型船进口煤炭和粮食等干散货。上市波罗的海巴拿马型干散货船运价指数（BPI指数）期货，将有利于完善我国国际航运产业避险工具体系，更好地服务“一带一路”倡议的实施。2022年1月，BPI指数期货获得中国证监会期货部批复立项，郑商所已初步完成合约规则（草案）设计和论证工作，并与指数编制机构签订谅解备忘录，正积极推进指数授权协议谈判等工作。

3. QFII/RQFII参与商品期货期权政策落地

经中国证监会同意，9月2日郑商所向市场发布《关于合格境外机构投资者和人民币合格境外机构投资者参与商品期货、期权合约的公告》《关于做好合格境外机构投资者和人民币合格境外机构投资者参与商品期货、期权合约交易有关事项的通知》。明确QFII/RQFII自9月2日起，可以参与PTA期货合约、PTA期权合约、甲醇期货合约、甲醇期权合约、白糖期货合约、白糖期权合约、菜籽油期货合约、菜籽油期权合约、短纤期货合约9个期货期权品种。

QFII/RQFII参与商品期货期权政策的落地，有利于进一步丰富国内衍生品市场的投资者结构，助力期货市场价格发现功能的更好发挥。

4. 成功举办2022中国（郑州）国际期货论坛

2022年9月6—8日，郑商所与郑州市政府、芝加哥商业交易所联合主办了2022中国（郑州）国际期货论坛。此次论坛主题为“稳中求进促发展 法治引领开新局”，中国证监会副主席方星海、河南省政府副省长费东斌出席论坛并致辞，诺贝尔经济学奖获得者罗伯特·默顿、全国人大财经委副主任委员尹中卿、央行货币政策委员会委员蔡昉等知名专家进行了主题演讲。据统计，本次论坛累计播放量43万次，各类媒体报道5000余篇，积极向外界传递了中国期货市场的声音，得到金融监管机构、政府部门及市场各界的支持和肯定。至此，中国（郑州）国际期货论坛已成功举办6届，已逐渐成为赋能实体经济和对外开放的重要窗口。

5. 稳妥有序开展线上及线下外事活动

郑商所深入贯彻落实中央和中国证监会关于疫情防控 and 对外交往决策部署，积极开展“云外事”活动，认真制订并执行郑商所年度线上国际会议参会计划，组织团组共6人参加Gartner科技发展与创新线上会议。本年度郑商所派遣1名工作人员赴中国商品交易所新加坡联合办事处郑商所工作组开展驻外工作，以驻外机构为抓手，广泛征集境外参与者的意见和建议，持续做好郑州期货市场的国际宣传工作。

6. 拓展境外市场，深化国际交流合作

郑商所成功主办两期“走进郑商所”的市场活动，联合举办中国商品期货市场推介活动，参与亚太期货、麦格里期货等举办的市场活动，宣介PTA期货及QFII情况。参加由国际期货业协会（FIA）主办的亚洲衍生品会议、由期货期权世界（FOW）举办的“交易新加坡”等国际期货行业重要会议，介绍PTA以及QFII品种的期货市场情况及相关政策，征求客户对郑商所品种及工作的意见建议。

（三）大连商品交易所对外开放情况

2022年，大商所积极推进高水平对外开放，进一步扩大境内特定品种范围，多点推进对外开放及对外交流，持续提高市场国际影响力。向合格境外投资者开放首批7个品种，其中11个产品为首次对外开放。

1. 黄大豆1号、黄大豆2号、豆粕、豆油期货和期权正式作为境内特定品种引入境外交易者

这是期货市场服务国内国际大豆和油料产业、促进大豆产业链供应链安全的重要举措，同时也是境内期货交易所首次在全品种链条同步引入境外交易者。通过大豆全系列品种对境外交易者开放，更好地满足了全球大豆产业链企业风险管理的需求，进一步增强了我国与国际大豆产业链供应链的黏性韧性，提升中国价格、中国大豆产业的全球影响力，为我国大豆产业链实现高质量发展和国家粮油安全战略保驾护航。

2. 探索推进铁矿石境外交收业务

境外交收业务依托具有境外交货能力的交割库，经交割库与标准仓单持有人



协商一致，进行境内标准仓单转让并办理境外商品交收。在铁矿石品种率先试点境外交收，一方面满足了企业个性化货物需求和国内企业“走出去”战略发展的需要，便于其更好地利用期货现货、国内国际两个市场，提升风险管理能力和综合竞争力；另一方面，拓展了期货业务在全球的辐射范围，实现铁矿石期货在全球交割，有利于健全境内外联动的交割体系，在深化铁矿石期货对外开放的同时提升中国期货价格在国际市场的影响力，为全球铁矿石贸易提供有效、权威的价格参考。

3. 首次面向合格境外投资者（QFII/RQFII）开放商品期货期权

2022年9月2日，商品期货期权首次面向合格境外投资者（QFII/RQFII）开放。其中，大商所首批开放了7个品种的期货和期权，共计14个产品。分别是黄大豆1号、黄大豆2号、豆油、豆粕、棕榈油、聚乙烯、铁矿石。

4. 丰富境外客户参与路径，积极拓展境外市场

一是开展境外客户关系维护及服务。实现首家境外产业企业（路易达孚）申请套保、参与企风计划；回复境外咨询邮件165封，向境外客户、经纪机构等联系人推送英文月刊12期，发布《国际市场聚焦》20期。

二是新增4家境外中介机构，截至2022年底，共有来自11个国家和地区的74家境外中介机构在大商所备案，参与特定品种交易。

三是积极推动QFII参与豆类期货和期权国际化。联合会员、托管行开展6场业务研讨会，发布常见问题清单；制订豆类品种国际化市场活动方案，制作英文宣传材料。

5. 国际合作及交流情况

根据中国证监会疫情防控常态化下关于国际交流活动有关要求，大商所积极开展国际交流合作，取得良好成效，具体包括以下六个方面：

一是党委书记、理事长冉华同志线上参加“世界经济论坛中国国务院总理李克强特别对话会”。

二是党委委员、副总经理程伟东同志为“马来西亚衍生产品交易所（BMD）棕榈与月桂油价格走势展望暨展览会”录制视频致辞。

三是正式印发《大连商品交易所国际交流与合作工作管理办法》。

四是与巴西交易所、阿根廷交易所（MatbaRofex）、乌兹别克斯坦共和国商品交易所（UZEX）、俄罗斯圣彼得堡国际商品原料交易所（SPIMEX）、三井物产、芝加哥商业交易所（CME）等境外交易所及机构进行工作层面线上交流，加强与境外市场的沟通联系。

五是对世界交易所联合会（WFE）事务进行投票，支持上交所担任董事，定期向WFE等国际行业组织提交年度和月度品种交易情况等多种数据。

六是推进与BMD合约外挂事宜。

（四）中国金融期货交易所对外开放情况

1. 对外开放情况

2022年，中金所立足于我国资本市场对外开放整体布局，积极探索金融期货市场对外开放有效模式并研究论证开放方案。研究分析境外市场及相关产品，持续推动境内外机构调研和方案设计，了解市场需求与意见建议，优化相关业务安排，努力服务于境外投资者对我国资本市场日益增长的投资和风险管理需求。9月2日，中金所正式发布 QFII/RQFII 参与股指期货交易有关事项的通知，并开始受理业务办理申请，QFII/RQFII 参与股指期货交易业务平稳落地。

同时，中金所稳步推进巴基斯坦证券交易所、中欧国际交易所境外合作项目发展。协助巴基斯坦证券交易所设立科创板，研发上市2只股票ETF产品和90天可交割个股期货，扩大投资者数量并优化交易所收入结构。推动中德通业务取得实质性进展，吸引三一重工赴法兰克福发行和上市GDR，推动中金公司、中信里昂成为法兰克福证券交易所会员，持续推进A股指数衍生品研发，切实推进“一带一路”项目发展，促进双边市场实质性合作。

2. 国际合作及交流情况

2022年，中金所持续加强国际交流合作，进一步巩固交易所国际关系网络，提升交易所国际影响力。

一是充分利用国际组织平台资源。持续开展与国际组织的沟通交流，与亚洲证券业和金融市场协会（ASIFMA）、国际掉期与衍生工具协会（ISDA）开展问卷调研及养老金运用金融衍生品案例、场内外利率市场协同发展等联合研究，积极参加世界交易所联合会（WFE）新兴市场委员会、企业风险工作组工作，参与交易所行业交流与标准制定。

二是深化与境外合作伙伴的交流与合作探讨。与香港交易所、芝加哥商业交易所、芝加哥期权交易所、日本交易所、德意志交易所、巴基斯坦证券交易所等多次开展业务交流探讨。借助第三届中日资本市场论坛契机与日本交易所签署谅解备忘录，并在备忘录框架下积极探索联合宣传推介等方面的合作，以加强与日本资本市场相互了解和经验共享，促进双方机构投资者更好地参与彼此金融衍生品市场。

三是积极参加国际会议和论坛。组织线上参加法兰克福衍生品论坛、WFE 2022年清算及衍生品论坛、FOW 2022年“交易新加坡”论坛、ISDA“中国衍生品市场新篇章”研讨会等国际会议和论坛，6批共22人次，进一步加强与国际协会和机构投资者沟通交流，积极宣介交易所业务发展情况。

（五）广州期货交易所对外开放情况

广期所以创新型、国际化、市场化为发展定位，积极开展国际合作与交流工作，助力高水平对外开放。



一是制定发布《广州期货交易所境外特殊参与者管理办法》《广州期货交易所期货公司会员接受境外中介机构委托开展特定品种期货交易业务管理办法》，为产品对外开放做好制度准备。

二是与香港交易所建立定期会谈机制，2022年1月27日至2022年底，双方开展了6轮线上会谈，就产品及业务领域的合作开展深入研讨，为金融服务粤港澳大湾区建设打下基础。

三是与德意志交易所集团（DBG）签署谅解备忘录，建立定期会谈机制，深入探讨双方在碳排放权、电力等绿色领域的业务合作，联合开展中欧碳市场研究与调研。

四是积极与芝加哥商业交易所集团（CME）、新加坡交易所（SGX）、日本交易所（JPX）等全球主要期货交易所，以及世界交易所联合会（WFE）、国际期货业协会（FIA）等国际组织加强沟通交流。

五是根据中国证监会的要求，制定广期所国际交流合作管理办法，全面规范国际业务工作。

三、中证商品指数有限责任公司对外开放情况

一是扎实推动国际业务及相关研究。开展香港商品期货市场和商品ETF市场研究，探讨指数衍生品境外发行事宜。同时，扎实开展境外监管规则研究，研究翻译了新加坡《证券与期货金融基准条例》和澳大利亚《金融基准规则》，为公司国际业务发展做好前期准备。

二是持续加强国际交流合作。通过线上线下相结合的方式，与标普道琼斯指数（S&P Dow Jones Indices）、标普全球普氏（S&P Global Platts）、富时罗素（FTSE Russell）等国际指数编制机构开展业务交流，深入学习借鉴指数编制、数据管理等先进经验，沟通探讨合作机会。组织参加了美国期货业协会、标普全球、明晟等举办的线上会议，把握行业最新动态及发展方向。

第二章

2022年中国期货市场 上市品种运行情况^①

>>> 第一节 上海期货交易所上市品种运行情况

上海期货交易所（以下简称上期所，SHFE）2022年全年累计成交量19.43亿手，占全国期货市场成交量的28.72%，同比下降20.54%；全年累计成交额181.30万亿元，占全国期货市场成交额的33.89%，同比下降15.51%。目前，对外开放的品种有国际铜、低硫燃料油、20号胶、原油、原油期货。上期所有期货公司会员150家，非期货公司会员11家（境外特殊参与者3家），已完成备案的境外经纪机构78家，来自10个国家（地区）。成交较为活跃的品种有纸浆、锌、锡、铜、国际铜、天然橡胶、石油沥青、热轧卷板、燃料油、铅、镍、螺纹钢、铝、黄金、不锈钢、白银、原油、低硫燃料油、20号胶、锌期权、铜期权、铝期权、原油期货；成交较为低迷的品种有线材、天然橡胶期权、黄金期权，单个品种年成交量在全国占比不足0.1%。2022年上期所新上市的品种有螺纹钢期权、白银期权。

^① 本部分数据进行了四舍五入处理。

一、铜期货、期权运行情况

(一) 期货、期权交易情况 (见表 2-1-1 ~ 表 2-1-6)

表 2-1-1 2022 年铜期货月度交易情况

月度	成交量 (万手)	同比变化 (%)	成交金额 (亿元)	同比变化 (%)	月末持仓量 (万手)	同比变化 (%)
1 月	328.24	-36.88	11 564.67	-24.41	32.10	13.90
2 月	265.32	-53.80	9 461.25	-48.85	32.12	-15.12
3 月	391.83	-49.78	14 269.55	-45.10	35.60	2.61
4 月	253.25	-58.47	9 350.03	-55.41	33.41	-10.08
5 月	268.57	-59.17	9 608.02	-60.68	32.44	-2.60
6 月	380.63	-26.06	12 898.16	-28.49	34.67	18.88
7 月	658.34	48.00	18 990.74	22.70	41.94	36.13
8 月	531.68	14.48	16 363.78	1.79	42.11	30.31
9 月	449.30	6.85	13 751.30	-5.75	42.12	50.25
10 月	326.24	-35.49	10 182.85	-44.25	46.14	34.07
11 月	481.73	-7.20	15 743.94	-13.66	42.89	11.14
12 月	314.53	-21.25	10 370.55	-25.10	39.71	19.55
总计	4 649.66	-27.47	152 554.84	-30.57	—	—

数据来源：上海期货交易所。

表 2-1-2 2021—2022 年铜期货年度交易情况

年度	成交量 (万手)	同比变化 (%)	成交金额 (万亿元)	同比变化 (%)	年末持仓量 (万手)	同比变化 (%)
2021 年	6 410.72	12.15	21.97	55.46	33.22	5.51
2022 年	4 649.66	-27.47	15.26	-30.57	39.71	19.55

数据来源：上海期货交易所。

表 2-1-3 2021—2022 年铜期货内外盘年度交易情况

年度	成交量 (万手)		年末持仓量 (万手)	
	上期所 (SHFE)	LME (伦敦金属交易所)	上期所 (SHFE)	LME (伦敦金属交易所)
2021 年	6 410.72	2 969.14	33.22	29.77
2022 年	4 649.66	2 937.72	39.71	29.25

注：上期所铜期货交易单位为 5 吨/手，LME 铜期货交易单位为 25 吨/手。

数据来源：上海期货交易所、LME (伦敦金属交易所)。

表 2-1-4 2022 年铜期权月度交易情况

月度	成交量 (万手)	同比变化 (%)	成交量 看跌/看涨 (PCR)	成交金额 (亿元)	同比变化 (%)	月末持仓量 (万手)	同比变化 (%)
1月	84.06	72.99	0.918	16.79	18.00	3.68	10.07
2月	67.00	22.78	0.859	15.16	-40.91	3.36	-19.81
3月	73.69	-1.83	0.747	22.36	-22.24	3.52	-15.91
4月	62.79	-18.06	0.869	13.97	-41.81	3.71	10.21
5月	72.67	1.81	1.601	16.78	-46.85	3.55	-13.32
6月	111.20	35.84	1.656	33.84	11.03	4.50	30.42
7月	118.15	62.37	1.040	52.49	126.83	4.61	20.69
8月	128.97	35.34	1.319	37.87	48.62	5.81	27.26
9月	144.38	88.65	1.853	37.11	67.51	6.80	102.20
10月	98.75	35.61	1.623	22.19	-23.64	6.60	91.91
11月	142.97	68.42	1.264	37.56	52.08	4.99	42.04
12月	106.75	28.36	1.353	21.20	29.58	3.93	25.21
总计	1 211.45	35.57	1.261	327.38	10.73	—	—

数据来源：上海期货交易所。

表 2-1-5 2021—2022 年铜期权年度交易情况

年度	成交量 (万手)	同比变化 (%)	成交量 看跌/看涨 (PCR)	成交金额 (亿元)	同比变化 (%)	年末持仓量 (万手)	同比变化 (%)
2021年	893.62	94.15	1.029	295.67	139.67	3.14	20.39
2022年	1 211.45	35.57	1.261	327.38	10.73	3.93	25.21

数据来源：上海期货交易所。

表 2-1-6 2021—2022 年铜期权内外盘年度交易情况

年度	成交量 (万手)			年末持仓量 (万手)		
	上期所 (SHFE)	LME (伦敦 金属交易所)	CME Group (芝加哥商业 交易所集团)	上期所 (SHFE)	LME (伦敦金属 交易所)	CME Group (芝加哥商业 交易所集团)
2021年	893.62	163.82	74.87	3.14	9.83	2.70
2022年	1 211.45	154.24	105.89	3.93	7.85	8.26

注：上期所铜期权交易单位为5吨/手，LME铜期权交易单位为25吨/手，CME Group铜期权交易单位为25 000磅/手。

数据来源：上海期货交易所、LME（伦敦金属交易所）、FIA。

（二）交割、行权情况（见表2-1-7~表2-1-10）

表 2-1-7 2022 年铜期货月度交割情况

月度	交割量（手）	同比变化（%）	交割金额（亿元）	同比变化（%）
1月	1 970	-19.43	6.95	-4.21
2月	9 090	182.74	32.14	246.00
3月	4 960	-64.23	17.77	-61.98
4月	6 400	-32.70	24.03	-24.61
5月	3 650	-64.37	13.01	-65.86
6月	2 160	-81.94	7.68	-81.65
7月	1 265	-80.61	3.45	-84.55
8月	795	-81.62	2.48	-83.70
9月	950	-48.79	3.01	-53.51
10月	9 550	2 590.14	30.77	2 246.09
11月	8 240	370.86	27.71	343.12
12月	4 740	441.71	15.70	421.64
总计	53 770	-19.66	184.70	-19.59

数据来源：上海期货交易所。

表 2-1-8 2021—2022 年铜期货年度交割情况

年度	交割量（手）	同比变化（%）	交割金额（亿元）	同比变化（%）
2021年	66 925	-29.74	229.69	4.51
2022年	53 770	-19.66	184.70	-19.59

数据来源：上海期货交易所。

表 2-1-9 2022 年铜期权月度行权情况

月度	行权量（手）
1月	2 596
2月	3 552
3月	3 873
4月	4 215
5月	5 345
6月	8 699
7月	12 287
8月	6 097
9月	5 042
10月	4 257
11月	7 757
12月	5 399
总计	69 119

数据来源：上海期货交易所。

表 2-1-10 2021—2022 年铜期权年度行权情况

年度	行权量（手）	同比变化（%）
2021 年	50 085	37.87
2022 年	69 119	38.00

数据来源：上海期货交易所。

（三）期货价格走势（见图 2-1-1、表 2-1-11、表 2-1-12）

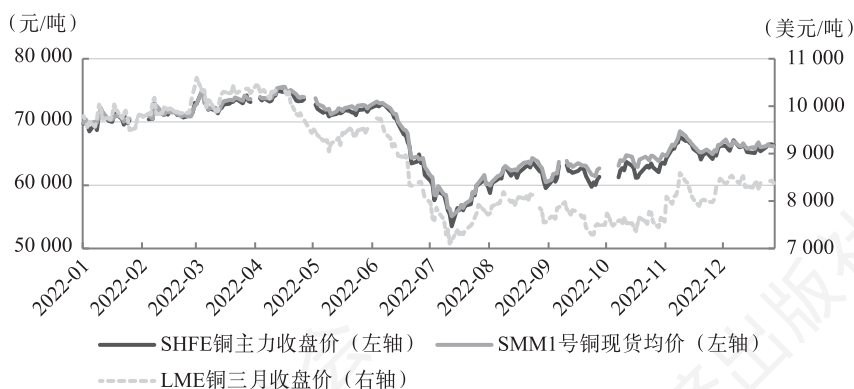


图 2-1-1 2022 年铜期货内外盘和国内现货市场价格走势

数据来源：上海期货交易所、LME（伦敦金属交易所）、上海有色网。

表 2-1-11 2022 年铜期货内外盘和国内现货市场价格指标

市场分类	2021 年末 收盘价	2022 年盘 中最高价	2022 年盘 中最低价	2022 年末 收盘价	全年涨跌	结算价 平均价	标准差	极差
上期所主力价格 (元/吨)	70 380	78 270	53 400	66 260	-4 120	67 633.24	4 770.71	24 870
LME 连续价格 (美元/吨)	9 755	10 600	7 104	8 374	-1 381	8 785.73	1 037.13	3 496
上海有色网 1 号电解 铜现货价格 (元/吨)	69 920	75 550	55 080	66 185	-3 735	67 387.67	5 044.63	20 470

数据来源：上海期货交易所、LME（伦敦金属交易所）、上海有色网。

表 2-1-12 2022 年铜期货内外盘和国内现货市场价格相关性

价格选择	相关系数
上期所主力结算价与 LME 连续价格	0.94
上期所主力结算价与铜现货市场价格	0.99

数据来源：上海期货交易所、LME（伦敦金属交易所）、上海有色网。

二、国际铜期货运行情况

(一) 期货交易情况 (见表 2-1-13 ~ 表 2-1-15)

表 2-1-13 2022 年国际铜期货月度交易情况

月度	成交量 (万手)	同比变化 (%)	成交金额 (亿元)	同比变化 (%)	月末持仓量 (万手)	同比变化 (%)
1 月	30.13	-13.36	946.27	3.89	1.50	-34.40
2 月	30.54	-23.06	970.58	-12.87	1.82	-17.06
3 月	53.15	28.48	1 737.25	41.74	2.46	53.82
4 月	37.46	-8.84	1 236.02	-1.77	2.15	-0.38
5 月	53.46	29.2	1 698.25	23.67	1.81	-15.07
6 月	59.45	48.43	1 800.82	44.22	2.40	41.76
7 月	74.52	75.72	1 912.32	45.28	2.63	111.60
8 月	64.44	59.3	1 755.64	40.95	1.75	85.32
9 月	38.64	7.17	1 047.86	-5.65	1.77	100.65
10 月	35.33	-31.26	981.07	-40.90	2.23	66.41
11 月	41.29	0.91	1 202.25	-5.80	2.08	101.14
12 月	36.73	8.86	1 081.77	4.06	2.31	105.92
总计	555.13	14.86	16 370.11	10.77	—	—

数据来源：上海国际能源交易中心。

表 2-1-14 2021—2022 年国际铜期货年度交易情况

年度	成交量 (万手)	同比变化 (%)	成交金额 (万亿元)	同比变化 (%)	年末持仓量 (万手)	同比变化 (%)
2021 年	483.33	769.29	1.48	936.62	1.12	-46.14
2022 年	555.13	14.86	1.64	10.77	2.31	105.92

数据来源：上海国际能源交易中心。

表 2-1-15 2021—2022 年国际铜期货内外盘年度交易情况

年度	成交量 (万手)		年末持仓量 (万手)	
	上期能源 (INE)	LME (伦敦金属交易所)	上期能源 (INE)	LME (伦敦金属交易所)
2021 年	483.33	2 969.14	1.12	29.77
2022 年	555.13	2 937.72	2.31	29.25

注：上期所铜期货交易单位为 5 吨/手，LME 铜期货交易单位为 25 吨/手。

数据来源：上海国际能源交易中心、LME (伦敦金属交易所)。

(二) 交割情况 (见表 2-1-16、表 2-1-17)

表 2-1-16 2022 年国际铜期货月度交割情况

月度	交割量 (手)	同比变化 (%)	交割金额 (亿元)	同比变化 (%)
1 月	380	—	1.18	—
2 月	1 035	—	3.27	—
3 月	2 245	80.32	6.96	87.60
4 月	4 245	117.14	14.3	152.20
5 月	2 545	-16.14	8.1	-19.96
6 月	785	-84.76	2.55	-84.26
7 月	615	-88.02	1.63	-89.44
8 月	1 255	-67.06	3.48	-70.56
9 月	2 720	94.98	7.41	73.54
10 月	2 335	391.58	6.53	350.34
11 月	1 660	472.41	4.8	427.47
12 月	1 095	447.50	3.22	419.35
总计	20 915	-7.82	63.43	-9.64

数据来源: 上海国际能源交易中心。

表 2-1-17 2021—2022 年国际铜期货年度交割情况

年度	交割量 (手)	同比变化 (%)	交割金额 (亿元)	同比变化 (%)
2021 年	22 690	—	70.20	—
2022 年	20 915	-7.82	63.43	-9.64

数据来源: 上海国际能源交易中心。

(三) 期货价格走势 (见图 2-1-2、表 2-1-18、表 2-1-19)

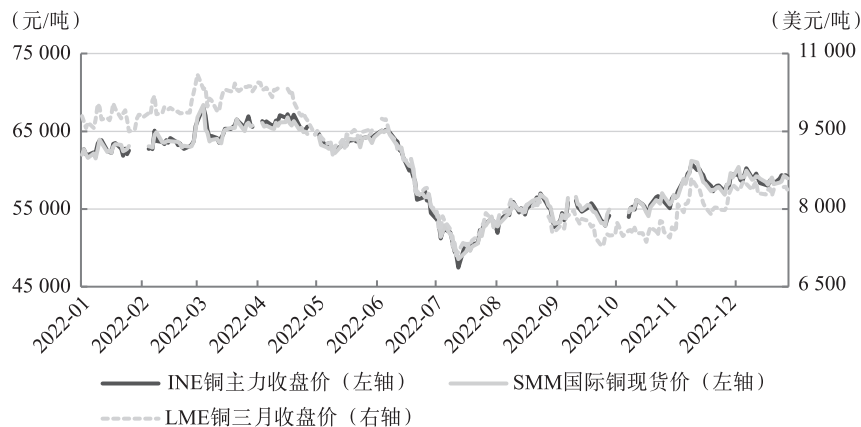


图 2-1-2 2022 年国际铜期货内外盘和国内现货市场价格走势

数据来源: 上海国际能源交易中心、LME (伦敦金属交易所)、上海有色网。

表 2-1-18 2022 年国际铜期货内外盘和国内现货市场价格指标

市场分类	2021 年末 收盘价	2022 年盘 中最高价	2022 年盘 中最低价	2022 年 末收盘价	全年 涨跌	结算价平 均价	标准差	极差
上期能源主力价格 (元/吨)	62 880	71 000	47 290	59 210	-3 670	59 560	4 841.39	23 710
LME 连续价格 (美元/吨)	9 755	10 600	7 104	8 374	-1 381	8 785.73	1 037.13	3 496
上海有色网国际铜现 货价格 (元/吨)	62 160	68 395	48 565	58 955	-3 205	59 508	4 725.34	19 830

数据来源：上海国际能源交易中心、LME（伦敦金属交易所）、上海有色网。

表 2-1-19 2022 年国际铜期货内外盘和国内现货市场价格相关性

价格选择	相关系数
上期能源主力结算价与 LME 连续价格	0.95
上期能源主力结算价与国际铜现货市场价格	0.99

数据来源：上海国际能源交易中心、LME（伦敦金属交易所）、上海有色网。

三、铝期货、期权运行情况

（一）期货、期权交易情况（见表 2-1-20 ~ 表 2-1-25）

表 2-1-20 2022 年铝期货月度交易情况

月度	成交量 (万手)	同比变化 (%)	成交金额 (亿元)	同比变化 (%)	月末持仓量 (万手)	同比变化 (%)
1 月	905.06	50.65	9 608.39	113.12	45.93	19.86
2 月	847.12	31.90	9 623.00	84.33	46.99	-6.37
3 月	1 179.47	-5.20	13 405.27	24.48	42.66	-6.08
4 月	763.12	-23.59	8 188.17	-9.09	42.30	-23.08
5 月	771.27	-34.24	7 855.72	-30.39	40.13	-13.18
6 月	910.64	4.62	9 033.68	11.45	40.52	-8.43
7 月	988.13	20.95	8 926.09	13.72	40.37	-23.50
8 月	867.73	-8.92	8 018.46	-17.21	35.76	-44.52
9 月	823.93	-43.30	7 582.82	-53.68	40.07	-14.96
10 月	553.56	-67.72	5 088.20	-73.47	43.27	-19.56
11 月	797.30	-47.97	7 422.22	-49.67	42.44	-14.81
12 月	590.17	-48.52	5 573.44	-49.90	34.45	-30.84
总计	9 997.51	-23.95	100 325.45	-21.53	—	—

数据来源：上海期货交易所。

表 2-1-21 2021—2022 年铝期货年度交易情况

年度	成交量 (万手)	同比变化 (%)	成交金额 (万亿元)	同比变化 (%)	年末持仓量 (万手)	同比变化 (%)
2021 年	13 145.79	148.67	12.79	243.62	49.81	54.79
2022 年	9 997.51	-23.95	10.03	-21.53	34.45	-30.84

数据来源：上海期货交易所。

表 2-1-22 2021—2022 年铝期货内外盘年度交易情况

年度	成交量 (万手)		年末持仓量 (万手)	
	上期所 (SHFE)	LME (伦敦金属交易所)	上期所 (SHFE)	LME (伦敦金属交易所)
2021 年	13 145.79	5 767.03	49.81	73.06
2022 年	9 997.51	5 204.77	34.45	62.85

注：上期所铝期货交易单位为 5 吨/手，LME 铝期货交易单位为 25 吨/手。

数据来源：上海期货交易所、LME（伦敦金属交易所）。

表 2-1-23 2022 年铝期权月度交易情况

月度	成交量 (万手)	同比变化 (%)	成交量 看跌/看涨 (PCR)	成交金额 (亿元)	同比变化 (%)	月末持仓量 (万手)	同比变化 (%)
1 月	84.29	163.65	0.872	9.07	315.70	3.55	106.74
2 月	70.08	150.63	0.960	7.48	126.96	4.15	68.95
3 月	77.91	70.31	0.790	11.17	93.58	4.13	38.78
4 月	78.89	33.12	1.020	8.24	39.72	3.83	-29.41
5 月	90.41	52.96	0.984	8.65	8.93	4.21	16.62
6 月	118.96	150.91	1.226	11.49	122.06	3.84	52.10
7 月	98.76	93.92	1.055	10.60	124.03	4.05	41.59
8 月	110.01	28.39	0.873	10.54	29.05	3.49	-41.18
9 月	113.49	-9.00	0.984	9.76	-44.09	3.81	-32.01
10 月	74.79	-13.27	0.898	4.78	-72.13	3.84	-28.79
11 月	125.31	84.98	0.927	9.20	-8.87	5.30	43.06
12 月	96.69	30.45	0.868	6.99	-1.47	3.91	28.55
总计	1 139.65	49.77	0.956	108.04	13.69	—	—

数据来源：上海期货交易所。

表 2-1-24 2021—2022 年铝期权年度交易情况

年度	成交量 (万手)	同比变化 (%)	成交量 看跌/看涨 (PCR)	成交金额 (亿元)	同比变化 (%)	年末持仓量 (万手)	同比变化 (%)
2021 年	760.93	799.07	0.837	95.03	1 353.01	3.04	111.62
2022 年	1 139.65	49.77	0.956	108.04	13.69	3.91	28.55

数据来源：上海期货交易所。

表 2-1-25 2021—2022 年铝期权内外盘年度交易情况

年度	成交量 (万手)		年末持仓量 (万手)	
	上期所 (SHFE)	LME (伦敦金属交易所)	上期所 (SHFE)	LME (伦敦金属交易所)
2021 年	760.93	313.68	3.04	22.24
2022 年	1 139.65	366.84	3.91	13.54

注：上期所铝期权单位为 5 吨/手，LME 铝期权单位为 25 吨/手。

数据来源：上海期货交易所、LME（伦敦金属交易所）。

(二) 交割、行权情况 (见表 2-1-26 ~ 表 2-1-29)

表 2-1-26 2022 年铝期货月度交割情况

月度	交割量 (手)	同比变化 (%)	交割金额 (亿元)	同比变化 (%)
1 月	14 945	372.2	15.82	571.12
2 月	17 250	314.17	19.51	501.95
3 月	10 410	-24.67	11.35	-6.41
4 月	9 750	48.18	10.59	78.53
5 月	4 045	-71.99	4.17	-70.63
6 月	6 195	90.62	6.12	98.13
7 月	5 375	36.08	4.65	21.82
8 月	13 535	442.48	12.47	394.08
9 月	7 990	143.97	7.46	104.2
10 月	15 200	210.2	14.15	144.07
11 月	3 715	-73.5	3.5	-74.17
12 月	3 820	-63.89	3.67	-63.64
总计	112 230	32.60	113.45	41.18

数据来源：上海期货交易所。

表 2-1-27 2021—2022 年铝期货年度交割情况

年度	交割量 (手)	同比变化 (%)	交割金额 (亿元)	同比变化 (%)
2021 年	84 640	-38.80	80.36	-15.59
2022 年	112 230	32.60	113.45	41.18

数据来源：上海期货交易所。

表 2-1-28 2022 年铝期权月度行权情况

月度	行权量（手）
1 月	9 212
2 月	5 876
3 月	5 614
4 月	12 897
5 月	9 691
6 月	12 627
7 月	9 522
8 月	14 535
9 月	9 054
10 月	6 980
11 月	12 810
12 月	9 404
总计	118 222

数据来源：上海期货交易所。

表 2-1-29 2021—2022 年铝期权年度行权情况

年度	行权量（手）	同比变化（%）
2021 年	113 631	894.15
2022 年	118 222	4.04

数据来源：上海期货交易所。

（三）期货价格走势（见图 2-1-3、表 2-1-30、表 2-1-31）



图 2-1-3 2022 年铝期货内外盘和国内现货市场价格走势

数据来源：上海期货交易所、LME（伦敦金属交易所）、上海有色网。

表 2-1-30 2022 年铝期货内外盘和国内现货市场价格指标

市场分类	2021 年末 收盘价	2022 年盘 中最高价	2022 年盘 中最低价	2022 年末 收盘价	全年涨跌	结算价 平均价	标准差	极差
上期所主力价格 (元/吨)	20 380	24 255	17 025	18 700	-1 680	19 914.11	1 687.06	3 875
LME 连续价格 (美元/吨)	2 807.5	3 740	2 114	2 378	-429.5	2 710.92	431.47	932.5
上海有色网 A00 铝现 货价格 (元/吨)	20 350	23 560	17 400	18 680	-1 670	19 938.72	1 653.58	3 210

数据来源：上海期货交易所、LME（伦敦金属交易所）、上海有色网。

表 2-1-31 2022 年铝期货内外盘和国内现货市场价格相关性

价格选择	相关系数
上期所主力结算价与 LME 连续价格	0.96
上期所主力结算价与铝现货市场价格	1.00

数据来源：上海期货交易所、LME（伦敦金属交易所）、上海有色网。

四、锌期货、期权运行情况

(一) 期货、期权交易情况 (见表 2-1-32 ~ 表 2-1-37)

表 2-1-32 2022 年锌期货月度交易情况

月度	成交量 (万手)	同比变化 (%)	成交金额 (亿元)	同比变化 (%)	月末持仓量 (万手)	同比变化 (%)
1 月	524.80	14.21	6 490.94	37.66	23.78	30.69
2 月	402.28	5.63	5 058.45	27.46	24.66	71.64
3 月	598.18	-7.87	7 775.32	11.02	20.27	39.35
4 月	553.96	0.59	7 740.71	29.12	21.00	38.73
5 月	516.61	-13.78	6 673.38	-0.92	19.88	21.21
6 月	604.72	1.51	7 601.13	14.67	19.59	31.92
7 月	731.84	31.75	8 316.27	34.62	22.77	44.40
8 月	689.72	22.43	8 513.03	34.76	25.32	73.83
9 月	605.48	12.02	7 317.24	19.34	19.42	35.16
10 月	483.68	-41.79	5 856.63	-43.67	23.49	58.34
11 月	679.34	8.90	7 978.31	9.82	20.73	25.75
12 月	442.42	-24.34	5 342.55	-22.73	16.57	-21.19
总计	6 833.04	-1.46	84 663.96	8.20	—	—

数据来源：上海期货交易所。

表 2-1-33 2021—2022 年锌期货年度交易情况

年度	成交量 (万手)	同比变化 (%)	成交金额 (万亿元)	同比变化 (%)	年末持仓量 (万手)	同比变化 (%)
2021 年	6 934.13	14.94	7.82	40.92	21.03	13.82
2022 年	6 833.04	-1.46	8.47	8.20	16.57	-21.19

数据来源：上海期货交易所。

表 2-1-34 2021—2022 年锌期货内外盘年度交易情况

年度	成交量 (万手)		年末持仓量 (万手)	
	上期所 (SHFE)	LME (伦敦金属交易所)	上期所 (SHFE)	LME (伦敦金属交易所)
2021 年	6 934.13	2 204.08	21.03	28.39
2022 年	6 833.04	2 133.19	16.57	21.43

注：上期所锌期货交易单位为 5 吨/手，LME 锌期货交易单位为 25 吨/手。

数据来源：上海期货交易所、LME（伦敦金属交易所）。

表 2-1-35 2022 年锌期权月度交易情况

月度	成交量 (万手)	同比变化 (%)	成交量 看跌/看涨 (PCR)	成交金额 (亿元)	同比变化 (%)	月末持仓量 (万手)	同比变化 (%)
1 月	42.64	47.06	0.774	5.68	95.64	2.03	85.14
2 月	34.17	45.74	0.973	3.81	14.67	1.96	79.96
3 月	44.42	46.45	0.620	6.05	37.04	1.73	69.25
4 月	70.07	119.05	0.852	9.09	145.67	2.55	24.72
5 月	57.99	41.05	0.954	7.11	26.82	1.92	19.11
6 月	76.20	94.47	1.521	10.43	114.16	2.34	53.43
7 月	73.28	133.22	1.241	10.24	201.08	1.92	59.19
8 月	83.17	133.57	1.050	10.67	217.62	2.25	32.92
9 月	96.06	128.97	1.347	10.31	144.08	2.21	22.64
10 月	67.38	39.15	1.252	7.05	-33.52	2.57	13.97
11 月	106.46	164.02	1.238	11.12	97.90	2.19	22.60
12 月	79.53	70.34	1.151	8.25	43.39	1.82	-11.26
总计	831.44	89.17	1.104	99.86	72.74	—	—

数据来源：上海期货交易所。

表 2-1-36 2021—2022 年锌期权年度交易情况

年度	成交量 (万手)	同比变化 (%)	成交量 看跌/看涨 (PCR)	成交金额 (亿元)	同比变化 (%)	年末持仓量 (万手)	同比变化 (%)
2021 年	439.52	271.25	0.794	57.81	340.07	2.05	86.32
2022 年	831.44	89.17	1.104	99.86	72.74	1.82	-11.26

数据来源：上海期货交易所。

表 2-1-37 2021—2022 年锌期权内外盘年度交易情况

年度	成交量 (万手)		年末持仓量 (万手)	
	上期所 (SHFE)	LME (伦敦金属交易所)	上期所 (SHFE)	LME (伦敦金属交易所)
2021 年	439.52	105.58	2.05	6.17
2022 年	831.44	111.21	1.82	1.57

数据来源: 上海期货交易所、LME (伦敦金属交易所)。

(二) 交割情况 (见表 2-1-38 ~ 表 2-1-41)

表 2-1-38 2022 年锌期货月度交割情况

月度	交割量 (手)	同比变化 (%)	交割金额 (亿元)	同比变化 (%)
1 月	4 790	96.71	5.87	129.94
2 月	7 660	285.89	9.60	381.74
3 月	9 990	147.28	12.59	186.49
4 月	7 595	62.11	10.69	111.66
5 月	4 455	96.26	5.67	125.29
6 月	8 705	745.15	11.26	877.55
7 月	9 355	1 978.89	10.42	2 019.33
8 月	5 145	478.09	6.41	541.69
9 月	2 860	572.94	3.59	653.11
10 月	7 060	388.58	9.34	404.51
11 月	360	-84.45	0.44	-83.37
12 月	640	-83.09	0.80	-81.70
总计	68 615	166.41	86.67	204.09

数据来源: 上海期货交易所。

表 2-1-39 2021—2022 年锌期货年度交割情况

年度	交割量 (手)	同比变化 (%)	交割金额 (亿元)	同比变化 (%)
2021 年	25 755	-46.70	28.50	-32.49
2022 年	68 615	166.41	86.67	204.09

数据来源: 上海期货交易所。

表 2-1-40 2022 年锌期权月度行权情况

月度	行权量 (手)
1 月	2 725
2 月	3 258
3 月	3 056

续表

月度	行权量（手）
4月	3 493
5月	3 653
6月	5 496
7月	3 908
8月	6 256
9月	4 348
10月	3 578
11月	4 249
12月	5 494
总计	49 514

数据来源：上海期货交易所。

表 2-1-41 2021—2022 年锌期权年度行权情况

年度	行权量（手）	同比变化（%）
2021年	39 980	384.37
2022年	49 514	23.85

数据来源：上海期货交易所。

(三) 期货价格走势（见图 2-1-4、表 2-1-42、表 2-1-43）



图 2-1-4 2022 年锌期货内外盘和国内现货市场价格走势

数据来源：上海期货交易所、LME（伦敦金属交易所）、上海有色网。

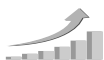


表 2-1-42 2022 年锌期货内外盘和国内现货市场价格指标

市场分类	2021 年末 收盘价	2022 年盘 中最高价	2022 年盘 中最低价	2022 年末 收盘价	全年涨跌	结算价 平均价	标准差	极差
上期所主力价格 (元/吨)	24 125	29 000	21 625	23 765	-360	24 892	1 340	7 375
LME 连续价格 (美元/吨)	3 534	4 460	2 664	2 973	-561	3 484	436	1 796
上海有色网 0# 锌锭现 货价格 (元/吨)	23 940	28 780	22 410	23 990	50	25 175	1 133	6 370

数据来源：上海期货交易所、LME（伦敦金属交易所）、上海有色网。

表 2-1-43 2022 年锌期货内外盘和国内现货市场价格相关性

价格选择	相关系数
上期所主力结算价与 LME 连续价格	0.88
上期所主力结算价与锌现货市场价格	0.96

数据来源：上海期货交易所、LME（伦敦金属交易所）、上海有色网。

五、铅期货运行情况

（一）期货交易情况（见表 2-1-44 ~ 表 2-1-46）

表 2-1-44 2022 年铅期货月度交易情况

月度	成交量 (万手)	同比变化 (%)	成交金额 (亿元)	同比变化 (%)	月末持仓量 (万手)	同比变化 (%)
1 月	192.52	9.57	1 488.67	12.51	9.66	39.54
2 月	150.38	-0.41	1 150.88	-1.60	10.12	15.96
3 月	217.80	-10.01	1 684.87	-7.47	9.30	26.44
4 月	141.11	-24.48	1 098.00	-22.32	7.38	-8.53
5 月	186.30	-5.08	1 407.93	-7.40	8.83	-10.32
6 月	186.68	-15.93	1 407.27	-17.73	9.58	-23.50
7 月	179.59	-27.22	1 347.37	-31.31	9.02	-27.52
8 月	146.31	-36.61	1 105.58	-38.28	8.90	-37.61
9 月	135.25	-38.97	1 011.41	-37.83	7.17	-39.76
10 月	116.07	-52.87	886.31	-53.90	9.18	-3.32
11 月	183.23	-14.03	1 427.28	-12.93	13.68	59.54
12 月	170.56	-12.33	1 343.97	-10.27	14.63	90.30
总计	2 005.78	-20.63	15 359.54	-20.82	—	—

数据来源：上海期货交易所。

表 2-1-45 2021—2022 年铅期货年度交易情况

年度	成交量 (万手)	同比变化 (%)	成交金额 (万亿元)	同比变化 (%)	年末持仓量 (万手)	同比变化 (%)
2021 年	2 526.98	125.36	1.94	134.60	7.69	17.46
2022 年	2 005.78	-20.63	1.54	-20.82	14.63	90.30

数据来源：上海期货交易所。

表 2-1-46 2021—2022 年铅期货内外盘年度交易情况

年度	成交量 (万手)		年末持仓量 (万手)	
	上期所 (SHFE)	LME (伦敦金属交易所)	上期所 (SHFE)	LME (伦敦金属交易所)
2021 年	2 526.98	1 045.98	7.69	11.70
2022 年	2 005.78	1 027.72	14.63	11.92

注：上期所铅期货交易单位为 5 吨/手，LME 铅期货交易单位为 25 吨/手。

数据来源：上海期货交易所、LME（伦敦金属交易所）。

(二) 交割情况（见表 2-1-47、表 2-1-48）

表 2-1-47 2022 年铅期货月度交割情况

月度	交割量 (手)	同比变化 (%)	交割金额 (亿元)	同比变化 (%)
1 月	3 460	-17.72	2.70	-13.97
2 月	6 715	261.99	5.14	265.37
3 月	7 520	8.83	5.62	9.26
4 月	4 435	-44.53	3.43	-42.21
5 月	4 245	-36.12	3.16	-36.95
6 月	5 005	-38.51	3.73	-39.91
7 月	7 045	-24.73	5.14	-30.41
8 月	5 560	-38.73	4.20	-39.71
9 月	4 295	-51.03	3.23	-49.77
10 月	6 405	-18.77	4.90	-18.69
11 月	4 875	-48.44	3.85	-46.85
12 月	6 945	-30.03	5.37	-28.86
总计	66 505	-26.29	50.43	-26.30

数据来源：上海期货交易所。

表 2-1-48 2021—2022 年铅期货年度交割情况

年度	交割量 (手)	同比变化 (%)	交割金额 (亿元)	同比变化 (%)
2021 年	90 220	189.21	68.42	193.82
2022 年	66 505	-26.29	50.43	-26.30

数据来源：上海期货交易所。

(三) 期货价格走势 (见图 2-1-5、表 2-1-49、表 2-1-50)

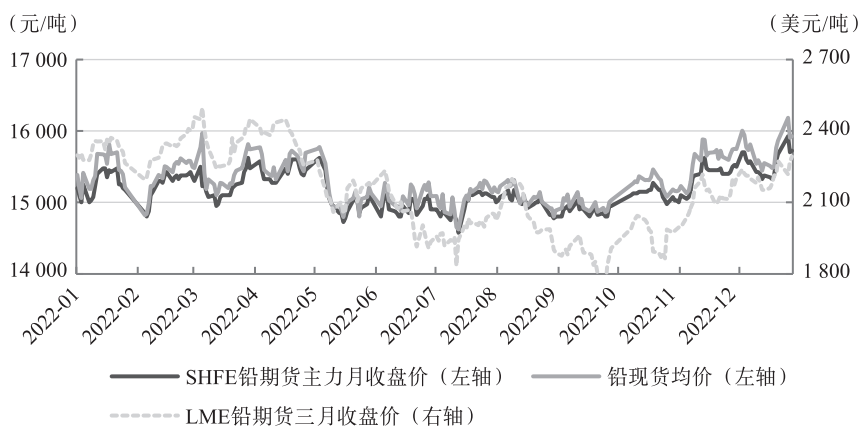


图 2-1-5 2022 年铅期货内外盘和国内现货市场价格走势

数据来源：上海期货交易所、LME（伦敦金属交易所）、上海有色网。

表 2-1-49 2022 年铅期货内外盘和国内现货市场价格指标

市场分类	2021 年末 收盘价	2022 年盘 中最高价	2022 年盘 中最低价	2022 年 末收盘 价	全年 涨跌	结算价 平均价	标准差	极差
上期所主力价格 (元/吨)	15 300	16 465	14 345	15 925	625	15 299	302.50	2 120
LME 连续价格 (美元/吨)	2 304	2 535	1 767	2 293	-11	2 150	175.26	768
上海有色网 1#铅锭现 货价格 (元/吨)	15 175	15 925	14 575	15 725	550	15 161	250.16	1 350

数据来源：上海期货交易所、LME（伦敦金属交易所）、上海有色网。

表 2-1-50 2022 年铅期货内外盘和国内现货市场价格相关性

价格选择	相关系数
上期所主力结算价与 LME 连续价格	0.66
上期所主力结算价与铅现货市场价格	0.98

数据来源：上海期货交易所、LME（伦敦金属交易所）、上海有色网。

六、镍期货运行情况

(一) 期货交易情况 (见表 2-1-51~表 2-1-53)

表 2-1-51 2022 年镍期货月度交易情况

月度	成交量 (万手)	同比变化 (%)	成交金额 (万亿元)	同比变化 (%)	月末持仓量 (万手)	同比变化 (%)
1月	983.99	-49.59	1.62	-37.34	25.06	-6.17
2月	639.38	-46.45	1.11	-32.16	27.70	11.94
3月	598.33	-72.06	1.25	-52.83	8.96	-62.00
4月	238.80	-85.66	0.54	-73.95	7.89	-68.85
5月	239.40	-83.48	0.49	-73.89	9.31	-57.10
6月	279.05	-78.94	0.54	-69.20	9.59	-57.88
7月	369.06	-72.64	0.60	-68.13	12.15	-47.87
8月	413.51	-73.58	0.71	-68.34	9.36	-66.54
9月	419.97	-72.53	0.76	-65.80	11.22	-39.51
10月	237.28	-81.00	0.43	-76.59	11.23	-41.18
11月	366.58	-63.25	0.72	-50.64	14.91	-47.13
12月	423.54	-47.12	0.92	-22.04	14.02	-52.69
总计	5 208.89	-69.74	9.70	-58.61	—	—

数据来源：上海期货交易所。

表 2-1-52 2021—2022 年镍期货年度交易情况

年度	成交量 (万手)	同比变化 (%)	成交金额 (万亿元)	同比变化 (%)	年末持仓量 (万手)	同比变化 (%)
2021年	17 216.56	-4.23	23.43	17.27	29.63	-5.00
2022年	5 208.89	-69.74	9.70	-58.61	14.02	-52.69

数据来源：上海期货交易所。

表 2-1-53 2021—2022 年镍期货内外盘年度交易情况

年度	成交量 (万手)		年末持仓量 (万手)	
	上期所 (SHFE)	LME (伦敦金属交易所)	上期所 (SHFE)	LME (伦敦金属交易所)
2021年	17 216.56	1 677.46	29.63	24.46
2022年	5 208.89	1 210.56	14.02	15.17

注：上期所镍期货交易单位为1吨/手，LME镍期货交易单位为6吨/手。

数据来源：上海期货交易所、LME（伦敦金属交易所）。

(二) 交割情况 (见表 2-1-54、表 2-1-55)

表 2-1-54 2022 年镍期货月度交割情况

月度	交割量 (手)	同比变化 (%)	交割金额 (亿元)	同比变化 (%)
1 月	1 218	-82.96	1.99	-79.50
2 月	2 214	-14.98	3.85	11.98
3 月	3 174	-7.19	7.03	71.51
4 月	1 410	-42.12	3.23	8.68
5 月	1 158	-4.93	2.45	54.30
6 月	1 434	-2.05	2.93	52.02
7 月	618	-74.44	1.03	-69.21
8 月	1 872	0.65	3.37	22.40
9 月	1 152	-60.41	2.25	-47.66
10 月	1 842	0.00	3.44	27.17
11 月	1 386	-50.54	2.90	-29.34
12 月	1 380	-22.82	3.09	20.82
总计	18 858	-40.90	37.56	-13.69

数据来源：上海期货交易所。

表 2-1-55 2021—2022 年镍期货年度交割情况

年度	交割量 (手)	同比变化 (%)	交割金额 (亿元)	同比变化 (%)
2021 年	31 908	-69.17	43.52	-61.81
2022 年	18 858	-40.90	37.56	-13.69

数据来源：上海期货交易所。

(三) 期货价格走势 (见图 2-1-6、表 2-1-56、表 2-1-57)



图 2-1-6 2022 年镍期货内外盘和国内现货市场价格走势

数据来源：上海期货交易所、LME (伦敦金属交易所)、上海有色网。

表 2-1-56 2022 年镍期货内外盘和国内现货市场价格指标

市场分类	2021 年末 收盘价	2022 年盘 中最高价	2022 年盘 中最低价	2022 年末 收盘价	全年涨跌	结算价 平均价	标准差	极差
上期所主力价格 (元/吨)	152 080	276 910	142 500	232 000	79 920	192 627	23 443	134 410
LME 连续价格 (美元/吨)	20 757	48 078	19 385	30 048	9 291	25 618	4 507	28 693
上海有色网 1#进口镍 现货价格 (元/吨)	152 800	292 700	152 000	239 750	86 950	198 020	23 511	140 700

数据来源：上海期货交易所、LME（伦敦金属交易所）、上海有色网。

表 2-1-57 2022 年镍期货内外盘和国内现货市场价格相关性

价格选择	相关系数
上期所主力结算价与 LME 连续价格	0.86
上期所主力结算价与镍现货市场价格	0.98

数据来源：上海期货交易所、LME（伦敦金属交易所）、上海有色网。

七、锡期货运行情况

(一) 期货交易情况 (见表 2-1-58 ~ 表 2-1-60)

表 2-1-58 2022 年锡期货月度交易情况

月度	成交量 (万手)	同比变化 (%)	成交金额 (亿元)	同比变化 (%)	月末持仓量 (万手)	同比变化 (%)
1 月	260.26	14.60	8 138.14	119.69	6.05	-25.01
2 月	137.56	-49.71	4 572.58	-6.98	5.94	-7.91
3 月	173.03	-38.72	5 968.45	19.81	4.97	-8.61
4 月	81.16	-61.49	2 705.76	-30.13	4.18	-19.17
5 月	155.41	-22.07	4 334.20	9.78	5.07	-26.51
6 月	300.30	26.86	6 967.01	43.05	7.56	14.92
7 月	306.10	33.65	5 851.42	14.29	11.75	114.84
8 月	277.37	23.08	5 469.23	2.84	8.20	45.65
9 月	365.44	61.27	6 473.99	8.90	8.62	112.83
10 月	218.49	10.48	3 658.61	-33.53	9.52	50.33
11 月	398.11	86.75	6 936.80	17.44	9.07	19.69
12 月	297.61	65.89	5 835.10	14.53	9.23	19.59
总计	2 970.83	9.98	66 911.28	13.06	—	—

数据来源：上海期货交易所。

表 2-1-59 2021—2022 年锡期货年度交易情况

年度	成交量 (万手)	同比变化 (%)	成交金额 (亿元)	同比变化 (%)	年末持仓量 (万手)	同比变化 (%)
2021 年	2 701.24	102.88	59 180.89	220.04	7.72	47.05
2022 年	2 970.83	9.98	66 911.28	13.06	9.23	19.59

数据来源：上海期货交易所。

表 2-1-60 2021—2022 年锡期货内外盘年度交易情况

年度	成交量 (万手)		年末持仓量 (万手)	
	上期所 (SHFE)	LME (伦敦金属交易所)	上期所 (SHFE)	LME (伦敦金属交易所)
2021 年	2 701.24	103.01	7.72	1.53
2022 年	2 970.83	100.92	9.23	1.52

注：上期所锡期货交易单位为 1 吨/手，LME 锡期货交易单位为 5 吨/手。

数据来源：上海期货交易所、LME（伦敦金属交易所）。

(二) 交割情况 (见表 2-1-61、表 2-1-62)

表 2-1-61 2022 年锡期货月度交割情况

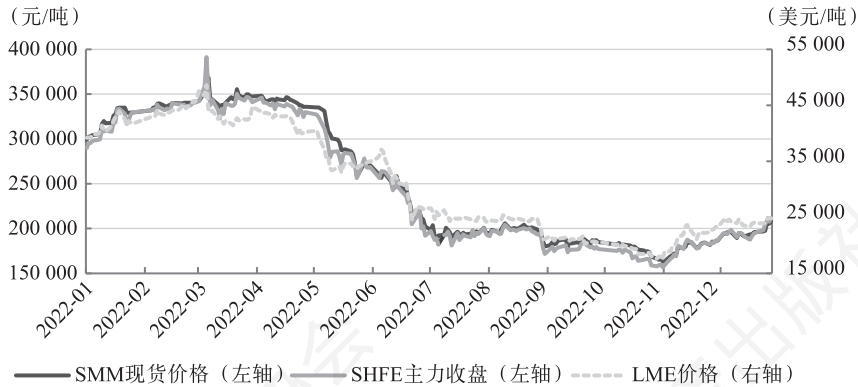
月度	交割量 (手)	同比变化 (%)	交割金额 (亿元)	同比变化 (%)
1 月	2 100	11.11	6.67	129.30
2 月	1 200	-59.95	3.99	-18.11
3 月	1 458	-24.77	4.87	43.79
4 月	1 458	-15.53	5.00	62.42
5 月	1 778	-18.66	5.28	22.77
6 月	1 546	-13.92	3.77	1.85
7 月	1 602	-24.36	2.96	-37.09
8 月	1 174	15.55	2.33	-3.94
9 月	1 096	12.99	2.03	-19.28
10 月	854	-3.39	1.54	-38.50
11 月	1 302	-20.61	2.39	-50.39
12 月	2 510	86.76	4.86	23.55
总计	18 078	-11.8	45.69	5.90

数据来源：上海期货交易所。

表 2-1-62 2021—2022 年锡期货年度交割情况

年度	交割量（手）	同比变化（%）	交割金额（亿元）	同比变化（%）
2021 年	20 504	58.63	43.15	139.72
2022 年	18 078	-11.83	45.69	5.90

数据来源：上海期货交易所。

（三）期货价格走势（见图 2-1-7、表 2-1-63、表 2-1-64）

图 2-1-7 2022 年锡期货内外盘和国内现货市场价格走势

数据来源：上海期货交易所、LME（伦敦金属交易所）、上海有色网。

表 2-1-63 2022 年锡期货内外盘和国内现货市场价格指标

市场分类	2021 年末 收盘价	2022 年盘 中最高价	2022 年盘 中最低价	2022 年末 收盘价	全年涨跌	结算价 平均价	标准差	极差
上期所主力价格 (元/吨)	296 110	395 000	154 160	211 890	-84 220	222 987	67 953.9	240 840
LME 三月合约 (美元/吨)	38 985	51 000	17 355	24 900	-14 085	30 822	9 342.185	33 645
上海有色网锡锭现货 价格(元/吨)	299 500	370 000	161 500	208 000	-91 500	248 969	68 311.49	208 500

数据来源：上海期货交易所、LME（伦敦金属交易所）、上海有色网。

表 2-1-64 2022 年锡期货内外盘和国内现货市场价格相关性

价格选择	相关系数
上期所主力结算价与 LME 连续价格	0.99
上期所主力结算价与锡现货市场价格	1.00

数据来源：上海期货交易所、LME（伦敦金属交易所）、上海有色网。

八、黄金期货、期权运行情况

（一）期货、期权交易情况（见表2-1-65~表2-1-70）

表 2-1-65 2022 年黄金期货月度交易情况

月度	成交量 (万手)	同比变化 (%)	成交金额 (亿元)	同比变化 (%)	月末持仓量 (万手)	同比变化 (%)
1月	293.63	-26.09	10 979.47	-29.43	17.74	-10.22
2月	279.52	-11.71	10 757.84	-10.74	22.66	20.85
3月	506.66	5.35	20 239.43	15.75	22.46	8.82
4月	297.60	-19.34	11 972.62	-12.64	23.92	18.01
5月	318.85	-21.41	12 763.25	-18.90	21.61	-16.08
6月	327.97	-16.07	13 031.52	-12.21	22.26	-14.61
7月	403.38	16.50	15 283.14	16.89	27.82	23.53
8月	276.32	-23.16	10 749.08	-20.02	27.54	24.00
9月	266.09	-18.25	10 282.81	-15.15	27.84	35.08
10月	208.58	-26.11	8 172.87	-21.80	29.07	56.04
11月	366.62	-20.48	14 764.23	-14.95	30.98	85.84
12月	356.46	-12.25	14 485.28	-3.52	26.31	48.20
总计	3 901.68	-14.08	153 481.54	-10.16	—	—

数据来源：上海期货交易所。

表 2-1-66 2021—2022 年黄金期货年度交易情况

年度	成交量 (万手)	同比变化 (%)	成交金额 (万亿元)	同比变化 (%)	年末持仓量 (万手)	同比变化 (%)
2021年	4 541.22	-13.34	17.08	-17.54	17.75	-5.54
2022年	3 901.68	-14.08	15.35	-10.16	26.31	48.20

数据来源：上海期货交易所。

表 2-1-67 2021—2022 年黄金期货内外盘年度交易情况

年度	成交量 (万手)		年末持仓量 (万手)	
	上期所 (SHFE)	COMEX (芝加哥商业交易所)	上期所 (SHFE)	COMEX (芝加哥商业交易所)
2021年	4 541.22	5 846.50	17.75	51.26
2022年	3 901.68	5 860.34	26.31	44.24

注：上期所黄金期货交易单位为1 000 克/手，COMEX 黄金期货交易单位为100 盎司/手。

数据来源：上海期货交易所、COMEX（芝加哥商业交易所）。

表 2-1-68 2022 年黄金期权月度交易情况

月度	成交量 (万手)	同比变化 (%)	成交量 看跌/看涨 (PCR)	成交金额 (亿元)	同比变化 (%)	月末持仓量 (万手)	同比变化 (%)
1月	28.42	-8.30	0.802	11.10	-25.85	2.14	-1.50
2月	29.82	48.71	0.713	12.60	11.75	3.18	-18.32
3月	34.47	7.42	0.535	18.28	33.77	2.75	-11.72
4月	25.40	-9.74	0.698	11.20	1.31	3.83	-14.17
5月	34.01	1.16	0.957	11.91	-0.79	2.45	-5.86
6月	42.27	79.71	0.986	13.82	24.92	3.91	6.32
7月	49.01	88.81	1.459	14.07	71.17	2.98	25.92
8月	26.68	9.81	0.911	8.92	-12.57	4.33	23.86
9月	39.66	80.00	1.195	11.70	50.11	3.75	55.65
10月	21.41	16.87	1.087	6.23	-6.12	4.57	42.14
11月	45.48	38.36	0.670	11.84	0.45	2.70	51.24
12月	38.01	75.39	0.670	11.13	14.33	4.01	48.72
总计	414.71	32.23	0.872	142.85	11.21	—	—

数据来源：上海期货交易所。

表 2-1-69 2021—2022 年黄金期权年度交易情况

年度	成交量 (万手)	同比变化 (%)	成交量 看跌/看涨 (PCR)	成交金额 (亿元)	同比变化 (%)	年末持仓量 (万手)	同比变化 (%)
2021年	313.62	33.60	0.686	128.46	-17.79	2.69	-32.75
2022年	414.71	32.23	0.872	142.85	11.21	4.01	48.72

数据来源：上海期货交易所。

表 2-1-70 2021—2022 年黄金期权内外盘年度交易情况

年度	成交量 (万手)		年末持仓量 (万手)	
	上期所 (SHFE)	CME Group (芝加哥 商业交易所集团)	上期所 (SHFE)	CME Group (芝加哥 商业交易所集团)
2021年	313.62	831.02	2.69	68.82
2022年	414.71	983.54	4.01	56.66

注：上期所黄金期权单位为1000克/手，CME Group（芝加哥商业交易所集团）黄金期权单位为100盎司/手。

数据来源：上海期货交易所、FIA。

（二）交割、行权情况（见表2-1-71~表2-1-74）

表 2-1-71 2022 年黄金期货月度交割情况

月度	交割量（手）	同比变化（%）	交割金额（亿元）	同比变化（%）
1月	63	—	0.23	—
2月	261	-78.25	0.98	-78.78
3月	36	71.43	0.15	87.47
4月	36	93.51	0.14	-92.97
5月	3	93.75	0.01	-93.25
6月	1 053	105.26	4.17	110.82
7月	—	—	—	—
8月	777	215.85	3.02	236.38
9月	—	—	—	—
10月	399	7.26	1.56	14.89
11月	6	-83.33	0.02	-82.40
12月	2 499	20.20	10.08	32.81
总计	5 133	-0.70	20.37	5.93

数据来源：上海期货交易所。

表 2-1-72 2021—2022 年黄金期货年度交割情况

年度	交割量（手）	同比变化（%）	交割金额（亿元）	同比变化（%）
2021年	5 169	88.10	19.22	81.85
2022年	5 133	-0.70	20.37	5.93

数据来源：上海期货交易所。

表 2-1-73 2022 年黄金期权月度行权情况

月度	行权量（手）
1月	1 564
2月	8
3月	2 429
4月	1
5月	1 860
6月	0
7月	2 420
8月	8
9月	2 114
10月	16
11月	4 812
12月	28
总计	15 260

数据来源：上海期货交易所。

表 2-1-74

2021—2022 年黄金期权年度行权情况

年度	行权量 (手)	同比变化 (%)
2021 年	15 460	20.84
2022 年	15 260	-1.29

数据来源：上海期货交易所。

(三) 期货价格走势 (见图 2-1-8、表 2-1-75、表 2-1-76)



图 2-1-8 2022 年黄金期货内外盘和国内现货市场价格走势

数据来源：上海期货交易所、Wind。

表 2-1-75

2022 年黄金期货内外盘和国内现货市场价格指标

市场分类	2021 年 末收盘 价	2022 年 盘中最高 价	2022 年 盘中最低 价	2022 年 末收盘 价	全年 涨跌	结算价 均价	标准差	极差
上期所主力价 (元/克)	397.6	406.94	354.58	376.42	-21.18	375.87	9.21	52.36
COMEX 主力价格 (美元/盎司)	1 830.5	2 078.8	1 618.3	1 830.1	-0.4	1 805.4	90.65	460.5
黄金现货市场价格 (元/克)	373.35	438.87	367.01	409.76	36.41	391.96	10.72	71.86

数据来源：上海期货交易所、Wind。

表 2-1-76

2022 年黄金期货内外盘和国内现货市场价格相关性

价格选择	相关系数
上期所主力结算价与 COMEX 黄金期货主力合约收盘价	0.34
上期所主力结算价与 SGE 黄金现货 T + D 结算价	0.99

数据来源：上海期货交易所、Wind。

九、白银期货、期权运行情况

2022年12月26日,白银期权在上期所上市交易。

(一) 期货、期权交易情况 (见表2-1-77~表2-1-81)

表 2-1-77 2022 年白银期货月度交易情况

月度	成交量 (万手)	同比变化 (%)	成交金额 (亿元)	同比变化 (%)	月末持仓量 (万手)	同比变化 (%)
1月	1 250.76	-60.56	9 037.87	-64.69	63.34	-5.42
2月	974.94	-60.60	7 173.38	-66.01	63.76	6.56
3月	1 729.03	-37.76	13 302.22	-40.31	64.80	6.59
4月	1 028.32	-45.76	7 864.71	-48.32	69.84	27.20
5月	1 096.98	-51.28	7 834.01	-59.55	74.78	32.99
6月	1 251.84	-22.70	8 765.09	-35.44	81.82	41.03
7月	1 718.98	13.79	10 903.50	-10.87	85.32	54.56
8月	1 617.13	7.96	10 652.71	-7.86	86.66	47.48
9月	1 537.96	14.00	10 012.04	-0.92	70.09	13.67
10月	1 311.95	5.80	8 829.93	-4.03	90.47	40.96
11月	2 479.86	42.33	18 072.49	38.29	93.98	34.42
12月	2 879.38	78.31	22 722.75	97.43	96.26	44.45
总计	18 877.15	-18.44	135 170.70	-26.87	—	—

数据来源:上海期货交易所。

表 2-1-78 2021—2022 年白银期货年度交易情况

年度	成交量 (万手)	同比变化 (%)	成交金额 (亿元)	同比变化 (%)	年末持仓量 (万手)	同比变化 (%)
2021年	23 145.76	-35.21	184 827.68	-33.49	66.64	-7.79
2022年	18 877.15	-18.44	135 170.70	-26.87	96.26	44.45

数据来源:上海期货交易所。

表 2-1-79 2021—2022 年白银期货内外盘交易情况比较

年度	成交量 (万手)		年末持仓量 (万手)	
	上期所 (内盘)	COMEX (外盘)	上期所 (内盘)	COMEX (外盘)
2021年	23 145.76	1 966.95	66.64	14.02
2022年	18 877.15	1 707.67	96.26	12.98

注:上期所白银期货交易单位为15千克/手,COMEX白银期货交易单位为5 000盎司/手。

数据来源:上海期货交易所、Reuters。

表 2-1-80 2022 年白银期权年度交易情况

年度	成交量 (万手)	同比变化 (%)	成交量 看跌/看涨 (PCR)	成交金额 (亿元)	同比变化 (%)	年末持仓量 (万手)	同比变化 (%)
2022 年	7.79	—	1.10	1.24	—	1.93	—

数据来源：上海期货交易所。

表 2-1-81 2022 年白银期权内外盘年度交易情况

年度	成交量 (万手)		年末持仓量 (万手)	
	上期所 (内盘)	COMEX (外盘)	上期所 (内盘)	COMEX (外盘)
2022 年	7.79	145.16	1.93	8.33

注：上期所白银期权交易单位为 15 千克/手，COMEX 白银期权交易单位为 5 000 盎司/手。

数据来源：上海期货交易所、COMEX。

(二) 交割、行权情况 (见表 2-1-82、表 2-1-83)

表 2-1-82 2022 年白银期货月度交割情况

月度	交割量 (手)	同比变化 (%)	交割金额 (亿元)	同比变化 (%)
1 月	7 822	-37.41	54 675.78	-44.76
2 月	12 516	-74.67	91 955.05	-76.91
3 月	5 622	-49.84	41 975.35	-53.03
4 月	7 270	19.57	56 651.48	17.31
5 月	3 042	-35.50	21 259.02	-46.51
6 月	18 688	-3.14	129 395.71	-20.32
7 月	3 916	-18.11	23 748.58	-39.04
8 月	6 512	60.24	44 463.94	44.38
9 月	6 514	8.28	42 953.32	-5.33
10 月	7 014	77.84	45 640.1	56.23
11 月	10 816	210.63	80 617.06	214.94
12 月	43 476	72.48	345 568.99	99.00
总计	133 208	-11.61	978 904.38	-17.23

数据来源：上海期货交易所。

表 2-1-83 2021—2022 年白银期货年度交割情况

年度	交割量 (手)	同比变化 (%)	交割金额 (亿元)	同比变化 (%)
2021 年	150 704	-10.24	118.27	-3.57
2022 年	133 208	-11.61	978 904.38	-17.23

数据来源：上海期货交易所。

2022年，白银期权无行权。

（三）期货价格走势（见图2-1-9、表2-1-84、表2-1-85）



图 2-1-9 2022 年白银期货内外盘和现货市场价格比较

数据来源：上海期货交易所、Reuters。

表 2-1-84 2022 年白银期货内外盘和国内现货市场价格指标

市场分类	2021 年末 收盘价	2022 年盘 中最高价	2022 年盘 中最低价	2022 年 末收盘价	全年 涨跌	结算价 平均价	标准差	极差
上期所主力合约 (元/千克)	4 880	5 443	4 018	5 363	483	4 741	336	1 425
COMEX 白银期货 (美元/盎司)	23.355	27.495	17.400	24.180	0.825	21.79	2.301	10.095
SGE Ag (T+D) (元/千克)	4 806	5 419	3 997	5 337	531	4 718	337	1 422

表 2-1-85 2022 年白银期货内外盘和现货市场价格相关性

价格选择	相关系数
上期所主力合约结算价与 COMEX 连续价格	0.90
上期所主力合约结算价与现货市场价格	1.00

数据来源：上海期货交易所、CME、Reuters。

十、螺纹钢期货、期权运行情况

2022 年 12 月 26 日，螺纹钢期权在上期所上市交易。

(一) 期货、期权交易情况 (见表 2-1-86 ~ 表 2-1-88)

表 2-1-86 2022 年螺纹钢期货月度交易情况

月度	成交量 (万手)	同比变化 (%)	成交金额 (亿元)	同比变化 (%)	月末持仓量 (万手)	同比变化 (%)
1 月	2 764.08	-34.61	12 695.50	-30.77	209.31	30.00
2 月	3 042.31	19.02	14 465.79	27.81	299.26	64.21
3 月	4 497.30	-32.03	21 968.78	-30.22	244.23	38.18
4 月	3 726.93	-34.61	18 567.90	-37.01	221.26	27.48
5 月	3 823.81	-35.12	17 654.57	-44.39	257.87	90.31
6 月	4 420.33	-12.58	19 653.84	-23.06	277.64	72.89
7 月	5 748.52	30.27	22 712.90	-6.19	299.51	40.77
8 月	5 778.20	-0.52	23 112.61	-24.89	304.04	86.73
9 月	3 990.54	-24.81	14 930.02	-48.94	243.58	60.01
10 月	3 629.38	-34.76	13 189.88	-53.64	296.32	24.95
11 月	5 627.32	-38.99	20 336.03	-47.74	295.90	0.21
12 月	5 469.10	4.48	21 512.38	-6.38	275.92	8.07
总计	52 517.82	-19.94	220 800.22	-31.53	—	—

数据来源：上海期货交易所。

表 2-1-87 2021—2022 年螺纹钢期货年度交易情况

年度	成交量 (万手)	同比变化 (%)	成交金额 (万亿元)	同比变化 (%)	年末持仓量 (万手)	同比变化 (%)
2021 年	65 598.67	79.21	32.25	141.49	255.33	62.07
2022 年	52 517.82	-19.94	22.08	-31.53	275.92	8.07

数据来源：上海期货交易所。

表 2-1-88 2022 年螺纹钢期权年度交易情况

年度	成交量 (万手)	同比变化 (%)	成交量 看跌/看涨 (PCR)	成交金额 (亿元)	同比变化 (%)	年末持仓量 (万手)	同比变化 (%)
2022 年	24.57	—	1.19	2.07	—	6.52	—

数据来源：上海期货交易所。

(二) 交割、行权情况 (见表 2-1-89、表 2-1-90)

表 2-1-89 2022 年螺纹钢期货月度交割情况

月度	交割量 (手)	同比变化 (%)	交割金额 (万元)	同比变化 (%)
1 月	3 240	-47.57	14 774.40	-43.16
2 月	2 610	-11.22	12 353.13	0.86
3 月	690	-87.43	3 373.41	-86.57
4 月	840	-15.15	4 170.60	-16.10
5 月	900	-36.17	4 545.00	-42.23
6 月	120	-80.00	559.20	-80.81
7 月	870	3.57	3 419.10	-19.40
8 月	180	-96.32	745.56	-97.12
9 月	1 500	-47.37	5 880.00	-62.25
10 月	9 780	-6.05	36 733.68	-37.95
11 月	390	-74.00	1 425.84	-78.27
12 月	510	30.77	1 886.49	12.41
总计	21 630	-43.80	89 866.41	-53.26

数据来源: 上海期货交易所。

表 2-1-90 2021—2022 年螺纹钢期货年度交割情况

年度	交割量 (手)	同比变化 (%)	交割金额 (亿元)	同比变化 (%)
2021 年	38 490	111.37	19.23	320.23
2022 年	21 630	-43.80	8.99	-53.26

数据来源: 上海期货交易所。

2022 年, 螺纹钢期权无行权。

(三) 期货价格走势 (见图 2-1-10、表 2-1-91、表 2-1-92)



图 2-1-10 2022 年螺纹钢期货和国内现货市场价格走势

数据来源: 上海期货交易所、Wind。

表 2-1-91 2022 年螺纹钢期货和国内现货市场价格指标

市场分类	2021 年末 收盘价	2022 年盘 中最高价	2022 年 盘中最 低价	2022 年 末收盘 价	全年 涨跌	结算价 平均价	标准差	极差
上期所主力价格 (元/吨)	4 388	5 190	3 389	4 105	-283	4 271	498	1 801
上海现货市场价格 (元/吨)	4 480	5 110	3 680	4 100	-380	4 389	466	1 430
天津现货市场价格 (元/吨)	4 100	5 200	3 570	4 000	-100	4 353	488	1 630

数据来源：上海期货交易所、Wind。

表 2-1-92 2022 年螺纹钢期货和国内现货市场价格相关性

价格选择	相关系数
上期所主力结算价与上海地区现货价格	0.98
上期所主力结算价与天津地区现货价格	0.98

数据来源：上海期货交易所、Wind。

十一、线材期货运行情况

(一) 期货交易情况 (见表 2-1-93)

表 2-1-93 2021—2022 年线材期货年度交易情况

年度	成交量 (手)	同比变化 (%)	成交金额 (亿元)	同比变化 (%)	年末持仓量 (手)	同比变化 (%)
2021 年	19 537	384.67	10.45	551.31	85	117.95
2022 年	16 162	-17.27	7.88	-24.59	12	-85.88

数据来源：上海期货交易所。

(二) 交割情况

2022 年，全年未发生交割。

(三) 期货价格走势 (见图 2-1-11、表 2-1-94、表 2-1-95)



图 2-1-11 2022 年线材期货和国内现货市场价格走势

数据来源：上海期货交易所、Wind。

表 2-1-94 2022 年线材期货和国内现货市场价格指标

市场分类	2021 年 末收盘 价	2022 年 盘中最高 价	2022 年 盘中最低 价	2022 年 末收盘 价	全年 涨跌	结算价 平均价	标准差	极差
上期所主力价格 (元/吨)	4 393	5 888	4 086	4 810	417	4 824.98	415.82	1 802
上海现货市场价格 (元/吨)	5 030	5 280	4 090	4 360	-670	4 715	392.55	1 190
天津现货市场价格 (元/吨)	4 700	5 260	3 680	4 150	-550	4 456	464.18	1 580

数据来源：上海期货交易所、Wind。

表 2-1-95 2022 年线材期货和国内现货市场价格相关性

价格选择	相关系数
上期所主力结算价与上海地区现货价格	0.87
上期所主力结算价与天津地区现货价格	0.93

数据来源：上海期货交易所、Wind。

十二、热轧卷板期货运行情况

(一) 期货交易情况 (见表 2-1-96、表 2-1-97)

表 2-1-96 2022 年热轧卷板期货月度交易情况

月度	成交量 (万手)	同比变化 (%)	成交金额 (亿元)	同比变化 (%)	月末持仓量 (万手)	同比变化 (%)
1 月	865.06	-41.91	4 083.71	-38.61	91.69	29.38
2 月	838.86	-1.72	4 116.69	4.80	91.58	27.35
3 月	1 608.52	-29.66	8 255.60	-28.31	99.75	0.82
4 月	1 129.14	-51.17	5 776.73	-54.54	87.24	3.20
5 月	1 115.79	-52.04	5 288.24	-60.91	93.52	30.26
6 月	1 252.77	-27.09	5 676.83	-37.99	102.83	57.21
7 月	1 590.56	-0.25	6 286.39	-32.40	118.41	20.98
8 月	1 401.65	-23.17	5 555.18	-46.22	113.30	73.31
9 月	1 144.89	-28.90	4 356.53	-52.53	106.79	114.87
10 月	888.71	-47.16	3 264.12	-64.04	124.36	57.46
11 月	1 177.06	-57.00	4 362.17	-64.43	114.68	-2.58
12 月	1 193.10	-27.13	4 789.63	-36.03	106.45	4.79
总计	14 206.11	-35.64	61 811.81	-46.31	—	—

数据来源：上海期货交易所。

表 2-1-97 2021—2022 年热轧卷板期货年度交易情况

年度	成交量 (万手)	同比变化 (%)	成交金额 (万亿元)	同比变化 (%)	年末持仓量 (万手)	同比变化 (%)
2021 年	22 071.59	168.03	11.51	269.44	101.58	52.61
2022 年	14 206.11	-35.64	6.18	-46.31	106.45	4.79

数据来源：上海期货交易所。

(二) 交割情况 (见表 2-1-98、表 2-1-99)

表 2-1-98 2022 年热轧卷板期货月度交割情况

月度	交割量 (手)	同比变化 (%)	交割金额 (万元)	同比变化 (%)
1 月	6 300	-71.89	30 466.80	-70.06
2 月	5 220	41.46	25 953.84	55.71
3 月	9 810	21.56	49 236.39	21.05
4 月	6 690	112.38	35 028.84	102.89
5 月	7 470	42.63	36 020.34	-54.04



续表

月度	交割量（手）	同比变化（%）	交割金额（万元）	同比变化（%）
6月	870	-81.41	4 142.07	-84.03
7月	990	-47.62	3 623.40	-67.54
8月	1 290	-34.85	5 211.60	-54.30
9月	8 100	462.5	31 889.70	278.56
10月	16 170	132.33	61 607.70	53.12
11月	1 110	640.00	4 246.86	499.84
12月	210	75.00	858.90	44.60
总计	64 230	-4.93	288 286.44	-18.38

数据来源：上海期货交易所。

表 2-1-99 2021—2022 年热轧卷板期货年度交割情况

年度	交割量（手）	同比变化（%）	交割金额（亿元）	同比变化（%）
2021 年	67 560	90.85	35.32	178.16
2022 年	64 230	-4.93	28.83	-18.38

数据来源：上海期货交易所。

（三）期货价格走势（见图 2-1-12、表 2-1-100、表 2-1-101）



图 2-1-12 2022 年热轧卷板期货和国内现货市场价格走势

数据来源：上海期货交易所、Wind。

表 2-1-100 2022 年热轧卷板期货和国内现货市场价格指标

市场分类	2021 年末 收盘价	2022 年盘 中最高价	2022 年 盘中最低 价	2022 年 末收盘 价	全年 涨跌	结算价 平均价	标准差	极差
上期所主力价格 (元/吨)	4 411	5 405	3 450	4 143	-268	4 357.01	548.86	1 955

续表

市场分类	2021 年末 收盘价	2022 年盘 中最高价	2022 年 盘中最 低价	2022 年 末收盘 价	全年 涨跌	结算价 平均价	标准差	极差
上海现货价格 (元/吨)	4 860	5 290	3 600	4 180	-680	4 412	532.88	1 690
天津现货价格 (元/吨)	4 660	5 300	3 610	4 040	-620	4 382	536.22	1 690

数据来源：上海期货交易所、Wind。

表 2-1-101 2022 年热轧卷板期货和国内现货市场价格相关性

价格选择	相关系数
上期所主力结算价与上海地区现货价格	0.99
上期所主力结算价与天津地区现货价格	0.99

数据来源：上海期货交易所、Wind。

十三、不锈钢期货运行情况

(一) 期货交易情况（见表 2-1-102、表 2-1-103）

表 2-1-102 2022 年不锈钢期货月度交易情况

月度	成交量 (万手)	同比变化 (%)	成交金额 (亿元)	同比变化 (%)	月末持仓量 (万手)	同比变化 (%)
1 月	312.21	-8.50	2 754.61	13.65	10.56	-52.20
2 月	211.80	-11.72	1 949.85	9.39	9.85	-48.17
3 月	503.73	35.04	5 162.47	93.81	10.85	-29.95
4 月	197.66	-25.05	1 954.31	4.61	9.49	-22.81
5 月	185.50	-40.27	1 735.50	-26.39	8.40	-33.37
6 月	237.70	-33.71	2 089.75	-27.60	8.43	-10.43
7 月	294.92	-42.51	2 389.10	-49.10	9.17	2.47
8 月	308.74	-19.21	2 405.07	-31.64	9.47	30.65
9 月	356.25	-19.47	2 960.01	-32.82	11.40	72.95
10 月	277.45	5.02	2 368.25	-9.66	11.83	49.70
11 月	378.14	17.58	3 142.82	10.67	10.81	-8.18
12 月	345.89	46.27	2 936.37	51.93	11.37	0.27
总计	3 609.98	-10.79	31 848.11	-6.31	—	—

数据来源：上海期货交易所。

表 2-1-103 2021—2022 年不锈钢期货年度交易情况

年度	成交量 (万手)	同比变化 (%)	成交金额 (万亿元)	同比变化 (%)	年末持仓量 (万手)	同比变化 (%)
2021 年	4 046.81	273.63	3.40	360.44	11.34	-33.89
2022 年	3 609.98	-10.79	3.18	-6.31	11.37	0.27

数据来源：上海期货交易所。

(二) 交割情况 (见表 2-1-104、表 2-1-105)

表 2-1-104 2022 年不锈钢期货月度交割情况

月度	交割量 (手)	同比变化 (%)	交割金额 (万元)	同比变化 (%)
1 月	4 428	-46.52	38 490.39	-32.82
2 月	9 912	-14.14	91 239.96	11.63
3 月	4 908	-48.16	51 411.30	-21.98
4 月	8 580	59.24	84 062.55	118.31
5 月	4 416	-0.81	42 040.32	23.20
6 月	1 320	-76.60	12 091.20	-73.56
7 月	684	-89.64	5 754.15	-90.10
8 月	504	-87.65	4 025.70	-89.45
9 月	1 320	48.65	10 893.30	25.50
10 月	636	-76.86	5 391.69	-80.88
11 月	2 616	890.91	22 981.56	810.82
12 月	5 064	2 244.44	44 044.14	2 174.49
总计	44 388	-25.48	412 426.26	-10.52

数据来源: 上海期货交易所。

表 2-1-105 2021—2022 年不锈钢期货年度交割情况

年度	交割量 (手)	同比变化 (%)	交割金额 (亿元)	同比变化 (%)
2021 年	59 568	865.76	46.09	965.59
2022 年	44 388	-25.48	41.24	-10.52

数据来源: 上海期货交易所。

(三) 期货价格走势 (见图 2-1-13、表 2-1-106、表 2-1-107)



图 2-1-13 2022 年不锈钢期货和国内现货市场价格走势

数据来源: 上海期货交易所、Wind。

表 2-1-106 2022 年不锈钢期货和国内现货市场价格指标

市场分类	2021 年末 收盘价	2022 年盘 中最高价	2022 年 盘中最 低价	2022 年 末收盘 价	全年 涨跌	结算价 平均价	标准差	极差
上期所主力价格 (元/吨)	17 125	24 785	14 825	16 820	-305	17 580	1 461	9 960
无锡现货价格 (元/吨)	17 220	22 170	15 670	16 870	-350	17 968	1 461	6 500

数据来源：上海期货交易所、Wind。

表 2-1-107 2022 年不锈钢期货和国内现货市场价格相关性

价格选择	相关系数
上期所主力结算价与无锡地区现货价格	0.96

数据来源：上海期货交易所、Wind。

十四、原油期货、期权运行情况

(一) 期货、期权交易情况 (见表 2-1-108 ~ 表 2-1-113)

表 2-1-108 2022 年原油期货月度交易情况

月度	成交量 (万手)	同比变化 (%)	成交金额 (亿元)	同比变化 (%)	月末持仓量 (万手)	同比变化 (%)
1 月	330.42	-10.41	17 394.63	41.16	6.16	-26.18
2 月	347.64	42.56	20 059.25	116.02	7.51	-17.77
3 月	660.71	24.24	45 481.65	111.24	5.52	-27.96
4 月	446.70	16.21	29 349.62	90.89	5.12	-31.87
5 月	467.47	59.54	32 656.39	163.99	7.09	-7.33
6 月	563.15	70.42	40 983.80	174.12	6.74	-13.07
7 月	664.03	79.41	44 087.70	167.09	8.20	6.99
8 月	482.25	35.64	33 061.39	117.99	7.73	13.55
9 月	380.35	42.00	24 787.18	98.95	5.55	13.85
10 月	228.99	-2.80	15 457.56	24.45	5.87	2.96
11 月	357.09	-7.99	22 596.63	15.26	7.52	22.68
12 月	429.29	-13.28	23 184.09	0.95	5.65	-16.31
总计	5 358.08	25.64	349 099.89	88.74	—	—

数据来源：上海期货交易所。

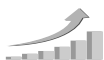


表 2-1-109 2021—2022 年原油期货年度交易情况

年度	成交量 (万手)	同比变化 (%)	成交金额 (万亿元)	同比变化 (%)	年末持仓量 (万手)	同比变化 (%)
2021 年	4 264.52	2.55	18.50	54.68	6.75	-20.31
2022 年	5 358.08	25.64	34.91	88.74	5.65	-16.31

数据来源：上海期货交易所。

表 2-1-110 2021—2022 年原油期货内外盘年度交易情况

年度	成交量 (万手)			年末持仓量 (万手)		
	上期能源 (INE SC)	CME Group WTI (芝加哥商业 交易所集团)	ICE Brent (洲际交易所)	上期能源 (INE SC)	CME Group WTI (芝加哥商业 交易所集团)	ICE Brent (洲际交易所)
2021 年	4 264.52	24 830.98	22 915.78	6.75	186.69	211.34
2022 年	5 358.08	20 598.99	22 036.77	5.65	144.07	185.47

注：INE SC、CME WTI、ICE Brent 交易单位均为 1 000 桶/手。

数据来源：上海期货能源、CME Group（芝加哥商业交易所集团）、ICE（洲际交易所）。

表 2-1-111 2022 年原油期货月度交易情况

月度	成交量 (万手)	同比变化 (%)	成交量 看跌/看涨 (PCR)	成交金额 (亿元)	同比变化 (%)	月末持仓量 (万手)	同比变化 (%)
1 月	25.22	—	1.374	20.58	—	1.87	—
2 月	27.21	—	1.353	27.07	—	2.02	—
3 月	37.97	—	1.133	54.75	—	1.80	—
4 月	29.39	—	0.835	32.30	—	1.66	—
5 月	43.43	—	1.134	43.59	—	2.22	—
6 月	75.02	2 055.86	1.217	77.14	1 718.17	2.70	329.23
7 月	66.83	215.52	1.490	90.54	449.72	3.14	65.69
8 月	79.46	171.25	1.349	74.24	401.62	3.13	69.73
9 月	58.75	193.20	1.004	55.63	314.91	2.53	61.56
10 月	35.92	142.57	1.036	32.72	187.88	2.13	38.63
11 月	81.47	175.77	1.004	57.08	172.90	3.75	134.74
12 月	99.35	162.16	0.934	70.21	192.50	1.08	-46.68
总计	660.08	322.45	1.130	635.91	504.40	—	—

数据来源：上海期货交易所。

表 2-1-112 2021—2022 年原油期货年度交易情况

年度	成交量 (万手)	同比变化 (%)	成交量 看跌/看涨 (PCR)	成交金额 (亿元)	同比变化 (%)	年末持仓量 (万手)	同比变化 (%)
2021 年	156.25	—	1.177	105.21	—	2.02	—
2022 年	660.08	322.45	1.130	635.91	504.40	1.08	-46.68

数据来源：上海期货交易所。

表 2-1-113

2021—2022 年原油期货内外盘年度交易情况

年度	成交量（万手）			年末持仓量（万手）		
	上期能源 (INE SC)	CME Group WTI (芝加哥商业 交易所集团)	ICE Brent (洲际交易所)	上期能源 (INE SC)	CME Group WTI (芝加哥商业 交易所集团)	ICE Brent (洲际交易所)
2021 年	156.25	3 000.61	2 901.77	2.02	197.75	221.12
2022 年	660.08	2 893.18	3 148.08	1.08	230.56	203.54

注：INE SC、CME WTI、ICE Brent 交易单位均为 1 000 桶/手。

数据来源：上海期货能源、CME Group（芝加哥商业交易所集团）、ICE（洲际交易所）。

（二）交割、行权情况（见表 2-1-114 ~ 表 2-1-117）

表 2-1-114

2022 年原油期货月度交割情况

月度	交割量（手）	同比变化（%）	交割金额（亿元）	同比变化（%）
1 月	0	-100.00	0	-100.00
2 月	0	-100.00	0	-100.00
3 月	1 730	98.62	10.27	199.42
4 月	1 956	12.22	13.65	106.82
5 月	4 498	199.67	29.53	387.29
6 月	2 774	-44.58	20.09	-4.83
7 月	52	-96.35	0.37	-94.30
8 月	145	-89.79	1.01	-83.52
9 月	39	-99.21	0.3	-98.56
10 月	4 149	997.62	28.31	1 490.45
11 月	4 162	208 000.00	28.12	281 100.00
12 月	4 566	293.28	26.25	354.15
总计	24 071	-7.71	157.91	55.70

数据来源：上海期货交易所。

表 2-1-115

2021—2022 年原油期货年度交割情况

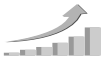
年度	交割量（手）	同比变化（%）	交割金额（亿元）	同比变化（%）
2021 年	26 081	-71.18	101.42	-59.33
2022 年	24 071	-7.71	157.91	55.70

数据来源：上海期货交易所。

表 2-1-116

2022 年原油期货月度行权情况

月度	行权量（手）
1 月	1 736
2 月	2 869



续表

月度	行权量（手）
3月	2 615
4月	1 396
5月	1 340
6月	1 893
7月	2 437
8月	2 418
9月	2 452
10月	1 984
11月	2 599
12月	8 662
总计	32 401

数据来源：上海期货交易所。

表 2-1-117 2021—2022 年原油期权年度行权情况

年度	行权量（手）	同比变化（%）
2021 年	10 108	—
2022 年	32 401	220.55

数据来源：上海期货交易所。

（三）期货价格走势（见图 2-1-14、表 2-1-118、表 2-1-119）

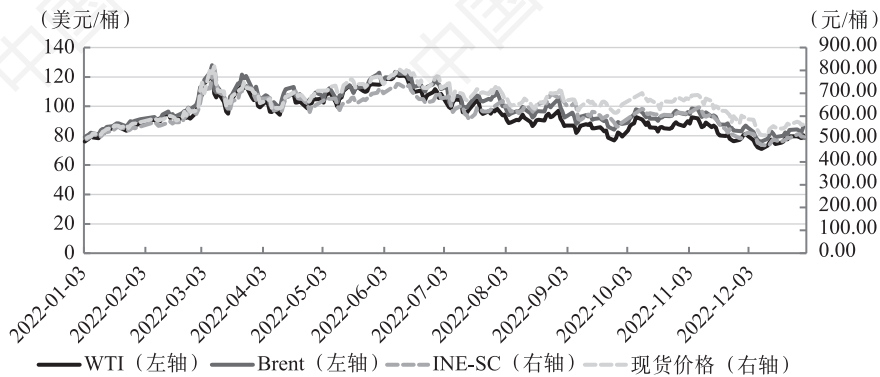


图 2-1-14 2022 年原油期货内外盘和国内现货市场价格走势

数据来源：上海期货交易所、Reuters（路透社）。

表 2-1-118 2022 年原油期货内外盘和国内现货市场价格指标

市场分类	2021 年 末收盘价	2022 年盘 中最高价	2022 年盘 中最低价	2022 年末 收盘价	全年 涨跌	结算价 平均价	标准差	极差
上期能源主力合约价格 (元/桶)	499.0	823.6	491.0	562.8	63.80	647.39	68.50	332.6
CME Group WTI 连续 合约价格 (美元/桶)	75.45	130.50	70.08	80.51	5.06	94.33	12.37	60.42
ICE Brent 连续合约价格 (美元/桶)	77.94	139.13	75.11	85.99	8.05	99.04	11.79	64.02
原油现货市场价格 (元/桶)	499.94	818.01	504.40	560.28	60.34	661.86	70.94	313.61

数据来源：上海期货交易所、Reuters（路透社）、CME Group（芝加哥商业交易所集团）、ICE（洲际交易所）。

表 2-1-119 2022 年原油期货内外盘和国内现货市场价格相关性

价格选择	相关系数
上期所主力结算价与 CME WTI 连续价格	0.89
上期所主力结算价与 ICE Brent 价格	0.83
上期所主力结算价与现货价格	0.95

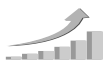
数据来源：上海期货交易所、CME Group（芝加哥商业交易所集团）、ICE（洲际交易所）。

十五、低硫燃料油期货运行情况

（一）期货交易情况（见表 2-1-120、表 2-1-121）

表 2-1-120 2022 年低硫燃料油期货月度交易情况

月度	成交量 (万手)	同比变化 (%)	成交金额 (亿元)	同比变化 (%)	月末持仓量 (万手)	同比变化 (%)
1 月	143.77	-14.56	560.77	19.03	8.39	-41.59
2 月	157.64	41.74	675.72	95.55	8.54	-2.14
3 月	288.80	80.37	1 444.21	179.54	5.99	-28.47
4 月	197.98	35.55	995.95	114.40	7.31	-18.01
5 月	282.27	82.35	1 607.55	225.14	10.74	59.42
6 月	400.38	153.97	2 428.90	352.28	12.02	68.38
7 月	630.19	338.06	3 290.44	565.93	12.60	90.86
8 月	431.88	243.00	2 132.21	414.29	12.24	70.39
9 月	393.64	150.63	1 787.44	219.64	9.84	18.99
10 月	286.91	74.17	1 367.25	111.92	11.38	81.55



续表

月度	成交量 (万手)	同比变化 (%)	成交金额 (亿元)	同比变化 (%)	月末持仓量 (万手)	同比变化 (%)
11月	408.10	108.82	1 840.47	154.01	10.78	35.99
12月	462.60	165.27	1 842.55	205.50	9.68	27.82
总计	4 084.16	119.64	19 973.45	218.55	—	—

数据来源:上海期货交易所(上海国际能源交易中心)。

表 2-1-121 2021—2022 年低硫燃料油期货年度交易情况

年度	成交量 (万手)	同比变化 (%)	成交金额 (亿元)	同比变化 (%)	年末持仓量 (万手)	同比变化 (%)
2021年	1 859.48	90.47	6 270.03	163.74	7.57	-46.14
2022年	4 084.16	119.64	19 973.45	218.55	9.68	27.82

数据来源:上海期货交易所(上海国际能源交易中心)。

(二) 交割情况(见表 2-1-122、表 2-1-123)

表 2-1-122 2022 年低硫燃料油期货月度交割情况

月度	交割量(手)	同比变化(%)	交割金额(万元)	同比变化(%)
1月	5 562.00	19.38	18 777.31	161.73
2月	3 440.00	337.66	14 654.40	671.62
3月	2 280.00	10.36	10 198.44	152.21
4月	1 800.00	-71.06	9 185.40	49.81
5月	1 858.00	-68.66	9 221.25	48.67
6月	42.00	-97.11	298.96	6.82
7月	37.00	-82.04	243.05	35.28
8月	1 700.00	-58.70	9 062.70	65.49
9月	7 333.00	228.83	41 174.80	576.82
10月	1 271.00	-70.61	5 891.09	38.71
11月	1 635.00	-61.10	7 688.41	45.16
12月	807.00	-83.53	3 594.38	20.16
总计	27 765.00	-32.43	129 990.19	-3.00

数据来源:上海期货交易所(上海国际能源交易中心)。

表 2-1-123 2021—2022 年低硫燃料油期货年度交割情况

年度	交割量(手)	同比变化(%)	交割金额(万元)	同比变化(%)
2021年	41 089.00	—	134 005.35	—
2022年	27 765.00	-32.43	129 990.19	-3.00

数据来源:上海期货交易所(上海国际能源交易中心)。

(三) 期货价格走势 (见图 2-1-15、表 2-1-124、表 2-1-125)



图 2-1-15 2022 年低硫燃料油期货和现货市场价格走势

数据来源：上海期货交易所（上海国际能源交易中心）、金联创。

表 2-1-124 2022 年低硫燃料油期货和现货市场价格指标

市场分类	2021 年末 收盘价	2022 年盘 中最高价	2022 年盘 中最低价	2022 年末 收盘价	全年 涨跌	结算价 平均价	标准差	极差
上期能源主力价格 (元/吨)	3 691	6 528	3 588	4 134	443	4 813.32	646.29	2 940
华东低硫燃料油现货 价格 (元/吨)	3 956	7 106	3 707	4 003	47	5 114.12	828.69	3 399

数据来源：上海期货交易所（上海国际能源交易中心）、金联创。

表 2-1-125 2022 年低硫燃料油期货和现货市场价格相关性

价格选择	相关系数
上期能源主力结算价与低硫燃料油现货市场价格	0.95

数据来源：上海期货交易所（上海国际能源交易中心）、金联创。

十六、燃料油期货运行情况

(一) 期货交易情况 (见表 2-1-126、表 2-1-127)

表 2-1-126 2022 年燃料油期货月度交易情况

月度	成交量 (万手)	同比变化 (%)	成交金额 (亿元)	同比变化 (%)	月末持仓量 (万手)	同比变化 (%)
1 月	794.22	-74.43	2 397.38	-64.34	43.20	-3.76

续表

月度	成交量 (万手)	同比变化 (%)	成交金额 (亿元)	同比变化 (%)	月末持仓量 (万手)	同比变化 (%)
2月	770.86	-55.91	2 514.31	-38.04	48.33	26.02
3月	1 871.28	-42.77	7 272.47	-9.33	38.31	20.50
4月	1 686.31	-39.39	6 756.23	-0.21	48.54	46.68
5月	1 363.02	-46.90	5 686.45	-9.43	51.21	41.85
6月	1 744.58	-26.30	6 938.45	10.96	48.61	20.76
7月	2 237.52	-12.31	7 052.71	6.43	57.29	94.39
8月	2 439.95	6.96	7 865.43	38.35	48.26	38.31
9月	2 524.29	5.73	7 130.76	7.95	58.91	38.76
10月	1 301.23	-37.28	3 540.94	-44.82	73.56	186.81
11月	1 740.19	28.20	4 825.11	25.61	67.10	71.01
12月	2 572.05	113.24	6 653.74	109.41	43.95	-10.94
总计	21 045.51	-24.02	68 633.99	-2.59	—	—

数据来源：上海期货交易所。

表 2-1-127 2021—2022 年燃料油期货年度交易情况

年度	成交量 (万手)	同比变化 (%)	成交金额 (亿元)	同比变化 (%)	年末持仓量 (万手)	同比变化 (%)
2021年	27 699.38	-41.95	70 455.63	-16.92	49.35	11.84
2022年	21 045.51	-24.02	68 633.99	-2.59	43.95	-10.94

数据来源：上海期货交易所。

(二) 交割情况 (见表 2-1-128、表 2-1-129)

表 2-1-128 2022 年燃料油期货月度交割情况

月度	交割量 (手)	同比变化 (%)	交割金额 (万元)	同比变化 (%)
1月	4 495.00	-65.51	11 761.90	-52.89
2月	196.00	-89.01	612.70	-82.82
3月	20.00	-99.47	64.80	-99.28
4月	35.00	-98.19	139.65	-96.88
5月	197.00	-96.18	939.49	-92.37
6月	1.00	-99.08	4.36	-98.23
7月	1.00	-99.38	3.77	-99.10
8月	3.00	-97.14	10.08	-96.21
9月	2 876.00	-80.01	9 985.47	-73.60
10月	209.00	-37.80	613.21	-41.51

续表

月度	交割量（手）	同比变化（%）	交割金额（万元）	同比变化（%）
11月	249.00	223.38	709.15	206.07
12月	8.00	-88.57	21.40	-88.76
总计	8 290.00	-79.75	24 865.98	-73.70

数据来源：上海期货交易所。

表 2-1-129 2021—2022 年燃料油期货年度交割情况

年度	交割量（手）	同比变化（%）	交割金额（万元）	同比变化（%）
2021年	40 935.00	-41.90	94 529.59	-22.93
2022年	8 290.00	-79.75	24 865.98	-73.70

数据来源：上海期货交易所。

(三) 期货价格走势（见图 2-1-16、表 2-1-130、表 2-1-131）



图 2-1-16 2022 年燃料油期货和现货市场价格走势

数据来源：上海期货交易所、金联创。

表 2-1-130 2022 年燃料油期货和现货市场价格指标

市场分类	2021 年末 收盘价	2022 年盘 中最高价	2022 年盘 中最低价	2022 年末 收盘价	全年 涨跌	结算价 平均价	标准差	极差
上期所主力价格 (元/吨)	2 892	4 556	2 417	2 749	-143	3 309.65	566.37	2 139
华东高硫 380 燃料油 现货价格 (元/吨)	2 835	4 618	2 397	2 615	-220	3 340.14	623.78	2 221

数据来源：上海期货交易所、金联创。



表 2-1-131 2022 年燃料油期货和现货市场价格相关性

价格选择	相关系数
上期所主力结算价与燃料油现货市场价格	0.98

数据来源：上海期货交易所、金联创。

十七、石油沥青期货运行情况

（一）期货交易情况（见表 2-1-132、表 2-1-133）

表 2-1-132 2022 年石油沥青期货月度交易情况

月度	成交量 (万手)	同比变化 (%)	成交金额 (亿元)	同比变化 (%)	月末持仓量 (万手)	同比变化 (%)
1 月	1 017.56	-22.99	3 528.57	-0.16	70.65	21.04
2 月	868.33	8.21	3 120.53	30.16	71.53	48.94
3 月	1 879.64	43.31	7 217.88	82.49	58.62	19.12
4 月	1 307.84	-2.50	5 149.72	32.56	78.49	66.77
5 月	1 495.05	27.22	6 531.98	75.96	102.95	152.94
6 月	1 511.31	35.11	6 949.18	86.54	90.42	83.01
7 月	1 854.08	33.26	7 486.62	62.03	94.49	94.82
8 月	1 571.28	25.05	6 379.17	60.61	89.87	87.94
9 月	1 074.07	5.47	3 988.71	21.53	73.95	82.79
10 月	965.71	5.71	3 705.93	25.15	81.72	75.91
11 月	1 369.39	11.59	4 927.91	30.99	72.77	33.32
12 月	1 343.57	14.93	4 765.51	34.45	73.28	7.96
总计	16 257.83	15.74	63 751.71	47.06	—	—

数据来源：上海期货交易所。

表 2-1-133 2021—2022 年石油沥青期货年度交易情况

年度	成交量 (万手)	同比变化 (%)	成交金额 (万亿元)	同比变化 (%)	年末持仓量 (万手)	同比变化 (%)
2021 年	14 046.32	-31.40	4.34	-12.94	67.88	2.58
2022 年	16 257.83	15.74	6.38	47.06	73.28	7.96

数据来源：上海期货交易所。

(二) 交割情况 (见表 2-1-134、表 2-1-135)

表 2-1-134 2022 年石油沥青期货月度交割情况

月度	交割量 (手)	同比变化 (%)	交割金额 (亿元)	同比变化 (%)
1 月	2 834	-71.05	0.92	-62.75
2 月	3 750	-0.12	1.36	16.24
3 月	8 414	0.23	3.33	58.57
4 月	2 457	1.22	0.91	193.55
5 月	3 163	22.96	1.33	3 225.00
6 月	12 992	0.01	6.18	54.89
7 月	2 073	-0.47	0.91	-30.53
8 月	1 449	-0.17	0.64	16.36
9 月	2 260	-0.77	0.96	-67.24
10 月	1 276	-0.88	0.54	-82.35
11 月	927	-0.84	0.41	-75.74
12 月	439	-0.98	0.15	-97.36
总计	42 034	-0.52	17.64	-30.28

数据来源: 上海期货交易所。

表 2-1-135 2021—2022 年石油沥青期货年度交割情况

年度	交割量 (手)	同比变化 (%)	交割金额 (亿元)	同比变化 (%)
2021 年	86 773	73.41	25.30	107.53
2022 年	42 034	-51.56	17.64	-30.28

数据来源: 上海期货交易所。

(三) 期货价格走势 (见图 2-1-17、表 2-1-136、表 2-1-137)



图 2-1-17 2022 年石油沥青期货和国内现货市场价格走势

数据来源: 上海期货交易所、百川盈孚。

表 2-1-136 2022 年石油沥青期货和国内现货市场价格指标

市场分类	2021 年末 收盘价	2022 年盘 中最高价	2022 年盘 中最低价	2022 年末 收盘价	全年 涨跌	结算价 平均价	标准差	极差
上期所主力价格 (元/吨)	3 344	4 912	3 278	3 865	521	3 911.36	366.44	1 634
华东国产重交沥青现 货价格 (元/吨)	3 129	4 813	3 179	3 602	473	4 126.66	477.57	1 634

数据来源：上海期货交易所、百川盈孚。

表 2-1-137 2022 年石油沥青期货和国内现货市场价格相关性

价格选择	相关系数
上期所主力结算价与石油沥青现货市场价格	0.73

数据来源：上海期货交易所、百川盈孚。

十八、天然橡胶期货、期权运行情况

(一) 期货、期权交易情况 (见表 2-1-138 ~ 表 2-1-142)

表 2-1-138 2022 年天然橡胶期货月度交易情况

月度	成交量 (万手)	同比变化 (%)	成交金额 (亿元)	同比变化 (%)	月末持仓量 (万手)	同比变化 (%)
1 月	597.08	-47.54	8 827.23	-46.38	34.00	24.13
2 月	430.92	-55.45	6 175.14	-58.95	37.47	26.01
3 月	794.92	-51.36	10 908.95	-55.59	33.21	9.52
4 月	585.65	-40.68	7 759.50	-43.30	30.81	18.16
5 月	671.31	-30.06	8 733.95	-39.70	29.93	-6.62
6 月	791.93	-18.01	10 314.97	-18.02	29.41	-9.07
7 月	892.16	-16.56	11 126.74	-22.07	25.93	-18.96
8 月	625.74	-38.04	7 873.70	-45.36	27.13	-1.95
9 月	650.90	1.10	8 327.75	-5.22	22.56	5.64
10 月	443.36	-59.00	5 546.09	-65.64	31.80	23.80
11 月	831.54	-10.33	10 423.26	-24.11	30.89	12.58
12 月	648.42	-5.41	8 365.67	-16.61	30.80	-1.55
总计	7 963.94	-34.51	104 382.94	-40.08	—	—

数据来源：上海期货交易所。

表 2-1-139 2021—2022 年天然橡胶期货年度交易情况

年度	成交量 (万手)	同比变化 (%)	成交金额 (万亿元)	同比变化 (%)	年末持仓量 (万手)	同比变化 (%)
2021 年	12 160.09	20.47	17.42	33.01	31.28	11.67
2022 年	7 963.94	-34.51	10.44	-40.08	30.80	-1.55

数据来源：上海期货交易所。

表 2-1-140 2021—2022 年天然橡胶期货内外盘年度交易情况

年度	成交量（万手）		年末持仓量（万手）	
	上期所（SHFE）	日本交易所（JPX）	上期所（SHFE）	日本交易所（JPX）
2021 年	12 160.09	66.53	31.28	0.85
2022 年	7 963.94	39.63	30.80	1.22

注：上期所天然橡胶期货交易单位为 10 吨/手，JPX3 号烟胶片期货交易单位为 5 吨/手。

数据来源：上海期货交易所、日本交易所（JPX）。

表 2-1-141 2022 年天然橡胶期权月度交易情况

月度	成交量 (万手)	同比变化 (%)	成交量 看跌/看涨 (PCR)	成交金额 (亿元)	同比变化 (%)	月末持仓量 (万手)	同比变化 (%)
1 月	27.37	-13.57	0.442	11.64	-34.71	5.75	18.69
2 月	28.99	-28.19	0.398	90.16	-68.25	6.20	31.58
3 月	50.08	-0.31	0.301	12.58	-44.08	7.83	46.62
4 月	41.99	-22.36	0.381	7.10	-53.86	5.06	24.81
5 月	36.29	27.90	0.365	7.73	-49.78	6.00	2.99
6 月	47.55	33.75	0.341	10.40	-22.35	7.81	5.22
7 月	69.33	47.88	0.476	14.22	7.36	8.84	25.30
8 月	56.99	11.13	0.487	8.63	-24.38	4.40	22.14
9 月	44.63	116.20	0.446	8.91	23.90	4.87	24.40
10 月	30.03	-23.64	0.442	5.37	-72.51	5.95	39.03
11 月	54.01	39.89	0.453	8.92	-39.43	5.89	22.05
12 月	47.74	19.48	0.534	6.74	-29.30	3.56	0.16
总计	535.04	12.16	0.423	111.30	-40.99	—	—

数据来源：上海期货交易所。

表 2-1-142 2021—2022 年天然橡胶期权年度交易情况

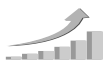
年度	成交量 (万手)	同比变化 (%)	成交量 看跌/看涨 (PCR)	成交金额 (亿元)	同比变化 (%)	年末持仓量 (万手)	同比变化 (%)
2021 年	477.02	88.28	0.436	188.63	111.37	3.56	-9.17
2022 年	535.04	12.16	0.423	111.30	-40.99	—	—

数据来源：上海期货交易所。

(二) 交割、行权情况（见表 2-1-143 ~ 表 2-1-146）

表 2-1-143 2022 年天然橡胶期货月度交割情况

月度	交割量（手）	同比变化（%）	交割金额（亿元）	同比变化（%）
1 月	2 036	69.95	2.99	76.12



续表

月度	交割量 (手)	同比变化 (%)	交割金额 (亿元)	同比变化 (%)
3 月	1 103	474.48	1.50	417.34
4 月	227	249.23	0.30	235.98
5 月	2 799	28.04	3.47	14.90
6 月	851	777.32	1.11	802.19
7 月	687	308.93	0.84	283.90
8 月	507	668.18	0.61	589.37
9 月	4 027	-10.89	4.63	-17.96
10 月	730	69.37	0.86	47.50
11 月	1 647	-32.58	1.91	-40.31
总计	14 614	28.59	18.23	21.92

数据来源: 上海期货交易所。

表 2-1-144 2021—2022 年天然橡胶期货年度交割情况

年度	交割量 (手)	同比变化 (%)	交割金额 (亿元)	同比变化 (%)
2021 年	11 365	-26.4	14.95	-17.01
2022 年	14 614	28.59	18.23	21.92

数据来源: 上海期货交易所。

表 2-1-145 2022 年天然橡胶期权月度行权情况

月度	行权量 (手)
1 月	15
2 月	1 499
3 月	1 198
4 月	8 262
5 月	1 586
6 月	318
7 月	2 434
8 月	5 261
9 月	1 769
10 月	1 726
11 月	330
12 月	2 534
总计	26 932

数据来源: 上海期货交易所。

表 2-1-146

2021—2022 年天然橡胶期权年度行权情况

年度	行权量 (手)	同比变化 (%)
2021 年	22 877	56.60
2022 年	26 932	17.73

数据来源：上海期货交易所。

(三) 期货价格走势 (见图 2-1-18、表 2-1-147、表 2-1-148)



图 2-1-18 2022 年天然橡胶期货内外盘和国内现货市场价格走势

数据来源：上海期货交易所、日本交易所 (JPX)、金联创。

表 2-1-147 2022 年天然橡胶期货内外盘和国内现货市场价格指标

市场分类	2021 年末 收盘价	2022 年盘 中最高价	2022 年盘 中最低价	2022 年末 收盘价	全年 涨跌	结算价 均价	标准差	极差
上期所主力价格 (元/吨)	14 855	15 240	11 490	12 695	-2 160	1, 3 103	756.53	3 750
JPX 3 号烟胶片主力 价格 (日元/千克)	234	272.5	205.8	217.5	-16.5	239	15.09	66.7
国产全乳胶现货价格 (元/吨)	14 500	14 800	11 650	12 900	-1 600	12 948	680.38	3 150

数据来源：上海期货交易所、日本交易所 (JPX)、金联创。

表 2-1-148 2022 年天然橡胶期货内外盘和国内现货市场价格相关性

价格选择	相关系数
上期所主力结算价与 JPX3 号烟胶片连续价格	0.45
上期所主力结算价与天然橡胶现货市场价格	0.98

数据来源：上海期货交易所、日本交易所 (JPX)、金联创。

十九、20 号胶期货运行情况

(一) 期货交易情况 (见表 2-1-149 ~ 表 2-1-151)

表 2-1-149 2022 年 20 号胶期货月度交易情况

月度	成交量 (万手)	同比变化 (%)	成交金额 (亿元)	同比变化 (%)	月末持仓量 (万手)	同比变化 (%)
1 月	77.86	45.96	922.07	60.72	5.88	18.94
2 月	82.57	15.58	978.45	18.33	7.43	40.78
3 月	117.68	22.26	1 343.66	18.57	6.52	23.33
4 月	81.00	38.28	898.67	39.51	7.23	53.27
5 月	91.37	52.20	1 012.46	50.89	6.82	56.73
6 月	119.08	109.26	1 342.45	121.85	7.74	137.12
7 月	156.76	243.80	1 698.65	248.42	8.42	169.75
8 月	113.00	165.89	1 159.98	141.57	8.84	136.44
9 月	116.96	149.40	1 131.70	121.14	8.38	129.12
10 月	93.29	41.22	886.92	13.51	10.02	139.89
11 月	155.67	100.53	1 480.51	63.17	7.82	47.43
12 月	153.93	82.17	1 509.91	56.30	8.71	56.33
总计	1 359.17	78.90	14 365.44	67.27	—	—

数据来源：上海期货交易所（上海国际能源交易中心）。

表 2-1-150 2021—2022 年 20 号胶期货年度交易情况

年度	成交量 (万手)	同比变化 (%)	成交金额 (万亿元)	同比变化 (%)	年末持仓量 (万手)	同比变化 (%)
2021 年	759.74	71.58	8 588.35	93.52	5.57	26.51
2022 年	1 359.17	78.90	14 365.44	67.27	8.71	56.33

数据来源：上海期货交易所（上海国际能源交易中心）。

表 2-1-151 2021—2022 年 20 号胶期货内外盘年度交易情况

年度	成交量 (万手)		年末持仓量 (万手)	
	上期能源 (INE SC)	新加坡交易所 (SGX)	上期能源 (INE SC)	新加坡交易所 (SGX)
2021 年	759.74	169.43	5.57	4.21
2022 年	1 359.17	186.75	8.71	4.65

注：上期能源 20 号胶期货交易单位为 10 吨/手，SGX 20 号胶期货交易单位为 5 吨/手。

数据来源：上海期货交易所（上海国际能源交易中心）、新加坡交易所（SGX）。

(二) 交割情况 (见表 2-1-152、表 2-1-153)

表 2-1-152 2022 年 20 号胶期货月度交割情况

月度	交割量 (手)	同比变化 (%)	交割金额 (亿元)	同比变化 (%)
1 月	1 474	107.61	1.71	139.63
2 月	1 185	317.25	1.37	366.33
3 月	824	23.91	0.93	18.34
4 月	590	-32.65	0.66	-28.92
5 月	1 413	342.95	1.52	326.91
6 月	1 770	225.97	2.02	257.08
7 月	1 386	273.58	1.56	303.55
8 月	1 571	143.57	1.68	140.37
9 月	660	9.09	0.61	-5.96
10 月	1 924	13.44	1.97	-2.44
11 月	2 066	3.61	1.94	-11.03
12 月	896	10.07	0.87	-4.28
总计	15 759	65.50	16.85	60.57

数据来源: 上海期货交易所 (上海国际能源交易中心)。

表 2-1-153 2021—2022 年 20 号胶期货年度交割情况

年度	交割量 (手)	同比变化 (%)	交割金额 (亿元)	同比变化 (%)
2021 年	9 522	-17.70	10.49	1.98
2022 年	15 759	65.50	16.85	60.57

数据来源: 上海期货交易所。

(三) 期货价格走势 (见图 2-1-19、表 2-1-154、表 2-1-155)



图 2-1-19 2022 年 20 号胶期货内外盘和国内现货市场价格走势

数据来源: 上海期货交易所 (上海国际能源交易中心)、新加坡交易所 (SGX)、金联创。



表 2-1-154 2022 年 20 号胶期货内外盘和国内现货市场价格指标

市场分类	2021 年末 收盘价	2022 年盘 中最高价	2022 年盘 中最低价	2022 年末 收盘价	全年 涨跌	结算价 平均价	标准差	极差
INE 20 号胶主力价格 (元/吨)	11 715	12 380	8 695	9 575	-2 140	10 649	856	3 685
SGX TSR20 连续价格 (美分/千克)	175.1	185.5	115.0	132.3	-42.8	153.7	19.3	70.5
20 号胶现货价格 (元/吨)	11 371	11 745	8 746	9 472	-1 899	10 601	848.74	2 999

数据来源：上海期货交易所（上海国际能源交易中心）、新加坡交易所（SGX）、金联创。

表 2-1-155 2022 年 20 号胶期货内外盘和国内现货市场价格相关性

价格选择	相关系数
上期能源主力结算价与 SGX 连续价格	0.98
上期能源主力结算价与 20 号胶现货市场价格	0.99

数据来源：上海期货交易所（上海国际能源交易中心）、新加坡交易所（SGX）、金联创。

二十、纸浆期货运行情况

（一）期货交易情况（见表 2-1-156、表 2-1-157）

表 2-1-156 2022 年纸浆期货月度交易情况

月度	成交量 (万手)	同比变化 (%)	成交金额 (亿元)	同比变化 (%)	月末持仓量 (万手)	同比变化 (%)
1 月	712.56	-43.45	4 377.36	-44.57	32.60	-24.32
2 月	456.25	-53.81	2 956.55	-56.32	38.02	1.74
3 月	721.46	-64.03	5 009.28	-65.26	29.01	-36.15
4 月	686.38	-45.34	4 820.62	-45.82	26.89	-22.21
5 月	772.41	-22.91	5 610.08	-17.23	30.93	12.40
6 月	889.30	-7.27	6 124.88	5.58	37.76	54.58
7 月	973.86	25.58	6 467.52	32.97	40.39	73.49
8 月	658.70	-0.13	4 468.91	8.86	34.28	20.19
9 月	652.97	27.09	4 425.43	43.04	33.86	47.90
10 月	463.87	-19.01	3 124.75	3.95	34.06	51.66
11 月	582.40	-19.08	3 951.54	7.36	33.91	29.50
12 月	545.69	-54.93	3 764.12	-46.13	22.92	-40.25
总计	8 115.84	-31.93	55 101.04	-27.78	—	—

数据来源：上海期货交易所。

表 2-1-157 2021—2022 年纸浆期货年度交易情况

年度	成交量 (万手)	同比变化 (%)	成交金额 (亿元)	同比变化 (%)	年末持仓量 (万手)	同比变化 (%)
2021 年	11 922.26	246.95	76 297.55	365.57	38.35	32.74
2022 年	8 115.84	-31.93	55 101.04	-27.78	22.92	-40.25

数据来源：上海期货交易所。

(二) 交割情况 (见表 2-1-158、表 2-1-159)

表 2-1-158 2022 年纸浆期货月度交割情况

月度	交割量 (手)	同比变化 (%)	交割金额 (亿元)	同比变化 (%)
1 月	5 244	17.58	3.30	23.87
2 月	2 758	-41.74	1.75	-43.49
3 月	5 048	0.60	3.58	-1.70
4 月	3 314	-38.10	2.28	-41.35
5 月	6 360	-6.85	4.61	-8.84
6 月	5 462	-3.77	3.90	11.16
7 月	7 510	22.71	5.14	30.73
8 月	5 640	-18.40	4.01	-9.68
9 月	7 616	-20.95	6.03	-3.22
10 月	4 652	-52.63	3.35	-43.53
11 月	5 002	-10.68	3.50	26.57
12 月	3 472	64.86	2.55	107.66
总计	62 078	-14.09	44.01	-5.12

数据来源：上海期货交易所。

表 2-1-159 2021—2022 年纸浆期货年度交割情况

年度	交割量 (手)	同比变化 (%)	交割金额 (亿元)	同比变化 (%)
2021 年	72 262	218.50	46.39	349.21
2022 年	62 078	-14.09	44.01	-5.12

数据来源：上海期货交易所。

（三）期货价格走势（见图 2-1-20、表 2-1-160、表 2-1-161）



图 2-1-20 2022 年纸浆期货和国内现货市场价格走势

数据来源：上海期货交易所、卓创资讯。

表 2-1-160 2022 年纸浆期货和国内现货市场价格指标

市场分类	2021 年末 收盘价	2022 年盘 中最高价	2022 年盘 中最低价	2022 年末 收盘价	全年 涨跌	结算价 平均价	标准差	极差
上期所主力价格 (元/吨)	6 056	7 490	5 906	6 726	670	6 795	322	1 584
纸浆现货市场价格 (元/吨)	5 978	7 500	5 978	7 233	1 255	7 039	391	1 522

数据来源：上海期货交易所、卓创资讯。

表 2-1-161 2022 年纸浆期货和国内现货市场价格相关性

价格选择	相关系数
上期所主力结算价与现货市场价格	0.65

数据来源：上海期货交易所、卓创资讯。

》》 第二节 郑州商品交易所上市品种运行情况

郑州商品交易所（以下简称郑商所，ZCE）2022 年全年累计成交量 23.98 亿手，占全国期货市场成交量的 35.42%，同比下降 7.14%；全年累计成交额 96.85

万亿元，占全国期货市场成交额的 18.1%，同比下降 10.33%。目前，对外开放的品种有 PTA。已完成备案的境外经纪机构 52 家，来自 20 个国家（地区），境内 32 家期货公司与 52 家境外经纪机构共开展 69 次委托业务备案。2022 年成交较为活跃的品种有 PTA、甲醇、纯碱、玻璃、菜籽粕、棉花、菜籽油、白糖、PTA 期权、硅铁、短纤、苹果、锰硅、甲醇期权、花生、尿素、白糖期权、棉花期权、菜籽粕期权、红枣；成交较为低迷的品种有棉纱、动力煤、动力煤期权、优质强筋小麦、油菜籽、粳稻、晚籼稻、普麦、早籼稻，单个品种年成交量在全国占比不足 0.1%。2022 年郑商所新上市的品种有菜籽油期权、花生期权。

一、棉花期货、期权运行情况

（一）期货、期权交易情况（见表 2-2-1~表 2-2-6）

表 2-2-1 2022 年棉花期货月度交易情况

月度	成交量 (万手)	同比变化 (%)	成交金额 (亿元)	同比变化 (%)	月末持仓量 (万手)	同比变化 (%)
1 月	493.16	-39.84	5 272.55	-15.44	50.55	-16.33
2 月	422.12	-32.48	4 500.11	-9.74	53.38	-28.54
3 月	643.39	-48.81	6 817.95	-30.47	51.61	-26.58
4 月	508.56	-49.42	5 438.09	-29.36	48.53	-27.44
5 月	489.55	-45.57	5 139.17	-27.71	48.82	-21.78
6 月	839.99	15.99	7 784.09	35.55	51.05	-14.16
7 月	1 690.26	51.51	12 851.65	36.46	75.25	10.81
8 月	1 703.58	54.92	12 630.70	29.94	87.45	66.04
9 月	1 439.10	45.29	10 192.21	14.20	92.50	60.14
10 月	1 196.84	3.78	7 999.92	-35.02	108.29	61.16
11 月	1 792.17	116.43	11 764.46	33.90	110.75	51.26
12 月	1 611.71	93.14	11 168.75	34.26	115.12	100.70
总计	12 830.43	13.02	101 559.65	2.53	—	—

数据来源：郑州商品交易所。

表 2-2-2 2021—2022 年棉花期货年度交易情况

年度	成交量 (万手)	同比变化 (%)	成交金额 (亿元)	同比变化 (%)	年末持仓量 (万手)	同比变化 (%)
2021 年	11 352.36	4.79	99 055.86	42.06	57.36	-9.77
2022 年	12 830.43	13.02	101 559.65	2.53	115.12	100.70

数据来源：郑州商品交易所。

表 2-2-3 2021—2022 年棉花期货内外盘年度交易情况

年度	成交量（万手）		年末持仓量（万手）	
	郑商所（ZCE）	ICE（洲际交易所）	郑商所（ZCE）	ICE（洲际交易所）
2021 年	11 352.36	850.17	57.36	23.99
2022 年	12 830.43	838.50	115.12	19.59

注：郑商所棉花期货交易单位为 5 吨/手，ICE 棉花期货交易单位为 50 000 磅/手。

数据来源：郑州商品交易所、ICE（洲际交易所）。

表 2-2-4 2022 年棉花期权月度交易情况

月度	成交量（万手）	同比变化（%）	成交量看跌/看涨（PCR）	成交金额（亿元）	同比变化（%）	月末持仓量（万手）	同比变化（%）
1 月	59.60	12.61	1.03	8.83	0.46	17.54	28.82
2 月	61.10	23.71	1.37	9.13	-3.28	17.26	13.86
3 月	121.97	35.08	0.85	12.12	12.12	21.55	17.31
4 月	77.95	39.72	0.99	10.26	17.53	17.76	37.96
5 月	125.56	150.40	1.25	14.30	77.20	21.91	38.55
6 月	131.20	215.30	0.89	26.32	381.17	20.53	34.66
7 月	205.04	89.73	0.68	39.79	228.84	32.29	94.15
8 月	167.90	207.19	0.61	26.06	167.28	22.20	132.56
9 月	174.04	154.03	0.69	21.79	38.26	30.19	148.22
10 月	139.32	93.50	0.59	14.53	-51.95	31.96	86.79
11 月	297.07	178.82	0.64	18.80	12.24	35.87	54.03
12 月	206.06	201.78	0.65	16.44	30.06	21.03	60.19
总计	1 766.83	115.93	0.75	218.37	47.00	—	—

数据来源：郑州商品交易所。

表 2-2-5 2021—2022 年棉花期权年度交易情况

年度	成交量（万手）	同比变化（%）	成交量看跌/看涨（PCR）	成交金额（亿元）	同比变化（%）	年末持仓量（万手）	同比变化（%）
2021 年	818.23	64.23	0.73	148.55	168.38	13.13	24.06
2022 年	1 766.83	115.93	0.75	218.37	47.00	21.03	60.19

数据来源：郑州商品交易所。

表 2-2-6 2021—2022 年棉花期权内外盘年度交易情况

年度	成交量（万手）		年末持仓量（万手）	
	郑商所（ZCE）	ICE（洲际交易所）	郑商所（ZCE）	ICE（洲际交易所）
2021 年	818.23	153.52	13.13	13.30
2022 年	1 766.83	233.09	21.03	22.10

注：郑商所棉花期权交易单位为 5 吨/手，ICE 棉花期权交易单位为 50 000 磅/手。

数据来源：郑州商品交易所、ICE（洲际交易所）。

(二) 交割、行权情况 (见表2-2-7~表2-2-10)

表 2-2-7 2022 年棉花期货月度交割情况

月度	交割量 (手)	同比变化 (%)	交割金额 (亿元)	同比变化 (%)
1 月	14 536	5.95	16.12	54.41
3 月	2 072	-23.15	2.25	4.10
5 月	4 296	-64.53	4.60	-51.45
7 月	2 152	-50.19	1.77	-49.25
9 月	12 048	-8.89	9.17	-22.18
11 月	640	-52.38	0.44	-68.84
总计	35 744	-24.62	34.35	-11.40

数据来源：郑州商品交易所。

表 2-2-8 2021—2022 年棉花期货年度交割情况

年度	交割量 (手)	同比变化 (%)	交割金额 (亿元)	同比变化 (%)
2021 年	47 416	-52.11	38.77	-34.15
2022 年	35 744	-24.62	34.35	-11.40

数据来源：郑州商品交易所。

表 2-2-9 2022 年棉花期权月度行权情况

月度	行权量 (手)
1 月	53
2 月	8 084
3 月	1 784
4 月	26 582
5 月	91
6 月	10 002
7 月	10 616
8 月	58 941
9 月	972
10 月	11 202
11 月	4 085
12 月	31 294
总计	163 706

数据来源：郑州商品交易所。

表 2-2-10 2021—2022 年棉花期权年度行权情况

年度	行权量 (手)	同比变化 (%)
2021 年	145 859	131.13
2022 年	163 706	12.24

数据来源: 郑州商品交易所。

(三) 期货价格走势 (见图 2-2-1、表 2-2-11、表 2-2-12)



图 2-2-1 2022 年棉花期货内外盘和国内现货市场价格走势

数据来源: 郑州商品交易所、ICE (洲际交易所)、中国棉花网。

表 2-2-11 2022 年棉花期货内外盘和国内现货市场价格指标

市场分类	2021 年 末收盘价	2022 年盘 中最高价	2022 年盘 中最低价	2022 年 末收盘价	全年 涨跌	结算价 平均价	标准差	极差
郑商所主力价格 (元/吨)	20 715	22 210	12 270	14 260	-6 455	17 461	3 545.28	9 940
ICE 连续价格 (美分/磅)	112.60	156.64	70.21	83.37	-29.23	112.62	22.53	86.43
国家棉花价格指数 CNCottonB (元/吨)	21 502	22 579	14 920	15 058	-6 444	18 697	3 175.81	7 659

数据来源: 郑州商品交易所、ICE (洲际交易所)、中国棉花网。

表 2-2-12 2022 年棉花期货内外盘和国内现货市场价格相关性

价格选择	相关系数
郑商所主力结算价与 ICE 连续价格	0.87
郑商所主力结算价与现货市场价格	0.99

数据来源: 郑州商品交易所、ICE (洲际交易所)、中国棉花网。

二、白糖期货、期权运行情况

(一) 期货、期权交易情况 (见表 2-2-13 ~ 表 2-2-18)

表 2-2-13 2022 年白糖期货月度交易情况

月度	成交量 (万手)	同比变化 (%)	成交金额 (亿元)	同比变化 (%)	月末持仓量 (万手)	同比变化 (%)
1 月	777.25	-30.84	4 485.66	-24.83	54.39	-16.33
2 月	669.68	-14.16	3 838.28	-8.62	64.46	-2.93
3 月	1 037.50	-10.99	6 055.25	-3.96	60.46	-12.12
4 月	748.34	-3.75	4 461.89	6.03	61.30	-0.07
5 月	620.58	-34.28	3 678.99	-30.85	62.34	-0.59
6 月	661.51	-17.63	3 957.92	-10.68	73.64	17.04
7 月	848.64	-17.16	4 900.32	-14.86	79.48	33.39
8 月	760.77	-23.67	4 250.66	-26.57	78.15	43.50
9 月	675.60	-15.56	3 743.93	-19.44	66.79	39.92
10 月	526.24	-46.53	2 942.26	-49.84	76.29	47.14
11 月	878.23	-27.61	4 941.41	-32.66	93.33	76.81
12 月	931.58	-9.78	5 287.89	-11.67	89.51	66.14
总计	9 135.92	-21.55	52 544.45	-20.16	—	—

数据来源：郑州商品交易所。

表 2-2-14 2021—2022 年白糖期货年度交易情况

年度	成交量 (万手)	同比变化 (%)	成交金额 (亿元)	同比变化 (%)	年末持仓量 (万手)	同比变化 (%)
2021 年	11 645.80	-6.50	65 815.21	0.97	53.88	-3.62
2022 年	9 135.92	-21.55	52 544.45	-20.16	89.51	66.14

数据来源：郑州商品交易所。

表 2-2-15 2021—2022 年白糖期货内外盘年度交易情况

年度	成交量 (万手)		年末持仓量 (万手)	
	郑商所 (ZCE)	ICE (洲际交易所)	郑商所 (ZCE)	ICE (洲际交易所)
2021 年	11 645.80	3 100.28	53.88	86.73
2022 年	9 135.92	3 275.01	89.51	94.57

注：郑商所白糖期货交易单位为 10 吨/手，ICE11 号原糖期货交易单位为 112 000 磅/手。

数据来源：郑州商品交易所、ICE (洲际交易所)。

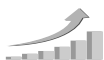


表 2-2-16 2022 年白糖期权月度交易情况

月度	成交量 (万手)	同比变化 (%)	成交量 看跌/看涨 (PCR)	成交金额 (亿元)	同比变化 (%)	月末持仓量 (万手)	同比变化 (%)
1月	120.61	64.19	0.60	6.48	5.54	19.22	30.63
2月	127.53	107.66	0.52	6.59	28.71	25.01	42.09
3月	225.08	118.67	0.39	11.47	96.40	28.04	35.30
4月	132.22	107.05	0.55	8.52	104.32	17.28	22.82
5月	169.81	71.69	0.53	9.42	32.86	22.44	19.14
6月	205.44	174.36	0.73	11.68	152.81	26.05	47.65
7月	262.80	150.15	0.87	13.73	133.90	27.71	53.11
8月	128.39	57.32	0.64	7.89	33.73	17.91	71.03
9月	147.52	103.71	0.63	6.73	30.43	21.89	43.96
10月	115.10	0.70	0.65	5.18	-48.66	20.17	19.07
11月	223.98	57.55	0.67	9.07	-3.10	25.30	42.60
12月	192.41	96.79	0.70	10.05	63.41	18.45	29.98
总计	2 050.87	88.37	0.62	106.81	41.45	—	—

数据来源：郑州商品交易所。

表 2-2-17 2021—2022 年白糖期权年度交易情况

年度	成交量 (万手)	同比变化 (%)	成交量 看跌/看涨 (PCR)	成交金额 (亿元)	同比变化 (%)	年末持仓量 (万手)	同比变化 (%)
2021年	1 088.76	74.08	0.48	75.51	59.07	14.19	32.47
2022年	2 050.87	88.37	0.62	106.81	41.45	18.45	29.98

数据来源：郑州商品交易所。

表 2-2-18 2021—2022 年白糖期权内外盘年度交易情况

年度	成交量 (万手)		年末持仓量 (万手)	
	郑商所 (ZCE)	ICE (洲际交易所)	郑商所 (ZCE)	ICE (洲际交易所)
2021年	1 088.76	580.64	14.19	59.10
2022年	2 050.87	587.38	18.45	53.68

注：郑商所白糖期权交易单位为10吨/手，ICE11号原糖期权交易单位为112 000磅/手。

数据来源：郑州商品交易所、ICE（洲际交易所）。

(二) 交割、行权情况 (见表 2-2-19 ~ 表 2-2-22)

表 2-2-19 2022 年白糖期货月度交割情况

月度	交割量 (手)	同比变化 (%)	交割金额 (亿元)	同比变化 (%)
1 月	7 527	59.27	4.29	74.17
3 月	4 288	70.36	2.48	82.26
5 月	12 978	39.14	7.52	44.74
7 月	2 227	-15.90	1.28	-12.23
9 月	5 659	-4.70	3.11	-6.18
11 月	683	-61.52	0.38	-62.05
总计	33 362	23.88	19.06	28.88

数据来源：郑州商品交易所。

表 2-2-20 2021—2022 年白糖期货年度交割情况

年度	交割量 (手)	同比变化 (%)	交割金额 (亿元)	同比变化 (%)
2021 年	26 931	386.82	14.79	392.75
2022 年	33 362	23.88	19.06	28.88

数据来源：郑州商品交易所。

表 2-2-21 2022 年白糖期权月度行权情况

月度	行权量 (手)
1 月	0
2 月	6 360
3 月	48
4 月	16 461
5 月	157
6 月	5 704
7 月	489
8 月	31 123
9 月	330
10 月	6 091
11 月	238
12 月	15 383
总计	82 384

数据来源：郑州商品交易所。

表 2-2-22 2021—2022 年白糖期权年度行权情况

年度	行权量 (手)	同比变化 (%)
2021 年	42 244	- 14. 60
2022 年	82 384	95. 02

数据来源：郑州商品交易所。

(三) 期货价格走势 (见图 2-2-2、表 2-2-23、表 2-2-24)

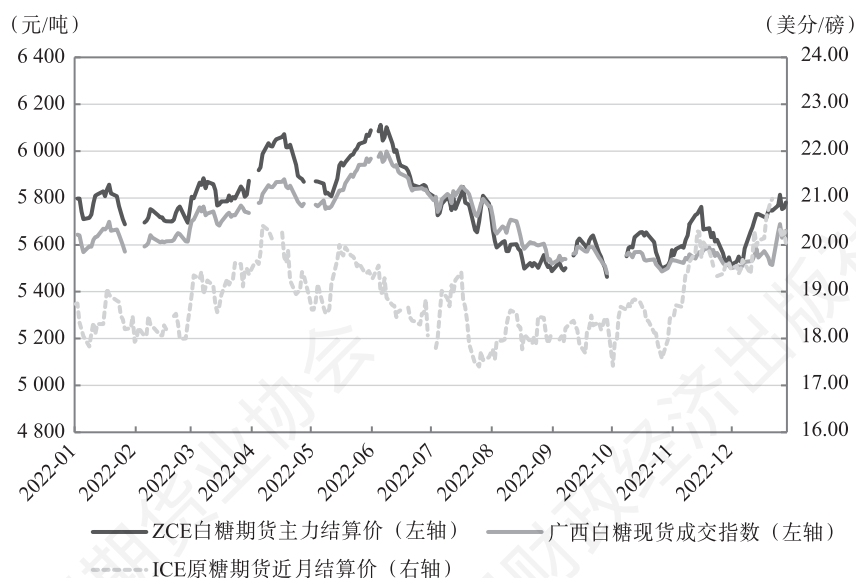


图 2-2-2 2022 年白糖期货内外盘和国内现货市场价格走势

数据来源：郑州商品交易所、ICE（洲际交易所）、泛糖科技。

表 2-2-23 2022 年白糖期货内外盘和国内现货市场价格指标

市场分类	2021 年末 收盘价	2022 年盘 中最高价	2022 年盘 中最低价	2022 年末 收盘价	全年 涨跌	结算价 均价	标准差	极差
郑商所主力价格 (元/吨)	5 777	6 129	5 440	5 783	6	5 746	159. 50	689
ICE 连续价格 (美分/磅)	18. 88	21. 18	17. 20	20. 04	1. 16	18. 82	0. 76	3. 98
广西白糖现货价格 (元/吨)	5 615	5 999	5 480	5 660	45	5 683	133. 00	519

数据来源：郑州商品交易所、ICE（洲际交易所）、泛糖科技。

表 2-2-24 2022 年白糖期货内外盘和国内现货市场价格相关性

价格选择	相关系数
郑商所主力结算价与 ICE 连续价格	0.43
郑商所主力结算价与现货市场价格	0.88

数据来源：郑州商品交易所、ICE（洲际交易所）、泛糖科技。

三、菜籽油期货、期权运行情况

2022 年 8 月 26 日，菜籽油期权在郑商所上市交易。

（一）期货、期权交易情况（见表 2-2-25 ~ 表 2-2-27）

表 2-2-25 2022 年菜籽油期货月度交易情况

月度	成交量 (万手)	同比变化 (%)	成交金额 (亿元)	同比变化 (%)	月末持仓量 (万手)	同比变化 (%)
1 月	769.63	3.72	9 242.02	25.19	22.10	19.53
2 月	661.28	49.52	8 153.54	85.65	21.29	13.75
3 月	762.79	-23.62	9 780.41	-7.12	22.98	2.83
4 月	518.56	-40.73	6 860.84	-25.28	25.42	41.31
5 月	357.92	-51.45	4 857.53	-37.89	26.24	43.27
6 月	541.57	-41.77	7 090.84	-24.74	22.67	10.25
7 月	997.09	-7.67	10 832.78	-2.88	27.67	11.99
8 月	887.25	-28.23	10 124.22	-22.15	28.36	10.59
9 月	844.50	-14.02	8 955.04	-16.26	27.17	4.22
10 月	745.66	-26.16	8 271.16	-33.78	29.91	2.37
11 月	1 341.09	12.15	15 139.26	1.37	32.92	19.90
12 月	1 017.39	-2.79	10 796.18	-15.82	32.17	24.62
总计	9 444.73	-16.24	110 103.82	-11.09	—	—

数据来源：郑州商品交易所。

表 2-2-26 2021—2022 年菜籽油期货年度交易情况

年度	成交量 (万手)	同比变化 (%)	成交金额 (亿元)	同比变化 (%)	年末持仓量 (万手)	同比变化 (%)
2021 年	11 275.52	6.93	123 831.61	37.64	25.81	59.94
2022 年	9 444.73	-16.24	110 103.82	-11.09	32.17	24.62

数据来源：郑州商品交易所。

表 2-2-27 2022 年菜籽油期权年度交易情况

年度	成交量 (万手)	同比变化 (%)	成交量 看跌/看涨 (PCR)	成交金额 (亿元)	同比变化 (%)	年末持仓量 (万手)	同比变化 (%)
2022 年	259.42	—	0.90	21.81	—	2.38	—

数据来源：郑州商品交易所。

(二) 交割、行权情况 (见表 2-2-28 ~ 表 2-2-30)

表 2-2-28 2022 年菜籽油期货月度交割情况

月度	交割量 (手)	同比变化 (%)	交割金额 (亿元)	同比变化 (%)
1 月	885	-33.31	1.08	-21.19
3 月	620	-48.97	0.84	-35.98
5 月	1 141	-82.77	1.57	-79.19
7 月	168	-79.36	0.20	-76.36
9 月	2 629	-45.17	3.24	-38.00
11 月	1 633	-18.35	2.15	-14.03
总计	7 076	-57.82	9.08	-51.72

数据来源: 郑州商品交易所。

表 2-2-29 2021—2022 年菜籽油期货年度交割情况

年度	交割量 (手)	同比变化 (%)	交割金额 (亿元)	同比变化 (%)
2021 年	16 775	111.65	18.81	180.47
2022 年	7 076	-57.82	9.08	-51.72

数据来源: 郑州商品交易所。

表 2-2-30 2022 年菜籽油期权年度行权情况

年度	行权量 (手)
2022 年	6 202

数据来源: 郑州商品交易所。

(三) 期货价格走势 (见图 2-2-3、表 2-2-31、表 2-2-32)



图 2-2-3 2022 年菜籽油期货和国内现货市场价格走势

数据来源: 郑州商品交易所、国家粮油信息中心。

表 2-2-31 2022 年菜籽油期货和国内现货市场价格指标

市场分类	2021 年末 收盘价	2022 年盘 中最高价	2022 年盘 中最低价	2022 年末 收盘价	全年 涨跌	结算价 平均价	标准差	极差
郑商所主力价格 (元/吨)	12 298	14 538	9 986	10 739	-1 559	11 944.45	1 139.85	4 552
广东湛江三级菜籽油 现货价格 (元/吨)	12 700	14 900	10 800	12 760	60	13 037.69	805.36	4 100

数据来源：郑州商品交易所、国家粮油信息中心。

表 2-2-32 2022 年菜籽油期货和国内现货市场价格相关性

价格选择	相关系数
郑商所主力结算价与现货市场价格	0.70

数据来源：郑州商品交易所、国家粮油信息中心。

四、菜籽粕期货、期权运行情况

(一) 期货、期权交易情况 (见表 2-2-33 ~ 表 2-2-36)

表 2-2-33 2022 年菜籽粕期货月度交易情况

月度	成交量 (万手)	同比变化 (%)	成交金额 (亿元)	同比变化 (%)	月末持仓量 (万手)	同比变化 (%)
1 月	1 280.17	-40.08	3 787.53	-39.86	73.27	47.17
2 月	1 543.57	-9.76	5 336.39	6.85	78.23	40.51
3 月	1 620.63	-45.25	6 104.77	-27.25	71.21	28.58
4 月	888.89	-64.31	3 167.60	-56.94	55.18	0.26
5 月	497.11	-76.13	1 709.38	-72.74	38.05	-28.63
6 月	638.06	-72.44	2 093.10	-68.82	37.06	-34.68
7 月	1 101.93	-48.83	3 094.15	-51.83	41.52	-37.74
8 月	1 160.77	-56.66	3 323.21	-57.65	42.13	-20.92
9 月	1 317.02	-34.62	4 023.81	-30.20	61.09	16.64
10 月	1 172.45	-36.34	3 583.64	-26.21	68.15	14.10
11 月	1 920.43	-15.81	5 866.00	-2.90	77.14	41.15
12 月	1 346.84	-39.55	4 125.02	-34.60	72.50	21.46
总计	14 487.87	-46.13	46 214.60	-40.19	—	—

数据来源：郑州商品交易所。

表 2-2-34 2021—2022 年菜籽粕期货年度交易情况

年度	成交量 (万手)	同比变化 (%)	成交金额 (亿元)	同比变化 (%)	年末持仓量 (万手)	同比变化 (%)
2021 年	26 892.72	68.19	77 267.62	100.09	59.69	24.62
2022 年	14 487.87	-46.13	46 214.60	-40.19	72.50	21.46

数据来源：郑州商品交易所。

表 2-2-35 2022 年菜籽粕期权月度交易情况

月度	成交量 (万手)	同比变化 (%)	成交量 看跌/看涨 (PCR)	成交金额 (亿元)	同比变化 (%)	月末持仓量 (万手)	同比变化 (%)
1月	52.00	-9.83	1.06	2.79	-13.89	7.60	3.45
2月	67.68	110.83	1.54	6.36	257.30	10.15	45.29
3月	96.05	26.95	1.80	8.64	221.19	12.16	43.33
4月	40.18	-2.89	1.32	4.02	100.00	7.30	73.83
5月	42.90	10.62	1.25	3.06	52.24	8.11	36.05
6月	60.26	101.31	1.52	2.94	90.91	7.09	40.88
7月	61.23	54.43	1.44	3.30	95.27	5.93	16.71
8月	34.77	52.02	0.84	2.40	116.22	5.30	93.66
9月	66.02	206.76	1.04	4.55	405.56	7.18	82.62
10月	46.75	88.63	1.35	2.38	96.69	7.13	29.37
11月	148.87	171.96	1.28	4.47	120.20	9.99	47.52
12月	82.28	103.79	1.01	3.05	36.16	5.79	13.45
总计	798.99	66.64	1.29	47.96	113.63	—	—

数据来源：郑州商品交易所。

表 2-2-36 2021—2022 年菜籽粕期权年度交易情况

年度	成交量 (万手)	同比变化 (%)	成交量 看跌/看涨 (PCR)	成交金额 (亿元)	同比变化 (%)	年末持仓量 (万手)	同比变化 (%)
2021年	479.46	41.71	0.85	22.45	65.07	5.11	0.05
2022年	798.99	66.64	1.29	47.96	113.63	5.79	13.45

数据来源：郑州商品交易所。

(二) 交割、行权情况 (见表 2-2-37 ~ 表 2-2-40)

表 2-2-37 2022 年菜籽粕期货月度交割情况

月度	交割量 (手)	同比变化 (%)	交割金额 (万元)	同比变化 (%)
1月	2 495	-26.36	7 744.48	-18.33
3月	1 006	-55.29	3 889.20	-36.66
5月	3 303	32.33	12 657.10	70.85
7月	369	-77.49	1 256.81	-73.80
8月	955	-13.18	3 333.91	2.05
9月	775	-73.47	3 014.75	-66.85
11月	0	-100.00	0.00	-100.00
总计	8 903	-46.13	31 896.24	-32.18

数据来源：郑州商品交易所。

表 2-2-38 2021—2022 年菜籽粕期货年度交割情况

年度	交割量（手）	同比变化（%）	交割金额（万元）	同比变化（%）
2021 年	16 526	169.99	47 030.94	237.14
2022 年	8 903	-46.13	31 896.24	-32.18

数据来源：郑州商品交易所。

表 2-2-39 2022 年菜籽粕期权月度行权情况

月度	行权量（手）
1 月	1 352
2 月	6 298
3 月	516
4 月	13 285
5 月	2 549
6 月	3 953
7 月	3 071
8 月	5 187
9 月	1 023
10 月	3 586
11 月	1 271
12 月	6 373
总计	48 464

数据来源：郑州商品交易所。

表 2-2-40 2021—2022 年菜籽粕期权年度行权情况

年度	行权量（手）	同比变化（%）
2021 年	36 569	57.23
2022 年	48 464	32.53

数据来源：郑州商品交易所。

（三）期货价格走势（见图 2-2-4、表 2-2-41、表 2-2-42）



图 2-2-4 2022 年菜籽粕期货和国内现货市场价格走势

数据来源：郑州商品交易所、国家粮油信息中心。



表 2-2-41 2022 年菜籽粕期货和国内现货市场价格指标

市场分类	2021 年末 收盘价	2022 年盘 中最高价	2022 年盘 中最低价	2022 年末 收盘价	全年 涨跌	结算价 平均价	标准差	极差
郑商所主力价格 (元/吨)	2 912	4 364	2 596	3 223	311	3 265.58	408.39	1 768
广东湛江菜籽粕现货 价格(元/吨)	2 940	4 660	2 940	3 320	380	3 772.19	427.06	1 720

数据来源：郑州商品交易所、国家粮油信息中心。

表 2-2-42 2022 年菜籽粕期货和国内现货市场价格相关性

价格选择	相关系数
郑商所主力结算价与现货市场价格	0.46

数据来源：郑州商品交易所、国家粮油信息中心。

五、花生期货、期权运行情况

2022 年 8 月 26 日，花生期权在郑商所上市交易。

(一) 期货、期权交易情况（见表 2-2-43 ~ 表 2-2-45）

表 2-2-43 2022 年花生期货月度交易情况

月度	成交量 (万手)	同比变化 (%)	成交金额 (亿元)	同比变化 (%)	月末持仓量 (万手)	同比变化 (%)
1 月	242.97	—	971.58	—	19.29	—
2 月	241.75	5.89	985.98	-17.22	18.35	651.12
3 月	304.47	583.91	1 342.99	455.46	7.75	500.50
4 月	136.64	766.49	637.34	672.88	8.97	605.14
5 月	314.16	1 045.94	1 619.62	1 050.39	13.14	611.53
6 月	393.97	430.02	1 991.28	477.71	15.49	364.22
7 月	256.40	64.67	1 217.62	67.32	13.72	29.17
8 月	186.60	11.76	905.29	19.70	16.54	51.76
9 月	301.34	98.75	1 580.38	143.42	16.26	107.55
10 月	270.32	-27.84	1 467.84	-11.18	19.49	18.81
11 月	295.45	26.76	1 587.50	56.84	18.96	8.13
12 月	217.54	2.41	1 110.74	27.96	12.36	-29.69
总计	3 161.61	87.67	15 418.17	101.10	—	—

数据来源：郑州商品交易所。

表 2-2-44 2021—2022 年花生期货年度交易情况

年度	成交量 (万手)	同比变化 (%)	成交金额 (亿元)	同比变化 (%)	年末持仓量 (万手)	同比变化 (%)
2021 年	1 684.71	—	7 666.78	—	17.58	—
2022 年	3 161.61	87.67	15 418.17	101.10	12.36	-29.69

数据来源：郑州商品交易所。

表 2-2-45 2022 年花生期权年度交易情况

年度	成交量 (万手)	同比变化 (%)	成交量 看跌/看涨 (PCR)	成交金额 (亿元)	同比变化 (%)	年末持仓量 (万手)	同比变化 (%)
2022 年	223.94	—	0.83	12.16	—	3.82	—

数据来源：郑州商品交易所。

(二) 交割、行权情况 (见表 2-2-46 ~ 表 2-2-48)

表 2-2-46 2022 年花生期货月度交割情况

月度	交割量 (手)	同比变化 (%)	交割金额 (万元)	同比变化 (%)
1 月	2 463	—	9 662.58	—
3 月	147	—	568.70	—
4 月	3 300	—	14 201.20	—
10 月	1 149	26.13	5 787.24	56.91
11 月	74	-37.82	373.95	-23.31
12 月	85	13.33	441.18	49.44
总计	7 218	553.21	31 034.84	594.14

数据来源：郑州商品交易所。

表 2-2-47 2021—2022 年花生期货年度交割情况

年度	交割量 (手)	同比变化 (%)	交割金额 (万元)	同比变化 (%)
2021 年	1 105	—	4 470.99	—
2022 年	7 218	553.21	31 034.84	594.14

数据来源：郑州商品交易所。

表 2-2-48 2022 年花生期权年度行权情况

年度	行权量 (手)
2022 年	5 253

数据来源：郑州商品交易所。

(三) 期货价格走势 (见图 2-2-5、表 2-2-49、表 2-2-50)



图 2-2-5 2022 年花生期货和国内现货市场价格走势

数据来源：郑州商品交易所、国家粮油信息中心。

表 2-2-49 2022 年花生期货和国内现货市场价格指标

市场分类	2021 年末 收盘价	2022 年盘 中最高价	2022 年盘 中最低价	2022 年末 收盘价	全年 涨跌	结算价 平均价	标准差	极差
郑商所主力价格 (元/吨)	8 252	11 256	7 794	9 986	1 734	9 679.99	915.20	3 462
山东东部油用花生米 现货价格 (元/吨)	8 300	9 900	7 300	9 650	1 350	8 537.81	822.27	2 600

数据来源：郑州商品交易所、国家粮油信息中心。

表 2-2-50 2022 年花生期货和国内现货市场价格相关性

价格选择	相关系数
郑商所主力结算价与现货市场价格	0.78

数据来源：郑州商品交易所、国家粮油信息中心。

六、PTA 期货、期权运行情况

(一) 期货、期权交易情况 (见表 2-2-51 ~ 表 2-2-54)

表 2-2-51 2022 年 PTA 期货月度交易情况

月度	成交量 (万手)	同比变化 (%)	成交金额 (亿元)	同比变化 (%)	月末持仓量 (万手)	同比变化 (%)
1 月	3 318.73	-22.19	8 759.10	3.19	188.19	-41.50
2 月	2 872.27	-24.61	8 059.89	-4.49	197.76	-33.59
3 月	5 070.99	-12.40	15 335.07	16.05	190.35	-33.49
4 月	3 572.16	-13.91	10 891.82	13.61	198.35	-20.95
5 月	4 215.29	2.51	13 923.64	42.81	259.92	1.61
6 月	4 974.47	7.68	17 390.75	53.80	246.80	-14.54
7 月	5 215.68	-10.85	15 078.21	-0.71	284.80	7.62
8 月	5 163.74	-7.35	14 520.72	0.44	296.22	14.05
9 月	5 545.41	28.15	15 448.42	43.95	254.45	18.50
10 月	3 669.54	-22.16	9 851.34	-22.83	317.16	44.28
11 月	5 331.88	29.15	13 927.87	35.89	316.30	30.23
12 月	4 632.38	16.60	12 146.57	30.48	311.60	59.48
总计	53 582.55	-3.13	155 333.39	16.37	—	—

数据来源：郑州商品交易所。

表 2-2-52 2021—2022 年 PTA 期货年度交易情况

年度	成交量 (万手)	同比变化 (%)	成交金额 (万亿元)	同比变化 (%)	年末持仓量 (万手)	同比变化 (%)
2021 年	55 311.71	71.73	13.35	125.70	195.38	-37.08
2022 年	53 582.55	-3.13	15.53	16.37	311.60	59.48

数据来源：郑州商品交易所。

表 2-2-53 2022 年 PTA 期权月度交易情况

月度	成交量 (万手)	同比变化 (%)	成交量 看跌/看涨 (PCR)	成交金额 (亿元)	同比变化 (%)	月末持仓量 (万手)	同比变化 (%)
1 月	292.46	83.87	0.99	11.21	48.85	24.11	-21.42
2 月	269.49	50.70	1.02	12.64	4.52	20.29	-23.06
3 月	339.49	33.46	0.94	20.28	91.29	20.86	-34.86
4 月	313.23	92.18	0.86	10.67	44.76	17.76	-18.19
5 月	458.09	176.31	1.07	18.16	140.88	23.28	-18.40
6 月	704.25	198.95	1.16	34.79	198.14	35.22	-0.44
7 月	747.00	81.52	1.03	35.82	109.22	36.14	-6.94
8 月	655.91	94.63	0.90	19.02	48.61	31.97	-14.41



续表

月度	成交量 (万手)	同比变化 (%)	成交量 看跌/看涨 (PCR)	成交金额 (亿元)	同比变化 (%)	月末持仓量 (万手)	同比变化 (%)
9月	749.42	142.84	0.94	21.37	78.84	26.19	-24.88
10月	547.00	72.88	0.89	12.29	-34.75	38.40	-0.70
11月	906.93	191.09	0.90	19.41	86.83	40.13	8.79
12月	906.47	330.29	0.92	20.35	181.07	38.42	51.89
总计	6 889.74	125.72	0.96	236.01	74.64	—	—

数据来源：郑州商品交易所。

表 2-2-54 2021—2022 年 PTA 期权年度交易情况

年度	成交量 (万手)	同比变化 (%)	成交量 看跌/看涨 (PCR)	成交金额 (亿元)	同比变化 (%)	年末持仓量 (万手)	同比变化 (%)
2021 年	3 052.38	158.93	0.59	135.14	232.50	25.30	-20.97
2022 年	6 889.74	125.72	0.96	236.01	74.64	38.42	51.89

数据来源：郑州商品交易所。

(二) 交割、行权情况 (见表 2-2-55 ~ 表 2-2-58)

表 2-2-55 2022 年 PTA 期货月度交割情况

月度	交割量 (手)	同比变化 (%)	交割金额 (亿元)	同比变化 (%)
1月	17 020	-76.43	4.38	-68.60
2月	5 625	10.10	1.57	50.44
3月	21 641	-22.57	6.63	3.97
4月	8 413	72.72	2.57	145.19
5月	15 911	-67.18	5.26	-53.94
6月	8 171	-16.54	3.00	31.13
7月	20 910	-22.24	6.69	-3.25
8月	3 910	-48.73	1.17	-42.64
9月	33 832	2.83	10.97	40.71
10月	12 097	-65.26	3.63	-61.46
11月	16 119	-53.46	4.48	-48.58
12月	9 962	-54.94	2.58	-48.70
总计	173 611	-46.97	52.91	-30.39

数据来源：郑州商品交易所。

表 2-2-56 2021—2022 年 PTA 期货年度交割情况

年度	交割量 (手)	同比变化 (%)	交割金额 (亿元)	同比变化 (%)
2021 年	327 392	21.86	76.01	51.15
2022 年	173 611	-46.97	52.91	-30.39

数据来源：郑州商品交易所。

表 2-2-57

2022 年 PTA 期权月度行权情况

月度	行权量（手）
1 月	18 696
2 月	53 644
3 月	18 606
4 月	21 300
5 月	17 101
6 月	28 114
7 月	23 347
8 月	30 770
9 月	27 698
10 月	11 458
11 月	17 596
12 月	20 321
总计	288 651

数据来源：郑州商品交易所。

表 2-2-58

2021—2022 年 PTA 期权年度行权情况

年度	行权量（手）	同比变化（%）
2021 年	328 734	199.61
2022 年	288 651	-12.19

数据来源：郑州商品交易所。

（三）期货价格走势（见图 2-2-6、表 2-2-59、表 2-2-60）



图 2-2-6 2022 年 PTA 期货和国内现货市场价格走势

数据来源：郑州商品交易所、化纤信息网。



表 2-2-59 2022 年 PTA 期货和国内现货市场价格指标

市场分类	2021 年末 收盘价	2022 年盘 中最高价	2022 年盘 中最低价	2022 年末 收盘价	全年 涨跌	结算价 平均价	标准差	极差
郑商所主力价格 (元/吨)	5 018	7 728	4 872	5 540	522	5 794.40	569.53	2 856
国产 PTA 现货价格 (元/吨)	4 945	7 735	4 985	5 540	595	6 059.19	570.16	2 750

数据来源：郑州商品交易所、化纤信息网。

表 2-2-60 2022 年 PTA 期货和国内现货市场价格相关性

价格选择	相关系数
郑商所连续价格与 PTA 现货市场价格	0.98

数据来源：郑州商品交易所、化纤信息网。

七、短纤期货运行情况

（一）期货交易情况（见表 2-2-61、表 2-2-62）

表 2-2-61 2022 年短纤期货月度交易情况

月度	成交量 (万手)	同比变化 (%)	成交金额 (亿元)	同比变化 (%)	月末持仓量 (万手)	同比变化 (%)
1 月	350.34	25.17	1 293.56	39.24	20.40	90.14
2 月	285.39	-10.09	1 084.41	-10.79	23.08	48.27
3 月	506.89	-40.04	1 994.42	-36.84	25.32	17.84
4 月	387.49	-35.75	1 510.91	-29.03	24.37	21.96
5 月	502.28	15.41	2 077.41	34.72	32.81	77.84
6 月	614.82	84.95	2 620.61	122.90	28.97	38.36
7 月	669.96	59.72	2 441.31	59.25	60.53	187.18
8 月	733.77	99.73	2 646.10	101.69	85.17	326.80
9 月	757.21	85.28	2 770.72	92.64	57.69	226.19
10 月	511.13	-4.20	1 803.08	-15.22	56.75	256.79
11 月	585.89	46.35	1 997.87	41.99	56.52	196.88
12 月	744.86	86.55	2 581.67	90.05	68.51	292.10
总计	6 650.02	24.48	24 822.07	28.45	—	—

数据来源：郑州商品交易所。

表 2-2-62 2021—2022 年短纤期货年度交易情况

年度	成交量 (万手)	同比变化 (%)	成交金额 (万亿元)	同比变化 (%)	年末持仓量 (万手)	同比变化 (%)
2021 年	5 342.13	225.46	1.93	276.46	17.47	53.11
2022 年	6 650.02	24.48	2.48	28.45	68.51	292.10

数据来源：郑州商品交易所。

(二) 交割情况 (见表 2-2-63、表 2-2-64)

表 2-2-63 2022 年短纤期货月度交割情况

月度	交割量 (手)	同比变化 (%)	交割金额 (亿元)	同比变化 (%)
1 月	5 041	—	1.79	—
2 月	2 621	—	1.00	—
3 月	314	—	0.13	—
4 月	434	—	0.17	—
5 月	2 257	-53.90	0.94	-42.78
6 月	181	352.50	0.08	479.33
7 月	9	-99.87	0.00	-99.86
8 月	234	265.63	0.09	283.88
9 月	0	-100	0	-100
10 月	0	-100	0	-100
11 月	4 471	-14.45	1.66	-10.23
12 月	1 000	116.45	0.33	116.13
总计	16 562	—	6.19	—

数据来源：郑州商品交易所。

表 2-2-64 2021—2022 年短纤期货年度交割情况

年度	交割量 (手)	同比变化 (%)	交割金额 (亿元)	同比变化 (%)
2021 年	22 381	—	7.86	—
2022 年	16 562	—	6.19	—

数据来源：郑州商品交易所。

(三) 期货价格走势 (见图 2-2-7、表 2-2-65、表 2-2-66)



图 2-2-7 2022 年短纤期货和国内现货市场价格走势

数据来源：郑州商品交易所、化纤信息网。



表 2-2-65 2022 年短纤期货和国内现货市场价格指标

市场分类	2021 年末 收盘价	2022 年盘 中最高价	2022 年盘 中最低价	2022 年末 收盘价	全年 涨跌	结算价 平均价	标准差	极差
郑商所主力价格 (元/吨)	7 070	9 168	6 440	7 266	196	7 491.88	545.22	2 728
国产短纤现货价格 (元/吨)	6 940	9 215	6 695	7 095	155	7 703.55	491.69	2 520

数据来源：郑州商品交易所、化纤信息网。

表 2-2-66 2022 年短纤期货和国内现货市场价格相关性

价格选择	相关系数
郑商所主力结算价与短纤现货市场价格	0.87

数据来源：郑州商品交易所、化纤信息网。

八、甲醇期货、期权运行情况

（一）期货、期权交易情况（见表 2-2-67 ~ 表 2-2-70）

表 2-2-67 2022 年甲醇期货月度交易情况

月度	成交量 (万手)	同比变化 (%)	成交金额 (亿元)	同比变化 (%)	月末持仓量 (万手)	同比变化 (%)
1 月	2 432.31	-18.91	6 570.19	-5.98	142.03	19.72
2 月	1 873.94	-5.70	5 247.39	11.16	156.88	26.82
3 月	2 975.97	-13.22	9 138.27	8.35	144.86	21.24
4 月	2 321.67	-17.55	6 627.68	-2.76	153.52	16.01
5 月	3 153.54	-4.10	8 656.50	0.17	178.21	26.83
6 月	3 681.07	24.70	10 206.69	37.54	192.26	29.17
7 月	4 157.60	48.02	10 192.59	36.65	228.73	42.55
8 月	4 108.42	50.86	10 320.35	37.57	217.63	64.75
9 月	3 800.39	5.48	10 219.33	-10.17	196.40	42.09
10 月	2 729.05	-52.31	7 243.16	-63.25	244.75	46.26
11 月	4 512.63	-18.73	11 519.16	-23.52	243.87	76.19
12 月	3 808.25	4.39	9 696.59	2.43	190.57	41.25
总计	39 554.85	-4.76	105 637.92	-7.00	—	—

数据来源：郑州商品交易所。

表 2-2-68 2021—2022 年甲醇期货年度交易情况

年度	成交量 (万手)	同比变化 (%)	成交金额 (亿元)	同比变化 (%)	年末持仓量 (万手)	同比变化 (%)
2021 年	41 530.48	20.42	113 593.02	66.19	134.92	29.31
2022 年	39 554.85	-4.76	105 637.92	-7.00	190.57	41.25

数据来源：郑州商品交易所。

表 2-2-69 2022 年甲醇期权月度交易情况

月度	成交量 (万手)	同比变化 (%)	成交量 看跌/看涨 (PCR)	成交金额 (亿元)	同比变化 (%)	月末持仓量 (万手)	同比变化 (%)
1 月	245.17	127.76	0.64	10.61	114.58	11.39	-22.30
2 月	176.87	58.19	0.68	8.22	47.35	13.48	-18.13
3 月	279.07	47.52	0.84	15.32	92.21	17.51	22.03
4 月	197.62	99.93	0.81	7.61	95.97	11.74	13.83
5 月	226.44	41.29	0.72	8.07	-20.24	13.65	8.65
6 月	285.85	141.31	0.86	11.23	92.21	16.65	16.70
7 月	304.49	108.81	0.87	11.42	88.39	18.81	63.23
8 月	318.46	111.94	0.93	9.70	55.72	12.94	62.14
9 月	371.47	73.88	0.90	12.66	-20.43	17.59	30.82
10 月	406.52	99.70	0.91	10.74	-56.77	23.80	12.85
11 月	669.19	163.79	0.85	17.58	22.48	26.84	18.00
12 月	542.17	126.69	0.90	13.18	40.69	16.99	-15.21
总计	4 023.32	101.94	0.84	136.32	18.45	—	—

数据来源：郑州商品交易所。

表 2-2-70 2021—2022 年甲醇期权年度交易情况

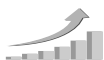
年度	成交量 (万手)	同比变化 (%)	成交量 看跌/看涨 (PCR)	成交金额 (亿元)	同比变化 (%)	年末持仓量 (万手)	同比变化 (%)
2021 年	1 992.33	96.02	0.71	115.09	149.22	20.04	53.27
2022 年	4 023.32	101.94	0.84	136.32	18.45	16.99	-15.21

数据来源：郑州商品交易所。

(二) 交割、行权情况 (见表 2-2-71 ~ 表 2-2-74)

表 2-2-71 2022 年甲醇期货月度交割情况

月度	交割量 (手)	同比变化 (%)	交割金额 (万元)	同比变化 (%)
1 月	665	-72.21	1 680.46	-70.82
2 月	3 691	254.22	9 932.48	308.23
3 月	1 789	-8.49	5 295.44	8.78
4 月	512	-5.54	1 459.20	14.08
5 月	971	-37.92	2 645.98	-36.68
6 月	313	4 371.43	875.77	4 730.52
7 月	585	-31.98	1 411.61	-34.81



续表

月度	交割量（手）	同比变化（%）	交割金额（万元）	同比变化（%）
8月	2 177	21.55	5 507.81	21.94
9月	2 516	19.92	6 554.18	10.23
10月	725	-58.50	2 039.43	-68.90
11月	1 274	46.27	3 457.64	39.63
12月	1 369	-51.91	3 547.08	-52.90
总计	16 587	-6.38	44 407.06	-6.96

数据来源：郑州商品交易所。

表 2-2-72 2021—2022 年甲醇期货年度交割情况

年度	交割量（手）	同比变化（%）	交割金额（万元）	同比变化（%）
2021年	17 717	-61.07	47 728.35	-41.20
2022年	16 587	-6.38	44 407.06	-6.96

数据来源：郑州商品交易所。

表 2-2-73 2022 年甲醇期权月度行权情况

月度	行权量（手）
1月	18 941
2月	11 874
3月	9 366
4月	31 382
5月	9 901
6月	13 690
7月	17 083
8月	14 846
9月	8 472
10月	12 026
11月	9 516
12月	16 576
总计	173 673

数据来源：郑州商品交易所。

表 2-2-74 2022 年甲醇期权年度行权情况

年度	行权量（手）	同比变化（%）
2021年	169 587	63.44
2022年	173 673	2.41

数据来源：郑州商品交易所。

(三) 期货价格走势 (见图 2-2-8、表 2-2-75、表 2-2-76)

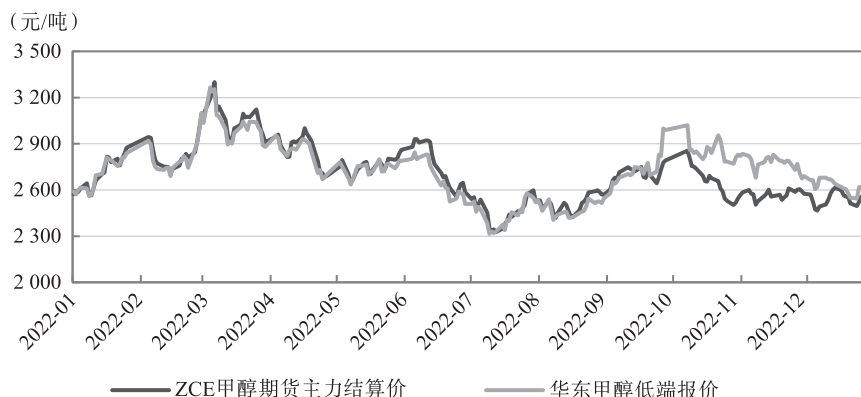


图 2-2-8 2022 年甲醇期货和国内现货市场价格比较

数据来源：郑州商品交易所、金联创。

表 2-2-75 2022 年甲醇期货和国内现货市场价格指标

市场分类	2021 年末 收盘价	2022 年盘 中最高价	2022 年盘 中最低价	2022 年末 收盘价	全年 涨跌	结算价 平均价	标准差	极差
郑商所主力价格 (元/吨)	2 478	3 370	2 276	2 653	175	2 696.62	186.42	1 094
华东甲醇现货市场 价格 (元/吨)	2 520	3 265	2 315	2 670	150	2 720.48	177.87	950

数据来源：郑州商品交易所、金联创。

表 2-2-76 2022 年甲醇期货和国内现货市场价格相关性

价格选择	相关系数
郑商所主力结算价与现货市场价格	0.86

数据来源：郑州商品交易所、金联创。

九、尿素期货运行情况

(一) 期货交易情况 (见表 2-2-77、表 2-2-78)

表 2-2-77 2022 年尿素期货月度交易情况

月度	成交量 (万手)	同比变化 (%)	成交金额 (亿元)	同比变化 (%)	月末持仓量 (万手)	同比变化 (%)
1 月	148.25	-37.37	749.86	-19.07	12.18	-13.51
2 月	135.07	-52.07	675.48	-40.51	13.28	-7.79

续表

月度	成交量 (万手)	同比变化 (%)	成交金额 (亿元)	同比变化 (%)	月末持仓量 (万手)	同比变化 (%)
3月	209.42	-57.89	1 138.74	-40.52	14.60	4.52
4月	185.95	-43.35	1 041.40	-21.16	15.39	17.25
5月	156.69	-63.89	904.00	-53.35	14.06	2.37
6月	141.78	-57.69	787.49	-49.00	13.80	26.48
7月	199.01	-19.75	885.56	-26.31	14.67	21.24
8月	241.68	-4.27	1 084.00	-8.94	14.12	43.67
9月	275.56	-36.07	1 327.03	-42.56	18.31	61.19
10月	229.53	-52.94	1 065.07	-62.33	24.97	176.71
11月	419.21	16.26	2 061.18	22.96	29.70	196.66
12月	369.21	60.22	1 887.43	74.78	25.24	132.56
总计	2 711.36	-34.24	13 607.23	-28.63	—	—

数据来源：郑州商品交易所。

表 2-2-78 2021—2022 年尿素期货年度交易情况

年度	成交量 (万手)	同比变化 (%)	成交金额 (万亿元)	同比变化 (%)	年末持仓量 (万手)	同比变化 (%)
2021年	4 123.20	147.70	1.91	239.70	10.85	94.79
2022年	2 711.36	-34.24	1.36	-28.63	25.24	132.56

数据来源：郑州商品交易所。

(二) 交割情况 (见表 2-2-79、表 2-2-80)

表 2-2-79 2022 年尿素期货月度交割情况

月度	交割量 (手)	同比变化 (%)	交割金额 (亿元)	同比变化 (%)
1月	2 596	-19.28	1.33	14.24
2月	348	2 385.71	0.18	3 150.64
3月	730	779.52	0.41	1 139.26
4月	26	—	0.02	—
5月	1 361	-19.56	0.85	15.33
6月	39	3 800.00	0.02	4 919.23
7月	443	-78.66	0.24	-77.73
8月	135	321.88	0.06	271.06
9月	1 119	-7.83	0.55	-10.61
10月	87	-65.48	0.04	-72.65
11月	96	14.29	0.05	18.95
12月	364	727.27	0.20	823.42
总计	7 344	-15.66	3.95	2.38

数据来源：郑州商品交易所。

表 2-2-80 2021—2022 年尿素期货年度交割情况

年度	交割量（手）	同比变化（%）	交割金额（亿元）	同比变化（%）
2021 年	8 708	126.30	3.86	209.84
2022 年	7 344	-15.66	3.95	2.38

数据来源：郑州商品交易所。

（三）期货价格走势（见图 2-2-9、表 2-2-81、表 2-2-82）



图 2-2-9 2022 年尿素期货和国内现货市场价格走势

数据来源：郑州商品交易所、金联创。

表 2-2-81 2022 年尿素期货和国内现货市场价格指标

市场分类	2021 年末 收盘价	2022 年盘 中最高价	2022 年盘 中最低价	2022 年末 收盘价	全年 涨跌	结算价 平均价	标准差	极差
郑商所主力价格 (元/吨)	2 428	3 064	2 044	2 544	116	2 540.91	229.91	1 020
山东尿素现货价格 (元/吨)	2 515	3 215	2 250	2 635	120	2 698.57	263.66	965

数据来源：郑州商品交易所、金联创。

表 2-2-82 2022 年尿素期货和国内现货市场价格相关性

价格选择	相关系数
郑商所主力结算价与尿素现货市场价格	0.89

数据来源：郑州商品交易所、金联创。



十、玻璃期货运行情况

（一）期货交易情况（见表 2-2-83、表 2-2-84）

表 2-2-83 2022 年玻璃期货月度交易情况

月度	成交量 (万手)	同比变化 (%)	成交金额 (亿元)	同比变化 (%)	月末持仓量 (万手)	同比变化 (%)
1 月	900.61	-57.85	3 656.15	-51.67	39.03	-33.19
2 月	1 091.30	-14.54	4 623.78	-4.51	53.85	-10.94
3 月	1 994.47	-37.56	7 876.79	-40.12	75.16	4.33
4 月	1 977.71	-19.20	7 861.03	-27.49	76.29	-9.40
5 月	1 872.21	-42.53	6 713.77	-61.38	118.65	62.99
6 月	2 576.33	76.42	8 879.12	13.87	129.44	81.08
7 月	2 201.99	49.33	6 740.72	-21.87	111.43	93.73
8 月	2 460.55	152.88	7 475.65	40.38	119.07	177.08
9 月	1 800.29	63.46	5 366.44	1.40	98.42	224.95
10 月	1 184.50	16.75	3 477.58	-22.57	121.70	225.50
11 月	2 079.67	60.01	5 800.39	28.94	133.91	208.86
12 月	2 310.75	108.82	7 128.31	76.18	109.85	168.28
总计	22 450.41	8.23	75 599.75	-19.46	—	—

数据来源：郑州商品交易所。

表 2-2-84 2021—2022 年玻璃期货年度交易情况

年度	成交量 (万手)	同比变化 (%)	成交金额 (亿元)	同比变化 (%)	年末持仓量 (万手)	同比变化 (%)
2021 年	20 743.55	11.97	93 864.12	47.65	40.95	-14.57
2022 年	22 450.41	8.23	75 599.75	-19.46	109.85	168.28

数据来源：郑州商品交易所。

（二）交割情况（见表 2-2-85、表 2-2-86）

表 2-2-85 2022 年玻璃期货月度交割情况

月度	交割量 (手)	同比变化 (%)	交割金额 (万元)	同比变化 (%)
1 月	43	-90.61	150.16	-90.76
2 月	1 038	1 976.00	4 683.46	2 345.67
3 月	312	-22.77	1 298.54	-20.48
4 月	808	-0.12	3 067.17	-10.50

续表

月度	交割量(手)	同比变化(%)	交割金额(万元)	同比变化(%)
5月	563	431.13	1 989.64	265.00
6月	220	175.00	758.12	78.87
7月	89	-25.21	262.19	-60.14
8月	471	-3.29	1 460.10	-48.68
9月	352	27.54	1 022.91	-40.63
10月	506	-62.15	1 581.76	-73.92
11月	62	-72.20	176.70	-78.41
12月	928	98.72	2 683.78	50.84
总计	5 392	11.96	19 134.52	-11.96

数据来源：郑州商品交易所。

表 2-2-86 2021—2022 年玻璃期货年度交割情况

年度	交割量(手)	同比变化(%)	交割金额(万元)	同比变化(%)
2021年	4 816	-25.71	21 734.37	23.89
2022年	5 392	11.96	19 134.52	-11.96

数据来源：郑州商品交易所。

(三) 期货价格走势(见图 2-2-10、表 2-2-87、表 2-2-88)



图 2-2-10 2022 年玻璃期货和国内现货市场价格比较

数据来源：郑州商品交易所网站、卓创资讯。

表 2-2-87 2022 年玻璃期货和国内现货市场价格指标

市场分类	2021 年末 收盘价	2022 年盘 中最高价	2022 年盘 中最低价	2022 年末 收盘价	全年涨跌	结算价 平均价	标准差	极差
郑商所主力价格 (元/吨)	1 705	2 430	1 332	1 660	-45	1 701.13	258.41	1 098
玻璃现货市场价格 (元/吨)	1 910	2 315	1 420	1 540	-370	1 737.71	229.42	895

数据来源：郑州商品交易所、卓创资讯。

表 2-2-88 2022 年玻璃期货和国内现货市场价格相关性

价格选择	相关系数
郑商所连续价格与现货市场价格	0.95

数据来源：郑州商品交易所、卓创资讯。

十一、纯碱期货运行情况

(一) 期货交易情况 (见表 2-2-89、表 2-2-90)

表 2-2-89 2022 年纯碱期货月度交易情况

月度	成交量 (万手)	同比变化 (%)	成交金额 (亿元)	同比变化 (%)	月末持仓量 (万手)	同比变化 (%)
1 月	1 685.90	89.82	8 636.96	208.80	58.32	130.35
2 月	2 224.01	242.21	12 825.95	477.11	74.57	159.98
3 月	3 296.70	28.46	17 786.31	78.20	79.03	71.95
4 月	2 577.10	49.15	15 614.35	132.87	76.07	87.08
5 月	2 550.20	2.10	14 756.98	35.45	93.77	77.25
6 月	2 623.63	132.21	15 053.15	196.90	93.54	76.94
7 月	3 181.51	194.94	15 772.53	206.99	87.87	64.88
8 月	3 042.92	94.00	14 424.94	72.01	80.30	53.34
9 月	2 852.11	31.25	13 375.45	2.14	77.11	73.45
10 月	1 837.91	-15.27	8 904.68	-34.54	87.41	158.14
11 月	3 144.31	29.41	15 569.40	26.51	128.54	204.86
12 月	4 054.99	108.15	21 257.11	129.88	106.66	109.48
总计	33 071.28	58.79	173 977.81	74.95	—	—

数据来源：郑州商品交易所。

表 2-2-90 2021—2022 年纯碱期货年度交易情况

年度	成交量 (万手)	同比变化 (%)	成交金额 (亿元)	同比变化 (%)	年末持仓量 (万手)	同比变化 (%)
2021 年	20 827.05	204.46	99 445.51	358.24	50.92	149.95
2022 年	33 071.28	58.79	173 977.81	74.95	106.66	109.48

数据来源：郑州商品交易所。

(二) 交割情况 (见表 2-2-91、表 2-2-92)

表 2-2-91 2022 年纯碱期货月度交割情况

月度	交割量 (手)	同比变化 (%)	交割金额 (万元)	同比变化 (%)
1 月	1 375	3.54	6 289.58	73.37
2 月	845	-54.20	4 769.18	-12.38
3 月	835	-62.27	4 416.39	-41.34
4 月	2 590	15.99	14 885.11	81.39
5 月	1 856	-23.78	10 654.11	16.51
6 月	6 505	80.19	39 240.66	169.99
7 月	2 988	522.50	16 234.39	741.46
8 月	2 696	-47.56	14 238.09	-40.59
9 月	3 936	11.91	20 797.91	12.59
10 月	2 988	-24.94	15 651.14	-40.44
11 月	473	-79.16	2 508.43	-80.51
12 月	1 132	-43.29	6 255.28	-41.45
总计	28 219	-9.11	155 940.28	9.29

数据来源: 郑州商品交易所。

表 2-2-92 2021—2022 年纯碱期货年度交割情况

年度	交割量 (手)	同比变化 (%)	交割金额 (万元)	同比变化 (%)
2021 年	31 049	144.67	142 681.18	281.75
2022 年	28 219	-9.11	155 940.28	9.29

数据来源: 郑州商品交易所。

(三) 期货价格走势 (见图 2-2-11、表 2-2-93、表 2-2-94)

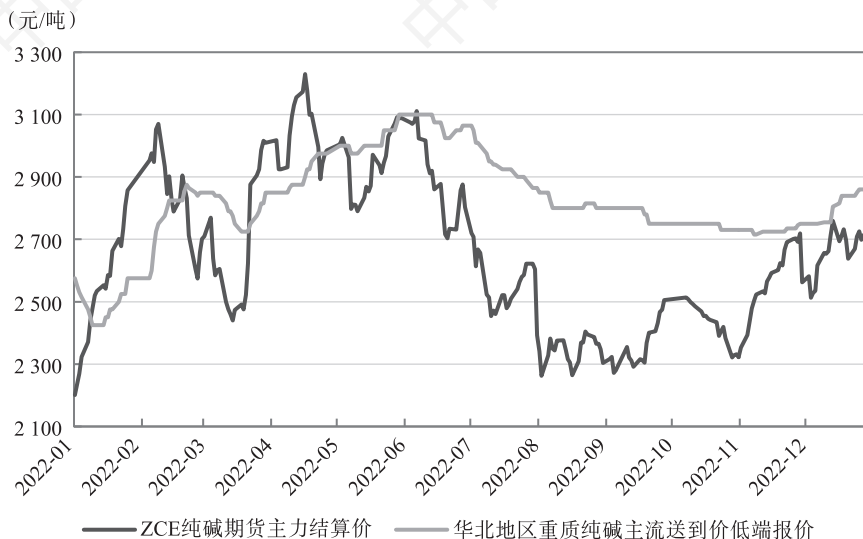


图 2-2-11 2022 年纯碱期货和国内现货市场价格比较

数据来源: 郑州商品交易所、卓创资讯。

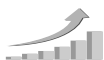


表 2-2-93 2022 年纯碱期货和国内现货市场价格指标

市场分类	2021 年末 收盘价	2022 年盘 中最高价	2022 年盘 中最低价	2022 年末 收盘价	全年 涨跌	结算价 平均价	标准差	极差
郑商所主力价格 (元/吨)	2 183	3 269	2 160	2 987	804	2 649.16	248.22	1 109
纯碱现货市场价格 (元/吨)	2 600	3 100	2 425	2 860	260	2 826.01	149.92	675

数据来源：郑州商品交易所、卓创资讯。

表 2-2-94 2022 年纯碱期货和国内现货市场价格相关性

价格选择	相关系数
郑商所连续价格与现货市场价格	0.70

数据来源：郑州商品交易所、卓创资讯。

十二、硅铁期货运行情况

（一）期货交易情况（见表 2-2-95、表 2-2-96）

表 2-2-95 2022 年硅铁期货月度交易情况

月度	成交量 (万手)	同比变化 (%)	成交金额 (亿元)	同比变化 (%)	月末持仓量 (万手)	同比变化 (%)
1 月	529.27	-40.99	2 349.07	-29.21	16.65	-0.64
2 月	468.81	0.43	2 160.58	28.97	20.52	3.34
3 月	641.05	-27.23	3 095.49	-6.43	25.53	20.51
4 月	632.88	-11.64	3 338.25	29.79	24.22	31.80
5 月	500.09	-52.71	2 243.11	-46.54	28.07	18.72
6 月	518.57	-43.92	2 311.65	-40.31	30.58	37.52
7 月	521.26	-17.56	2 012.21	-24.81	37.21	23.91
8 月	581.37	-37.40	2 280.78	-48.13	36.16	4.45
9 月	726.40	-49.39	2 939.65	-66.51	38.80	163.41
10 月	474.80	-26.08	1 948.11	-58.55	43.07	209.95
11 月	627.99	40.02	2 599.00	22.97	45.76	264.82
12 月	667.44	35.12	2 775.20	31.82	39.59	208.31
总计	6 889.93	-27.66	30 053.10	-31.25	—	—

数据来源：郑州商品交易所。

表 2-2-96 2021—2022 年硅铁期货年度交易情况

年度	成交量 (万手)	同比变化 (%)	成交金额 (亿元)	同比变化 (%)	年末持仓量 (万手)	同比变化 (%)
2021 年	9 524.12	203.86	43 710.93	368.34	12.84	27.59
2022 年	6 889.93	-27.66	30 053.10	-31.25	39.59	208.31

数据来源：郑州商品交易所。

(二) 交割情况 (见表 2-2-97、表 2-2-98)

表 2-2-97 2022 年硅铁期货月度交割情况

月度	交割量 (手)	同比变化 (%)	交割金额 (万元)	同比变化 (%)
1 月	978	-44.08	4 167.06	-33.78
2 月	524	336.67	2 352.24	489.71
3 月	4 270	505.67	20 538.70	641.67
4 月	1 144	17.09	5 975.02	78.98
5 月	1 755	-33.22	7 769.82	-21.18
6 月	2 400	0.50	11 059.90	12.20
7 月	2 126	-62.19	8 378.57	-64.17
8 月	1 945	149.04	7 730.42	120.35
9 月	3 661	-14.50	14 493.90	-37.73
10 月	1 773	91.47	7 356.39	-2.38
11 月	1 167	16.24	4 928.24	-8.02
12 月	2 453	49.48	10 547.90	50.74
总计	24 196	6.01	105 298.15	2.66

数据来源: 郑州商品交易所。

表 2-2-98 2021—2022 年硅铁期货年度交割情况

年度	交割量 (手)	同比变化 (%)	交割金额 (万元)	同比变化 (%)
2021 年	22 824	-36.53	102 572.55	-3.49
2022 年	24 196	6.01	105 298.15	2.66

数据来源: 郑州商品交易所。

(三) 期货价格走势 (见图 2-2-12、表 2-2-99、表 2-2-100)

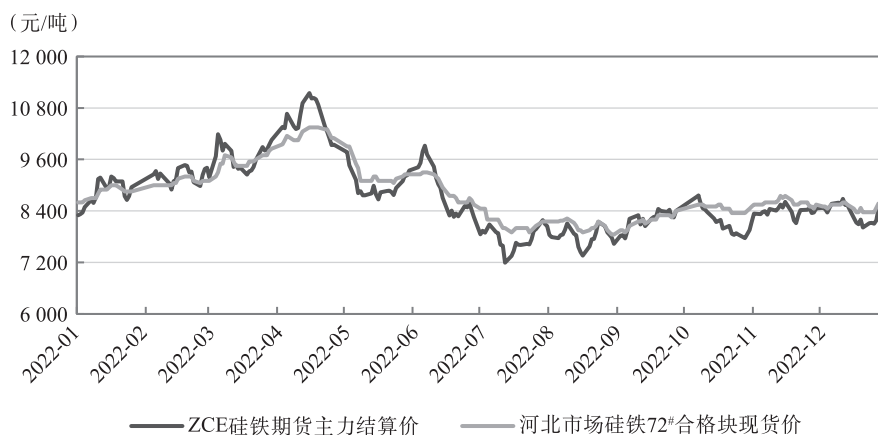


图 2-2-12 2022 年硅铁期货和国内现货市场价格比较

数据来源: 郑州商品交易所、我的钢铁网。

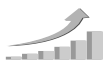


表 2-2-99 2022 年硅铁期货和国内现货市场价格指标

市场分类	2021 年末 收盘价	2022 年盘 中最高价	2022 年盘 中最低价	2022 年末 收盘价	全年 涨跌	结算价 平均价	标准差	极差
郑商所主力价格 (元/吨)	8 312	11 340	7 070	8 486	174	8 697.55	815.72	4 270
河北市场硅铁 72# 合 格块现货价 (元/吨)	8 650	10 350	7 850	8 570	-80	8 783.72	625.50	2 500

数据来源：郑州商品交易所、我的钢铁网。

表 2-2-100 2022 年硅铁期货和国内现货市场价格相关性

价格选择	相关系数
郑商所连续价格与现货市场价格	0.96

数据来源：郑州商品交易所、我的钢铁网。

十三、锰硅期货运行情况

(一) 期货交易情况 (见表 2-2-101、表 2-2-102)

表 2-2-101 2022 年锰硅期货月度交易情况

月度	成交量 (万手)	同比变化 (%)	成交金额 (亿元)	同比变化 (%)	月末持仓量 (万手)	同比变化 (%)
1 月	252.02	-69.33	1 043.43	-65.30	22.98	48.41
2 月	204.71	-51.33	848.04	-44.17	24.57	49.37
3 月	355.93	-48.93	1 550.36	-38.90	26.34	15.41
4 月	395.81	-43.42	1 734.86	-29.49	24.80	24.71
5 月	325.22	-61.62	1 354.28	-56.89	26.00	15.30
6 月	366.79	-55.11	1 498.87	-51.70	29.13	48.13
7 月	405.62	-39.62	1 501.31	-41.26	31.34	29.61
8 月	449.11	-42.84	1 624.41	-47.92	30.29	22.32
9 月	420.35	-63.16	1 515.06	-73.36	34.13	126.16
10 月	320.35	-45.73	1 145.53	-64.87	41.11	234.74
11 月	438.96	59.84	1 580.31	32.96	31.18	118.88
12 月	479.24	69.40	1 796.18	54.69	34.58	113.56
总计	4 414.11	-45.16	17 192.64	-47.49	—	—

数据来源：郑州商品交易所。

表 2-2-102 2021—2022 年锰硅期货年度交易情况

年度	成交量 (万手)	同比变化 (%)	成交金额 (亿元)	同比变化 (%)	年末持仓量 (万手)	同比变化 (%)
2021 年	8 049.61	77.73	32 740.18	119.59	16.19	7.67
2022 年	4 414.11	-45.16	17 192.64	-47.49	34.58	113.56

数据来源：郑州商品交易所。

(二) 交割情况 (见表 2-2-103、表 2-2-104)

表 2-2-103 2022 年锰硅期货月度交割情况

月度	交割量 (手)	同比变化 (%)	交割金额 (万元)	同比变化 (%)
1 月	6 550	53.40	27 086.43	75.28
2 月	1 501	3 390.70	6 143.83	3 911.23
3 月	6 293	115.07	27 154.30	139.74
4 月	2 535	50.09	11 017.11	91.43
5 月	6 840	-5.47	28 201.32	7.77
6 月	4 800	-3.61	20 188.80	6.63
7 月	3 737	89.89	14 444.89	100.76
8 月	5 884	158.52	21 453.06	141.93
9 月	11 123	27.57	39 896.15	4.95
10 月	3 352	136.06	12 382.13	45.89
11 月	481	-71.92	1 757.57	-78.05
12 月	2 724	17.26	10 449.26	10.14
总计	55 820	41.09	220 174.85	39.49

数据来源: 郑州商品交易所。

表 2-2-104 2021—2022 年锰硅期货年度交割情况

年度	交割量 (手)	同比变化 (%)	交割金额 (万元)	同比变化 (%)
2021 年	39 563	77.50	157 846.50	114.36
2022 年	55 820	41.09	220 174.85	39.49

数据来源: 郑州商品交易所。

(三) 期货价格走势 (见图 2-2-13、表 2-2-105、表 2-2-106)



图 2-2-13 2022 年锰硅期货和国内现货市场价格比较

数据来源: 郑州商品交易所、我的钢铁网。



表 2-2-105 2022 年锰硅期货和国内现货市场价格指标

市场分类	2021 年末 收盘价	2022 年盘 中最高价	2022 年盘 中最低价	2022 年末 收盘价	全年 涨跌	结算价 平均价	标准差	极差
郑商所主力价格 (元/吨)	8 178	9 170	6 750	7 684	-494	7 842.48	623.51	2 420
江苏市场锰硅 FeMn65Si17 现货价格 (元/吨)	8 100	8 750	7 340	7 660	-440	7 966.57	478.54	1 410

数据来源：郑州商品交易所、我的钢铁网。

表 2-2-106 2022 年锰硅期货和国内现货市场价格相关性

价格选择	相关系数
郑商所连续价格与现货市场价格	0.95

数据来源：郑州商品交易所、我的钢铁网。

十四、苹果期货运行情况

(一) 期货交易情况（见表 2-2-107、表 2-2-108）

表 2-2-107 2022 年苹果期货月度交易情况

月度	成交量 (万手)	同比变化 (%)	成交金额 (亿元)	同比变化 (%)	月末持仓量 (万手)	同比变化 (%)
1 月	394.32	-52.71	3 349.03	-35.26	20.35	-54.46
2 月	261.86	-58.39	2 385.31	-39.50	22.24	-57.24
3 月	384.75	-69.51	3 542.12	-51.94	21.31	-64.14
4 月	611.06	-52.66	5 523.07	-25.88	26.12	-47.71
5 月	460.08	-62.17	4 247.40	-42.11	29.24	-36.27
6 月	417.21	-56.64	3 707.72	-38.39	27.36	-34.46
7 月	403.95	-36.47	3 559.14	-7.86	27.63	-35.34
8 月	330.72	-40.15	2 946.98	-11.29	31.30	-26.87
9 月	384.71	-47.17	3 299.01	-22.87	28.49	0.76
10 月	360.48	-62.26	2 980.00	-59.01	27.93	0.80
11 月	392.12	-55.55	3 193.91	-54.98	30.14	14.78
12 月	352.60	-41.29	2 822.79	-43.03	26.49	13.82
总计	4 753.86	-54.94	41 556.47	-38.96	—	—

数据来源：郑州商品交易所。

表 2-2-108 2021—2022 年苹果期货年度交易情况

年度	成交量 (万手)	同比变化 (%)	成交金额 (亿元)	同比变化 (%)	年末持仓量 (万手)	同比变化 (%)
2021 年	10 549.27	67.42	68 075.41	45.58	23.27	-29.31
2022 年	4 753.86	-54.94	41 556.47	-38.96	26.49	13.82

数据来源：郑州商品交易所。

(二) 交割情况 (见表 2-2-109、表 2-2-110)

表 2-2-109 2022 年苹果期货月度交割情况

月度	交割量 (手)	同比变化 (%)	交割金额 (万元)	同比变化 (%)
1 月	170	-19.81	1 464.64	17.85
2 月	23	—	199.80	—
3 月	51	-37.80	443.38	4.61
4 月	149	—	1 452.97	—
5 月	108	-1.82	1 076.14	68.84
6 月	24	300	234.02	571.74
7 月	0	—	0	—
8 月	0	—	0	—
9 月	0	—	0	—
10 月	223	-44.11	1 914.83	-34.15
11 月	162	852.94	1 442.09	1 022.16
12 月	561	312.50	4 873.90	339.38
总计	1 471	52.91	13 101.78	102.04

数据来源：郑州商品交易所。

表 2-2-110 2021—2022 年苹果期货年度交割情况

年度	交割量 (手)	同比变化 (%)	交割金额 (万元)	同比变化 (%)
2021 年	962	29.30	6 484.68	27.94
2022 年	1 471	52.91	13 101.78	102.04

数据来源：郑州商品交易所。

(三) 期货价格走势 (见图 2-2-14、表 2-2-111、表 2-2-112)



图 2-2-14 2022 年苹果期货和国内现货市场价格走势

数据来源：郑州商品交易所、卓创资讯。



表 2-2-111 2022 年苹果期货和国内现货市场价格指标

市场分类	2021 年末 收盘价	2022 年盘 中最高价	2022 年盘 中最低价	2022 年末 收盘价	全年 涨跌	结算价 均价	标准差	极差
郑商所主力价格 (元/吨)	8 394	10 666	7 571	7 880	-514	8 747.93	517.18	3 095
山东栖霞 80#纸袋红 富士价格 (元/吨)	6 800	10 000	7 000	7 600	800	8 619.01	605.60	3 000

数据来源：郑州商品交易所、卓创资讯。

表 2-2-112 2022 年苹果期货和国内现货市场价格相关性

价格选择	相关系数
郑商所连续价格与现货市场价格	0.55

数据来源：郑州商品交易所、卓创资讯。

十五、红枣期货运行情况

(一) 期货交易情况 (见表 2-2-113、表 2-2-114)

表 2-2-113 2022 年红枣期货月度交易情况

月度	成交量 (万手)	同比变化 (%)	成交金额 (亿元)	同比变化 (%)	月末持仓量 (万手)	同比变化 (%)
1 月	50.43	7.93	332.08	38.43	6.26	117.24
2 月	27.00	-36.34	186.74	-15.90	5.87	55.14
3 月	38.62	-30.48	238.60	-16.02	5.20	67.42
4 月	43.74	-1.19	258.74	17.64	4.46	9.86
5 月	34.91	-74.14	216.97	-64.68	4.75	20.49
6 月	42.43	-72.97	240.47	-64.87	5.59	-1.29
7 月	54.98	-87.97	317.79	-87.09	4.77	-67.94
8 月	37.76	-91.50	224.86	-92.54	4.23	-71.29
9 月	26.56	-91.53	161.56	-92.75	3.20	-77.27
10 月	20.45	-94.34	117.51	-95.67	3.45	-75.29
11 月	31.07	-88.57	171.53	-92.04	3.67	-71.21
12 月	50.16	-51.83	263.33	-67.38	5.03	-41.25
总计	458.10	-81.17	2 730.18	-82.55	—	—

数据来源：郑州商品交易所。

表 2-2-114 2021—2022 年红枣期货年度交易情况

年度	成交量 (万手)	同比变化 (%)	成交金额 (亿元)	同比变化 (%)	年末持仓量 (万手)	同比变化 (%)
2021 年	2 432.82	272.78	15 649.86	377.14	8.57	218.76
2022 年	458.10	-81.17	2 730.18	-82.55	5.03	-41.25

数据来源：郑州商品交易所。

(二) 交割情况 (见表 2-2-115、表 2-2-116)

表 2-2-115 2022 年红枣期货月度交割情况

月度	交割量 (手)	同比变化 (%)	交割金额 (万元)	同比变化 (%)
1 月	1 705	1 408.85	10 941.07	1 882.98
2 月	0	—	0	—
3 月	1 227	373.75	8 013.90	510.51
4 月	0	—	0	—
5 月	2 403	516.15	13 792.18	658.16
6 月	0	—	0	—
7 月	2 277	921.08	12 117.01	1 205.49
8 月	0	—	0	—
9 月	4 746	2 847.83	24 961.42	2 935.60
10 月	0	—	0	—
11 月	0	—	0	—
12 月	202	-88.43	1 091.36	-91.66
总计	12 560	334.30	70 916.93	282.90

数据来源：郑州商品交易所。

表 2-2-116 2021—2022 年红枣期货年度交割情况

年度	交割量 (手)	同比变化 (%)	交割金额 (万元)	同比变化 (%)
2021 年	2 892	278.04	18 520.83	401.56
2022 年	12 560	334.30	70 916.93	282.90

数据来源：郑州商品交易所。

(三) 期货价格走势 (见图 2-2-15、表 2-2-117、表 2-2-118)



图 2-2-15 2022 年红枣期货和国内现货市场价格走势

数据来源：郑州商品交易所、卓创资讯。

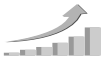


表 2-2-117 2022 年红枣期货和国内现货市场价格指标

市场分类	2021 年末 收盘价	2022 年盘 中最高价	2022 年盘 中最低价	2022 年末 收盘价	全年 涨跌	结算价 平均价	标准差	极差
郑商所主力价格 (元/吨)	14 180	14 430	9 925	10 190	-3 990	11 871	913.69	4 505
红枣现货市场价格 (元/吨)	12 200	12 700	10 400	10 400	-1 800	11 789	551.60	2 300

数据来源：郑州商品交易所、卓创资讯。

表 2-2-118 2022 年红枣期货和国内现货市场价格相关性

价格选择	相关系数
郑商所连续价格与现货市场价格	0.66

数据来源：郑州商品交易所、卓创资讯。

十六、棉纱期货运行情况

（一）期货交易情况（见表 2-2-119）

表 2-2-119 2021—2022 年棉纱期货年度交易情况

年度	成交量 (万手)	同比变化 (%)	成交金额 (亿元)	同比变化 (%)	年末持仓量 (手)	同比变化 (%)
2021 年	293.97	22.45	3 739.75	53.25	2 928	-64.73
2022 年	84.01	-71.42	976.92	-73.88	3 338	14.00

数据来源：郑州商品交易所。

（二）交割情况（见表 2-2-120）

表 2-2-120 2021—2022 年棉纱期货年度交割情况

年度	交割量（手）	同比变化（%）	交割金额（万元）	同比变化（%）
2021 年	1 532	219.17	17 534.07	305.06
2022 年	1 616	5.48	20 451.46	16.64

数据来源：郑州商品交易所。

(三) 期货价格走势 (见图 2-2-16、表 2-2-121、表 2-2-122)



图 2-2-16 2022 年棉纱期货和国内现货市场价格走势

数据来源：郑州商品交易所、中国棉纺织信息网。

表 2-2-121 2022 年棉纱期货和国内现货市场价格指标

市场分类	2021 年末 收盘价	2022 年盘 中最高价	2022 年盘 中最低价	2022 年末 收盘价	全年 涨跌	结算价 均价	标准差	极差
郑商所主力价格 (元/吨)	27 840	29 570	19 000	21 680	-6 160	24 419	3 362.96	10 570
棉纱现货价格指数 CYC32 (元/吨)	28 080	29 700	21 790	22 500	-5 580	25 847	2 716.58	7 910

数据来源：郑州商品交易所、中国棉纺织信息网。

表 2-2-122 2022 年棉纱期货和国内现货市场价格相关性

价格选择	相关系数
郑商所主力结算价与现货市场价格	0.96

数据来源：郑州商品交易所、中国棉纺织信息网。

十七、油菜籽期货运行情况

（一）期货交易情况（见表 2-2-123、表 2-2-124）

表 2-2-123 2021—2022 年油菜籽期货年度交易情况

年度	成交量 (手)	同比变化 (%)	成交金额 (亿元)	同比变化 (%)	年末持仓量 (手)	同比变化 (%)
2021 年	8 173	243.69	4.90	305.86	12	—
2022 年	6 936	-15.14	4.44	-9.39	7	-41.67

数据来源：郑州商品交易所。

表 2-2-124 2021—2022 年油菜籽期货内外盘交易情况

年度	成交量 (手)		年末持仓量 (手)	
	郑商所 (ZCE)	ICE (洲际交易所)	郑商所 (ZCE)	ICE (洲际交易所)
2021 年	8 173	5 915 237	12	176 502
2022 年	6 936	6 149 845	7	223 369

注：郑商所油菜籽期货交易单位为 10 吨/手；ICE 油菜籽期货交易单位为 20 吨/手。

数据来源：郑州商品交易所、ICE（洲际交易所）。

（二）交割情况

2022 年，郑商所油菜籽期货无交割。

（三）期货价格走势（见图 2-2-17、表 2-2-125、表 2-2-126）



图 2-2-17 2022 年油菜籽期货内外盘和国内现货市场价格走势

数据来源：郑州商品交易所、ICE（洲际交易所）、国家粮油信息中心。

表 2-2-125 2022 年油菜籽期货内外盘和国内现货市场价格指标

市场分类	2021 年末 收盘价	2022 年盘 中最高价	2022 年盘 中最低价	2022 年末 收盘价	全年涨跌	结算价 平均价	标准差	极差
郑商所主力价格 (元/吨)	5 945	6 975	5 565	5 982	37	6 219.03	307.70	1 410
ICE 连续价格 (加元/吨)	1 012.8	1 220.9	766	858.4	-154.4	970.74	133.69	454.9
四川成都油菜籽现货 价格 (元/吨)	6 550	7 300	6 550	7 200	650	6 811.57	209.71	750

数据来源：郑州商品交易所、ICE（洲际交易所）、国家粮油信息中心。

表 2-2-126 2022 年油菜籽期货内外盘和国内现货市场价格相关性

价格选择	相关系数
郑商所主力结算价与 ICE 连续价格	0.30
郑商所主力结算价与现货市场价格	0.12

数据来源：郑州商品交易所、ICE（洲际交易所）、国家粮油信息中心。

十八、强麦期货运行情况

(一) 期货交易情况（见表 2-2-127、表 2-2-128）

表 2-2-127 2021—2022 年强麦期货年度交易情况

年度	成交量 (手)	同比变化 (%)	成交金额 (亿元)	同比变化 (%)	年末持仓量 (手)	同比变化 (%)
2021 年	13 421	-58.18	7.51	-55.06	97	-82.71
2022 年	46 987	250.10	32.75	336.09	48	-50.52

数据来源：郑州商品交易所。

表 2-2-128 2021—2022 年强麦期货内外盘年度交易情况

年度	成交量 (手)		年末持仓量 (手)	
	郑商所 (ZCE)	CME Group (芝加哥 商业交易所集团)	郑商所 (ZCE)	CME Group (芝加哥 商业交易所集团)
2021 年	13 421	29 977 000	97	353 764
2022 年	46 987	25 955 569	48	333 740

注：郑商所强麦期货交易单位为 20 吨/手；芝加哥商业交易所集团软红冬小麦期货交易单位为 5 000 蒲式耳/手。

数据来源：郑州商品交易所、CME Group（芝加哥商业交易所集团）。

(二) 交割情况 (见表 2-2-129)

表 2-2-129 2021—2022 年强麦期货年度交割情况

年度	交割量 (手)	同比变化 (%)	交割金额 (万元)	同比变化 (%)
2021 年	224	1 217.65	1 181.38	1 311.28
2022 年	0	-100	0	-100

数据来源: 郑州商品交易所。

(三) 期货价格走势 (见图 2-2-18、表 2-2-130、表 2-2-131)



图 2-2-18 2022 年强麦期货内外盘和国内现货市场价格走势

数据来源: 郑州商品交易所、CME Group (芝加哥商业交易所集团)、国家粮油信息中心。

表 2-2-130 2022 年强麦期货内外盘和国内现货市场价格指标

市场分类	2021 年末 收盘价	2022 年盘 中最高价	2022 年盘 中最低价	2022 年末 收盘价	全年 涨跌	结算价 平均价	标准差	极差
郑商所主力价格 (元/吨)	2 946	3 761	2 907	3 284	338	3 297.53	194.03	854
CME Group 软红冬小 麦近月连续价格 (美分/蒲式耳)	771	1 350.00	702.50	791	20	901.67	148.41	647.50
河南郑州郑麦 366 进 厂价格 (元/吨)	2 980	3 460	2 980	3 370	390	3 256.24	135.62	480

数据来源: 郑州商品交易所、CME Group (芝加哥商业交易所集团)、国家粮油信息中心。

表 2-2-131 2022 年强麦期货内外盘和国内现货市场价格相关性

价格选择	相关系数
郑商所主力结算价与 CME Group 连续价格	0.35
郑商所主力结算价与现货市场价格	0.75

数据来源：郑州商品交易所、CME Group（芝加哥商业交易所集团）、国家粮油信息中心。

十九、普麦期货运行情况

（一）期货交易情况（见表 2-2-132、表 2-2-133）

表 2-2-132 2021—2022 年普麦期货年度交易情况

年度	成交量 (手)	同比变化 (%)	成交金额 (万元)	同比变化 (%)	年末持仓量 (手)	同比变化 (%)
2021 年	389	-48.61	4 906	-44.02	0	-100
2022 年	471	21.08	6 951	41.68	0	—

数据来源：郑州商品交易所。

表 2-2-133 2021—2022 年普麦期货内外盘年度交易情况

年度	成交量（手）		年末持仓量（手）	
	郑商所 (ZCE)	CME Group（芝加哥 商业交易所集团）	郑商所 (ZCE)	CME Group（芝加哥 商业交易所集团）
2021 年	389	29 977 000	0	353 764
2022 年	471	25 955 569	0	333 740

注：郑商所普麦期货交易单位为 50 吨/手；芝加哥商业交易所集团软红冬小麦期货交易单位为 5 000 蒲式耳/手。

数据来源：郑州商品交易所、CME Group（芝加哥商业交易所集团）。

（二）交割情况（见表 2-2-134）

表 2-2-134 2021—2022 年普麦期货年度交割情况

年度	交割量（手）	同比变化（%）	交割金额（万元）	同比变化（%）
2021 年	2	—	24.51	—
2022 年	0	-100	0	-100

数据来源：郑州商品交易所。

(三) 期货价格走势 (见图 2-2-19、表 2-2-135、表 2-2-136)



图 2-2-19 2022 年普麦期货内外盘和国内现货市场价格走势

数据来源：郑州商品交易所、CME Group（芝加哥商业交易所集团）、国家粮油信息中心。

表 2-2-135 2022 年普麦期货内外盘和国内现货市场价格指标

市场分类	2021 年末 收盘价	2022 年盘 中最高价	2022 年盘 中最低价	2022 年末 收盘价	全年 涨跌	结算价 平均价	标准差	极差
郑商所主力价格 (元/吨)	2 422	3 381	2 359	3 043	621	2 822.52	284.65	1 022
CME Group 软红冬小 麦近月连续价格 (美分/蒲式耳)	771	1 350.00	702.50	791	20	901.67	148.41	647.50
河南郑州普通小麦进 厂价格 (元/吨)	2 860	3 310	2 860	3 210	350	3 130.17	121.84	450

数据来源：郑州商品交易所、CME Group（芝加哥商业交易所集团）、国家粮油信息中心。

表 2-2-136 2022 年普麦期货内外盘和国内现货市场价格相关性

价格选择	相关系数
郑商所主力结算价与 CME Group 连续价格	-0.21
郑商所主力结算价与现货市场价格	0.46

数据来源：郑州商品交易所、CME Group（芝加哥商业交易所集团）、国家粮油信息中心。

二十、早籼稻期货运行情况

(一) 期货交易情况 (见表 2-2-137、表 2-2-138)

表 2-2-137 2021—2022 年早籼稻期货年度交易情况

年度	成交量 (手)	同比变化 (%)	成交金额 (万元)	同比变化 (%)	年末持仓量 (手)	同比变化 (%)
2021 年	311	-84.07	1 701	-83.52	1	—
2022 年	403	29.58	2 366	39.09	0	-100

数据来源：郑州商品交易所。

表 2-2-138 2021—2022 年早籼稻期货内外盘年度交易情况

年度	成交量 (手)		年末持仓量 (手)	
	郑商所 (ZCE)	CME Group (芝加哥 商业交易所集团)	郑商所 (ZCE)	CME Group (芝加哥 商业交易所集团)
2021 年	311	221 775	1	7 469
2022 年	403	245 747	0	7 325

注：郑商所早籼稻期货交易单位为 20 吨/手；芝加哥商业交易所集团糙米期货交易单位为 2 000 英担/手。
数据来源：郑州商品交易所、CME Group (芝加哥商业交易所集团)。

(二) 交割情况

2022 年，郑商所早籼稻期货无交割。

(三) 期货价格走势 (见图 2-2-20、表 2-2-139、表 2-2-140)



图 2-2-20 2022 年早籼稻期货内外盘和国内现货市场价格走势

数据来源：郑州商品交易所、CME Group (芝加哥商业交易所集团)、国家粮油信息中心。

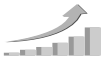


表 2-2-139 2022 年早籼稻期货内外盘和国内现货市场价格指标

市场分类	2021 年末 收盘价	2022 年盘 中最高价	2022 年盘 中最低价	2022 年末 收盘价	全年 涨跌	结算价 平均价	标准差	极差
郑商所主力价格 (元/吨)	2 718	3 161	2 500	2 479	- 239	2 714. 68	207. 51	661
CME Group 糙米近月 连续价格 (美元/英担)	14. 86	18. 20	14. 10	18. 05	3. 19	16. 52	0. 92	4. 10
湖南长沙早籼稻收购 价格 (元/吨)	2 720	2 740	2 680	2 680	- 40	2 708. 06	18. 83	60

数据来源：郑州商品交易所、CME Group（芝加哥商业交易所集团）、国家粮油信息中心。

表 2-2-140 2022 年早籼稻期货内外盘和国内现货市场价格相关性

价格选择	相关系数
郑商所主力结算价与 CME Group 连续价格	- 0. 44
郑商所主力结算价与现货市场价格	0. 70

数据来源：郑州商品交易所、CME Group（芝加哥商业交易所集团）、国家粮油信息中心。

二十一、晚籼稻期货运行情况

（一）期货交易情况（见表 2-2-141、表 2-2-142）

表 2-2-141 2021—2022 年晚籼稻期货年度交易情况

年度	成交量 (手)	同比变化 (%)	成交金额 (万元)	同比变化 (%)	年末持仓量 (手)	同比变化 (%)
2021 年	0	- 100	0	- 100	0	—
2022 年	566	—	3 352	—	0	—

数据来源：郑州商品交易所。

表 2-2-142 2021—2022 年晚籼稻期货内外盘年度交易情况

年度	成交量 (手)		年末持仓量 (手)	
	郑商所 (ZCE)	CME Group (芝加哥 商业交易所集团)	郑商所 (ZCE)	CME Group (芝加哥 商业交易所集团)
2021 年	0	221 775	0	7 469
2022 年	566	245 747	0	7 325

注：郑商所晚籼稻期货交易单位为 20 吨/手；芝加哥商业交易所集团糙米期货交易单位为 2 000 英担/手。

数据来源：郑州商品交易所、CME Group（芝加哥商业交易所集团）。

(二) 交割情况

2022年，郑商所晚籼稻期货无交割。

(三) 期货价格走势（见图 2-2-21、表 2-2-143、表 2-2-144）

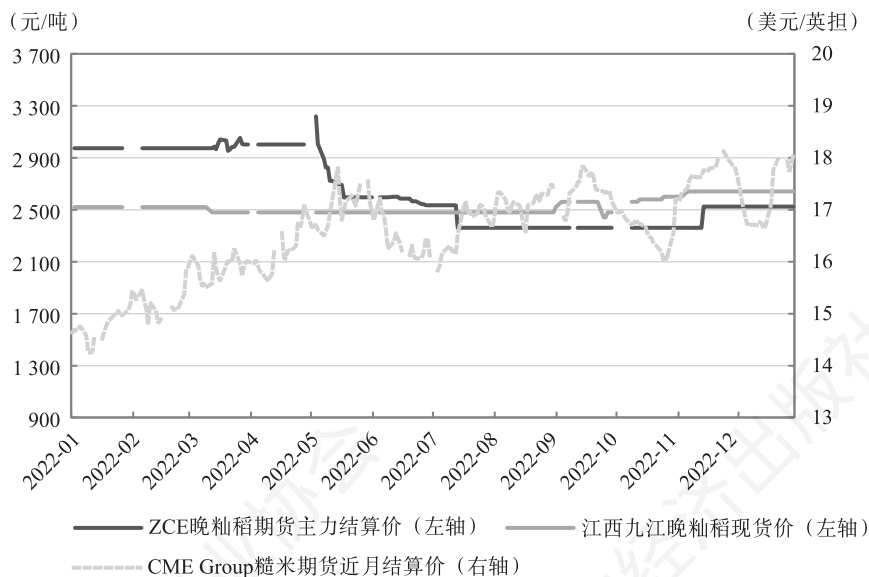


图 2-2-21 2022 年晚籼稻期货内外盘和国内现货市场价格走势

数据来源：郑州商品交易所、CME Group（芝加哥商业交易所集团）、国家粮油信息中心。

表 2-2-143 2022 年晚籼稻期货内外盘和国内现货市场价格指标

市场分类	2021 年末 收盘价	2022 年盘 中最高价	2022 年盘 中最低价	2022 年末 收盘价	全年 涨跌	结算价 平均价	标准差	极差
郑商所主力价格 (元/吨)	2 973	3 422	2 535	2 525	-448	2 636.34	263.64	887
CME Group 糙米近月 连续价格 (美元/英担)	14.86	18.20	14.10	18.05	3.19	16.52	0.92	4.10
江西九江晚籼稻出库 价格(元/吨)	2 520	2 640	2 440	2 640	120	2 526.78	60.31	200

数据来源：郑州商品交易所、CME Group（芝加哥商业交易所集团）、国家粮油信息中心。

表 2-2-144 2022 年晚籼稻期货内外盘和国内现货市场价格相关性

价格选择	相关系数
郑商所主力结算价与 CME Group 连续价格	-0.72
郑商所主力结算价与现货市场价格	-0.30

数据来源：郑州商品交易所、CME Group（芝加哥商业交易所集团）、国家粮油信息中心。

二十二、粳稻期货运行情况

(一) 期货交易情况 (见表 2-2-145)

表 2-2-145 2021—2022 年粳稻期货年度交易情况

年度	成交量 (手)	同比变化 (%)	成交金额 (万元)	同比变化 (%)	年末持仓量 (手)	同比变化 (%)
2021 年	2 564	-78.28	14 456	-78.65	5	25.00
2022 年	986	-61.54	5 819	-59.75	0	-100

数据来源：郑州商品交易所。

(二) 交割情况

2022 年，郑商所粳稻期货无交割。

(三) 期货价格走势 (见图 2-2-22、表 2-2-146、表 2-2-147)

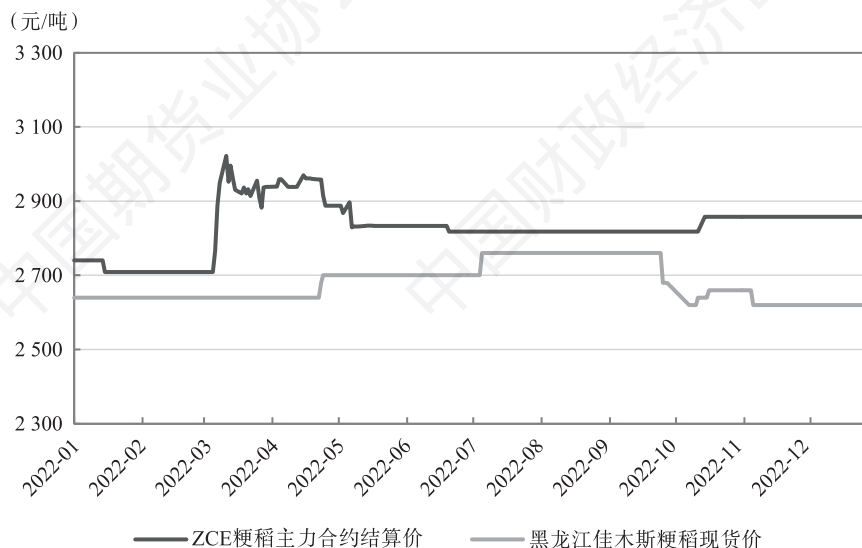


图 2-2-22 2022 年粳稻期货和国内现货市场价格走势

数据来源：郑州商品交易所、国家粮油信息中心。

表 2-2-146 2022 年粳稻期货和国内现货市场价格指标

市场分类	2021 年末 收盘价	2022 年盘 中最高价	2022 年盘 中最低价	2022 年末 收盘价	全年 涨跌	结算价 平均价	标准差	极差
郑商所主力价格 (元/吨)	2 702	3 139	2 400	2 758	56	2 829.70	66.27	739

续表

市场分类	2021 年末 收盘价	2022 年盘 中最高价	2022 年盘 中最低价	2022 年末 收盘价	全年 涨跌	结算价 平均价	标准差	极差
黑龙江佳木斯圆粒粳 稻出库价格（元/吨）	2 640	2 760	2 620	2 620	-20	2 678.43	52.44	140

数据来源：郑州商品交易所、国家粮油信息中心。

表 2-2-147 2022 年粳稻期货和国内现货市场价格相关性

价格选择	相关系数
郑商所连续价格与现货市场价格	0.40

数据来源：郑州商品交易所、国家粮油信息中心。

二十三、动力煤期货、期权运行情况

(一) 期货、期权交易情况（见表 2-2-148 ~ 表 2-2-150）

表 2-2-148 2021—2022 年动力煤期货年度交易情况

年度	成交量 (手)	同比变化 (%)	成交金额 (亿元)	同比变化 (%)	年末持仓量 (手)	同比变化 (%)
2021 年	84 236 073	37.70	63 165.99	70.18	33 534	-85.39
2022 年	479 453	-99.43	373.58	-99.41	0	-100

数据来源：郑州商品交易所。

表 2-2-149 2021—2022 年动力煤期货内外盘年度交易情况

年度	成交量（手）		年末持仓量（手）	
	郑商所 (ZCE)	CME Group（芝加哥 商业交易所集团）	郑商所 (ZCE)	CME Group（芝加哥 商业交易所集团）
2021 年	84 236 073	153 051	33 534	16 846
2022 年	479 453	56 889	0	7 567

注：郑商所动力煤期货交易单位为 100 吨/手；芝加哥商业交易所集团北欧三港（API2）交易单位为 1 000 吨/手。

数据来源：郑州商品交易所、CME Group（芝加哥商业交易所集团）。

表 2-2-150 2021—2022 年动力煤期权年度交易情况

年度	成交量 (手)	同比变化 (%)	成交量 看跌/看涨 (PCR)	成交金额 (亿元)	同比变化 (%)	年末持仓量 (手)	同比变化 (%)
2021 年	7 864 306	120.54	1.36	168.78	411.45	11 766	-86.87
2022 年	123 517	-98.43	0.53	3.86	-97.71	2	-99.98

数据来源：郑州商品交易所。

(二) 交割、行权情况 (见表 2-2-151、表 2-2-152)

表 2-2-151 2021—2022 年动力煤期货年度交割情况

年度	交割量 (手)	同比变化 (%)	交割金额 (万元)	同比变化 (%)
2021 年	12 801	-78.88	97 346.17	-70.60
2022 年	25	-99.80	207.15	-99.79

数据来源: 郑州商品交易所。

表 2-2-152 2021—2022 年动力煤期权年度行权情况

年度	行权量 (手)	同比变化 (%)
2021 年	62 215	71.67
2022 年	1 426	-97.71

数据来源: 郑州商品交易所。

(三) 期货价格走势 (见图 2-2-23、表 2-2-153、表 2-2-154)

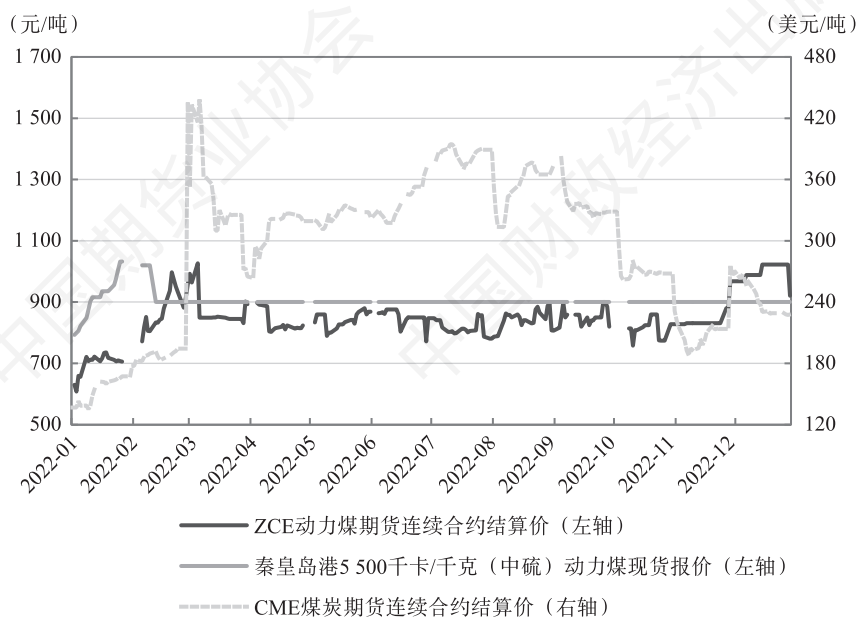


图 2-2-23 2022 年动力煤期货内外盘和国内现货市场价格走势

数据来源: 郑州商品交易所、CME Group (芝加哥商业交易所集团)、中国煤炭市场网。

表 2-2-153 2022 年动力煤期货内外盘和国内现货市场价格指标

市场分类	2021 年末 收盘价	2022 年盘 中最高价	2022 年盘 中最低价	2022 年末 收盘价	全年 涨跌	结算价 平均价	标准差	极差
郑商所主力价格 (元/吨)	672.2	1 150	680	921	248.8	869.14	81.53	470

续表

市场分类	2021 年末 收盘价	2022 年盘 中最高价	2022 年盘 中最低价	2022 年末 收盘价	全年 涨跌	结算价 平均价	标准差	极差
CME 煤炭期货近月结 算价 (美元/吨)	136.75	438.35	135	227.9	91.15	290.39	73.58	303.35
秦皇岛港 5 500 千卡/ 千克 (中硫) 动力煤 平仓价格 (元/吨)	793	1 032	793	900	107	903.46	26.50	239

数据来源：郑州商品交易所、CME Group（芝加哥商业交易所集团）、中国煤炭市场网。

表 2-2-154 2022 年动力煤期货内外盘和国内现货市场价格相关性

价格选择	相关系数
郑商所连续价格与 CME 连续价格	0.16
郑商所连续价格与现货市场价格	0.16

数据来源：郑州商品交易所、CME Group（芝加哥商业交易所集团）、中国煤炭市场网。

>>> 第三节 大连商品交易所上市品种运行情况

大连商品交易所（以下简称大商所，DCE）2022 年全年累计成交量 22.75 亿手，占全国期货市场成交量的 33.62%，同比下降 3.77%；全年累计成交额 123.73 万亿元，占全国期货市场成交额的 23.13%，同比下降 11.91%。目前，对外开放的品种有铁矿石期货和期权、棕榈油期货和期权、聚乙烯期货和期权、黄大豆 1 号期货和期权、黄大豆 2 号期货和期权、豆粕期货和期权、豆油期货和期权。截至 2022 年底，共有来自 11 个国家和地区的 74 家境外中介机构在大商所备案，参与特定品种交易。成交较为活跃的品种有豆粕、聚氯乙烯、棕榈油、铁矿石、豆油、聚丙烯、聚乙烯、玉米、乙二醇、苯乙烯、玉米淀粉、液化石油气、黄大豆 1 号、鸡蛋、黄大豆 2 号、焦煤、焦炭、生猪；成交较为低迷的品种有：粳米、纤维板、胶合板，单个品种年成交量在全国占比不足 0.1%。2022 年大商所新上市的品种有黄大豆 1 号期权、黄大豆 2 号期权、豆油期权。

一、黄大豆 1 号期货、期权运行情况

2022 年 8 月 8 日，黄大豆 1 号期权在大商所上市交易。

(一) 期货、期权交易情况 (见表 2-3-1 ~ 表 2-3-5)

表 2-3-1 2022 年黄大豆 1 号期货月度交易情况

月度	成交量 (万手)	同比变化 (%)	成交金额 (亿元)	同比变化 (%)	月末持仓量 (万手)	同比变化 (%)
1 月	361.58	0.05	2 144.32	3.19	16.43	73.04
2 月	330.14	33.07	2 037.65	42.12	16.9	59.89
3 月	343.14	-27.85	2 127.45	-24.61	19.76	58.41
4 月	217.09	-51.66	1 333.84	-48.67	16.34	24.28
5 月	214.29	-40.96	1 331.89	-38.88	20.28	16.1
6 月	262.39	-38.55	1 600.19	-34.23	19.01	-17.63
7 月	295.38	-40.42	1 710.31	-40.55	15.49	-34.86
8 月	312.51	-35.44	1 875.13	-33.01	13.25	-36
9 月	286.58	-29.19	1 679.11	-29.59	18.86	0.31
10 月	241.75	-22.02	1 381.96	-27.34	22.95	4.72
11 月	295.07	-35.23	1 646.61	-42.72	18	-15.53
12 月	325.9	-32.34	1 748.15	-39.33	25.8	4.15
总计	3 485.82	-29.66	20 616.61	-29.55	—	—

数据来源：大连商品交易所。

表 2-3-2 2021—2022 年黄大豆 1 号期货年度交易情况

年度	成交量 (万手)	同比变化 (%)	成交金额 (亿元)	同比变化 (%)	年末持仓量 (万手)	同比变化 (%)
2021 年	4 955.84	-16.63	29 263.77	4.63	24.77	130.43
2022 年	3 485.82	-29.66	20 616.61	-29.55	25.8	4.15

数据来源：大连商品交易所。

表 2-3-3 2021—2022 年黄大豆 1 号期货内外盘年度交易情况

年度	成交量 (万手)		年末持仓量 (万手)	
	大商所 (DCE)	CME Group (芝加哥商业交易所集团)	大商所 (DCE)	CME Group (芝加哥商业交易所集团)
2021 年	4 955.84	5 332.45	24.77	63.16
2022 年	3 485.82	5 172.08	25.8	59.04

注：大商所黄大豆 1 号期货交易单位为 10 吨/手；芝加哥商业交易所集团大豆期货交易单位为 5 000 蒲式耳/手。

数据来源：大连商品交易所、CME Group (芝加哥商业交易所集团)。

表 2-3-4 2022 年黄大豆 1 号期权年度交易情况

年度	成交量 (万手)	同比变化 (%)	成交量 看跌/看涨 (PCR)	成交金额 (亿元)	同比变化 (%)	年末持仓量 (万手)	同比变化 (%)
2022 年	182.65	—	1.47	6.15	—	5.12	—

数据来源：大连商品交易所。

表 2-3-5 2022 年黄大豆 1 号期权内外盘年度交易情况

年度	成交量 (万手)		年末持仓量 (万手)	
	大商所 (DCE)	CME Group (芝加哥 商业交易所集团)	大商所 (DCE)	CME Group (芝加哥 商业交易所集团)
2022 年	182.65	1 672.77	5.12	37.89

注：大商所黄大豆 1 号期权交易单位为 1 手（10 吨）黄大豆 1 号期货合约，芝加哥商业交易所集团大豆期权交易单位为 1 手（5 000 蒲式耳）大豆期货合约。

数据来源：大连商品交易所、CME Group（芝加哥商业交易所集团）。

（二）交割、行权情况（见表 2-3-6~表 2-3-8）

表 2-3-6 2022 年黄大豆 1 号期货月度交割情况

月度	交割量 (手)	同比变化 (%)	交割金额 (亿元)	同比变化 (%)
1 月	2 520	-52.39	1.49	-50.68
3 月	7 294	423.24	4.44	440.42
5 月	6 718	-33.75	4.09	-33.1
7 月	7 427	601.32	4.38	617.66
9 月	4 378	36.26	2.58	39.77
11 月	1 778	-65.1	1.02	-67.89
总计	30 115	14.96	18.00	15.41

数据来源：大连商品交易所。

表 2-3-7 2021—2022 年黄大豆 1 号期货年度交割情况

年度	交割量 (手)	同比变化 (%)	交割金额 (亿元)	同比变化 (%)
2021 年	26 195	125.06	15.61	246.82
2022 年	30 115	14.96	18.00	15.41

数据来源：大连商品交易所。

表 2-3-8 2022 年黄大豆 1 号期权年度行权情况

年度	行权量 (手)	同比变化 (%)
2022 年	7 972	—

数据来源：大连商品交易所。

(三) 期货价格走势 (见图 2-3-1、表 2-3-9、表 2-3-10)

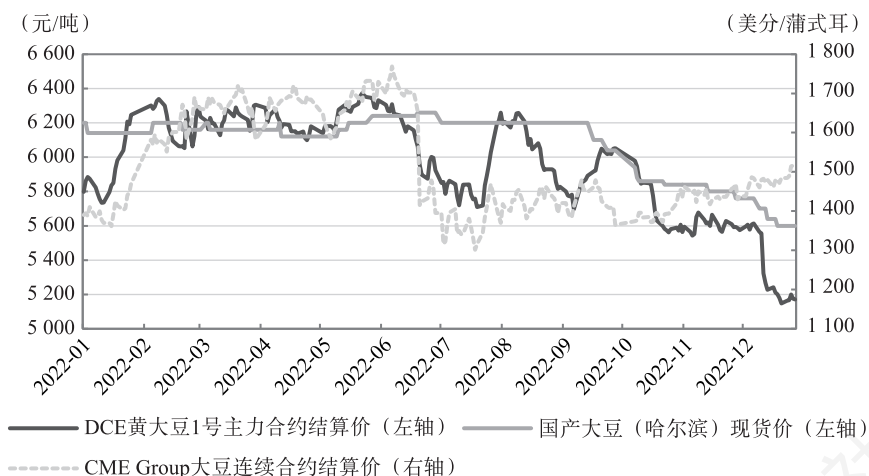


图 2-3-1 2022 年黄大豆 1 号期货内外盘和国内现货市场价格走势

数据来源：大连商品交易所、Wind、大豆天下。

表 2-3-9 2022 年黄大豆 1 号期货内外盘和国内现货市场价格指标

市场分类	2021 年 末收盘价	2022 年盘 中最高价	2022 年 盘中最低 价	2022 年 末收盘价	全年 涨跌	结算价 均价	标准差	极差
大商所主力价格 (元/吨)	5 878	6 443	5 120	5 179	-699	5 950.33	298.71	1 323
CME Group 连续价格 (美分/蒲式耳)	1 339.75	1 784	1 288.5	1 524.25	184.5	1 513.49	126.71	495.5
国产大豆 (哈尔滨) 现货价 (元/吨)	6 000	6 260	5 600	5 600	-400	6 078.26	183.34	660

数据来源：大连商品交易所、Wind、大豆天下。

表 2-3-10 2022 年黄大豆 1 号期货内外盘和国内现货市场价格相关性

价格选择	相关系数
大商所主力结算价与 CME Group 连续价格	0.6
大商所主力结算价与黄大豆 1 号现货市场价格	0.8

数据来源：大连商品交易所、Wind、大豆天下。

二、黄大豆 2 号期货、期权运行情况

2022 年 8 月 8 日，黄大豆 2 号期权在大商所上市交易。

(一) 期货、期权交易情况 (见表 2-3-11 ~ 表 2-3-15)

表 2-3-11 2022 年黄大豆 2 号期货月度交易情况

月度	成交量 (万手)	同比变化 (%)	成交金额 (亿元)	同比变化 (%)	月末持仓量 (万手)	同比变化 (%)
1 月	93.22	-50.1	404.59	-49.34	3.61	-13.48
2 月	143.14	35.52	712.11	58.76	4.18	19.43
3 月	165.46	-23.43	857.95	-4.43	3.82	-25.26
4 月	83.81	-53.88	432.17	-42.92	3.01	-50.57
5 月	91.37	-35.73	484.61	-20.89	4.44	-16.79
6 月	122.16	-21.47	638.44	-1.97	2.8	-48.62
7 月	167.18	-2.08	779.9	4.24	4.72	-3.67
8 月	139.05	-8.71	698.2	3.99	4.77	-5.12
9 月	144.94	10.72	759.64	27.33	5.21	22.3
10 月	178.09	77.06	972.82	120.75	5.24	20.38
11 月	183.66	59.69	946.25	100.62	5.39	-1.9
12 月	136.15	27.3	679.46	52.77	4.96	28.5
总计	1 648.23	-6.59	8 366.14	10.97	—	—

数据来源：大连商品交易所。

表 2-3-12 2021—2022 年黄大豆 2 号期货年度交易情况

年度	成交量 (万手)	同比变化 (%)	成交金额 (亿元)	同比变化 (%)	年末持仓量 (万手)	同比变化 (%)
2021 年	1 764.44	-3.9	7 539.23	19.71	3.86	-24.05
2022 年	1 648.23	-6.59	8 366.14	10.97	4.96	28.5

数据来源：大连商品交易所。

表 2-3-13 2021—2022 年黄大豆 2 号期货内外盘年度交易情况

年度	成交量 (万手)		年末持仓量 (万手)	
	大商所 (DCE)	CME Group (芝加哥商业交易所集团)	大商所 (DCE)	CME Group (芝加哥商业交易所集团)
2021 年	1 764.44	5 332.45	3.86	63.16
2022 年	1 648.23	5 172.08	4.96	59.04

注：大商所黄大豆 2 号期货交易单位为 10 吨/手，芝加哥商业交易所集团大豆期货交易单位为 5 000 蒲式耳/手。

数据来源：大连商品交易所、CME Group (芝加哥商业交易所集团)、FIA。

表 2-3-14 2022 年黄大豆 2 号期权年度交易情况

年度	成交量 (万手)	同比变化 (%)	成交量 看跌/看涨 (PCR)	成交金额 (亿元)	同比变化 (%)	年末持仓量 (万手)	同比变化 (%)
2022 年	135.55	—	1.15	4.06	—	1.96	—

数据来源：大连商品交易所。

表 2-3-15 2022 年黄大豆 2 号期权内外盘年度交易情况

年度	成交量 (万手)		年末持仓量 (万手)	
	大商所 (DCE)	CME Group (芝加哥商业交易所集团)	大商所 (DCE)	CME Group (芝加哥商业交易所集团)
2022 年	135.55	1 672.77	1.96	37.89

注：大商所黄大豆 2 号期权交易单位为 1 手（10 吨）黄大豆 2 号期货合约，芝加哥商业交易所集团大豆期权交易单位为 1 手（5 000 蒲式耳）大豆期货合约。

数据来源：大连商品交易所、CME Group（芝加哥商业交易所集团）。

(二) 交割、行权情况 (见表 2-3-16 ~ 表 2-3-18)

表 2-3-16 2022 年黄大豆 2 号期货月度交割情况

月度	交割量 (手)	同比变化 (%)	交割金额 (亿元)	同比变化 (%)
1 月	500	—	0.21	—
2 月	0	-100	0	-100
3 月	0	—	0	—
4 月	700	—	0.35	—
5 月	0	-100	0	-100
6 月	200	-81.82	0.11	-75.69
7 月	300	-50	0.14	-40.12
8 月	0	—	0	—
9 月	0	-100	0	-100
10 月	1 000	-33.33	0.58	-14.83
11 月	0	-100	0	-100
12 月	0	—	0	—
总计	2 700	-56.45	1.39	-47.69

数据来源：大连商品交易所。

表 2-3-17 2021—2022 年黄大豆 2 号期货年度交割情况

年度	交割量 (手)	同比变化 (%)	交割金额 (亿元)	同比变化 (%)
2021 年	6 200	-7.46	2.67	24.77
2022 年	2 700	-56.45	1.39	-47.69

数据来源：大连商品交易所。

表 2-3-18 2022 年黄大豆 2 号期权年度行权情况

年度	行权量 (手)	同比变化 (%)
2022 年	5 209	—

数据来源：大连商品交易所。

(三) 期货价格走势 (见图 2-3-2、表 2-3-19、表 2-3-20)

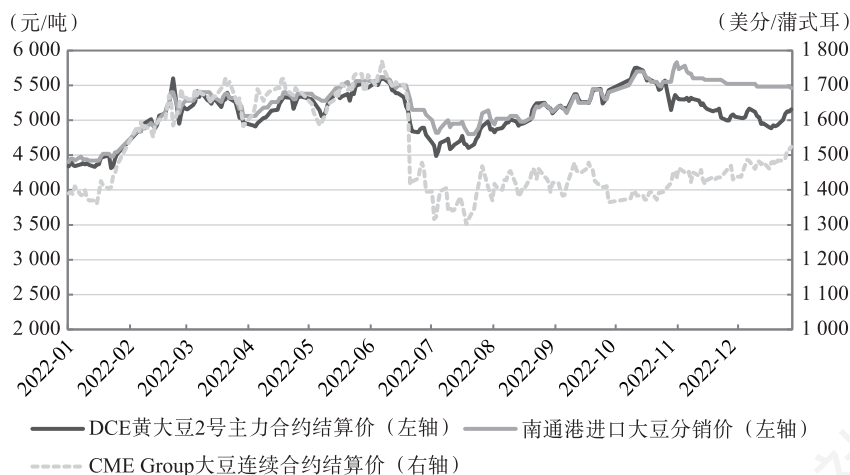


图 2-3-2 2022 年黄大豆 2 号期货内外盘和国内现货市场价格走势

数据来源：大连商品交易所、Wind。

表 2-3-19 2022 年黄大豆 2 号期货内外盘和国内现货市场价格指标

市场分类	2021 年末 收盘价	2022 年盘 中最高价	2022 年盘 中最低价	2022 年末 收盘价	全年 涨跌	结算价 平均价	标准差	极差
大商所主力价格 (元/吨)	4 247	5 798	4 229	5 181	934	5 096.51	320.56	1 569
CME Group 连续价格 (美分/蒲式耳)	1 339.75	1 784	1 288.5	1 524.25	184.5	1 513.49	126.71	495.5
南通港进口大豆分销 价 (元/吨)	4 251.3	5 830	4 400	5 460	1 208.7	5 244.42	326.74	1 430

数据来源：大连商品交易所、Wind。

表 2-3-20 2022 年黄大豆 2 号期货内外盘和国内现货市场价格相关性

价格选择	相关系数
大商所主力结算价与 CME Group 连续价格	0.44
大商所主力结算价与黄大豆 2 号现货市场价格	0.86

数据来源：大连商品交易所、Wind。

三、豆粕期货、期权运行情况

(一) 期货、期权交易情况 (见表 2-3-21 ~ 表 2-3-26)

表 2-3-21 2022 年豆粕期货月度交易情况

月度	成交量 (万手)	同比变化 (%)	成交金额 (亿元)	同比变化 (%)	月末持仓量 (万手)	同比变化 (%)
1 月	2 123.58	-50.07	6 913.2	-54.48	211	-10.07
2 月	3 209.92	12.32	12 183.94	21.89	254.17	4.26
3 月	5 535.34	29.29	22 775.57	59.83	258.97	14.22
4 月	2 510.27	-23.4	9 943.56	-13.72	198.25	-3.75
5 月	1 806.15	-28.63	7 310.19	-19.72	225.26	13.31
6 月	2 369.59	-23.4	9 467.68	-12.35	196.2	-1.66
7 月	2 808.92	-9.46	10 674.06	-4.4	203.34	-2.59
8 月	2 174.22	-28.49	8 308.93	-22.84	178.31	-18.22
9 月	2 113.48	-14.01	8 435.75	-1.41	209.94	1.47
10 月	2 218.68	4.2	8 988.04	30.9	254.97	1.76
11 月	2 956.08	23.38	12 126.78	62.71	247.65	7.73
12 月	2 683.2	2.41	10 737.87	28.79	201.76	-8.89
总计	32 509.43	-9.79	127 865.57	3.11	—	—

数据来源：大连商品交易所。

表 2-3-22 2021—2022 年豆粕期货年度交易情况

年度	成交量 (万手)	同比变化 (%)	成交金额 (亿元)	同比变化 (%)	年末持仓量 (万手)	同比变化 (%)
2021 年	36 038.82	0.26	124 013.83	16.76	221.45	-3.92
2022 年	32 509.43	-9.79	127 865.57	3.11	201.76	-8.89

数据来源：大连商品交易所。

表 2-3-23 2021—2022 年豆粕期货内外盘年度交易情况

年度	成交量 (万手)		年末持仓量 (万手)	
	大商所 (DCE)	CME Group (芝加哥商业交易所集团)	大商所 (DCE)	CME Group (芝加哥商业交易所集团)
2021 年	36 038.82	2 677.62	221.45	38.45
2022 年	32 509.43	2 809.17	201.76	40.06

注：大商所豆粕期货交易单位为 10 吨/手，芝加哥商业交易所集团豆粕期货交易单位为 100 短吨/手。

数据来源：大连商品交易所、CME Group (芝加哥商业交易所集团)。

表 2-3-24 2022 年豆粕期权月度交易情况

月度	成交量 (万手)	同比变化 (%)	成交量 看跌/看涨 (PCR)	成交金额 (亿元)	同比变化 (%)	月末持仓量 (万手)	同比变化 (%)
1月	406.36	32.67	0.78	23.17	-25.26	48.69	-10.09
2月	478.02	85.72	1.25	42.18	114.84	52.4	-21.53
3月	633.85	32.68	1.16	49.76	69.38	75.24	1.8
4月	323.19	24.37	0.96	23.88	14.84	49.32	6.06
5月	308.77	24.6	0.92	17.72	-18.74	59.17	-7.59
6月	552.18	59.34	1.3	32.73	14.1	74.35	30.47
7月	767.28	96.99	1.97	48.42	86.01	72.53	44.1
8月	311.13	45.1	1.27	20.25	31.61	46.91	29.86
9月	398.36	67.08	1.3	27.59	80.09	68.03	51.29
10月	379.36	27.79	1.35	21.37	-1.67	68.54	17.37
11月	517.94	45.11	1.35	25.92	26.61	65.12	13.74
12月	264.36	-35.13	1.33	14.81	-41.46	30.93	-31.69
总计	5 340.8	40.57	1.26	347.8	26.22	—	—

数据来源：大连商品交易所。

表 2-3-25 2021—2022 年豆粕期权年度交易情况

年度	成交量 (万手)	同比变化 (%)	成交量 看跌/看涨 (PCR)	成交金额 (亿元)	同比变化 (%)	年末持仓量 (万手)	同比变化 (%)
2021年	3 799.3	26.1	275.6	57	45.3	17.5	0.8
2022年	5 340.8	40.57	1.26	347.8	26.22	30.93	-31.69

数据来源：大连商品交易所。

表 2-3-26 2021—2022 年豆粕期权内外盘年度交易情况

年度	成交量 (万手)		年末持仓量 (万手)	
	大商所 (DCE)	CME Group (芝加哥 商业交易所集团)	大商所 (DCE)	CME Group (芝加哥 商业交易所集团)
2021年	3 799.3	289.7	45.3	11.4
2022年	5 340.8	282.25	30.93	12.39

注：大商所豆粕期权交易单位为1手（10吨）豆粕期货合约，芝加哥商业交易所集团豆粕期权交易单位为1手（100短吨）豆粕期货合约。

数据来源：大连商品交易所、CME Group（芝加哥商业交易所集团）。

(二) 交割、行权情况 (见表 2-3-27 ~ 表 2-3-30)

表 2-3-27 2022 年豆粕期货月度交割情况

月度	交割量 (手)	同比变化 (%)	交割金额 (亿元)	同比变化 (%)
1 月	1 062	-78.69	0.37	-78.58
3 月	905	-71.08	0.41	-63.57
5 月	2 534	-61.41	1.06	-54.29
7 月	3 292	-35.7	1.33	-26.34
8 月	719	20.44	0.3	36.56
9 月	2 000	-9.84	0.91	-20.33
11 月	4 895	13.02	2.45	73.28
12 月	6 502	38.4	3.06	100.5
总计	21 909	-47.53	9.89	-32.92

数据来源: 大连商品交易所。

表 2-3-28 2021—2022 年豆粕期货年度交割情况

年度	交割量 (手)	同比变化 (%)	交割金额 (亿元)	同比变化 (%)
2021 年	41 755	103.57	14.72	147.91
2022 年	21 909	-47.53	9.89	-32.92

数据来源: 大连商品交易所。

表 2-3-29 2022 年豆粕期权月度行权情况

月度	行权量 (手)
1 月	2 532
2 月	26 112
3 月	11 842
4 月	85 809
5 月	727
6 月	14 659
7 月	18 125
8 月	54 900
9 月	1 340
10 月	25 217
11 月	9 630
12 月	65 625
总计	316 518

数据来源: 大连商品交易所。

表 2-3-30 2021—2022 年豆粕期权年度行权情况

年度	行权量（手）	同比变化（%）
2021 年	268 154	44.7
2022 年	316 518	18.04

数据来源：大连商品交易所。

（三）期货价格走势（见图 2-3-3、表 2-3-31、表 2-3-32）

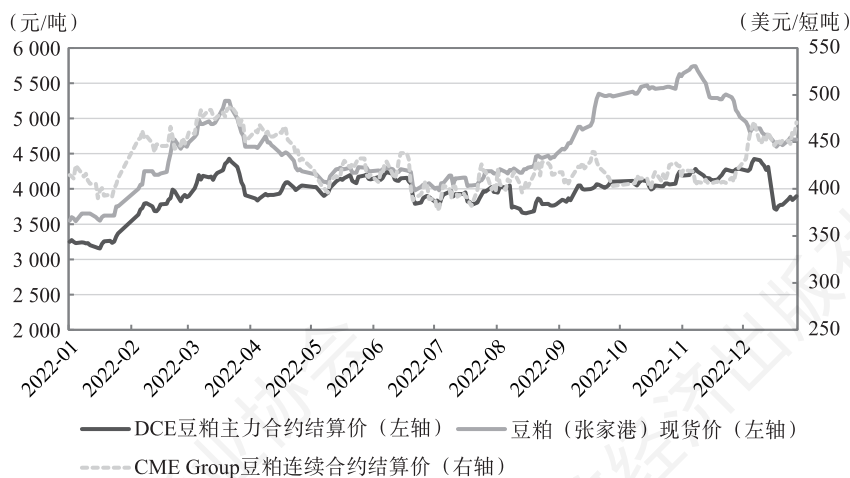


图 2-3-3 2022 年豆粕期货内外盘和国内现货市场价格走势

数据来源：大连商品交易所、Wind。

表 2-3-31 2022 年豆粕期货内外盘和国内现货市场价格指标

市场分类	2021 年末 收盘价	2022 年盘 中最高价	2022 年 盘中最低 价	2022 年 末收盘 价	全年 涨跌	结算价 平均价	标准差	极差
大商所主力价格 (元/吨)	3 189	4 495	3 121	3 936	747	3 951.68	272.14	1 374
CME Group 连续价格 (美元/短吨)	399.9	494.7	375.3	471.4	71.5	426.54	25.72	119.4
张家港豆粕现货价格 (元/吨)	3 520	5 740	3 540	4 700	1 180	4 569.92	542.29	2 200

数据来源：大连商品交易所、Wind。

表 2-3-32 2022 年豆粕期货内外盘和国内现货市场价格相关性

价格选择	相关系数
大商所主力结算价与 CME Group 连续价格	0.3
大商所主力结算价与豆粕现货市场价格	0.69

数据来源：大连商品交易所、Wind。

四、豆油期货、期权运行情况

2022年8月8日,豆油期权在大商所上市交易。

(一) 期货、期权交易情况 (见表2-3-33~表2-3-37)

表 2-3-33 2022 年豆油期货月度交易情况

月度	成交量 (万手)	同比变化 (%)	成交金额 (亿元)	同比变化 (%)	月末持仓量 (万手)	同比变化 (%)
1月	1 389.08	-8.03	12 785.64	8.51	75.48	19.27
2月	1 528.61	64.89	15 433.41	108.35	76.65	9.31
3月	1 877.72	-20.88	19 762.28	-6.12	73.97	14.65
4月	1 161.13	-42.56	12 642.96	-25.53	63.17	3.38
5月	1 114.96	-41.39	12 603.1	-24.53	70.6	5.9
6月	1 543.24	-32.59	17 025.28	-10.99	62.46	-7.43
7月	2 096.16	-5	19 300.88	0.14	58.88	-15.27
8月	1 717.76	-18.96	16 843.15	-11.3	61.48	-24.78
9月	1 540.46	-17.65	14 145.1	-16.44	66.34	-15.13
10月	1 243.26	-23.93	11 668.81	-26.86	70.42	-11.51
11月	1 694.53	-22.8	15 601.37	-24.21	72.56	-11.98
12月	1 443.72	-23.55	12 771.85	-21.96	63.55	-20.78
总计	18 350.63	-20	180 583.83	-10.22	—	—

数据来源:大连商品交易所。

表 2-3-34 2021—2022 年豆油期货年度交易情况

年度	成交量 (万手)	同比变化 (%)	成交金额 (亿元)	同比变化 (%)	年末持仓量 (万手)	同比变化 (%)
2021年	22 938.35	32.5	201 138.98	76.13	80.22	36.55
2022年	18 350.63	-20	180 583.83	-10.22	63.55	-20.78

数据来源:大连商品交易所。

表 2-3-35 2021—2022 年豆油期货内外盘年度交易情况

年度	成交量 (万手)		年末持仓量 (万手)	
	大商所 (DCE)	CME Group (芝加哥商业交易所集团)	大商所 (DCE)	CME Group (芝加哥商业交易所集团)
2021年	22 938.35	3 267.54	80.22	37.26
2022年	18 350.63	3 005.21	63.55	37.52

注:大商所豆油期货交易单位为10吨/手,芝加哥商业交易所集团豆油期货交易单位为60 000磅/手。

数据来源:大连商品交易所、CME Group (芝加哥商业交易所集团)。

表 2-3-36 2022 年豆油期权年度交易情况

年度	成交量 (万手)	同比变化 (%)	成交量 看跌/看涨 (PCR)	成交金额 (亿元)	同比变化 (%)	年末持仓量 (万手)	同比变化 (%)
2022 年	340.77	—	1.25	30.08	—	5.84	—

数据来源：大连商品交易所。

表 2-3-37 2022 年豆油期权内外盘年度交易情况

年度	成交量 (万手)		年末持仓量 (万手)	
	大商所 (DCE)	CME Group (芝加哥 商业交易所集团)	大商所 (DCE)	CME Group (芝加哥 商业交易所集团)
2022 年	340.77	308	5.84	10.28

注：大商所豆油期权交易单位为 1 手（10 吨）豆油期货合约，芝加哥商业交易所集团豆油期权交易单位为 1 手（10 公吨）豆油期货合约。

数据来源：大连商品交易所、CME Group（芝加哥商业交易所集团）。

（二）交割、行权情况（见表 2-3-38 ~ 表 2-3-40）

表 2-3-38 2022 年豆油期货月度交割情况

月度	交割量 (手)	同比变化 (%)	交割金额 (亿元)	同比变化 (%)
1 月	896	-82.18	0.83	-81.33
3 月	404	-14.23	0.45	2.7
5 月	1 905	90.5	2.17	130.05
7 月	808	57.2	0.76	64.66
8 月	910	3 400	0.9	3 757.08
9 月	2 336	-66.49	2.41	-63.31
11 月	1 926	92.6	1.93	89.02
12 月	806	3 930	0.79	4 103.66
总计	9 991	-33.53	10.24	-26.39

数据来源：大连商品交易所。

表 2-3-39 2021—2022 年豆油期货年度交割情况

年度	交割量 (手)	同比变化 (%)	交割金额 (亿元)	同比变化 (%)
2021 年	15 031	-27.39	13.9	8.54
2022 年	9 991	-33.53	10.24	-26.39

数据来源：大连商品交易所。

表 2-3-40 2021—2022 年豆油期权年度行权情况

年度	行权量 (手)	同比变化 (%)
2022 年	16 639	—

数据来源：大连商品交易所。

(三) 期货价格走势 (见图 2-3-4、表 2-3-41 ~ 表 2-3-42)

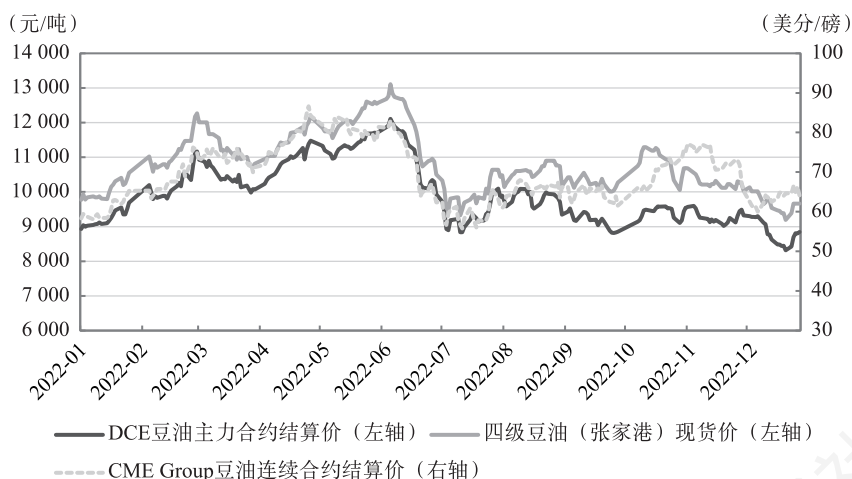


图 2-3-4 2022 年豆油期货内外盘和国内现货市场价格走势

数据来源: 大连商品交易所、Wind。

表 2-3-41 2022 年豆油期货内外盘和国内现货市场价格指标

市场分类	2021 年末 收盘价	2022 年盘 中最高价	2022 年盘 中最低价	2022 年末 收盘价	全年涨跌	结算价 平均价	标准差	极差
大商所主力价格 (元/吨)	8 880	12 280	8 248	8 900	20	9 916.6	885.72	4 032
CME Group 连续价格 (美元/吨)	56.57	87.65	54.42	64.12	7.55	69.23	7.31	33.23
张家港四级豆油现货 价格 (元/吨)	9 710	13 110	9 190	9 660	-50	10 793.35	861.55	3 920

数据来源: 大连商品交易所、Wind。

表 2-3-42 2022 年豆油期货内外盘和国内现货市场价格相关性

价格选择	相关系数
大商所主力结算价与 CME Group 连续价格	0.78
大商所主力结算价与豆油现货市场价格	0.96

数据来源: 大连商品交易所、Wind。

五、玉米期货、期权运行情况

(一) 期货、期权交易情况 (见表 2-3-43 ~ 表 2-3-48)

表 2-3-43 2022 年玉米期货月度交易情况

月度	成交量 (万手)	同比变化 (%)	成交金额 (亿元)	同比变化 (%)	月末持仓量 (万手)	同比变化 (%)
1 月	1 074. 27	-40. 58	2 922. 35	-42. 54	155. 83	-0. 88
2 月	1 078. 16	-21. 85	3 011. 94	-21. 48	180. 49	33. 22
3 月	1 588. 43	-18. 05	4 602. 36	-12. 49	179. 84	51. 41
4 月	1 202. 15	-25. 12	3 543. 6	-17. 89	200. 06	107. 53
5 月	1 022. 28	-27. 91	3 034. 79	-22. 49	179. 67	73. 31
6 月	1 088. 24	-23. 24	3 114. 99	-17. 2	162. 09	53. 94
7 月	1 123. 52	-33. 33	3 011. 99	-30. 57	151. 39	36. 61
8 月	1 145. 97	-31. 07	3 123. 03	-26. 66	144. 2	10. 53
9 月	916. 14	-38. 68	2 574. 49	-30. 38	133. 55	8. 33
10 月	803. 73	-43. 94	2 297. 68	-37. 7	139. 03	15. 52
11 月	1 241. 92	-21. 76	3 577. 36	-15. 75	146. 15	5. 79
12 月	1 150. 93	-23. 22	3 240. 25	-19. 71	151. 74	3. 64
总计	13 435. 74	-29. 02	38 054. 83	-24. 55	—	—

数据来源：大连商品交易所。

表 2-3-44 2021—2022 年玉米期货年度交易情况

年度	成交量 (万手)	同比变化 (%)	成交金额 (亿元)	同比变化 (%)	年末持仓量 (万手)	同比变化 (%)
2021 年	18 928. 71	6. 51	50 439. 37	22. 56	146. 42	-5. 92
2022 年	13 435. 74	-29. 02	38 054. 83	-24. 55	151. 74	3. 64

数据来源：大连商品交易所。

表 2-3-45 2021—2022 年玉米期货内外盘年度交易情况

年度	成交量 (万手)		年末持仓量 (万手)	
	大商所 (DCE)	CME Group (芝加哥商业交易所集团)	大商所 (DCE)	CME Group (芝加哥商业交易所集团)
2021 年	18 928. 71	8 690. 2	146. 42	151. 28
2022 年	13 435. 74	7 788. 11	151. 74	121. 55

注：大商所玉米期货交易单位为 10 吨/手，芝加哥商业交易所集团玉米期货交易单位为 5 000 蒲式耳/手。

数据来源：大连商品交易所、CME Group (芝加哥商业交易所集团)。



表 2-3-46 2022 年玉米期权月度交易情况

月度	成交量 (万手)	同比变化 (%)	成交量 看跌/看涨 (PCR)	成交金额 (亿元)	同比变化 (%)	月末持仓量 (万手)	同比变化 (%)
1月	257.11	118.45	0.94	8.01	37.26	63.01	95.75
2月	244.13	188.57	0.71	6.27	105.12	61.74	71.64
3月	432.14	115.5	0.64	10.99	138.24	74.92	63.47
4月	226.75	129.79	0.76	6.59	94.04	45.67	194.82
5月	264.97	161.7	0.95	7.11	72.01	66.38	151.73
6月	367.86	183.73	1.05	9.88	121.51	68.4	93.27
7月	375.22	78.13	1.21	11.59	87.69	63.23	54.12
8月	161.89	0.9	1.09	5.89	-13.42	29.58	-0.59
9月	142.9	-16.2	1	4.79	-24.14	31.72	-19.9
10月	133.13	-31.11	1.03	3.81	-44.3	32.9	-20.85
11月	268.47	-12.72	1.17	5.72	-43.35	42.29	-16.09
12月	168.37	-40.96	1.05	4.61	-46.22	32.28	-36.73
总计	3 042.94	47.71	0.93	85.26	21.28	—	—

数据来源：大连商品交易所。

表 2-3-47 2021—2022 年玉米期权年度交易情况

年度	成交量 (万手)	同比变化 (%)	成交量 看跌/看涨 (PCR)	成交金额 (亿元)	同比变化 (%)	年末持仓量 (万手)	同比变化 (%)
2021年	2 060	97.2	1.06	70.3	116.5	51	123.1
2022年	3 042.94	47.71	0.93	85.26	21.28	32.28	-36.73

数据来源：大连商品交易所。

表 2-3-48 2021—2022 年玉米期权内外盘年度交易情况

年度	成交量 (万手)		年末持仓量 (万手)	
	大商所 (DCE)	CME Group (芝加哥商业交易所集团)	大商所 (DCE)	CME Group (芝加哥商业交易所集团)
2021年	2 060	3 164.8	51	104.6
2022年	3 042.94	3 004.69	32.28	87.75

注：大商所玉米期权交易单位为1手（10吨）玉米期货合约，芝加哥商业交易所集团玉米期权交易单位为1手（5000蒲式耳）玉米期货合约。

数据来源：大连商品交易所、CME Group（芝加哥商业交易所集团）。

(二) 交割、行权情况 (见表 2-3-49 ~ 表 2-3-52)

表 2-3-49 2022 年玉米期货月度交割情况

月度	交割量 (手)	同比变化 (%)	交割金额 (亿元)	同比变化 (%)
1 月	34 987	-22.87	9.11	-22.87
3 月	32 633	-5.88	8.92	-9.06
5 月	121 146	701.81	35	727.81
7 月	48 219	1 106.38	12.95	1 147.12
9 月	75 680	758.54	20.67	821.45
11 月	30 950	-14.71	8.76	-7.5
总计	343 615	138.22	95.41	144.34

数据来源: 大连商品交易所。

表 2-3-50 2021—2022 年玉米期货年度交割情况

年度	交割量 (手)	同比变化 (%)	交割金额 (亿元)	同比变化 (%)
2021 年	144 240	12	39.05	41.94
2022 年	343 615	138.22	95.41	144.34

数据来源: 大连商品交易所。

表 2-3-51 2022 年玉米期权月度行权情况

月度	行权量 (手)
1 月	1 436
2 月	17 293
3 月	18 123
4 月	71 588
5 月	188
6 月	69 230
7 月	29 977
8 月	112 478
9 月	662
10 月	11 655
11 月	509
12 月	24 685
总计	357 824

数据来源: 大连商品交易所。

表 2-3-52 2021—2022 年玉米期权年度行权情况

年度	行权量 (手)	同比变化 (%)
2021 年	149 124	-35.6
2022 年	357 824	139.95

数据来源: 大连商品交易所。

(三) 期货价格走势 (见图 2-3-5、表 2-3-53、表 2-3-54)



图 2-3-5 2022 年玉米期货内外盘和国内现货市场价格走势

数据来源: 大连商品交易所、Wind。

表 2-3-53 2022 年玉米期货内外盘和国内现货市场价格指标

市场分类	2021 年末 收盘价	2022 年盘 中最高价	2022 年盘 中最低价	2022 年末 收盘价	全年 涨跌	结算价 平均价	标准差	极差
大商所主力价格 (元/吨)	2 672	3 046	2 548	2 824	152	2 824.62	95.13	498
CME Group 连续价格 (美分/蒲式耳)	592.5	824.5	561.75	678.5	86	684.67	63.55	262.75
大连港玉米现货价格 (元/吨)	2 640	2 980	2 640	2 880	240	2 797.07	80.79	340

数据来源: 大连商品交易所、Wind。

表 2-3-54 2022 年玉米期货内外盘和国内现货市场价格相关性

价格选择	相关系数
大商所主力结算价与 CME Group 连续价格	0.89
大商所主力结算价与玉米现货市场价格	0.68

数据来源: 大连商品交易所、Wind。

六、玉米淀粉期货运行情况

(一) 期货交易情况 (见表 2-3-55、表 2-3-56)

表 2-3-55 2022 年玉米淀粉期货月度交易情况

月度	成交量 (万手)	同比变化 (%)	成交金额 (亿元)	同比变化 (%)	月末持仓量 (万手)	同比变化 (%)
1 月	345.11	-19.01	1 072.86	-21.75	27.89	35.8
2 月	387.55	15.86	1 246.56	16.17	39.32	109.17
3 月	573.86	6.4	1 955.7	12.03	36	65.46
4 月	344.5	-29.8	1 170.21	-26.28	34.78	80.07
5 月	342.23	-22.42	1 145.66	-19.98	35.81	74.06
6 月	337	-28.1	1 081.38	-25.09	24.95	37.14
7 月	326.3	-39.61	998.04	-37.34	20.8	4.14
8 月	368.25	-19.03	1 119.59	-16.49	25.02	32.6
9 月	351.29	-18.99	1 067.71	-14.48	33.43	95.62
10 月	372.03	-37.87	1 104.74	-40.47	38.07	158.44
11 月	429.96	-5.64	1 305.3	-10	23.76	20.83
12 月	441.68	-7.74	1 308.29	-11.32	25.56	4.57
总计	4 619.76	-18.41	14 576.04	-17.26	—	—

数据来源：大连商品交易所。

表 2-3-56 2021—2022 年玉米淀粉期货年度交易情况

年度	成交量 (万手)	同比变化 (%)	成交金额 (亿元)	同比变化 (%)	年末持仓量 (万手)	同比变化 (%)
2021 年	5 662.51	100.09	17 615.78	133.75	24.44	40.1
2022 年	4 619.76	-18.41	14 576.04	-17.26	25.56	4.57

数据来源：大连商品交易所。

(二) 交割情况 (见表 2-3-57、表 2-3-58)

表 2-3-57 2022 年玉米淀粉期货月度交割情况

月度	交割量 (手)	同比变化 (%)	交割金额 (亿元)	同比变化 (%)
1 月	3 107	25.99	0.92	15.22
3 月	7 088	320.65	2.28	278.62
5 月	21 799	628.82	7.3	641.28
7 月	8 593	260.14	2.57	265.11

续表

月度	交割量 (手)	同比变化 (%)	交割金额 (亿元)	同比变化 (%)
9 月	19 650	773.33	6	767.37
11 月	7 307	1 827.97	2.01	1 599.83
总计	67 544	455.6	21.08	440.28

数据来源: 大连商品交易所。

表 2-3-58 2021—2022 年玉米淀粉期货年度交割情况

年度	交割量 (手)	同比变化 (%)	交割金额 (亿元)	同比变化 (%)
2021 年	12 157	67.57	3.9	123.82
2022 年	67 544	455.6	42.15	440.28

数据来源: 大连商品交易所。

(三) 期货价格走势 (见图 2-3-6、表 2-3-59、表 2-3-60)



图 2-3-6 2022 年玉米淀粉期货和现货市场价格走势

数据来源: 大连商品交易所、Wind。

表 2-3-59 2022 年玉米淀粉期货和现货市场价格指标

市场分类	2021 年末 收盘价	2022 年盘 中最高价	2022 年盘 中最低价	2022 年末 收盘价	全年 涨跌	结算价 平均价	标准差	极差
大商所主力价格 (元/吨)	2 981	3 543	2 798	2 939	-42	3 122.89	166.61	745
长春玉米淀粉现货价 格 (元/吨)	3 250	3 400	2 930	2 930	-320	3 206.82	116.92	470

数据来源: 大连商品交易所、Wind。

表 2-3-60 2022 年玉米淀粉期货和现货市场价格相关性

价格选择	相关系数
大商所主力结算价与玉米淀粉现货市场价格	0.71

数据来源：大连商品交易所、Wind。

七、棕榈油期货、期权运行情况

(一) 期货、期权交易情况（见表 2-3-61 ~ 表 2-3-66）

表 2-3-61 2022 年棕榈油期货月度交易情况

月度	成交量 (万手)	同比变化 (%)	成交金额 (亿元)	同比变化 (%)	月末持仓量 (万手)	同比变化 (%)
1月	1 452.67	-3.12	13 310.3	29.83	68.27	41.97
2月	1 616.58	70.49	16 969.18	158.52	69.89	46.99
3月	2 598.54	38.05	29 671.26	107.92	59.79	34.37
4月	1 646.32	1.39	18 472.2	55.64	48.12	8.49
5月	1 594.35	-6.7	18 668.83	38.64	55.33	8.06
6月	1 930.28	-11.33	20 374.76	29.12	54.87	-10.14
7月	2 709.85	18.33	21 909.42	21.21	63.05	-10.2
8月	2 408.11	-2.97	20 234.63	-2.2	56.89	-15.25
9月	1 946.43	-2.48	15 025.65	-10.37	71.54	9.74
10月	1 609.14	-8.22	12 773.01	-23.18	76.41	25.02
11月	2 427.55	4.64	20 052.95	-7.81	78.15	25.35
12月	2 218.45	11.99	17 712.03	5.36	68.78	13.09
总计	24 158.27	6.61	225 174.22	23.1	—	—

数据来源：大连商品交易所。

表 2-3-62 2021—2022 年棕榈油期货年度交易情况

年度	成交量 (万手)	同比变化 (%)	成交金额 (亿元)	同比变化 (%)	年末持仓量 (万手)	同比变化 (%)
2021年	22 661.4	-28.1	182 921.88	1.94	60.82	46.05
2022年	24 158.27	6.61	225 174.22	23.1	68.78	13.09

数据来源：大连商品交易所。

表 2-3-63 2021—2022 年棕榈油期货内外盘年度交易情况

年度	成交量 (万手)		年末持仓量 (万手)	
	大商所 (DCE)	BMD (马来西亚 衍生品交易所)	大商所 (DCE)	BMD (马来西亚 衍生品交易所)
2021年	22 661.4	1 560.81	60.82	20.87
2022年	24 158.27	1 620.69	68.78	20.02

注：大商所棕榈油期货交易单位为 10 吨/手，马来西亚衍生品交易所棕榈油期货交易单位为 25 公吨/手。

数据来源：大连商品交易所、FIA。

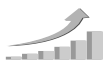


表 2-3-64 2022 年棕榈油期权月度交易情况

月度	成交量 (万手)	同比变化 (%)	成交量 看跌/看涨 (PCR)	成交金额 (亿元)	同比变化 (%)	月末持仓量 (万手)	同比变化 (%)
1月	181.94	—	2.56	26.9	—	26.83	—
2月	178.83	—	2.3	32.99	—	34.39	—
3月	329.66	—	2.1	64.43	—	30.31	—
4月	161.8	—	1.7	24.97	—	11.53	—
5月	180.87	—	1.55	22.02	—	14.44	—
6月	253.82	680.08	1.31	37.14	490.23	16.47	269.68
7月	323.52	134.21	1.04	44.33	158.35	16.39	30.99
8月	209.64	36.05	0.98	20.63	6.73	9.6	-18.46
9月	182.34	107.16	0.99	19.44	27.86	10.88	-6.41
10月	150.39	77.6	1.42	12.22	-45.18	15.2	12.48
11月	280.13	14.44	1.37	22.14	-36.16	15.73	-21.68
12月	237.94	16.72	0.93	17.1	-21.34	9.5	-51.17
总计	2 670.88	—	1.4	344.31	—	—	—

数据来源：大连商品交易所。

表 2-3-65 2021—2022 年棕榈油期权年度交易情况

年度	成交量 (万手)	同比变化 (%)	成交量 看跌/看涨 (PCR)	成交金额 (亿元)	同比变化 (%)	年末持仓量 (万手)	同比变化 (%)
2021年	946.1	—	1.5	136.7	—	19.5	—
2022年	2 670.88	—	1.4	344.31	—	9.5	-51.17

数据来源：大连商品交易所。

表 2-3-66 2021—2022 年棕榈油期权内外盘年度交易情况

年度	成交量 (万手)		年末持仓量 (万手)	
	大商所 (DCE)	BMD (马来西亚 衍生品交易所)	大商所 (DCE)	BMD (马来西亚 衍生品交易所)
2021年	946.1	9.5	19.5	1.6
2022年	2 670.88	3.65	9.5	1.02

注：大商所棕榈油期权交易单位为1手（10吨）棕榈油期货合约，马来西亚衍生品交易所棕榈油期权交易单位为1手（25公吨）棕榈油期货合约。

数据来源：大连商品交易所、马来西亚衍生品交易所（BMD）。

(二) 交割、行权情况 (见表 2-3-67 ~ 表 2-3-70)

表 2-3-67 2022 年棕榈油期货月度交割情况

月度	交割量 (手)	同比变化 (%)	交割金额 (亿元)	同比变化 (%)
1 月	2 348	500.51	2.3	686.7
2 月	2 200	-61.38	2.44	-41.69
3 月	1 484	147.33	2.04	325.52
4 月	1 062	—	1.42	—
5 月	1 296	45.62	1.98	149.53
6 月	190	—	0.30	—
7 月	1 429	23 716.67	1.37	27 578.69
8 月	612	—	0.58	—
9 月	801	5.39	0.69	0.25
10 月	516	15.7	0.42	-7.96
11 月	3 000	64.74	2.53	28.16
12 月	348	-78.57	0.30	-81.49
总计	15 286	24.94	16.37	56.42

数据来源: 大连商品交易所。

表 2-3-68 2021—2022 年棕榈油期货年度交割情况

年度	交割量 (手)	同比变化 (%)	交割金额 (亿元)	同比变化 (%)
2021 年	12 235	39.43	10.47	113.22
2022 年	15 286	24.94	16.37	56.42

数据来源: 大连商品交易所。

表 2-3-69 2022 年棕榈油期权月度行权情况

月度	行权量 (手)
1 月	9 577
2 月	5 364
3 月	19 535
4 月	35 367
5 月	5 064
6 月	3 976
7 月	18 374
8 月	21 091
9 月	6 597
10 月	4 964
11 月	4 878
12 月	10 625
总计	145 412

数据来源: 大连商品交易所。



表 2-3-70 2021—2022 年棕榈油期权年度行权情况

年度	行权量（手）	同比变化（%）
2021 年	52 985	—
2022 年	145 412	—

数据来源：大连商品交易所。

（三）期货价格走势（见图 2-3-7、表 2-3-71~表 2-3-72）

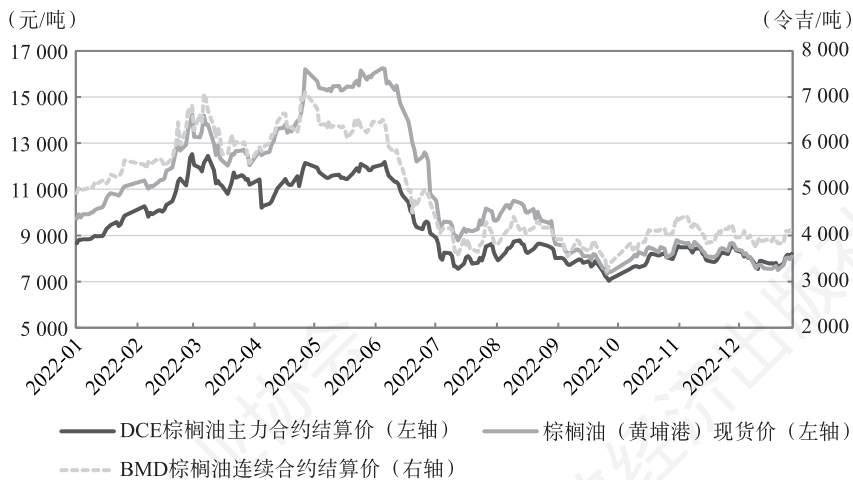


图 2-3-7 2022 年棕榈油期货内外盘和国内现货市场价格走势

数据来源：大连商品交易所、Wind。

表 2-3-71 2022 年棕榈油期货内外盘和国内现货市场价格指标

市场分类	2021 年末 收盘价	2022 年盘 中最高价	2022 年盘 中最低价	2022 年末 收盘价	全年涨跌	结算价 平均价	标准差	极差
大商所主力价格 (元/吨)	8 550	12 796	6 882	8 338	-212	9 419.83	1 578.27	5 914
BMD 连续价格 (令吉/吨)	5 159	7 104	3 226	4 174	-985	4 916.23	1 068.98	3 878
棕榈油（黄埔港）现 货价格（元/吨）	9 570	16 250	7 330	8 080	-1 490	10 866.94	2 624.84	8 920

数据来源：大连商品交易所、Wind。

表 2-3-72 2022 年棕榈油期货内外盘和国内现货市场价格相关性

价格选择	相关系数
大商所主力结算价与 BMD 连续价格	0.97
大商所主力结算价与棕榈油现货市场价格	0.95

数据来源：大连商品交易所、Wind。

八、鸡蛋期货运行情况

(一) 期货交易情况 (见表 2-3-73、表 2-3-74)

表 2-3-73 2022 年鸡蛋期货月度交易情况

月度	成交量 (万手)	同比变化 (%)	成交金额 (亿元)	同比变化 (%)	月末持仓量 (万手)	同比变化 (%)
1 月	235.2	-74.58	962.49	-75.95	20.37	-43.76
2 月	160.71	-70.48	687.96	-71.84	22.39	-32.2
3 月	245.67	-71.14	1 085.96	-71.35	16.92	-46.58
4 月	169.13	-70.8	798.82	-70.28	12.36	-53.84
5 月	144.99	-70.27	686.9	-70.48	14.14	-52.12
6 月	164.56	-64.5	767.68	-65.06	19.33	-37.77
7 月	177.07	-63.64	771.37	-65.72	17.8	-40.44
8 月	277.1	-31.91	1 146.65	-36.12	16.25	-39.16
9 月	198.55	-27.85	852.65	-28.72	20.49	-5.6
10 月	205	-37.17	922.89	-37.47	22.15	-11.31
11 月	271.17	-14.39	1 177.16	-17.3	22.33	-7.6
12 月	257.86	-6.59	1 100.43	-4.01	18.97	-20.56
总计	2 507.01	-57.79	10 960.96	-59	—	—

数据来源：大连商品交易所。

表 2-3-74 2021—2022 年鸡蛋期货年度交易情况

年度	成交量 (万手)	同比变化 (%)	成交金额 (亿元)	同比变化 (%)	年末持仓量 (万手)	同比变化 (%)
2021 年	5 939.8	-55.02	26 734.19	-43.06	23.88	-28.38
2022 年	2 507.01	-57.79	10 960.96	-59	18.97	-20.56

数据来源：大连商品交易所。

(二) 交割情况 (见表 2-3-75、表 2-3-76)

表 2-3-75 2022 年鸡蛋期货月度交割情况

月度	交割量 (手)	同比变化 (%)	交割金额 (亿元)	同比变化 (%)
1 月	99	-10	0.06	-44.21
2 月	4	-97.33	0.04	-82.35
3 月	0	-100	0.04	-65.78
4 月	0	-100	0.00	-98.20
5 月	46	4500	0.02	-38.25
6 月	5	25	0.06	65.23
7 月	0	—	0.05	-53.51

续表

月度	交割量 (手)	同比变化 (%)	交割金额 (亿元)	同比变化 (%)
8 月	0	-100	0.05	102.65
9 月	150	150	0.07	45.38
10 月	87	—	0.05	-10.04
11 月	68	—	0.08	-20.01
12 月	44	—	0.06	-39.43
总计	503	24.2	0.60	41.25

数据来源: 大连商品交易所。

表 2-3-76 2021—2022 年鸡蛋期货年度交割情况

年度	交割量 (手)	同比变化 (%)	交割金额 (亿元)	同比变化 (%)
2021 年	2 231	48.24	0.99	109.84
2022 年	503	24.2	0.60	-39.43

数据来源: 大连商品交易所。

(三) 期货价格走势 (见图 2-3-8、表 2-3-77、表 2-3-78)



图 2-3-8 2022 年鸡蛋期货和现货市场价格走势

数据来源: 大连商品交易所、Wind。

表 2-3-77 2022 年鸡蛋期货和现货市场价格指标

市场分类	2021 年末 收盘价	2022 年盘 中最高价	2022 年盘 中最低价	2022 年末 收盘价	全年 涨跌	结算价 平均价	标准差	极差
大商所主力价格 (元/500 千克)	4 138	4 969	3 957	4 326	188	4 391.62	224.16	1 012
鸡蛋现货平均批 发价 (元/500 千克)	4 940	5 690	3 580	4 270	-670	4 552.19	585.26	2 110

数据来源: 大连商品交易所、Wind。

表 2-3-78 2022 年鸡蛋期货和现货市场价格相关性

价格选择	相关系数
大商所主力结算价与鸡蛋现货市场价格	0.05

数据来源：大连商品交易所、Wind。

九、线型低密度聚乙烯（LLDPE）期货、期权运行情况

（一）期货、期权交易情况（见表 2-3-79 ~ 表 2-3-82）

表 2-3-79 2022 年 LLDPE 期货月度交易情况

月度	成交量 (万手)	同比变化 (%)	成交金额 (亿元)	同比变化 (%)	月末持仓量 (万手)	同比变化 (%)
1月	1 044.21	33.42	4 605.72	52.99	53.69	51.46
2月	1 001.7	29.54	4 476.75	36.3	62.3	63.49
3月	1 441.68	-4.14	6 600.48	-0.48	60.85	38.73
4月	967.6	-10.67	4 304.59	-4.52	54.62	19.16
5月	1 032.25	-3.56	4 483.34	4.48	61.12	18.44
6月	1 288.87	16.97	5 661.71	31.18	65.9	19.48
7月	1 343.7	15.77	5 380.06	12.18	64.01	15.28
8月	1 247.53	11.91	4 843.78	6	64.37	0.27
9月	1 061.18	-17.19	4 259.55	-24.35	59.07	-0.62
10月	799.97	-29.02	3 138.02	-40.77	74.42	45.11
11月	1 208.88	-22.71	4 732.93	-31.2	69.11	17.01
12月	1 209.84	-8.51	4 906.9	-12.37	67.27	19.11
总计	13 647.41	-1.72	57 393.83	-2.42	—	—

数据来源：大连商品交易所。

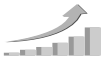
表 2-3-80 2021—2022 年 LLDPE 期货年度交易情况

年度	成交量 (万手)	同比变化 (%)	成交金额 (亿元)	同比变化 (%)	年末持仓量 (万手)	同比变化 (%)
2021 年	13 885.89	44.94	58 816.1	76.57	56.48	113.26
2022 年	13 647.41	-1.72	57 393.83	-2.42	67.27	19.11

数据来源：大连商品交易所。

表 2-3-81 2022 年 LLDPE 期权月度交易情况

月度	成交量 (万手)	同比变化 (%)	成交量 看跌/看涨 (PCR)	成交金额 (亿元)	同比变化 (%)	月末持仓量 (万手)	同比变化 (%)
1月	38.26	225.45	1.69	3.06	184.57	2.68	-1.48
2月	39.1	125.4	1.01	2.73	22.28	3.78	7.53



续表

月度	成交量 (万手)	同比变化 (%)	成交量 看跌/看涨 (PCR)	成交金额 (亿元)	同比变化 (%)	月末持仓量 (万手)	同比变化 (%)
3月	42.75	62.45	0.62	2.51	-14.89	3.67	-19.73
4月	24.65	31.93	0.73	1.26	-36.19	1.62	-56.04
5月	38.46	74.95	1	2.03	-19.97	2.8	-46.86
6月	104.23	137.16	1.03	3.82	-4.15	4.55	-30.9
7月	66.23	-5.35	1.24	2.49	-53.16	4.54	-35.57
8月	17.57	-67.7	1.48	1.01	-67.11	1.55	-63.44
9月	20.78	-62.51	1.45	1.3	-75	2.11	-58.71
10月	22.83	11.26	1.24	0.83	-73.77	3.08	-21.85
11月	49.54	19.96	0.72	1.15	-37.75	2.91	-37.29
12月	20.53	-31.94	1.08	0.71	-69.36	1.13	-25.49
总计	484.93	17.75	1.03	22.9	-35.82	—	—

数据来源：大连商品交易所。

表 2-3-82 2021—2022 年 LLDPE 期权年度交易情况

年度	成交量 (万手)	同比变化 (%)	成交量 看跌/看涨 (PCR)	成交金额 (亿元)	同比变化 (%)	年末持仓量 (万手)	同比变化 (%)
2021年	411.8	—	0.88	35.7	—	1.5	-45.4
2022年	484.93	17.75	1.03	22.9	-35.82	1.13	-25.49

数据来源：大连商品交易所。

(二) 交割、行权情况（见表 2-3-83 ~ 表 2-3-86）

表 2-3-83 2022 年 LLDPE 期货月度交割情况

月度	交割量 (手)	同比变化 (%)	交割金额 (亿元)	同比变化 (%)
1月	368	-60.17	0.16	-55.11
2月	1 747	186.86	0.79	224.33
3月	711	-34.47	0.32	-32.42
4月	673	-16.91	0.30	-11.95
5月	1 061	-79.04	0.46	-78.35
6月	547	2 504.76	0.24	2 981.47
7月	1 828	2 998.31	0.74	3 004.43
8月	494	3 700	0.20	3 611.99
9月	1 542	-16.29	0.61	-19.59
10月	1 380	55.06	0.58	35.32
11月	1 388	17.03	0.55	5.32
12月	467	17.93	0.19	14.58
总计	12 206	-5.36	5.14	-6.01

数据来源：大连商品交易所。

表 2-3-84 2021—2022 年 LLDPE 期货年度交割情况

年度	交割量（手）	同比变化（%）	交割金额（亿元）	同比变化（%）
2021 年	12 897	86.59	5.48	118.84
2022 年	12 206	-5.36	5.14	-6.01

数据来源：大连商品交易所。

表 2-3-85 2022 年 LLDPE 期权月度行权情况

月度	行权量（手）
1 月	248
2 月	154
3 月	230
4 月	6 035
5 月	113
6 月	46
7 月	779
8 月	8 118
9 月	88
10 月	68
11 月	18
12 月	5 050
总计	20 947

数据来源：大连商品交易所。

表 2-3-86 2021—2022 年 LLDPE 期权年度行权情况

年度	行权量（手）	同比变化（%）
2021 年	56 200	—
2022 年	20 947	-62.73

数据来源：大连商品交易所。

（三）期货价格走势（见图 2-3-9、表 2-3-87、表 2-3-88）



图 2-3-9 2022 年 LLDPE 期货和现货市场价格走势

数据来源：大连商品交易所、卓创资讯。



表 2-3-87 2022 年 LLDPE 期货和现货市场价格指标

市场分类	2021 年末 收盘价	2022 年盘 中最高价	2022 年盘 中最低价	2022 年末 收盘价	全年 涨跌	结算价 平均价	标准差	极差
大商所主力价格 (元/吨)	8 522	9 886	7 411	8 159	-363	8 398.43	519.69	2 475
吉林石化 LLDPE 现货 价格 (元/吨)	8 850	9 600	7 880	8 300	-550	8 565.64	412.24	1 720

数据来源：大连商品交易所、卓创资讯。

表 2-3-88 2022 年 LLDPE 期货和现货市场价格相关性

价格选择	相关系数
大商所主力结算价与 LLDPE 现货市场价格	0.97

数据来源：大连商品交易所、卓创资讯。

十、聚丙烯（PP）期货、期权运行情况

（一）期货、期权交易情况（见表 2-3-89 ~ 表 2-3-92）

表 2-3-89 2022 年 PP 期货月度交易情况

月度	成交量 (万手)	同比变化 (%)	成交金额 (亿元)	同比变化 (%)	月末持仓量 (万手)	同比变化 (%)
1 月	1 314.28	0.89	5 527.62	5.67	56.93	49.5
2 月	1 185.97	10.61	5 066.01	7.72	68.5	74
3 月	1 955.08	9.44	8 829.42	8.3	61.45	51.81
4 月	1 329.83	-13.99	5 812.07	-12.7	56.01	37.16
5 月	1 285.86	-4.16	5 551.88	-3.74	68.29	33.75
6 月	1 447.38	-3.9	6 285.24	0.18	72.5	16.56
7 月	1 584.43	-10.79	6 353.08	-16.03	69.86	11.77
8 月	1 646.42	-6.23	6 440.08	-12.31	70.77	-11.28
9 月	1 315.19	-41.32	5 221.48	-48.22	70.66	-6.11
10 月	1 009.67	-53.68	3 878.03	-62.28	92.88	50.04
11 月	1 504.61	-34.46	5 744.29	-40.78	74.94	-1.72
12 月	1 535.94	-25.68	5 981.86	-28.22	79.19	28.87
总计	17 114.66	-18	70 691.06	-21.54	—	—

数据来源：大连商品交易所。

表 2-3-90 2021—2022 年 PP 期货年度交易情况

年度	成交量 (万手)	同比变化 (%)	成交金额 (亿元)	同比变化 (%)	年末持仓量 (万手)	同比变化 (%)
2021 年	20 870.64	20.38	90 094.6	39.15	61.45	104.64
2022 年	17 114.66	-18	70 691.06	-21.54	79.19	28.87

数据来源：大连商品交易所。

表 2-3-91 2022 年 PP 期权月度交易情况

月度	成交量 (万手)	同比变化 (%)	成交量 看跌/看涨 (PCR)	成交金额 (亿元)	同比变化 (%)	月末持仓量 (万手)	同比变化 (%)
1 月	35.12	71.28	0.68	2.29	48.6	2.94	-4.39
2 月	28.35	23.46	0.96	1.84	-20.54	3.52	-16.28
3 月	31.74	-33.91	0.65	2.53	-37.19	3.59	-28.92
4 月	15.53	-39.59	0.8	0.88	-63.45	1.63	-51.42
5 月	27.75	-15.42	0.98	1.31	-65.89	2.24	-47.5
6 月	65.98	-13.65	1.23	2	-65.13	3.98	-31.7
7 月	49.79	-34.48	1.7	2.1	-56.24	4.31	-41.52
8 月	12.14	-77.71	1.24	0.57	-78.94	1.15	-71.45
9 月	11.22	-81.32	0.9	0.66	-87.58	1.89	-61.61
10 月	17.79	-31.15	1.41	0.7	-80.52	2.96	-22.25
11 月	42.59	10.84	0.91	1.03	-43.82	3.6	-23.11
12 月	16.56	-43.34	0.85	0.69	-65.46	1.32	-36.2
总计	354.56	-30.54	1.02	16.6	-58.61	—	—

数据来源：大连商品交易所。

表 2-3-92 2021—2022 年 PP 期权年度交易情况

年度	成交量 (万手)	同比变化 (%)	成交量 看跌/看涨 (PCR)	成交金额 (亿元)	同比变化 (%)	年末持仓量 (万手)	同比变化 (%)
2021 年	510.5	—	0.88	40.1	—	2.1	-35.8
2022 年	354.56	-30.54	1.02	16.6	-58.61	1.32	-36.2

数据来源：大连商品交易所。

(二) 交割、行权情况 (见表 2-3-93 ~ 表 2-3-96)

表 2-3-93 2022 年 PP 期货月度交割情况

月度	交割量 (手)	同比变化 (%)	交割金额 (亿元)	同比变化 (%)
1 月	1 027	112.19	0.42	117.56
2 月	1 083	2 827.03	0.46	2 791.2
3 月	1 527	20.33	0.66	10.6
4 月	222	-81.39	0.10	-81.32
5 月	3 039	43.69	1.32	41.56
6 月	879	691.89	0.39	747.28
7 月	323	3 488.89	0.13	3 208.06



续表

月度	交割量 (手)	同比变化 (%)	交割金额 (亿元)	同比变化 (%)
8 月	825	9 066.67	0.33	8 705.09
9 月	1 666	6.11	0.67	0.57
10 月	1 510	-60.04	0.60	-67.03
11 月	901	-79.35	0.35	-81.18
12 月	1 095	76.61	0.43	72.2
总计	14 097	-9.4	5.86	-15.28

数据来源: 大连商品交易所。

表 2-3-94 2021—2022 年 PP 期货年度交割情况

年度	交割量 (手)	同比变化 (%)	交割金额 (亿元)	同比变化 (%)
2021 年	15 559	111.4	6.92	139.86
2022 年	14 097	-9.4	5.86	-15.28

数据来源: 大连商品交易所。

表 2-3-95 2022 年 PP 期权月度行权情况

月度	行权量 (手)
1 月	238
2 月	177
3 月	334
4 月	6 081
5 月	113
6 月	71
7 月	145
8 月	5 492
9 月	154
10 月	92
11 月	106
12 月	5 037
总计	18 040

数据来源: 大连商品交易所。

表 2-3-96 2021—2022 年 PP 期权年度行权情况

年度	行权量 (手)	同比变化 (%)
2021 年	49 672	—
2022 年	18 040	-63.68

数据来源: 大连商品交易所。

(三) 期货价格走势 (见图 2-3-10、表 2-3-97、表 2-3-98)



图 2-3-10 2022 年 PP 期货和现货市场价格走势

数据来源：大连商品交易所、卓创资讯。

表 2-3-97 2022 年 PP 期货和现货市场价格指标

市场分类	2021 年末 收盘价	2022 年盘 中最高价	2022 年盘 中最低价	2022 年末 收盘价	全年涨跌	结算价 平均价	标准差	极差
大商所主力价格 (元/吨)	8 143	9 861	7 327	7 825	-318	8 244.06	482.76	2 534
绍兴三圆 T30S PP 现 货价格 (元/吨)	8 600	9 700	7 800	7 890	-710	8 402.69	389.52	1 900

数据来源：大连商品交易所、卓创资讯。

表 2-3-98 2022 年 PP 期货和现货市场价格相关性

价格选择	相关系数
大商所主力结算价与 PP 现货市场价格	0.96

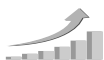
数据来源：大连商品交易所、卓创资讯。

十一、聚氯乙烯 (PVC) 期货、期权运行情况

(一) 期货、期权交易情况 (见表 2-3-99~表 2-3-102)

表 2-3-99 2022 年 PVC 期货月度交易情况

月度	成交量 (万手)	同比变化 (%)	成交金额 (亿元)	同比变化 (%)	月末持仓量 (万手)	同比变化 (%)
1 月	2 059.05	199.66	8 867.6	258.85	59.75	42.95



续表

月度	成交量 (万手)	同比变化 (%)	成交金额 (亿元)	同比变化 (%)	月末持仓量 (万手)	同比变化 (%)
2月	1 783.85	159.19	7 870.48	183.44	70.15	89.06
3月	2 402.55	55.27	10 866.61	61.17	72.91	53.43
4月	1 681.5	45.69	7 587.43	49.53	64.06	34.53
5月	1 535.89	54.22	6 518.14	46.48	76.38	53.83
6月	2 114.38	94.72	8 386.15	79.44	92.32	73.05
7月	3 155.83	210.69	10 306.97	126	90.58	46.22
8月	2 886.38	140.23	9 402.29	71.1	84.96	12.49
9月	2 438.33	38.54	7 632.85	-16.1	99.44	46.12
10月	1 873.3	-12.77	5 554.68	-52.85	151.8	173.61
11月	3 282.75	18.36	9 624	-19.93	138.15	107.25
12月	3 152.33	17.71	9 815.71	-12.25	135.14	109.32
总计	28 366.14	59.94	102 432.91	27.52	—	—

数据来源：大连商品交易所。

表 2-3-100 2021—2022 年 PVC 期货年度交易情况

年度	成交量 (万手)	同比变化 (%)	成交金额 (亿元)	同比变化 (%)	年末持仓量 (万手)	同比变化 (%)
2021年	17 735.02	203.3	80 326.91	314.72	64.56	57.45
2022年	28 366.14	59.94	102 432.91	27.52	135.14	109.32

数据来源：大连商品交易所。

表 2-3-101 2022 年 PVC 期权月度交易情况

月度	成交量 (万手)	同比变化 (%)	成交量 看跌/看涨 (PCR)	成交金额 (亿元)	同比变化 (%)	月末持仓量 (万手)	同比变化 (%)
1月	31.57	27.93	0.44	3.34	88.01	4.37	12.08
2月	41.38	81.74	0.66	3.07	18.96	6.47	59.14
3月	55.31	9.88	0.29	2.83	-40.55	6.54	-4.35
4月	21.45	-18.72	0.34	0.95	-65.95	1.93	-53.29
5月	22.26	19.42	0.71	1.49	-44.82	4.1	-5.14
6月	60.34	71.43	0.81	3.77	-1.43	7.39	32.28
7月	97.38	126.98	0.62	4.28	12.18	9.99	58.23
8月	32.9	2.8	0.94	1.49	-30.56	1.88	-59.31
9月	33.79	-26.42	0.67	2.02	-69.24	4.8	-16.64
10月	45.06	31.69	0.76	1.64	-77.32	9.57	44.29
11月	116.45	78.52	0.54	2.88	-36.03	11.91	36.73
12月	50.94	20.51	0.67	2.13	-46.71	3.48	-0.96
总计	608.83	38.2	0.6	29.89	-35.98	—	—

数据来源：大连商品交易所。

表 2-3-102 2021—2022 年 PVC 期权年度交易情况

年度	成交量 (万手)	同比变化 (%)	成交量 看跌/看涨 (PCR)	成交金额 (亿元)	同比变化 (%)	年末持仓量 (万手)	同比变化 (%)
2021 年	440.6	—	0.93	46.7	—	3.5	-29.3
2022 年	608.83	38.2	0.6	29.89	-35.98	3.48	-0.96

数据来源：大连商品交易所。

(二) 交割、行权情况 (见表 2-3-103 ~ 表 2-3-106)

表 2-3-103 2022 年 PVC 期货月度交割情况

月度	交割量 (手)	同比变化 (%)	交割金额 (亿元)	同比变化 (%)
1 月	9 825	-23.24	4.16	-7.74
2 月	7 642	216.57	3.51	279.51
3 月	5 406	47.83	2.43	55.08
4 月	3 500	8.29	1.61	13.88
5 月	3 311	-57.5	1.47	-59.75
6 月	729	-57.57	0.31	-59.99
7 月	1 339	92.94	0.47	45.78
8 月	2 431	6 845.71	0.84	4 900.63
9 月	16 544	162.1	5.59	82.08
10 月	3 840	137.77	1.17	10.68
11 月	930	-75.18	0.27	-84.77
12 月	1 379	147.13	0.41	64.93
总计	56 876	27.6	22.24	14.96

数据来源：大连商品交易所。

表 2-3-104 2021—2022 年 PVC 期货年度交割情况

年度	交割量 (手)	同比变化 (%)	交割金额 (亿元)	同比变化 (%)
2021 年	44 572	225.13	19.36	330.65
2022 年	56 876	27.6	22.24	14.96

数据来源：大连商品交易所。

表 2-3-105 2022 年 PVC 期权月度行权情况

月度	行权量 (手)
1 月	309
2 月	199
3 月	239
4 月	7 716
5 月	112
6 月	218
7 月	1 936

续表

月度	行权量 (手)
8 月	17 479
9 月	211
10 月	101
11 月	55
12 月	12 630
总计	41 205

数据来源: 大连商品交易所。

表 2-3-106 2021—2022 年 PVC 期权年度行权情况

年度	行权量 (手)	同比变化 (%)
2021 年	65 070	—
2022 年	41 205	-36.68

数据来源: 大连商品交易所。

(三) 期货价格走势 (见图 2-3-11、表 2-3-107、表 2-3-108)



图 2-3-11 2022 年 PVC 期货和现货市场价格走势

数据来源: 大连商品交易所、卓创资讯。

表 2-3-107 2022 年 PVC 期货和现货市场价格指标

市场分类	2021 年末 收盘价	2022 年盘 中最高价	2022 年盘 中最低价	2022 年末 收盘价	全年 涨跌	结算价 平均价	标准差	极差
大商所主力价格 (元/吨)	8 321	9 529	5 484	6 263	-2 058	7 417.27	1 275.52	4 045
PVC 新疆天业 (杭州) 现货价格 (元/吨)	8 420	9 415	5 790	6 320	-2 100	7 562.17	1 234.44	3 625

数据来源: 大连商品交易所、Wind。

表 2-3-108 2022 年 PVC 期货和现货市场价格相关性

价格选择	相关系数
大商所主力结算价与 PVC 现货市场价格	0.997

数据来源：大连商品交易所、Wind。

十二、焦炭期货运行情况

(一) 期货交易情况 (见表 2-3-109、表 2-3-110)

表 2-3-109 2022 年焦炭期货月度交易情况

月度	成交量 (万手)	同比变化 (%)	成交金额 (亿元)	同比变化 (%)	月末持仓量 (万手)	同比变化 (%)
1 月	67.28	-89.76	2 049.27	-88.84	2.76	-85.03
2 月	64.31	-82.61	2 065.96	-78.37	3.6	-80.47
3 月	76.16	-88.56	2 755.31	-82.03	3.71	-81.32
4 月	69.88	-87.93	2 717.63	-81.22	2.83	-87.28
5 月	65.16	-89.66	2 205.73	-86.51	3.09	-88.34
6 月	88.27	-88.45	2 909.86	-85.66	3.55	-86.91
7 月	105.33	-86.5	2 914.09	-85.99	4.02	-87.88
8 月	104.19	-87.74	2 902.68	-88.67	3.94	-84.05
9 月	73.54	-74.47	1 920.58	-80.47	3.96	-55.7
10 月	54.3	-62.86	1 438.99	-73.15	4.28	-22.5
11 月	75.22	-22.02	1 992.69	-26.14	3.99	24.62
12 月	82.11	-6.2	2 286.46	-11.49	3.12	-3.89
总计	925.75	-84.34	28 159.25	-82.54	—	—

数据来源：大连商品交易所。

表 2-3-110 2021—2022 年焦炭期货年度交易情况

年度	成交量 (万手)	同比变化 (%)	成交金额 (亿元)	同比变化 (%)	年末持仓量 (万手)	同比变化 (%)
2021 年	5 913.3	2.9	161 252.09	31.54	3.25	-84.62
2022 年	925.75	-84.34	28 159.25	-82.54	3.12	-3.89

数据来源：大连商品交易所。

(二) 交割情况 (见表 2-3-111、表 2-3-112)

表 2-3-111 2022 年焦炭期货月度交割情况

月度	交割量 (手)	同比变化 (%)	交割金额 (亿元)	同比变化 (%)
1 月	320	-60.49	0.99	-60.26

续表

月度	交割量（手）	同比变化（%）	交割金额（亿元）	同比变化（%）
2月	10	-97.67	0.03	-97.48
3月	30	-84.21	0.11	-79.07
4月	0	-100	0	-100
5月	450	-57.55	1.65	-41.02
6月	0	-100	0	-100
7月	0	-100	0	-100
8月	0	-100	0	-100
9月	750	177.78	1.83	70.06
10月	0	-100	0	-100
11月	0	-100	0	-100
12月	0	-100	0	-100
总计	1 560	-53.43	4.61	-53.59

数据来源：大连商品交易所。

表 2-3-112 2021—2022 年焦炭期货年度交割情况

年度	交割量（手）	同比变化（%）	交割金额（亿元）	同比变化（%）
2021年	3 350	216.04	9.92	360.31
2022年	1 560	-53.43	-4.61	-53.59

数据来源：大连商品交易所。

（三）期货价格走势（见图 2-3-12、表 2-3-113、表 2-3-114）



图 2-3-12 2022 年焦炭期货和现货市场价格走势

数据来源：大连商品交易所、我的钢铁网。

表 2-3-113 2022 年焦炭期货和现货市场价格指标

市场分类	2021 年末 收盘价	2022 年盘 中最高价	2022 年盘 中最低价	2022 年末 收盘价	全年 涨跌	结算价 平均价	标准差	极差
大商所主力价格 (元/吨)	2 934	4 284	2 367.5	2 670	-264	3 070.9	438.44	1 916.5
日照港准一级冶金焦 现货价格 (元/吨)	2 570	4 030	2 450	2 750	180	3 014.88	427.77	1 580

数据来源：大连商品交易所、我的钢铁网。

表 2-3-114 2022 年焦炭期货和现货市场价格相关性

价格选择	相关系数
大商所主力结算价与焦炭现货市场价格	0.94

数据来源：大连商品交易所、我的钢铁网。

十三、焦煤期货运行情况

(一) 期货交易情况 (见表 2-3-115、表 2-3-116)

表 2-3-115 2022 年焦煤期货月度交易情况

月度	成交量 (万手)	同比变化 (%)	成交金额 (亿元)	同比变化 (%)	月末持仓量 (万手)	同比变化 (%)
1 月	84.71	-82.93	1 156.23	-76.79	3.28	-76.99
2 月	88.15	-67.9	1 318.47	-46.94	5.04	-65.72
3 月	131.49	-75.41	2 341.3	-52.5	5.95	-67.41
4 月	100.59	-76.44	1 828.39	-57.3	3.91	-80.42
5 月	101.49	-83.21	1 591.79	-76.51	4.37	-82.78
6 月	137.03	-79.82	2 104.16	-73.25	4.83	-83.07
7 月	186.61	-74.58	2 325.41	-73.87	6.27	-85.45
8 月	170.07	-85.46	2 093.8	-87.31	6.08	-82.94
9 月	130.82	-71.22	1 550.64	-79.73	6.96	-51.05
10 月	92.23	-52.01	1 119.89	-68.46	8.31	31.08
11 月	131.52	-5.53	1 589.67	-6.14	9.33	99.84
12 月	153.03	22.71	1 783.38	13.42	7.74	60.14
总计	1 507.74	-74.14	20 803.13	-70.78	—	—

数据来源：大连商品交易所。

表 2-3-116 2021—2022 年焦煤期货年度交易情况

年度	成交量 (万手)	同比变化 (%)	成交金额 (亿元)	同比变化 (%)	年末持仓量 (万手)	同比变化 (%)
2021 年	5 830.59	120.59	71 189.65	236.93	4.84	-62.47
2022 年	1 507.74	-74.14	20 803.13	-70.78	7.74	60.14

数据来源：大连商品交易所。

(二) 交割情况 (见表 2-3-117、表 2-3-118)

表 2-3-117 2022 年焦煤期货月度交割情况

月度	交割量 (手)	同比变化 (%)	交割金额 (亿元)	同比变化 (%)
1 月	3 000	57.89	4.03	126.07
2 月	0	-100	0	-100
3 月	0	-100	0	-100
4 月	0	-100	0	-100
5 月	1 300	30	2.37	123.62
6 月	0	-100	0	-100
7 月	0	-100	0	-100
8 月	0	-100	0	-100
9 月	300	-88.46	0.38	-92.05
10 月	0	-100	0	-100
11 月	0	-100	0	-100
12 月	0	—	0	—
总计	4 600	-52.08	6.78	-44.76

数据来源: 大连商品交易所。

表 2-3-118 2021—2022 年焦煤期货年度交割情况

年度	交割量 (手)	同比变化 (%)	交割金额 (亿元)	同比变化 (%)
2021 年	9 600	65.52	12.29	186.93
2022 年	4 600	-52.08	6.78	-44.76

数据来源: 大连商品交易所。

(三) 期货价格走势 (见图 2-3-13、表 2-3-119、表 2-3-120)



图 2-3-13 2022 年焦煤期货和现货市场价格走势

数据来源: 大连商品交易所、我的钢铁网。

表 2-3-119 2022 年焦煤期货和现货市场价格指标

市场分类	2021 年末 收盘价	2022 年盘 中最高价	2022 年盘 中最低价	2022 年末 收盘价	全年 涨跌	结算价 平均价	标准差	极差
大商所主力价格 (元/吨)	2 228.5	3 297.5	1 778	1 864.5	-364	2 355.51	401.69	1 519.5
柳林中硫主焦煤现货 价格(元/吨)	2 400	3 080	1 900	2 450	50	2 442.36	355.82	1 180

数据来源：大连商品交易所、我的钢铁网。

表 2-3-120 2022 年焦煤期货和现货市场价格相关性

价格选择	相关系数
大商所主力结算价与焦煤现货市场价格	0.78

数据来源：大连商品交易所、我的钢铁网。

十四、铁矿石期货、期权运行情况

(一) 期货、期权交易情况 (见表 2-3-121 ~ 表 2-3-126)

表 2-3-121 2022 年铁矿石期货月度交易情况

月度	成交量 (万手)	同比变化 (%)	成交金额 (亿元)	同比变化 (%)	月末持仓量 (万手)	同比变化 (%)
1 月	1 533.01	71.79	11 164.21	20.68	99.6	67.04
2 月	1 551.1	151.75	11 385.47	76.72	98.24	50.22
3 月	2 130.86	74.12	17 279.01	36.6	102.2	31.74
4 月	1 368.04	48.74	12 069.48	24.74	98.39	23.76
5 月	1 432.73	39.67	11 824.96	0.88	120.07	39.07
6 月	1 753.28	58.14	14 233.09	11.64	125.46	21.77
7 月	2 261.77	91.52	15 789.31	17.99	126.7	13.45
8 月	2 190.22	21.2	15 859.81	3.33	113.34	3.94
9 月	1 712.27	-10.91	12 062.07	-11.6	109.04	21.04
10 月	1 284.43	-15.02	8 679.98	-18.94	130.68	33.36
11 月	2 559.93	3.12	17 932.9	26.51	144.3	34.64
12 月	2 334.43	-15.14	18 834.04	3.91	131.33	22.27
总计	22 112.07	26.78	167 114.33	13.01	—	—

数据来源：大连商品交易所。

表 2-3-122 2021—2022 年铁矿石期货年度交易情况

年度	成交量 (万手)	同比变化 (%)	成交金额 (亿元)	同比变化 (%)	年末持仓量 (万手)	同比变化 (%)
2021 年	17 441.2	-38.72	147 872.51	-31.52	107.41	76.98
2022 年	22 112.07	26.78	167 114.33	13.01	131.33	22.27

数据来源：大连商品交易所。

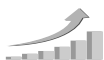


表 2-3-123 2021—2022 年铁矿石期货内外盘年度交易情况

年度	成交量（万手）		年末持仓量（万手）	
	大商所（DCE）	SGX（新加坡交易所）	大商所（DCE）	SGX（新加坡交易所）
2021 年	17 441.2	1 818.47	107.41	73.7
2022 年	22 112.07	2 507.84	131.33	88.66

注：大商所铁矿石期货交易单位为 100 吨/手，新加坡交易所铁矿石期货交易单位为 100 公吨/手。

数据来源：大连商品交易所、SGX（新加坡交易所）。

表 2-3-124 2022 年铁矿石期权月度交易情况

月度	成交量（万手）	同比变化（%）	成交量看跌/看涨（PCR）	成交金额（亿元）	同比变化（%）	月末持仓量（万手）	同比变化（%）
1 月	157.58	133.08	1.33	30.85	40.61	24.42	51.72
2 月	253.88	266.94	1.33	43.71	86.15	31.38	83.05
3 月	348.5	111.57	1.03	55.57	46.2	33.9	54.61
4 月	247.09	217.06	1.3	40.86	76.19	16.16	23.24
5 月	257.54	167.72	1.39	42.27	-2.13	23.47	51.24
6 月	359.79	184.58	1.55	63.86	40.46	38.4	62.93
7 月	508.91	136.9	1.46	71.24	48.99	38.99	57.19
8 月	351.38	99.12	1.19	48.45	-2.08	24.6	28.8
9 月	270.02	99.9	1.23	32.4	-17.49	30.25	40.05
10 月	299.84	160.94	1.16	33.02	14.8	45.56	76.7
11 月	669.87	105.1	1.18	70.8	43.76	52.6	33.38
12 月	446.82	87.77	1.61	49.49	17.31	40.8	66.8
总计	4 171.22	130.72	1.3	582.52	28.87	—	—

数据来源：大连商品交易所。

表 2-3-125 2021—2022 年铁矿石期权年度交易情况

年度	成交量（万手）	同比变化（%）	成交量看跌/看涨（PCR）	成交金额（亿元）	同比变化（%）	年末持仓量（万手）	同比变化（%）
2021 年	1 807.9	55.9	1.01	452	95.5	24.5	32.9
2022 年	4 171.22	130.72	1.3	582.52	28.87	40.8	66.8

数据来源：大连商品交易所。

表 2-3-126 2021—2022 年铁矿石期权内外盘年度交易情况

年度	成交量（万手）		年末持仓量（万手）	
	大商所（DCE）	SGX（新加坡交易所）	大商所（DCE）	SGX（新加坡交易所）
2021 年	1 807.9	332.5	24.5	58.6
2022 年	4 171.22	529.17	40.8	64.34

注：大商所铁矿石期权交易单位为 1 手（100 吨）铁矿石期货合约；新加坡交易所铁矿石期权交易单位为 1 手（100 公吨）铁矿石期货合约。

数据来源：大连商品交易所、新加坡交易所（SGX）。

(二) 交割、行权情况 (见表 2-3-127~表 2-3-130)

表 2-3-127 2022 年铁矿石期货月度交割情况

月度	交割量 (手)	同比变化 (%)	交割金额 (亿元)	同比变化 (%)
1 月	11 200	286.21	7.79	139.86
2 月	900	200	0.73	108.97
3 月	600	0	0.51	-32.98
4 月	200	-60	0.19	-68.41
5 月	200	-94.59	0.2	-95.9
6 月	100	-66.67	0.1	-75.34
7 月	0	—	0	—
8 月	800	—	0.63	—
9 月	3 400	277.78	2.61	228.02
10 月	1 500	400	1.14	427.32
11 月	0	-100	0	-100
12 月	400	-55.56	0.32	-40.86
总计	19 300	80.37	14.22	19.69

数据来源: 大连商品交易所。

表 2-3-128 2021—2022 年铁矿石期货年度交割情况

年度	交割量 (手)	同比变化 (%)	交割金额 (亿元)	同比变化 (%)
2021 年	10 700	-45.96	11.87	-28.8
2022 年	19 300	80.37	14.22	19.69

数据来源: 大连商品交易所。

表 2-3-129 2022 年铁矿石期权月度行权情况

月度	行权量 (手)
1 月	9 786
2 月	5 385
3 月	6 955
4 月	28 284
5 月	4 727
6 月	5 562
7 月	8 842
8 月	24 223
9 月	4 995
10 月	5 426
11 月	7 091
12 月	47 973
总计	159 249

数据来源: 大连商品交易所。

表 2-3-130 2021—2022 年铁矿石期权年度行权情况

年度	行权量（手）	同比变化（%）
2021 年	114 976	-14.4
2022 年	159 249	38.51

数据来源：大连商品交易所。

（三）期货价格走势（见图 2-3-14、表 2-3-131、表 2-3-132）

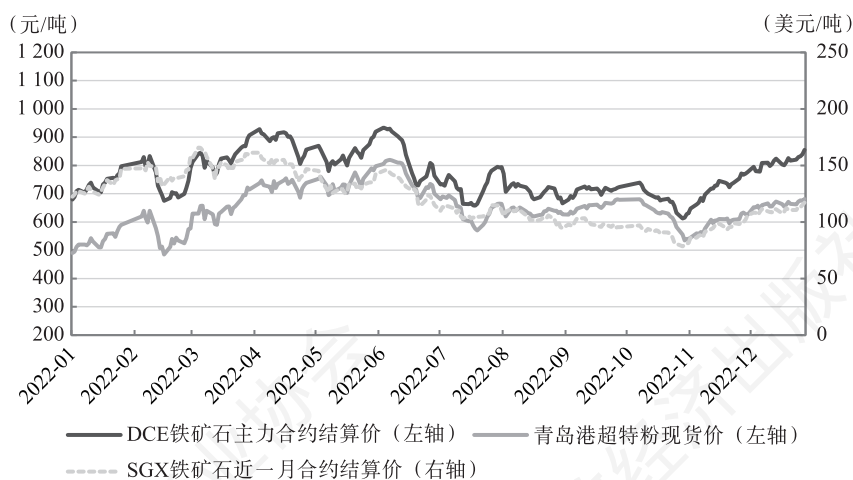


图 2-3-14 2022 年铁矿石期货内外盘和国内现货市场价格走势

数据来源：大连商品交易所、Wind。

表 2-3-131 2022 年铁矿石期货内外盘和国内现货市场价格指标

市场分类	2021 年末 收盘价	2022 年盘 中最高价	2022 年盘 中最低价	2022 年末 收盘价	全年 涨跌	结算价 平均价	标准差	极差
大商所主力价格 (元/吨)	680	948	599.5	863	183	767.37	75.23	348.5
SGX 连续价格 (美元/公吨)	121.07	165.88	78.57	117.15	-3.92	120.16	22.23	87.31
青岛港超特粉现货 价格 (元/吨)	490	820	485	681	191	649.07	73.02	335

数据来源：大连商品交易所、Wind。

表 2-3-132 2022 年铁矿石期货内外盘和国内现货市场价格相关性

价格选择	相关系数
大商所主力结算价与 CME Group 连续价格	0.73
大商所主力结算价与铁矿石现货市场价格	0.75

数据来源：大连商品交易所、Wind。

十五、乙二醇期货运行情况

(一) 期货交易情况 (见表 2-3-133、表 2-3-134)

表 2-3-133 2022 年乙二醇期货月度交易情况

月度	成交量 (万手)	同比变化 (%)	成交金额 (亿元)	同比变化 (%)	月末持仓量 (万手)	同比变化 (%)
1 月	772.5	-0.12	4 059.24	17.92	40.36	26.56
2 月	653.58	-14.97	3 391.92	-14.85	51.36	49.71
3 月	1 123.24	-32.9	5 979.3	-33.57	45.01	51.59
4 月	968.7	-4.83	4 761.91	-3.25	43.96	42.28
5 月	885.49	-0.18	4 446.53	1.62	47.47	36.3
6 月	1 070.08	40.42	5 287.26	41.76	59.98	76.25
7 月	1 099.77	16.42	4 757.64	-3.78	51.25	18.4
8 月	1 203.07	27.78	4 934.7	1.51	55.35	45.25
9 月	1 032.07	5.09	4 466.24	-17.76	46.77	20.49
10 月	641.08	-55.47	2 588.8	-71.96	66.29	105.65
11 月	1 103.69	-2.59	4 289.8	-29.14	60.35	45
12 月	1 186.56	33.5	4 830.66	11.9	51.06	24.99
总计	11 739.83	-3.87	53 794	-16.33	—	—

数据来源: 大连商品交易所。

表 2-3-134 2021—2022 年乙二醇期货年度交易情况

年度	成交量 (万手)	同比变化 (%)	成交金额 (亿元)	同比变化 (%)	年末持仓量 (万手)	同比变化 (%)
2021 年	12 212.69	46.58	64 293.73	100.14	40.85	50.18
2022 年	11 739.83	-3.87	53 794	-16.33	51.06	24.99

数据来源: 大连商品交易所。

(二) 交割情况 (见表 2-3-135、表 2-3-136)

表 2-3-135 2022 年乙二醇期货月度交割情况

月度	交割量 (手)	同比变化 (%)	交割金额 (亿元)	同比变化 (%)
1 月	7 385	212.39	3.80	256.86
2 月	2 168	610.82	1.11	755.55
3 月	1 093	51.6	0.53	30.28
4 月	2 273	1 375.97	1.15	1 427.91



续表

月度	交割量（手）	同比变化（%）	交割金额（亿元）	同比变化（%）
5月	3 358	148.01	1.65	146.3
6月	4 106	950.13	2.02	972.29
7月	3 942	1 175.73	1.70	1 046.33
8月	965	534.87	0.41	463.72
9月	7 919	313.74	3.19	214.71
10月	3 846	110.16	1.60	31.41
11月	4 846	221.57	1.83	119.88
12月	2 037	231.22	0.80	170.66
总计	43 938	278.25	19.79	223.51

数据来源：大连商品交易所。

表 2-3-136 2021—2022 年乙二醇期货年度交割情况

年度	交割量（手）	同比变化（%）	交割金额（亿元）	同比变化（%）
2021 年	11 616	-28.67	6.11	2.19
2022 年	43 938	278.25	19.79	223.51

数据来源：大连商品交易所。

（三）期货价格走势（见图 1-3-15、表 2-3-137、表 2-3-138）



图 2-3-15 2022 年乙二醇期货和现货市场价格走势

数据来源：大连商品交易所、卓创资讯。

表 2-3-137 2022 年乙二醇期货和现货市场价格指标

市场分类	2021 年末 收盘价	2022 年盘 中最高价	2022 年盘 中最低价	2022 年末 收盘价	全年 涨跌	结算价 平均价	标准差	极差
大商所主力价格 (元/吨)	4 935	5 903	3 715	4 190	-745	4 596.48	536.47	2 188

续表

市场分类	2021 年末 收盘价	2022 年盘 中最高价	2022 年盘 中最低价	2022 年末 收盘价	全年 涨跌	结算价 平均价	标准差	极差
华东地区乙二醇现货 价格 (元/吨)	4 880	5 677.5	3 772.5	4 007.5	-872.5	4 527.36	513.1	1 905

数据来源：大连商品交易所、卓创资讯。

表 2-3-138 2022 年乙二醇期货和现货市场价格相关性

价格选择	相关系数
大商所主力结算价与乙二醇现货市场价格	0.996

数据来源：大连商品交易所、卓创资讯。

十六、胶合板期货运行情况

(一) 期货交易情况 (见表 2-3-139)

表 2-3-139 2021—2022 年胶合板期货年度交易情况

年度	成交量 (手)	同比变化 (%)	成交金额 (万元)	同比变化 (%)	年末持仓量 (手)	同比变化 (%)
2021 年	307	-83.93	4 252.34	-77.19	0	—
2022 年	39	-87.3	774.68	-81.78	0	—

数据来源：大连商品交易所。

(二) 交割情况

2022 年，大商所胶合板期货没有交割。

(三) 期货价格走势 (见图 2-3-16、表 2-3-140、表 2-3-141)

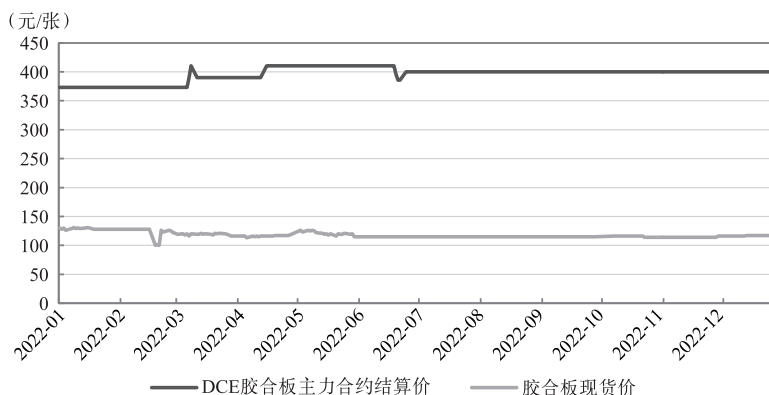


图 2-3-16 2022 年胶合板期货和现货市场价格走势

数据来源：大连商品交易所、Wind 资讯 (1—6 月)、隆众资讯 (7—12 月)。



表 2-3-140 2022 年胶合板期货和现货市场价格指标

市场分类	2021 年末 收盘价	2022 年盘 中最高价	2022 年盘 中最低价	2022 年末 收盘价	全年 涨跌	结算价 平均价	标准差	极差
大商所主力价格 (元/张)	373.3	451.65	370.05	400	26.7	396.17	11.87	81.6
鱼珠现货市场胶合板 现货价格 (元/张)	83	131	100	117	34	117.67	5.09	31

数据来源：大连商品交易所、隆众资讯。

表 2-3-141 2022 年胶合板期货和现货市场价格相关性

价格选择	相关系数
大商所主力结算价与胶合板现货市场价格	-0.54

数据来源：大连商品交易所、Wind 资讯（1—6 月）、隆众资讯（7—12 月）。

十七、纤维板期货运行情况

（一）期货交易情况（见表 2-3-142）

表 2-3-142 2021—2022 年纤维板期货年度交易情况

年度	成交量 (万手)	同比变化 (%)	成交金额 (亿元)	同比变化 (%)	年末持仓量 (手)	同比变化 (%)
2021 年	155.45	50.4	210.96	50.43	1 004	18.4
2022 年	48.13	-69.04	63.98	-69.67	0.19	93.03

数据来源：大连商品交易所。

（二）交割情况（见表 2-3-143、表 2-3-144）

表 2-3-143 2022 年纤维板期货月度交割情况

月度	交割量 (手)	同比变化 (%)	交割金额 (万元)	同比变化 (%)
1 月	133	216.67	167.31	210.38
2 月	86	68.63	111.03	77.13
3 月	200	-21.57	257.9	-6.96
4 月	150	-49.15	200.03	-45.84
5 月	100	-45.95	135.35	-44.17
6 月	50	-48.98	70.1	-46.22
7 月	0	-100	0	-100
8 月	11	-8.33	14.94	-2.94
9 月	41	-85.86	56.97	-84.22

续表

月度	交割量（手）	同比变化（%）	交割金额（万元）	同比变化（%）
10月	209	5125	256.97	4401.85
11月	43	975	52.31	802.2
12月	0	—	0	—
总计	1023	-24.05	1322.91	-20.61

数据来源：大连商品交易所。

表 2-3-144 2021—2022 年纤维板期货年度交割情况

年度	交割量（手）	同比变化（%）	交割金额（亿元）	同比变化（%）
2021年	1347	94.37	0.17	105.05
2022年	1023	-24.05	0.13	-20.61

数据来源：大连商品交易所。

(三) 期货价格走势（见图 2-3-17、表 2-3-145、表 2-3-146）



图 2-3-17 2022 年纤维板期货和现货市场价格走势

数据来源：大连商品交易所、隆众资讯。

表 2-3-145 2022 年纤维板期货和现货市场价格指标

市场分类	2021 年末 收盘价	2022 年盘 中最高价	2022 年盘 中最低价	2022 年末 收盘价	全年 涨跌	结算价 平均价	标准差	极差
大商所主力价格 (元/立方米)	1243	1445	1175	1188	-55	1315.03	67	270
纤维板现货（广西） 价格（元/立方米）	1200	1420	1200	1200	-659	1330.23	65.01	220

数据来源：大连商品交易所、隆众资讯。



表 2-3-146 2022 年纤维板期货和现货市场价格相关性

价格选择	相关系数
大商所主力结算价与纤维板现货市场价格	0.86

数据来源：大连商品交易所、隆众资讯。

十八、粳米期货运行情况

(一) 期货交易情况 (见表 2-3-147、表 2-3-148)

表 2-3-147 2022 年粳米期货月度交易情况

月度	成交量 (万手)	同比变化 (%)	成交金额 (亿元)	同比变化 (%)	月末持仓量 (万手)	同比变化 (%)
1月	26.35	-62.72	89.02	-65.81	2.26	-19.69
2月	21.11	-50.23	72.9	-52.92	2.54	-9.82
3月	31.79	-56.92	110.09	-58.8	2.95	-22.63
4月	25.8	-48.69	88.39	-51.38	2.59	-39.87
5月	25.51	-23.11	87.87	-26.8	3.22	-8.84
6月	24.7	-38.45	83.42	-41.31	3.08	-2.88
7月	18.16	-46.21	61.12	-48.75	3.17	-0.4
8月	19.58	-48.98	66.53	-51.14	3.06	3.02
9月	14.47	-54.97	49.33	-56.09	2.72	20.69
10月	11.22	-63.25	38.13	-63.7	3.11	18.99
11月	13.81	-68.87	46.95	-69.63	2.87	-0.99
12月	11.77	-75.84	39.82	-75.87	2.48	-30.3
总计	244.27	-54.63	833.57	-56.56	—	—

数据来源：大连商品交易所。

表 2-3-148 2021—2022 年粳米期货年度交易情况

年度	成交量 (万手)	同比变化 (%)	成交金额 (亿元)	同比变化 (%)	年末持仓量 (万手)	同比变化 (%)
2021 年	538.37	4.32	1 918.75	5.51	3.56	-23.97
2022 年	244.27	-54.63	833.57	-56.56	2.48	-30.3

数据来源：大连商品交易所。

(二) 交割情况 (见表 2-3-149、表 2-3-150)

表 2-3-149 2022 年粳米期货月度交割情况

月度	交割量 (手)	同比变化 (%)	交割金额 (万元)	同比变化 (%)
1月	30	-91.55	100.11	-91.88

续表

月度	交割量（手）	同比变化（%）	交割金额（万元）	同比变化（%）
2月	109	-90.35	363.25	-91.13
3月	20	-93.94	65.54	-94.32
4月	39	-68.55	127.97	-70.79
5月	159	-41.33	539.02	-43.07
6月	151	-80.86	495.45	-82.62
7月	24	-95.71	78.24	-96.03
8月	0	-100	0	-100
9月	30	-	99.24	-
10月	4	-80	13.48	-79.15
11月	343	802.63	1 153.72	869.07
12月	18	-48.57	60.3	-42.57
总计	927	-76.72	3 096.32	-78.04

数据来源：大连商品交易所。

表 2-3-150 2021—2022 年粳米期货年度交割情况

年度	交割量（手）	同比变化（%）	交割金额（亿元）	同比变化（%）
2021年	3 982	189.81	1.41	217.28
2022年	927	-76.72	0.31	-78.04

数据来源：大连商品交易所。

(三) 期货价格走势（见图 2-3-18、表 2-3-151、表 2-3-152）



图 2-3-18 2022 年粳米期货和现货市场价格走势

数据来源：大连商品交易所、Wind。

表 2-3-151 2022 年粳米期货和现货市场价格指标

市场分类	2021 年末 收盘价	2022 年盘 中最高价	2022 年盘 中最低价	2022 年末 收盘价	全年 涨跌	结算价 平均价	标准差	极差
大商所主力价格 (元/吨)	3 323	3 622	3 285	3 367	44	3 388.66	42.76	337
佳木斯普通粳米现货 价格(元/吨)	3 650	3 650	3 560	3 570	-80	3 599.3	29.87	90

数据来源：大连商品交易所、Wind。

表 2-3-152 2022 年粳米期货和现货市场价格相关性

价格选择	相关系数
大商所主力结算价与粳米现货市场价格	-0.12

数据来源：大连商品交易所、Wind。

十九、苯乙烯期货运行情况

(一) 期货交易情况（见表 2-3-153、表 2-3-154）

表 2-3-153 2022 年苯乙烯期货月度交易情况

月度	成交量 (万手)	同比变化 (%)	成交金额 (亿元)	同比变化 (%)	月末持仓量 (万手)	同比变化 (%)
1 月	568.19	-20.38	2 454.26	-0.35	19.31	28.29
2 月	410.98	-43.57	1 872.47	-39.59	18.83	4.03
3 月	555.86	-33.36	2 719.73	-26.23	18.3	25.37
4 月	456.14	-37.32	2 216.75	-31.79	19.04	-10.59
5 月	501.22	-24.16	2 523.01	-18.75	28.07	36.14
6 月	720.63	-5.14	3 823.15	16.8	20.27	-32.28
7 月	724.43	-13.05	3 288.71	-13.46	20.92	-14.65
8 月	842.6	24.71	3 489.78	19.8	24.74	1.31
9 月	910.62	18.19	3 985.34	13.09	19.44	12.26
10 月	633.13	17.43	2 607.01	1.31	25.51	37.51
11 月	872.18	28.47	3 448.03	18.94	22.75	-3.47
12 月	744.74	6.94	3 037.77	8.42	27.61	27.75
总计	7 940.72	-7.86	35 466.01	-5.14	—	—

数据来源：大连商品交易所。

表 2-3-154 2021—2022 年苯乙烯期货年度交易情况

年度	成交量 (万手)	同比变化 (%)	成交金额 (亿元)	同比变化 (%)	年末持仓量 (万手)	同比变化 (%)
2021 年	8 617.99	64.34	37 388.86	122.73	21.62	112.76
2022 年	7 940.72	-7.86	35 466.01	-5.14	27.61	27.75

数据来源：大连商品交易所。

(二) 交割情况 (见表 2-3-155、表 2-3-156)

表 2-3-155 2022 年苯乙烯期货月度交割情况

月度	交割量 (手)	同比变化 (%)	交割金额 (亿元)	同比变化 (%)
1 月	516	-40.69	0.22	-23.58
2 月	2 140	-60.81	0.95	-60.93
3 月	3 120	3.31	1.55	22.89
4 月	1 204	-59.87	0.59	-60.5
5 月	2 433	57.99	1.23	56.61
6 月	925	334.27	0.50	431.28
7 月	1 421	173.27	0.69	185.48
8 月	861	97.93	0.37	93.08
9 月	738	12.50	0.35	19.2
10 月	1 566	0.19	0.67	-9.49
11 月	962	-20.3	0.40	-28.1
12 月	345	-54.18	0.14	-55.09
总计	16 231	-15.63	7.66	-11.76

数据来源: 大连商品交易所。

表 2-3-156 2021—2022 年苯乙烯期货年度交割情况

年度	交割量 (手)	同比变化 (%)	交割金额 (亿元)	同比变化 (%)
2021 年	19 237	5.53	8.67	55.95
2022 年	16 231	-15.63	7.66	-11.76

数据来源: 大连商品交易所。

(三) 期货价格走势 (见图 2-3-19、表 2-3-157、表 2-3-158)



图 2-3-19 2022 年苯乙烯期货和现货市场价格走势

数据来源: 大连商品交易所、卓创资讯。

表 2-3-157 2022 年苯乙烯期货和现货市场价格指标

市场分类	2021 年末 收盘价	2022 年盘 中最高价	2022 年盘 中最低价	2022 年末 收盘价	全年 涨跌	结算价 平均价	标准差	极差
大商所主力价格 (元/吨)	8 552	11 515	7 550	8 455	-97	9 053.9	864.56	3 965
苯乙烯(江苏)现货 价格(元/吨)	8 450	11 365	7 785	8 325	-125	9 295.18	850.57	3 580

数据来源：大连商品交易所、卓创资讯。

表 2-3-158 2022 年苯乙烯期货和现货市场价格相关性

价格选择	相关系数
大商所主力结算价与苯乙烯现货市场价格	0.92

数据来源：大连商品交易所、卓创资讯。

二十、液化石油气期货、期权运行情况

(一) 期货、期权交易情况（见表 2-3-159~表 2-3-162）

表 2-3-159 2022 年液化石油气期货月度交易情况

月度	成交量 (万手)	同比变化 (%)	成交金额 (亿元)	同比变化 (%)	月末持仓量 (万手)	同比变化 (%)
1 月	502.52	116.44	4 781.04	177.02	11.01	27.7
2 月	397.25	85.63	4 266.97	174	11.12	110.88
3 月	462.76	111.94	5 823.22	239.69	10.4	98.81
4 月	302.16	78.66	3 627.33	184.94	9.07	1.1
5 月	337.49	74.2	4 097.84	155.12	9.92	2.62
6 月	387.66	77.42	4 487.9	127.37	10.59	0.43
7 月	430.23	68.78	4 679.19	86.79	9.29	-8.9
8 月	366.48	55.13	3 927.93	64.64	12.19	10.26
9 月	370.45	-3.69	3 973.56	-8.57	11.87	-18.62
10 月	241.21	-47.38	2 434.88	-57.11	10.46	-1.9
11 月	334.98	-23.62	3 376.56	-20.84	10.71	-21.02
12 月	315.96	-35.17	2 841.44	-33.56	14.06	-5.62
总计	4 449.15	26.9	48 317.86	45.07	—	—

数据来源：大连商品交易所。

表 2-3-160 2021—2022 年液化石油气期货年度交易情况

年度	成交量 (万手)	同比变化 (%)	成交金额 (亿元)	同比变化 (%)	年末持仓量 (万手)	同比变化 (%)
2021 年	3 506.03	-27.34	33 307.22	-1.46	14.9	128.37
2022 年	4 449.15	26.9	48 317.86	45.07	14.06	-5.62

数据来源：大连商品交易所。

表 2-3-161 2022 年液化石油气期权月度交易情况

月度	成交量 (万手)	同比变化 (%)	成交量 看跌/看涨 (PCR)	成交金额 (亿元)	同比变化 (%)	月末持仓量 (万手)	同比变化 (%)
1 月	25.91	55.92	0.66	3.02	57.71	1.49	-48.03
2 月	25.32	36.63	0.85	2.86	19	1.83	-11.01
3 月	42.07	127.6	0.76	7.07	196.83	2.01	-6.78
4 月	33.7	98.42	0.89	2.98	87.15	2.35	-7.33
5 月	41.75	68.31	0.89	3.11	16.09	2.67	-3.74
6 月	66.74	173.75	1.06	5.2	122.57	4.26	27.07
7 月	55.17	73.91	1.7	5.99	83.4	2.66	-7.23
8 月	44.43	113.34	1.16	4.05	86.7	3.16	44.55
9 月	49	91.45	0.98	4.04	-26.24	3.06	10.02
10 月	39.35	110.43	0.88	2.19	-53.93	2.64	33.45
11 月	61.77	189.28	1.03	3.29	15.49	3.19	93
12 月	63.03	153.65	0.73	2.78	8.42	4.1	131.92
总计	548.24	108.58	0.97	46.58	35.46	—	—

数据来源：大连商品交易所。

表 2-3-162 2021—2022 年液化石油气期权年度交易情况

年度	成交量 (万手)	同比变化 (%)	成交量 看跌/看涨 (PCR)	成交金额 (亿元)	同比变化 (%)	年末持仓量 (万手)	同比变化 (%)
2021 年	262.8	—	0.85	34.4	—	1.8	-16.7
2022 年	548.24	108.58	0.97	46.58	35.46	4.1	131.92

数据来源：大连商品交易所。

(二) 交割、行权情况 (见表 2-3-163 ~ 表 2-3-166)

表 2-3-163 2022 年液化石油气期货月度交割情况

月度	交割量 (手)	同比变化 (%)	交割金额 (亿元)	同比变化 (%)
1 月	1 225	-55.95	1.15	-42.1
2 月	1 352	-60.27	1.30	-42.1
3 月	1 029	43.12	1.17	142.15
4 月	1 183	3 979.31	1.42	5 447.55
5 月	684	236.95	0.82	413.21
6 月	680	31.02	0.80	81.1
7 月	550	-47.17	0.63	-37.01



续表

月度	交割量（手）	同比变化（%）	交割金额（亿元）	同比变化（%）
8月	17	-98.72	0.02	-98.59
9月	2 005	-38.52	2.23	-31.58
10月	2 924	166.06	2.97	115.02
11月	1 412	-16.1	1.48	-9.11
12月	1 050	-49.45	1.00	-43.83
总计	14 111	-22.24	14.99	-4.63

数据来源：大连商品交易所。

表 2-3-164 2021—2022 年液化石油气期货年度交割情况

年度	交割量（手）	同比变化（%）	交割金额（亿元）	同比变化（%）
2021年	18 146	337.46	15.75	430.41
2022年	14 111	-22.24	14.99	-4.63

数据来源：大连商品交易所。

表 2-3-165 2022 年液化石油气期权月度行权情况

月度	行权量（手）
1月	3 991
2月	4 222
3月	3 983
4月	2 507
5月	1 715
6月	2 061
7月	3 263
8月	2 255
9月	3 621
10月	3 527
11月	3 586
12月	3 903
总计	38 634

数据来源：大连商品交易所。

表 2-3-166 2021—2022 年液化石油气期权年度行权情况

年度	行权量（手）	同比变化（%）
2021年	55 138	—
2022年	38 634	-29.93

数据来源：大连商品交易所。

(三) 期货价格走势 (见图 2-3-20、表 2-3-167、表 2-3-168)



图 2-3-20 2022 年液化石油气期货和现货市场价格走势

数据来源：大连商品交易所、Wind。

表 2-3-167 2022 年液化石油气期货和现货市场价格指标

市场分类	2021 年末 收盘价	2022 年盘 中最高价	2022 年盘 中最低价	2022 年末 收盘价	全年 涨跌	结算价 平均价	标准差	极差
大商所主力价格 (元/吨)	4 748	7 017	4 191	4 238	-510	5 436.6	568.68	2 826
广州地区液化石油气 现货价格 (元/吨)	5 338	7 448	5 198	5 428	90	5 798.25	489.06	2 250

数据来源：大连商品交易所、Wind。

表 2-3-168 2022 年液化石油气期货和现货市场价格相关性

价格选择	相关系数
大商所主力结算价与液化石油气现货市场价格	0.76

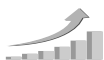
数据来源：大连商品交易所、Wind。

二十一、生猪期货运行情况

(一) 期货交易情况 (见表 2-3-169、表 2-3-170)

表 2-3-169 2022 年生猪期货月度交易情况

月度	成交量 (万手)	同比变化 (%)	成交金额 (亿元)	同比变化 (%)	月末持仓量 (万手)	同比变化 (%)
1 月	50.75	43.39	1 163.49	-21.12	11.42	438.32
2 月	60.04	264.64	1 379.89	92.32	10.35	410.05



续表

月度	成交量 (万手)	同比变化 (%)	成交金额 (亿元)	同比变化 (%)	月末持仓量 (万手)	同比变化 (%)
3月	98.26	759.72	2 256.35	340.51	11.86	678.5
4月	77.8	1 012.2	2 009.61	561.31	9.09	490.51
5月	61.37	328.15	1 858.52	239.68	9.77	251.89
6月	58.07	-19.61	1 820.83	-16.31	10.33	71.09
7月	110.01	139.75	3 814.9	178.07	9.08	55.19
8月	61.11	15.64	2 134.72	47.61	8.34	7.27
9月	49.75	-45.93	1 784.96	-16.47	7.29	-33.18
10月	48.64	-54.79	1 764.23	-35.55	8.18	-16.63
11月	61.48	-26.85	2 036.5	-5.51	7.9	-28.04
12月	90.64	36.21	2 505.57	59.89	7.18	-28.68
总计	827.92	36.67	24 529.57	43.06	—	—

数据来源：大连商品交易所。

表 2-3-170

2021—2022 年生猪期货年度交易情况

年度	成交量 (万手)	同比变化 (%)	成交金额 (亿元)	同比变化 (%)	年末持仓量 (万手)	同比变化 (%)
2021年	605.78	—	17 146.43	—	10.07	—
2022年	827.92	36.67	24 529.57	43.06	7.18	-28.68

数据来源：大连商品交易所。

(二) 交割情况（见表 2-3-171、表 2-3-172）

表 2-3-171

2022 年生猪期货月度交割情况

月度	交割量（手）	同比变化（%）	交割金额（万元）	同比变化（%）
1月	47	—	1 037.90	—
3月	225	—	4 330.62	—
5月	204	—	5 006.94	—
7月	23	—	797.08	—
9月	16	-15.79	622.88	49.96
11月	78	129.41	3 050.83	232.38
总计	593	—	14 882.25	—

数据来源：大连商品交易所。

表 2-3-172

2021—2022 年生猪期货年度交割情况

年度	交割量（手）	同比变化（%）	交割金额（亿元）	同比变化（%）
2021年	53	—	0.13	—
2022年	94	—	1.49	—

数据来源：大连商品交易所。

(三) 期货价格走势 (见图 2-3-21、表 2-3-173、表 2-3-174)



图 2-3-21 2022 年生猪期货和现货市场价格走势

数据来源：大连商品交易所、Wind。

表 2-3-173 2022 年生猪期货和现货市场价格指标

市场分类	2021 年末 收盘价	2022 年盘 中最高价	2022 年盘 中最低价	2022 年末 收盘价	全年 涨跌	结算价 平均价	标准差	极差
大商所主力价格 (元/吨)	14 450	24 300	12 360	16 145	1 695	18 731.05	3 706.52	11 940
河南外三元生猪(开 封)现货价格 (元/吨)	16 250	28 500	11 500	16 750	500	18 595.04	4 875.12	17 000

数据来源：大连商品交易所、Wind。

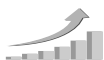
表 2-3-174 2022 年生猪期货和现货市场价格相关性

价格选择	相关系数
大商所主力结算价与生猪现货市场价格	0.9

数据来源：大连商品交易所、Wind。

》》 第四节 中国金融期货交易所上市品种运行情况

中国金融期货交易所(以下简称中金所, CFFEX)2022 年全年累计成交量 1.52 亿手, 占全国期货市场成交量的 2.24%, 成交量同比增长 24.44%; 全年累计成交额 133.04 万亿元, 占全国期货市场成交额的 24.87%, 成交金额同比增长 12.58%。



一、沪深 300 股指期货、期权运行情况

(一) 期货、期权交易情况 (见表 2-4-1 ~ 表 2-4-4)

表 2-4-1 2022 年沪深 300 股指期货月度交易情况

月度	成交量 (万手)	较上年变化 (%)	成交金额 (亿元)	较上年变化 (%)	月末持仓量 (万手)	较上年变化 (%)
1 月	189.40	-33.88	27 199.31	-42.07	20.84	-1.93
2 月	150.16	-27.96	20 691.62	-40.32	20.32	-8.71
3 月	306.71	-13.85	38 862.68	-28.30	20.62	-0.33
4 月	260.75	-4.58	31 721.04	-22.99	22.75	5.53
5 月	227.67	-7.14	27 025.74	-28.31	22.20	0.17
6 月	271.16	0.87	34 510.65	-17.29	21.21	2.85
7 月	239.70	-14.93	30 958.08	-26.95	19.80	-7.82
8 月	211.46	-17.69	26 201.86	-29.92	18.51	-12.54
9 月	183.76	-23.42	21 872.26	-37.70	17.84	-2.12
10 月	172.32	11.51	19 187.10	-15.71	19.92	8.19
11 月	250.51	35.75	28 285.52	5.07	19.59	6.98
12 月	211.35	-0.40	24 922.37	-21.29	19.72	1.89
总计	2 674.94	-9.88	331 438.21	-26.78	—	—

数据来源: 中国金融期货交易所。

表 2-4-2 2021—2022 年沪深 300 股指期货年度交易情况

年度	成交量 (万手)	较上年变化 (%)	成交金额 (亿元)	较上年变化 (%)	年末持仓量 (万手)	较上年变化 (%)
2021 年	2 968.05	-1.06	452 669.08	14.91	19.36	-4.76
2022 年	2 674.94	-9.88	331 438.21	-26.78	19.72	1.89

数据来源: 中国金融期货交易所。

表 2-4-3 2022 年沪深 300 股指期权月度交易情况

月度	成交量 (万手)	同比变化 (%)	成交量 看跌/看涨 (PCR)	成交金额 (亿元)	同比变化 (%)	月末持仓量 (万手)	同比变化 (%)
1 月	277.65	-1.45	0.85	174.89	-44.80	18.52	8.59
2 月	194.29	-3.68	0.88	115.22	-49.40	17.61	-9.31
3 月	390.89	35.73	0.86	297.28	6.46	21.03	23.00
4 月	279.48	25.45	0.85	211.73	13.84	20.74	22.82

续表

月度	成交量 (万手)	同比变化 (%)	成交量 看跌/看涨 (PCR)	成交金额 (亿元)	同比变化 (%)	月末持仓量 (万手)	同比变化 (%)
5月	239.21	4.22	0.86	161.54	-14.23	19.06	-8.05
6月	351.18	45.11	0.85	247.68	29.92	19.74	0.35
7月	272.61	-4.56	0.82	177.75	-20.22	18.89	-2.07
8月	229.19	-22.43	0.79	127.73	-38.56	17.09	-8.82
9月	203.38	-28.42	0.85	118.42	-42.43	15.76	-0.02
10月	213.40	27.99	0.77	128.41	4.18	18.11	14.06
11月	297.08	20.59	0.77	174.29	10.61	17.03	2.19
12月	207.01	-26.09	0.82	120.12	-33.31	14.45	-26.27
总计	3 155.35	4.34	0.83	2 055.06	-17.34	—	—

数据来源：中国金融期货交易所。

表 2-4-4 2021—2022 年沪深 300 股指期货年度交易情况

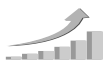
年度	成交量 (万手)	同比变化 (%)	成交量 看跌/看涨 (PCR)	成交金额 (亿元)	同比变化 (%)	年末持仓量 (万手)	同比变化 (%)
2021 年	3 024.15	80.62	0.73	2 485.07	81.99	19.60	36.97
2022 年	3 155.35	4.34	0.83	2 055.06	-17.34	14.45	-26.27

数据来源：中国金融期货交易所。

(二) 交割、行权情况 (见表 2-4-5 ~ 表 2-4-8)

表 2-4-5 2022 年沪深 300 股指期货月度交割情况

月度	交割量 (手)	同比变化 (%)	交割金额 (亿元)	同比变化 (%)
1月	8 005	31	114.69	14.92
2月	7 410	17	103.06	-6.05
3月	12 804	7	163.31	-9.12
4月	8 515	8	107.15	-8.79
5月	8 750	66	106.81	30.99
6月	15 391	25	198.49	5.30
7月	10 281	13	132.22	-5.65
8月	7 998	-10	99.88	-20.93
9月	15 604	14	185.23	-6.57
10月	9 732	12	109.32	-14.59
11月	8 737	26	100.06	-1.31



续表

月度	交割量（手）	同比变化（%）	交割金额（亿元）	同比变化（%）
12月	12 187	19	144.03	-5.63
总计	125 414	16.73	1 564.25	-3.64

数据来源：中国金融期货交易所。

表 2-4-6 2021—2022 年沪深 300 股指期货年度交割情况

年度	交割量（手）	同比变化（%）	交割金额（亿元）	同比变化（%）
2021 年	107 437	43.90	1 623.42	66.37
2022 年	125 414	16.73	1 564.25	-3.64

数据来源：中国金融期货交易所。

表 2-4-7 2022 年沪深 300 股指期权月度行权情况

月度	行权量（手）	到期未平仓量（手）	行权比例（%）
1月	21 249	89 401	23.77
2月	20 684	78 464	26.36
3月	23 822	89 969	26.48
4月	17 251	86 770	19.88
5月	20 501	89 032	23.03
6月	21 794	84 873	25.68
7月	16 768	77 523	21.63
8月	18 183	75 439	24.10
9月	18 764	81 725	22.96
10月	17 491	70 344	24.86
11月	16 349	63 753	25.64
12月	17 203	76 057	22.62
总计	230 059	963 350	23.88%

数据来源：中国金融期货交易所。

表 2-4-8 2021—2022 年沪深 300 股指期权年度行权情况

年度	行权量（手）	同比变化（%）
2021 年	156 851	125.35
2022 年	230 059	46.67

数据来源：中国金融期货交易所。

(三) 期货价格走势 (见图 2-4-1、表 2-4-9、表 2-4-10)

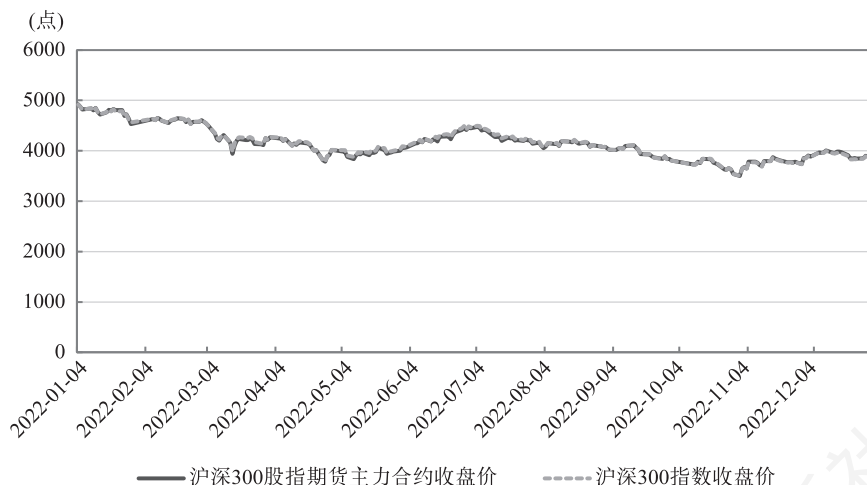


图 2-4-1 2022 年沪深 300 股指期货和沪深 300 指数价格比较

数据来源：中国金融期货交易所。

表 2-4-9 2022 年沪深 300 股指期货和现货指数价格主要显性指标

市场分类	2021 年末 收盘价	2022 年盘 中最高价	2022 年盘 中最低价	2022 年末 收盘价	全年 涨跌	结算价 均价	标准差	极差
沪深 300 股指期货 主力合约价格	4 944.80	4 966.00	3 488.00	3 879.40	-1 065.40	4 137.92	307.37	1 478.00
沪深 300 指数价格	4 940.37	4 961.45	3 495.95	3 871.63	-1 068.74	4 146.27	310.05	1 465.50

数据来源：中国金融期货交易所。

表 2-4-10 2022 年沪深 300 股指期货和现货指数价格相关性

价格选择	相关系数
沪深 300 股指期货主力合约收盘价与沪深 300 指数收盘价	0.9984

数据来源：中国金融期货交易所。

二、上证 50 股指期货、期权运行情况

2022 年 12 月 19 日，上证 50 股指期权在中金所上市交易。

(一) 期货、期权交易情况 (见表 2-4-11 ~ 表 2-4-13)

表 2-4-11 2022 年上证 50 股指期货月度交易情况

月度	成交量 (万手)	较上年变化 (%)	成交金额 (亿元)	较上年变化 (%)	月末持仓量 (万手)	较上年变化 (%)
1 月	114.21	-0.30	10 972.86	-15.90	11.97	62.01



续表

月度	成交量 (万手)	较上年变化 (%)	成交金额 (亿元)	较上年变化 (%)	月末持仓量 (万手)	较上年变化 (%)
2月	84.09	5.22	7 864.23	-15.10	10.31	29.94
3月	153.22	15.71	13 306.88	-6.25	9.23	21.45
4月	131.64	24.91	11 188.33	1.74	11.32	38.08
5月	113.24	13.17	9 286.76	-11.74	10.96	34.47
6月	143.86	20.02	12 434.08	-1.60	11.06	33.45
7月	122.58	-12.25	10 680.81	-23.37	10.02	-1.72
8月	122.17	-15.95	10 096.14	-26.69	11.75	7.70
9月	118.77	-22.83	9 607.54	-34.62	11.98	22.07
10月	119.37	20.68	8 865.79	-8.73	13.31	33.05
11月	169.95	44.91	12 769.08	13.05	12.93	29.31
12月	147.65	16.97	11 797.67	-5.65	11.88	3.23
总计	1 540.77	7.48	128 870.18	-12.08	—	—

数据来源：中国金融期货交易所。

表 2-4-12 2021—2022 年上证 50 股指期货年度交易情况

年度	成交量 (万手)	较上年变化 (%)	成交金额 (亿元)	较上年变化 (%)	年末持仓量 (万手)	较上年变化 (%)
2021 年	1 433.59	22.01	146 580.12	33.14	11.51	47.18
2022 年	1 540.77	7.48	128 870.18	-12.08	11.88	3.23

数据来源：中国金融期货交易所。

表 2-4-13 2022 年上证 50 股指期权年度交易情况

年度	成交量 (万手)	同比变化 (%)	成交量 看跌/看涨 (PCR)	成交金额 (亿元)	同比变化 (%)	年末持仓量 (万手)	同比变化 (%)
2022 年	20.06	—	1.01	7.91	—	2.63	—

数据来源：中国金融期货交易所。

(二) 交割、行权情况 (见表 2-4-14、表 2-4-15)

表 2-4-14 2022 年上证 50 股指期货月度交割情况

月度	交割量 (手)	同比变化 (%)	交割金额 (亿元)	同比变化 (%)
1月	4 577	54.16	44.14	29.94
2月	3 388	11.93	32.05	-11.95
3月	4 561	14.40	39.69	-5.52
4月	4 253	18.70	37.45	1.13

续表

月度	交割量（手）	同比变化（%）	交割金额（亿元）	同比变化（%）
5月	4 551	43.52	38.24	15.32
6月	6 855	18.19	60.28	0.50
7月	7 973	97.06	68.55	67.20
8月	3 585	-11.61	29.65	-20.36
9月	8 595	-15.93	69.46	-28.15
10月	8 189	28.45	61.13	-2.94
11月	3 704	-18.58	28.40	-34.98
12月	6 340	-6.59	50.92	-23.85
总计	66 571	13.65	559.95	-5.26

数据来源：中国金融期货交易所。

表 2-4-15 2021—2022 年上证 50 股指期货年度交割情况

年度	交割量（手）	同比变化（%）	交割金额（亿元）	同比变化（%）
2021 年	58 574	67.41	591.01	81.62
2022 年	66 571	13.65	559.95	-5.26

数据来源：中国金融期货交易所。

2022 年，上证 50 股指期货无行权。

(三) 期货价格走势（见图 2-4-2、表 2-4-16、表 2-4-17）



图 2-4-2 2022 年上证 50 股指期货和上证 50 指数价格比较

数据来源：中国金融期货交易所。



表 2-4-16 2022 年上证 50 股指期货和现货指数价格主要显性指标

市场分类	2021 年末 收盘价	2022 年盘 中最高价	2022 年盘 中最低价	2022 年末 收盘价	全年 涨跌	结算价 均价	标准差	极差
上证 50 股指期货主力 合约价格	3 279.40	3 299.60	2 283.20	2 646.40	-633.00	2 804.04	211.02	1 016.40
上证 50 指数价格	3 274.32	3 289.16	2 288.01	2 635.25	-639.07	2 806.13	211.69	1 001.15

数据来源：中国金融期货交易所。

表 2-4-17 2022 年上证 50 股指期货和现货指数价格相关性

价格选择	相关系数
上证 50 股指期货主力合约收盘价与上证 50 指数收盘价	0.9987

数据来源：中国金融期货交易所。

三、中证 500 股指期货运行情况

（一）期货交易情况（见表 2-4-18、表 2-4-19）

表 2-4-18 2022 年中证 500 股指期货月度交易情况

月度	成交量 (万手)	较上年变化 (%)	成交金额 (亿元)	较上年变化 (%)	月末持仓量 (万手)	较上年变化 (%)
1 月	168.35	-24.35	23 608.50	-17.32	31.42	34.45
2 月	135.39	-16.44	18 272.18	-11.80	30.11	29.01
3 月	261.22	7.41	32 971.50	9.82	31.26	29.92
4 月	263.82	44.83	30 431.70	32.76	35.33	42.59
5 月	249.86	57.92	28 486.55	38.98	34.93	56.02
6 月	302.18	71.79	37 367.18	60.42	34.45	43.02
7 月	243.36	13.22	30 600.01	5.34	32.49	16.97
8 月	222.24	14.14	27 848.01	3.55	32.68	22.44
9 月	215.56	-6.71	25 925.28	-23.00	32.39	16.30
10 月	179.97	24.46	21 130.35	4.91	33.33	24.64
11 月	207.17	25.58	25 307.86	8.79	30.67	12.18
12 月	172.99	-2.79	20 939.63	-18.73	30.83	13.56
总计	2 622.11	15.40	322 888.74	5.94	—	—

数据来源：中国金融期货交易所。

表 2-4-19 2021—2022 年中证 500 股指期货年度交易情况

年度	成交量 (万手)	较上年变化 (%)	成交金额 (亿元)	较上年变化 (%)	年末持仓量 (万手)	较上年变化 (%)
2021 年	2 272.28	-30.63	304 786.00	-20.89	27.15	18.72
2022 年	2 622.11	15.40	322 888.74	5.94	30.83	13.56

数据来源：中国金融期货交易所。

(二) 交割情况 (见表 2-4-20、表 2-4-21)

表 2-4-20 2022 年中证 500 股指期货月度交割情况

月度	交割量 (手)	同比变化 (%)	交割金额 (亿元)	同比变化 (%)
1 月	8 488	9.58	118.53	19.70
2 月	6 105	29.84	83.25	32.65
3 月	10 216	11.97	128.83	13.94
4 月	6 940	-12.01	84.50	-15.41
5 月	9 647	128.98	114.06	107.12
6 月	14 792	86.96	186.15	76.92
7 月	10 068	38.51	125.91	24.49
8 月	7 233	19.99	92.94	12.07
9 月	14 635	10.01	175.83	-10.13
10 月	8 210	-7.62	97.96	-21.54
11 月	6 673	7.02	82.93	-6.98
12 月	12 737	26.61	154.20	4.66
总计	115 744	23.97	1 445.09	13.24

数据来源: 中国金融期货交易所。

表 2-4-21 2021—2022 年中证 500 股指期货年度交割情况

年度	交割量 (手)	同比变化 (%)	交割金额 (亿元)	同比变化 (%)
2021 年	93 366	35.87	1 276.10	54.83
2022 年	115 744	23.97	1 445.09	13.24

数据来源: 中国金融期货交易所。

(三) 期货价格走势 (见图 2-4-3、表 2-4-22、表 2-4-23)



图 2-4-3 2022 年中证 500 股指期货和中证 500 指数价格比较

数据来源：中国金融期货交易所。

表 2-4-22 2022 年中证 500 股指期货和现货指数价格指标

市场分类	2021 年末 收盘价	2022 年盘 中最高价	2022 年盘 中最低价	2022 年末 收盘价	全年 涨跌	结算价 平均价	标准差	极差
中证 500 股指期货主力合约价格	7 371.80	7 326.40	5 063.60	5 871.00	-1 500.80	6 197.85	388.71	2 262.80
中证 500 指数价格	7 359.40	7 392.10	5 158.48	5 864.47	-1 494.93	6 246.77	381.28	2 233.62

数据来源：中国金融期货交易所。

表 2-4-23 2022 年中证 500 股指期货和现货指数价格相关性

价格选择	相关系数
中证 500 股指期货主力合约收盘价与中证 500 指数收盘价	0.9930

数据来源：中国金融期货交易所。

四、中证 1000 股指期货、期权运行情况

2022 年 7 月 22 日，中证 1000 股指期货、期权在中金所上市交易。

（一）期货、期权交易情况（见表 2-4-24、表 2-4-25）

表 2-4-24 2022 年中证 1000 股指期货年度交易情况

年度	成交量 (万手)	较上年变化 (%)	成交金额 (亿元)	较上年变化 (%)	年末持仓量 (万手)	较上年变化 (%)
2022 年	611.55	—	80 355.80	—	13.17	—

数据来源：中国金融期货交易所。

表 2-4-25 2022 年中证 1000 股指期货期权年度交易情况

年度	成交量 (万手)	同比变化 (%)	成交量 看跌/看涨 (PCR)	成交金额 (亿元)	同比变化 (%)	年末持仓量 (万手)	同比变化 (%)
2022 年	679.75	—	0.96	580.34	—	6.63	—

数据来源：中国金融期货交易所。

（二）交割、行权情况（见表 2-4-26、表 2-4-27）

表 2-4-26 2022 年中证 1000 股指期货年度交割情况

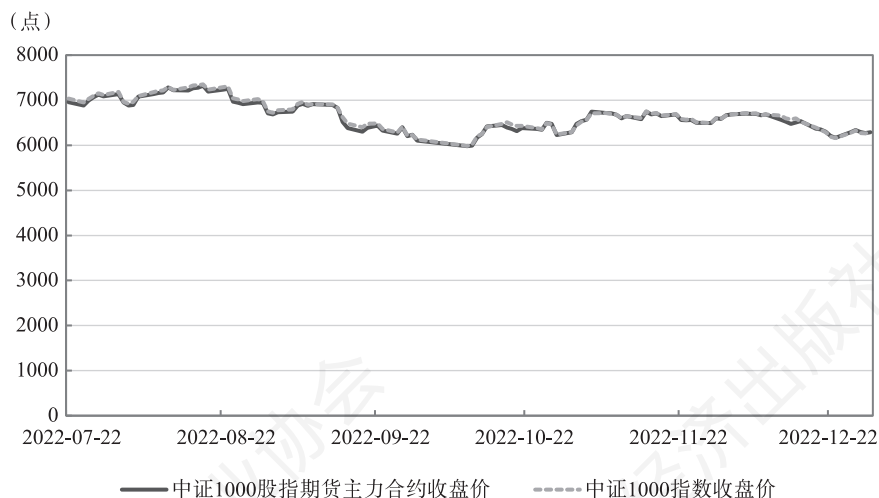
年度	交割量 (手)	同比变化 (%)	交割金额 (亿元)	同比变化 (%)
2022 年	25 841	—	344.66	—

数据来源：中国金融期货交易所。

表 2-4-27 2022 年中证 1000 股指期货年度行权情况

年度	行权量（手）	同比变化（%）
2022 年	30 257	—

数据来源：中国金融期货交易所。

（三）期货价格走势（见图 2-4-4、表 2-4-28、表 2-4-29）

图 2-4-4 2022 年中证 1000 股指期货和中证 1000 指数价格比较

数据来源：中国金融期货交易所。

表 2-4-28 2022 年中证 1000 股指期货和现货指数价格主要显性指标^①

市场分类	2021 年末 收盘价	2022 年盘 中最高价	2022 年盘 中最低价	2022 年末 收盘价	全年 涨跌	结算价 平均价	标准差	极差
中证 1000 股指期货主 力合约价格（点）	—	7337.00	5895.20	6285.80	—	6645.13	323.21	1441.80
中证 1000 指数价格 （点）	—	7369.73	5918.02	6281.62	—	6675.51	332.25	1451.71

数据来源：中国金融期货交易所。

表 2-4-29 2022 年中证 1000 股指期货和现货指数价格相关性

价格选择	相关系数
中证 1000 股指期货主力合约收盘价与中证 1000 指数收盘价	0.9949

数据来源：中国金融期货交易所。

^① 数据统计区间为 2022 年 7 月 22 日至 12 月 31 日。



五、5 年期国债期货运行情况

（一）期货交易情况（见表 2-4-30、表 2-4-31）

表 2-4-30 2022 年 5 年期国债期货月度交易情况

月度	成交量 (万手)	同比变化 (%)	成交金额 (亿元)	同比变化 (%)	月末持仓量 (万手)	同比变化 (%)
1 月	67.58	22.19	6 895.01	24.87	10.79	75.42
2 月	78.49	70.05	7 987.23	74.21	9.15	71.90
3 月	100.95	114.87	10 238.87	119.41	10.99	82.83
4 月	68.24	57.41	6 931.23	60.35	10.41	41.84
5 月	77.01	44.40	7 822.29	46.59	10.40	87.11
6 月	71.06	66.15	7 196.26	68.49	10.18	41.75
7 月	76.27	59.47	7 730.99	60.56	12.73	71.10
8 月	129.87	123.69	13 240.71	125.70	11.76	99.31
9 月	102.92	128.97	10 475.69	130.60	12.90	95.22
10 月	81.90	109.53	8 338.85	111.99	13.77	71.07
11 月	190.29	166.07	19 254.99	166.45	10.16	25.78
12 月	121.96	111.55	12 285.64	110.45	9.35	6.49
总计	1 166.56	92.19	118 397.77	94.33	—	—

数据来源：中国金融期货交易所。

表 2-4-31 2021—2022 年 5 年期国债期货年度交易情况

年度	成交量 (万手)	同比变化 (%)	成交金额 (亿元)	同比变化 (%)	年末持仓量 (万手)	同比变化 (%)
2021 年	606.99	4.48	60 925.11	3.79	8.78	45.46
2022 年	1 166.56	92.19	118 397.77	94.33	9.35	6.49

数据来源：中国金融期货交易所。

（二）交割情况（见表 2-4-32、表 2-4-33）

表 2-4-32 2022 年 5 年期国债期货月度交割情况

月度	交割量 (手)	同比变化 (%)	交割金额 (亿元)	同比变化 (%)
3 月	2 761	1 323.20	28.94	1 431.22
6 月	1 170	33.26	12.04	34.38
9 月	330	-88.48	3.34	-88.79
12 月	1 865	-58.82	18.78	-59.92
总计	6 126	-27.63	63.10	-27.89

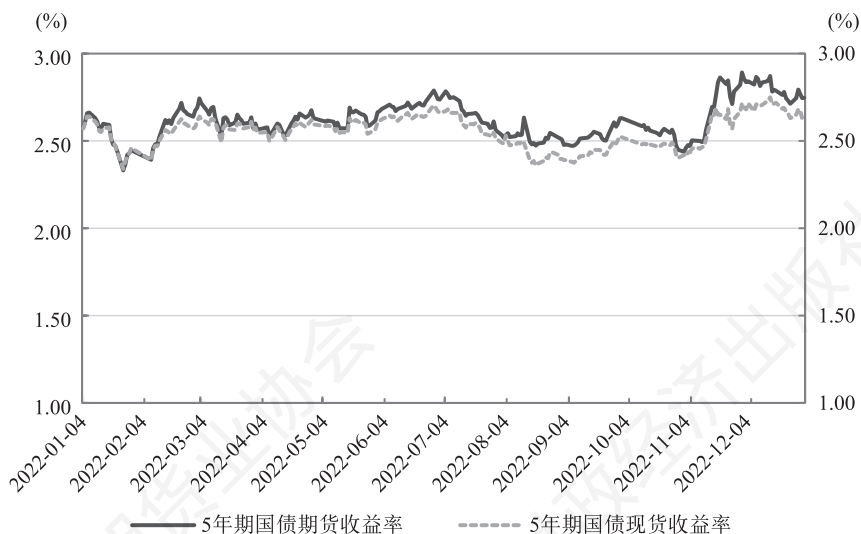
数据来源：中国金融期货交易所。

表 2-4-33 2021—2022 年 5 年期国债期货年度交割情况

年度	交割量（手）	同比变化（%）	交割金额（亿元）	同比变化（%）
2021 年	8 465	40.59	87.51	42.87
2022 年	6 126	-27.63	63.10	-27.89

数据来源：中国金融期货交易所。

（三）期货价格走势（见图 2-4-5、表 2-4-34、表 2-4-35）

图 2-4-5 2022 年 5 年期国债期货和现货市场收益率^①比较

数据来源：中国金融期货交易所、Wind。

表 2-4-34 2022 年 5 年期国债期现货收益率主要指标

市场分类	2021 年末	2022 年最高值	2022 年最低值	2022 年末	全年涨跌	平均值	标准差	极差
5 年期国债期货收益率（%）	2.607	2.892	2.332	2.746	0.139	2.621	0.109	0.56
5 年期国债现货收益率（%）	2.630	2.750	2.340	2.625	-0.005	2.555	0.094	0.41

数据来源：中国金融期货交易所、Wind。

表 2-4-35 2022 年 5 年期国债期现货价格相关性

价格选择	相关系数
5 年期国债期货价格与国债现货价格	0.9920

数据来源：中国金融期货交易所、Wind。

① 国债现货收益率为主力合约对应的最便宜可交割券（CTD）收益率。



六、10年期国债期货运行情况

（一）期货交易情况（见表2-4-36、表2-4-37）

表2-4-36 2022年10年期国债期货月度交易情况

月度	成交量 (万手)	同比变化 (%)	成交金额 (亿元)	同比变化 (%)	月末持仓量 (万手)	同比变化 (%)
1月	127.44	1.81	12 857.46	4.86	16.87	31.10
2月	151.21	43.48	15 192.03	48.56	16.82	41.56
3月	196.75	49.53	19 699.19	54.25	17.99	34.24
4月	130.06	10.19	13 056.87	13.33	19.09	38.51
5月	141.59	-1.83	14 234.54	0.49	16.11	27.76
6月	135.14	4.07	13 539.17	6.30	18.39	17.39
7月	145.59	-1.83	14 613.72	-0.73	22.37	39.92
8月	208.74	20.05	21 173.39	21.76	16.96	15.54
9月	159.26	25.78	16 128.32	27.45	19.47	29.35
10月	114.83	10.00	11 623.03	12.36	20.62	24.84
11月	306.46	71.23	30 746.27	71.95	17.99	10.55
12月	181.86	20.10	18 142.65	19.64	16.29	-10.03
总计	1 998.94	22.05	201 006.65	24.20	—	—

数据来源：中国金融期货交易所。

表2-4-37 2021—2022年10年期国债期货年度交易情况

年度	成交量(万手)	同比变化 (%)	成交金额 (亿元)	同比变化 (%)	年末持仓量 (万手)	同比变化 (%)
2021年	1 637.85	2.93	161 837.56	2.22	18.11	53.22
2022年	1 998.94	22.05	201 006.65	24.20	16.29	-10.03

数据来源：中国金融期货交易所。

（二）交割情况（见表2-4-38、表2-4-39）

表2-4-38 2022年10年期国债期货月度交割情况

月度	交割量(手)	同比变化 (%)	交割金额(亿元)	同比变化 (%)
3月	2 300	190.77	22.92	200.00
6月	75	-88.28	0.76	-87.94
9月	364	-73.22	3.68	-72.66
12月	6 520	421.60	64.7	418.85
总计	9 259	129.18	92.07	130.93

数据来源：中国金融期货交易所。

表 2-4-39 2021—2022 年 10 年期国债期货年度交割情况

年度	交割量（手）	同比变化（%）	交割金额（亿元）	同比变化（%）
2021 年	4 040	-12.54	39.87	-12.76
2022 年	9 259	129.18	92.07	130.93

数据来源：中国金融期货交易所。

（三）期货价格走势（见图 2-4-6、表 2-4-40、表 2-4-41）

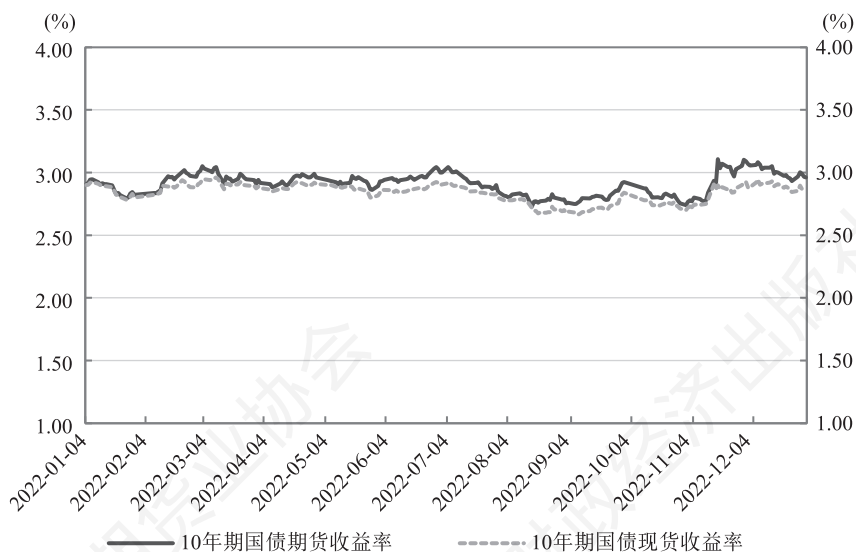


图 2-4-6 2022 年 10 年期国债期货和现货收益率比较

数据来源：中国金融期货交易所、Wind。

表 2-4-40 2022 年 10 年期国债期货和现货收益率主要指标

市场分类	2021 年末	2022 年最高值	2022 年最低值	2022 年末	全年涨跌	平均值	标准差	极差
10 年期国债期货收益率（%）	2.889	3.107	2.730	2.962	0.073	2.911	0.089	0.377
10 年期国债现货收益率（%）	2.898	2.962	2.664	2.846	-0.052	2.838	0.076	0.298

数据来源：中国金融期货交易所、Wind。

表 2-4-41 2022 年 10 年期国债期货期现货价格相关性

价格选择	相关系数
10 年期国债期货价格与国债现货价格	0.9586

数据来源：中国金融期货交易所、Wind。



七、2 年期国债期货运行情况

(一) 期货交易情况 (见表 2-4-42、表 2-4-43)

表 2-4-42 2022 年 2 年期国债期货月度交易情况

月度	成交量 (万手)	同比变化 (%)	成交金额 (亿元)	同比变化 (%)	月末持仓量 (万手)	同比变化 (%)
1 月	26.84	45.37	5 431.34	46.48	5.20	111.48
2 月	32.38	144.03	6 556.22	146.56	3.42	161.34
3 月	39.98	113.80	8 087.69	116.14	4.82	113.19
4 月	33.56	71.03	6 792.42	72.66	4.86	47.30
5 月	37.34	69.57	7 552.43	70.83	4.15	32.94
6 月	45.59	123.79	9 204.96	125.33	4.74	45.09
7 月	52.35	173.95	10 575.09	174.89	6.06	94.14
8 月	78.44	257.83	15 881.39	259.35	5.28	120.80
9 月	80.70	367.04	16 331.86	369.04	5.93	105.35
10 月	62.14	220.15	12 580.64	222.10	7.65	178.12
11 月	124.68	272.62	25 182.21	273.34	4.05	27.39
12 月	102.16	177.83	20 584.60	177.45	4.40	-12.30
总计	716.15	175.03	144 760.83	176.43	—	—

数据来源：中国金融期货交易所。

表 2-4-43 2021—2022 年 2 年期国债期货年度交易情况

年度	成交量 (万手)	同比变化 (%)	成交金额 (亿元)	同比变化 (%)	年末持仓量 (万手)	同比变化 (%)
2021 年	260.39	12.58	52 367.59	12.22	5.02	118.24
2022 年	716.15	175.03	144 760.83	176.43	4.40	-12.30

数据来源：中国金融期货交易所。

(二) 交割情况 (见表 2-4-44、表 2-4-45)

表 2-4-44 2022 年 2 年期国债期货月度交割情况

月度	交割量 (手)	同比变化 (%)	交割金额 (亿元)	同比变化 (%)
3 月	2 620	181.72	53.3	184.12
6 月	1 855	-40.35	37.3	-40.83
9 月	1 169	341.13	23.74	343.74
12 月	660	-26.99	13.3	-27.08
总计	6 304	21.02	127.64	21.12

数据来源：中国金融期货交易所。

表 2-4-45 2021—2022 年 2 年期国债期货年度交割情况

年度	交割量（手）	同比变化（%）	交割金额（亿元）	同比变化（%）
2021 年	5 209	2.58	105.38	3.23
2022 年	6 304	21.02	127.64	21.12

数据来源：中国金融期货交易所。

（三）期货价格走势（见图 2-4-7、表 2-4-46、表 2-4-47）

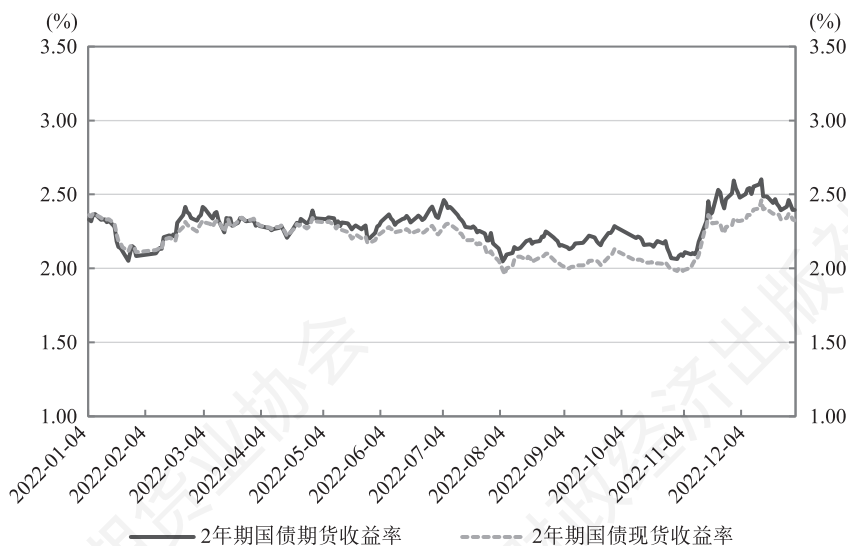


图 2-4-7 2022 年 2 年期国债期货和现货市场收益率比较

数据来源：中国金融期货交易所、Wind。

表 2-4-46 2022 年 2 年期国债期货现货收益率主要指标

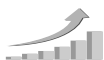
市场分类	2021 年末	2022 年最高值	2022 年最低值	2022 年末	全年涨跌	平均值	标准差	极差
2 年期国债期货收益率（%）	2.325	2.601	2.047	2.396	0.071	2.282	0.119	0.554
2 年期国债现货收益率（%）	2.400	2.460	1.960	2.325	-0.075	2.205	0.121	0.5

数据来源：中国金融期货交易所、Wind。

表 2-4-47 2022 年 2 年期国债期货现货价格相关性

价格选择	相关系数
2 年期国债期货价格与国债现货价格	0.9822

数据来源：中国金融期货交易所、Wind。



第五节 广州期货交易所上市品种运行情况

2022年12月22日，广州期货交易所（以下简称广期所，GFEX）首个品种工业硅期货上市交易，12月23日工业硅期权上市交易。广期所2022年全年累计成交量19.36万手，全年累计成交额158.40亿元。工业硅期货、期权运行情况如下：

期货、期权交易情况（见表2-5-1、表2-5-2）。

表2-5-1 2022年工业硅期货年度交易情况

年度	成交量 (万手)	同比变化 (%)	成交金额 (亿元)	同比变化 (%)	年末持仓量 (万手)	同比变化 (%)
2022年	17.78	—	157.60	—	0.96	—

数据来源：广州期货交易所。

表2-5-2 2022年工业硅期权年度交易情况

年度	成交量 (万手)	同比变化 (%)	成交量 看跌/看涨 (PCR)	成交金额 (亿元)	同比变化 (%)	年末持仓量 (万手)	同比变化 (%)
2022年	1.58	—	0.95	0.80	—	0.56	—

数据来源：广州期货交易所。

2022年，工业硅期货、期权无交割、行权。

期货价格走势如图2-5-1、表2-5-3所示。

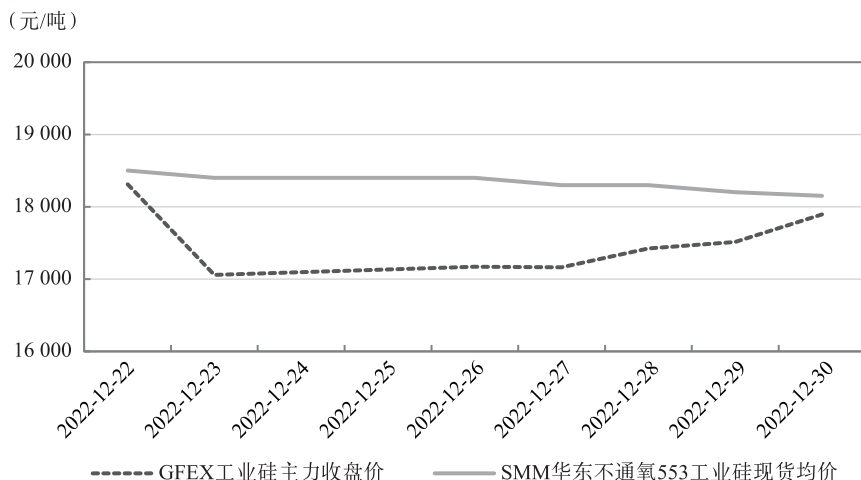


图2-5-1 2022年工业硅期货和国内现货市场价格走势

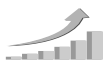
数据来源：广州期货交易所、上海有色网。

表 2-5-3 2022 年工业硅期货和国内现货市场价格指标

市场分类	2021 年末 收盘价	2022 年盘 中最高价	2022 年盘 中最低价	2022 年末 收盘价	全年 涨跌	结算价 平均价	标准差	极差
广期所主力价格 (元/吨)	—	19 720	16 825	17 895	—	17 624	458	2 895
上海有色网华东不通 氧 553 # 硅现货价格 (元/吨)	19 700	22 150	15 250	18 150	-1 550	18 831	1 594	6 900

数据来源：广州期货交易所、上海有色网。

中国期货业协会
中国财政经济出版社



第三章

2022 年中国期货市场服务 实体经济情况

>>> 第一节 服务实体经济总体概况

2022年，中国证监会以习近平新时代中国特色社会主义思想为指导，面对新冠疫情反复延宕、国际环境风高浪急的复杂严峻形势，围绕提升金融服务实体经济质效、服务大宗商品保供稳价和服务“三农”，加大期货市场品种供给，提升市场运行质量，优化完善“保险+期货”模式，促进风险管理和价格发现功能的有效发挥，为金融服务实体经济贡献期货力量。

一、拓展服务实体经济领域，继续推进期货市场建设

2022年，中国证监会围绕丰富服务实体经济载体，继续加大市场建设力度，积极稳妥有序推进新品种上市。一是加强期货产品供给，支持相关产业高质量发展。全年共上市中证1000股指、黄大豆1号、黄大豆2号等期货期权品种16个，广期所首个品种工业硅期货和期权挂牌交易，全市场期货期权品种达到110个，基本覆盖国民经济主要领域。二是完善期货市场法制。2022年4月20日，《期货和衍生品法》经十三届全国人大常委会审议通过，期货期权品种注册管理制度落地，完成了上市制度“里程碑式的改革”，其他配套法规文件有序推进，期货市场法制“四梁

八柱”基本形成。三是大力培育产业客户和机构投资者，改善期货市场投资者结构。持续推动“银保入市”扩点拓面，新增3家保险机构入市交易，拓展中长期资金参与期货市场。

二、做精做细现有品种，服务实体能力进一步提升

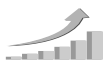
2022年，中国证监会指导期货交易所持续做精做细现有品种，更好地服务实体经济发展。完善品种规则和合约设计，持续优化品种运行。全年指导各期货交易所累计修改规则29项，涉及142个业务细则。不断提高合约连续性，试点在铁矿石期货交割月合约上引入做市商，提升近月合约流动性，服务企业套期保值需求；试点开展组合保证金业务，降低市场成本；实施套保交易、交割、仓单转让等手续费减收政策，便利产业客户参与。

三、做好功能评估工作，提升期货市场运行质量

2022年，中国证监会组织开展两次期货市场功能评估工作，检视已上市品种运行质量和功能发挥情况，引导期货交易所及时补足短板。期货市场套期保值效率达到95.62%，全市场法人持仓占比（不含做市商）达到68.67%，期现价格相关性达到95.57%，期货市场功能作用进一步彰显。同时，组织开展提升产业客户参与度专项评估工作。指导各期货交易所采取一系列工作举措提升产业客户参与度，产业客户数量和成交规模均有所增长，全市场产业客户参与数量同比增加17.1%，日均成交量和日均持仓量同比分别增长7.1%和18.4%。

四、服务大宗商品保供稳价，助力实体经济稳健发展

2022年以来，受新冠疫情反复、地缘政治冲突、全球气候变化等多种不确定因素叠加影响，大宗商品价格波动加剧，中国证监会服务大宗商品保供稳价，助力实体经济稳健发展。一是及时有效强化期货市场监管，加强期现联动监管。对大宗商品价格走势和风险点进行研判，针对部分大宗商品价格波动加大、成交有所放大的情况，统筹各期货交易所及时采取风控措施。2022年，在48个主要大宗商品品种上采取提高手续费标准、保证金水平、扩大涨跌停板幅度、收紧限仓水平等措施共计166次。依规及时采取措施应对伦敦金属交易所镍期货价格非理性暴涨导致的输入性风险，取得良好效果。继续加强与发展改革委、农业农村部等现货管理部门沟通，协同采取措施，助力保供稳价。二是协调各期货市场参与方制定并落实支持行业发展的举措，发挥行业作用助力中小企业应对成本大幅波动，持续提升期货风险管理公司服务实体企业能力。《国务院办公厅关于进一步加大对中小企业纾困帮扶力度的通知》（国办发〔2021〕45号）和《“十四五”促进中小企业发展规划》明确提出，“推动期货公司为中小企业提供风险管理服务，助力中小企业运用期货套



期保值工具应对原材料价格大幅波动风险”。2022年，期货风险管理公司通过基差贸易、现货仓单约定购回等形式，助力解决中小企业采购成本快速上涨、供销不畅、融资困难等痛点、堵点。截至2022年末，期货公司及风险管理公司利用期货市场价格发现和套期保值功能，与实体产业客户开展基差贸易，利用期货价格指导现货购销，累计贸易额4 827.55亿元。其中，为中小微企业提供服务累计贸易额2 235.29亿元，占比46%。通过现货仓单约定购回等形式，为实体产业客户提供短期资金融通的仓单服务业务，累计购销规模325.86亿元，累计提供资金支持222.20亿元。其中，为中小微企业提供资金112.14亿元，占比69%。期货行业通过以上两项业务累计服务客户43 896家次，其中，中小微企业29 074家次，占比达66.23%。

五、优化完善“保险+期货”，助力产业发展推动乡村振兴

2022年，中国证监会深入贯彻中央“一号文件”精神，稳步推进“保险+期货”，模式不断完善优化，覆盖区域稳步扩大，涉及品种逐渐丰富，惠农保障力度持续提升。全年指导上海期货交易所、郑州商品交易所、大连商品交易所在黑龙江、陕西、云南等29个省（市、区）开展458个“保险+期货”项目，涉及天然橡胶、白糖、棉花、苹果、红枣、大豆、玉米、鸡蛋、豆粕、生猪、花生11个品种，预计保障现货规模约294万吨，承保土地面积约630万亩，为约58万农户提供了价格和收入保障，在促进乡村产业发展、助力乡村振兴方面发挥了积极作用。各期货交易所不断优化完善项目模式，充分发挥保险和期货两种金融工具服务“三农”的功能，项目保障链条从“种植环节”进一步延伸至“全产业链”。

》》 第二节 商品期货服务实体经济情况

一、上海期货交易所服务实体经济

（一）期货、期权品种创新

1. 推出螺纹钢期权和白银期权

2022年12月26日，螺纹钢期权和白银期权在上海期货交易所挂牌交易，完善了钢铁行业、有色行业的风险管理工具。上市首日，螺纹钢期权全天成交量26 872手，成交金额2 177.1万元；白银期权全天成交量3 796手，成交金额566.26万元。螺纹钢期权和白银期权的上市，可与螺纹钢和白银期货相互协同，进一步完善国内钢铁行业和有色行业的避险体系，提升我国企业在风险管理上的效率和精度。

2. 进一步做好氧化铝期货上市准备

2022年，上期所根据国家标准化委员会颁布的氧化铝新版国家标准，对氧化铝期货合约及规则进行了修订和完善，上报《关于氧化铝期货研发上市工作进展的报告》，完成氧化铝期货交割细则、风控规则等业务规则，以及氧化铝交割商品的注册及认可管理规定、厂库和仓库作业规范、进口氧化铝质检细则等配套业务规则的制定或修订工作。组织多场企业研讨会、交易所内跨部门会议，讨论和落实氧化铝期货业务规则、仓储和质检规则、异地仓库升贴水和仓储收费标准等。

3. 完成合成橡胶期货与期权上市准备

为深化期货市场服务实体经济、助力大宗商品保供稳价功能，服务石化产业高质量发展，助力橡胶及轮胎行业技术升级，促进完善市场化定价机制，打造丁二烯相关品种定价权，上期所完成合成橡胶期货与期权上市准备。在前期市场调研论证的基础上，进一步细化完善期货和期权相关合约规则设计，全力推进交割仓库布局与设置等方面的工作，为合成橡胶相关产业链企业提供有效的风险管理工具。

4. 持续推进能源类新品种研发

紧密跟踪天然气、成品油市场改革发展情况，在“总体设计、分步实施，短期可操作、长期可拓展”和“国际平台、净价交易、完税交割、人民币计价”的总体思路下，加强与相关部委、行业协会、产业客户等市场主体的沟通和交流，不断完善品种规则设计，加快推进研发上市工作。

5. 开展铝合金期货研发

一是完成《铝合金期货可行性研究》课题，初步确定了期货合约标的及交割区域和方式；二是广泛征求各方意见，多次与部委、协会、产业交流，就期货标的选取和规则设计难点听取市场意见。

6. 做好冷轧卷板期货研发工作

一是完成《关于冷轧卷板期货国际化路径及运用前景研究》课题，进一步完善研究基础；二是广泛征求各方意见，多次与行业协会及产业交流，就期货标的选取和规则设计难点听取市场意见；三是在上海开展为期1年的冷轧卷板期货仓储存放实验，合理制定合约规则。

（二）促进合约连续活跃

截至2022年底，上期所已连续5年开展期货做市工作。经过持续优化做市方案并积极探索市场配套措施，合约的连续活跃成效得到进一步稳固。

1. 持续优化做市方案，结合品种特点进行差异化管理

一是优化做市商报价质量评价指标，使其兼具报价宽度和订单厚度导向，进一步激励做市商为市场提供充足的流动性。二是结合品种特点做好精细化管理，对于螺纹钢、石油沥青、白银等市场规模较大，尚未实现主力合约逐月轮转的品种，采取充实做市商数量、强化做市商考核和激励力度等针对性措施，有效促进了合约连



续性的进一步改善；对于不锈钢等已实现主力合约逐月轮转的品种，适当降低做市力度，维持其较好的连续活跃效果。

2. 优化做市商管理，持续培育有竞争力的做市商队伍

一是实现银行和非银行做市商的分类考核管理，进一步增强贵金属品种两类做市商参与积极性。二是制订《做市商排名评价方案》，将做市义务完成情况、日常运行中的不规范行为、对交易所工作的配合等因素一并纳入评价范畴，客观、准确、全面地反映做市商的市场服务质量，为做市商遴选、表彰、淘汰等提供参照标准。三是根据品种做市效果和管理需要，启动实施淘汰机制，强化竞争，提升做市商队伍的整体实力。

3. 探索实施面向全市场的引导措施

试点实施完善合约交易结构、差异化合约交易手续费、持仓重点合约等方案，引导市场参与非传统主力月份合约交易，与做市机制形成合力，共同促进品种连续活跃。方案实施以来，螺纹钢、石油沥青等试点品种非传统主力月份合约的交投规模显著增加，引导效果初步显现。

4. 合约活跃连续成效进一步稳固

合约连续性成效进一步稳固，14个期货做市品种均实现多个合约同时活跃。其中，8个已基本实现主力合约逐月轮转的品种，维持了较好的连续性指标，连续活跃成效得到进一步稳固。2022年，黄金2302和黄金2304合约相继成为主力合约，基本实现主力合约双月轮转的做市目标。石油沥青和白银品种也打破了固有的主力轮转格局，连续活跃成效得到突破和提升。其余的尚未实现主力合约逐月轮转品种（螺纹钢、热轧卷板、天然橡胶和纸浆），做市合约呈现市场投资者参与积极、做市商占比持续下降的良好态势。

（三）修改合约规则

一是修订铜期货合约规则。2022年，为推动我国铜产业产品升级，鼓励行业高质量发展，上期所顺应现货市场变化，将铜期货交割品级中的1号标准铜删除。合约修订后，沪铜交割品质量将进一步对标国际标准，同时，沪铜、国际铜期货的交割品标准将统一。该修订自2022年12月21日起实施。2023年6月19日起，存量1号标准铜仓单应注销转为现货。

二是优化铜期权合约规则。2022年，上期所对铜期权合约内容进行了修订，将铜期权合约行权价格覆盖范围参数由涨跌停板幅度的1倍调整为1.5倍，该修订已于2022年12月9日周五结算后（交易日期为12月12日）起实施。

（四）优化交割业务模式

2022年，上海期货交易所不断优化拓展交割仓库布局，进一步加强交割仓库日常监管，构筑完善全方位监管体系，优化品种合约交割制度，多措并举保障交割业

务平稳有序，为产业链供应链提升韧性和安全稳定提供有力支持。

1. 拓展交割仓库布局

一是在海南洋浦地区增设原油期货指定交割仓库。洋浦经济开发区是国家级开发区，毗邻国际石油贸易主要海上运输航线，是中国距离中东石油最近的油气储备基地。前期，上期所已在洋浦经开区设立了中国石化集团石油商业储备油库，2022年增设国投（洋浦）油气储运有限公司，有利于原油期货资源的市场化流动，充分激发洋浦油气中转口岸作用，是服务海南自由贸易港战略的具体举措，以原油期货助力打造海南岛现代化、国际化、全球化的金融贸易体系。

二是设置第二家低硫燃料油期货集团交割境外交收库。立足于首单低硫燃料油期货跨境交收成功经验，拓展引入资质服务均优的中石化相关企业成为第二家低硫燃料油交割集团厂库，推动境外提货升贴水形成竞争性报价，为境内外实体经济统筹资源提供更多渠道和支持。

三是在深圳设置首家非银行指定交割金库。深圳是我国黄金产业规模最大的集聚区，深圳市威豹金融押运股份有限公司是黄金现货市场库存规模最大的仓库。此前，上期所金库均为银行库，此次设置深圳威豹为首家非银行金库，有助于激活金库竞争机制，全面提高金库交割服务水平和质量，更好地满足当地产业客户参与黄金期货交易交割需求，促进期现市场融合。

2. 优化交割机制

一是优化贵金属仓单系统操作流程。简化黄金品种的入库生成仓单流程，大幅缩短了仓单制作时间，提高了仓单后续质押及交割业务的效率，进一步帮助企业提升运营效率。

二是调整原油期货可交割油种，增加巴士拉中质原油（Basrah Medium）、图皮原油（Tupi）为原油期货可交割油种，进一步丰富可交割资源，更好地满足炼厂、贸易商风险管理和资源配置的需求。

三是顺应市场发展，服务产业需求，调整5个A级铜品牌升贴水，满足了市场人士对调整升水铜品牌的需求，提高了铜期货价格发现、套期保值的效率，使期现价格结合得更加紧密。

（五）加强交割仓库管理

2022年，上期所全年累计交割量82.22万手，折合771.90万吨，同比下降13.65%。上期所根据产业变化 and 市场需求，动态调整交割仓库布局，全年增设仓库5家、集团交割厂库1家；取消仓库6家。交割仓库总数为114家、存放点223个。上期所强化交割仓库治理能力，多措并举提升防范化解风险能力。2022年上期所交割仓（厂）库库容情况见表3-2-1。

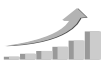


表 3-2-1 2022 年上海期货交易所交割仓（厂）库库容情况

类别	2021 年	2022 年	同比变化（%）
金属交割仓库总库容（万吨）	645.63	594.36	-7.94
能源化工交割仓库总库容（万吨）	2 206.08	2 208.78	0.12
交割品牌总量（个）	380	358	-5.79
国际化品种交割仓库总库容（万吨）	1 761.03	1 769.03	0.45

1. 夯实交割仓库日常监管措施

在检查方面，上期所克服疫情不利影响，加强现场检查力度，全年开展 102 次现场检查。同步开展线上远程查库，强化监管威慑，开展远程线上检查共计 135 次。

在制度方面，严把准入关口，提高指定交割仓库及担保单位净资产要求，增强风险抵御能力。制订《指定交割仓库担保单位准入及变更业务审核流程》。紧跟《期货和衍生品法》出台实施，部署修订《交割仓库管理办法》等系列管理规则，持续强化交割制度的建设和执行。

在集团合作方面，发挥央企、龙头企业在物流仓储行业中的示范效应，与中国物流集团、上港集团签署战略合作协议，提升交割仓储稳健经营以及抵御和处置突发风险能力。

在监管协作方面，增进期货市场“五位一体”监管协作，主动加强与地方金融监管机构间的业务信息交流和监管协同，形成合力，共同防范交割风险。上期所自 2022 年 2 月起每月向 22 家证监局发送《上期交割月报》，通报当地辖区交割仓库月度仓单、交割等信息。

在市场监管方面，针对指定交割仓库出现的经营异常信息、商贸关联关系，以及涉嫌违法违规行为等情形，上期所在交易所网站交割专栏开辟建立线索举报渠道，上线交割业务市场建议与投诉举报板块，以扩大举报渠道知晓度，主动寻求市场监管，增强违规打击示范效应。

2. 科技赋能提升监管质效

一是按“建系统、立标准、促普及”思路推进智慧仓储项目。推进智慧仓储项目是落实中国证监会科技赋能监管要求的实际举措，是以新技术赋能动产管理的积极实践。以智慧仓储为抓手，着力推动交割仓库提升科技管理水平，强化交易所对交割仓库及交割商品安全的管控能力。力争通过各类信息数据的比对分析及仓储视频智能监测，实现交割仓储风险的早发现、早预警、早处置。

二是上线交割仓库风险管理系统，探索开展仓库资信资质实时监测。目前，系统 1.0 版已在上期所数据智能化应用平台上线。1.0 版已经实现交割仓库、注册企业的初步“画像”和工商经营、司法、部分舆情信息的数据查询和风险报警功能。

三是上线期货仓单货位信息查询功能，防范现货市场风险向期货市场传导。上期所于 11 月 29 日在上期所官网上线“期货仓单货位信息查询”功能栏目，允许市

场参与者随时查询期货库区的仓单货位信息，为现货市场客户核验贸易货物真实性提供了帮助，提高了违法违规行为的成本，有助于防范仓单盗卖、重复质押等风险事件的发生。

（六）提升产业客户参与度

上期所持续加强期货品种功能发挥，各品种产业客户持续增加，法人客户已成为期货市场的主要参与群体。截至2022年底，上期所法人客户同比增长14.6%，上期能源法人客户同比增长25.6%。

1. 开展专项激励项目，引导产业客户参与

上期所坚持支持、引导产业企业利用期货衍生工具进行风险管理，试点开展类型多样的专项项目，优化市场服务、降低企业交易成本。2022年，上期所开展了8个市场专项激励项目，涉及螺纹钢、20号胶、国际铜等期货品种，以及原油、铜、铝、天然橡胶等多个期权品种和仓单交易服务，通过手续费减收等方式支持产业客户。

一是国际铜期货“一路铜行”项目鼓励产业客户深度参与国际铜期货，促进品种服务实体经济的功能进一步发挥。二是20号胶期货“丰羽行动”鼓励企业采用20号胶期货作为长协贸易和现货贸易的定价基准。三是原油期货“助实体 稳发展”项目鼓励会员引导企业采用原油期货作为原油、成品油、天然气贸易定价基准。四是“期货稳价订单”项目由产业链龙头企业为上下游实体企业提供现货供应保障、上期所及期货风险管理公司为实体企业提供降低价格波动的风险对冲等工具，实现“龙头保供、期货稳价”的效果。五是“期权稳产行动”项目帮助橡胶企业筑建产业扶持平台，保障天然橡胶原料货源，稳定天然橡胶产业的生产第一线队伍，切实帮助广大胶农稳定收入。六是综合业务平台鼓励交易商在平台采购仓单用于交割，上游生产企业在平台销售仓单，下游消费企业在平台采购仓单。七是期权“走进企业 服务实体”项目鼓励期货公司为实体企业提供产业支持，促进企业利用场内期权，助力企业生产经营，协助进行风险管理活动。八是“提升期权市场运行质量”项目，鼓励期货公司制作投教作品、举办培训、进行市场培育，为做大做强期权市场奠定基础。

2. 推动套保信息披露规则的修订，解决上市公司披露痛点

为解决上市公司披露套保业务信息的难点、痛点，在中国证监会相关部门领导下，上期所会同上海证券交易所、深圳证券交易所对上市公司的套保业务信息披露相关规则进行修订，以更好地反映上市公司套保业务实质，减少投资者误解，助力上市公司稳定经营。

3. 顺应行业发展趋势，积极推进“创新改旧”

为便利产业客户参与期货交易，上期所持续跟踪各行业动态，根据行业发展趋势，及时完善合约及相关业务规则；为完善各产业链品种序列，不断丰富满足产业



需求的产品体系和风险管理工具，上期所以“总体规划，分步实施”的方案，积极推进氧化铝、航运指数、液化天然气、合成橡胶等期货期权新品种研发上市工作。

4. 聚焦产业客户所需，拓展期货价格影响力

为切实解决企业实际需求，引导产业客户利用期货和期权工具进行风险管理，上期所发布原油、燃料油、石油沥青期货月均结算价、20号胶期货月均价，方便现货贸易计价参考，并联合浙油中心发布“中国舟山低硫燃料油保税船供买方报价”，打造具有区域性影响力的定价机制。

5. 针对性开展培训交流活动，不断提高产业客户参与度

上期所积极加强期货市场功能发挥及服务实体经济成效的推广，持续与相关部委和行业协会沟通联系，联合地方监管机构共同参与及指导企业套保业务，以上市公司等产业客户为抓手，发挥合力，精准施策，有针对性地开展期货、财务等专家培训和交流活动，服务期货市场高质量发展。

6. 举办行业会议，加强市场培育

上期所与商务部合作举办进博会配套活动石油商贸大会能源分论坛，与石化联合会合作举办2022全国石油和化工行业经济形势分析会能源分论坛，宣传上海原油期货运行和功能发挥情况，让市场深入了解上期所能源品种。

二、郑州商品交易所服务实体经济情况

（一）期货、期权品种创新情况

1. 菜籽油、花生期权挂牌上市

2022年8月26日，郑商所上市菜籽油、花生期权，是我国上市的第100个和第101个期货期权品种。菜籽油、花生期权上市后市场运行平稳，规模稳步扩大，与标的期货联动良好，实现了“稳起步”的目标。菜籽油、花生期权的上市丰富了油脂油料衍生品工具体系，满足了产业企业更加精细化、个性化的风险管理需求。

2. 持续推进期权新品种研发

全面积极地推进纯碱、玻璃、短纤、锰硅和硅铁5个期权新品种合约规则设计、市场调研、意见征求等工作，根据注册制新要求完成上市申请材料初稿，召开4场规则论证会，覆盖110家产业企业及期货公司，规则草案获得广泛认可，为丰富企业风险管理工具箱、厚植郑商所期权品种发展潜力奠定基础。

3. 实现烧碱、对二甲苯（PX）上市进程突破

做好PX、烧碱等品种的上市准备工作，一是以广泛开展市场调研、质量和库容摸底为支撑，逐个解决烧碱、对二甲苯现货市场特点带来的研发难题。二是持续加强部委沟通，抓住上市窗口期，全力推进烧碱、对二甲苯品种上市进程。

4. 全力推进钢坯等立项品种研发

丙烯、钢坯、瓶片、鸡肉、大蒜5个品种研发工作基本完成；水泥、葵花籽油、

马铃薯品种研发稳步推进，重难点问题持续攻关。此外，主导鸡肉质检团体标准发布实施；鸡肉和大蒜质检设备和方法获6项国家专利。

5. 成功发布国内首条冷链物流运价指数

主动服务国家《“十四五”冷链物流发展规划》，认真落实《中共中央 国务院关于新时代推动中部地区高质量发展的意见》（中发〔2021〕12号）和《河南省人民政府 关于支持郑州商品交易所优势再造的意见》（豫政〔2022〕13号），全力攻坚冷链物流运价指数研发工作，并取得阶段性成果。2022年11月7日，发布国内首个冷链物流运价指数（郑州—北京线路）。

（二）促进合约连续活跃

1. 适时恢复部分期货品种做市

2022年，郑商所在白糖、棉花、菜油、PTA、甲醇、短纤、硅铁、锰硅、纯碱共9品种持续开展做市，并根据市场运行情况适时恢复玻璃、尿素、菜粕期货做市。郑商所正在实施连续活跃方案的期货品种有12个，覆盖主要的工业品及农产品期货。

2. 扩大农产品期货做市合约覆盖范围

根据农产品期货合约挂牌特点及产业企业实际需要，郑商所通过适当增加农产品做市合约数量、延长做市周期，改善农产品期货的流动性结构，满足产业客户在农产品期货上的多样化套期保值需要。

3. 分类灵活施策提升连续活跃效果

郑商所坚持“因品、因时、因势”原则，根据品种特点及合约运行情况调整做市商政策。郑商所坚持逐月动态调整短纤、白糖、硅铁期货品种，力促连续活跃效果上台阶；根据菜油品种特征，调整做市报价要求，鼓励做市商积极提供流动性；根据纯碱期货价格波动情况，调整持续报价价差等义务，鼓励做市商在行情波动较大时提供合理流动性，满足市场交易者的流动性需求。

4. 营造良好做市业务生态

研究制定期货做市评价指标体系，科学、高效地评价期货做市商做市质量，引导做市商不断提升报价质量；探索实施期货做市商竞争性激励和动态进出机制，强化同一期货品种做市商间的竞争、促进做市商充分发挥作用；严格做市商管理，开展做市商年度检查，督促合规做市。

5. 活跃合约连续取得实效

一是活跃合约连续取得突破。短纤、硅铁、白糖3个期货品种实现主力合约逐月轮换，达到活跃合约连续的培育目标。成为主力合约期间，相应合约日均成交、持仓量大幅增加，微观流动性显著改善，相关指标值与传统主力合约基本一致。

二是近月合约活跃的格局进一步形成。除短纤、硅铁、白糖3个期货品种主力合约逐月轮换外，其余实施连续活跃方案期货品种做市周期内，多数目标合约能够



发育为次主力合约，近月合约活跃格局持续夯实。

三是产业企业在非传统主力合约参与度显著提升。2022年，实施连续活跃的期货品种非传统主力月份交割量占比首次超越传统主力月份合约，交割占比同比上升3.89%。

（三）修改合约规则

1. 修订菜油期货业务规则

6月24日，郑商所以对菜油期货交割细则和仓单管理办法进行修订。修订后规则对色泽判定方法进行了简化，并将部分指标要求放宽，有利于减少交割菜油生产或加工中产生的浪费，达到了节粮减损目的，服务国家油脂供应安全。

2. 修订红枣期货合约规则

10月28日，郑商所以对红枣期货合约规则进行修订。修订后规则增加了车（船）板和厂库交割方式，便于各类产业主体参与；将三级枣纳入替代交割品，有效扩大红枣可供交割量，保障红枣期货稳定运行。

3. 推进品种合约规则优化

与中国化纤协会联合研发短纤期货基准交割品团体标准，创新性解决纺纱用和水刺用短纤区分难题，对减少现货交易不确定性、助力产业标准化规范化发展具有积极意义。

4. 做好玻璃期货规则修订“回头看”

2021年玻璃期货规则中取消了交割环节买方的选择权，在2022年首个主力合约顺利完成交割后，对规则修订效果进行综合评估，玻璃期货主要功能发挥指标大幅提升，得到产业企业高度认可。

5. 完善期权合约，优化期权交易管理办法

及时响应市场需求，调整期权行权价格挂牌方式，延后期权合约最后交易日。确保企业在价格大幅波动时有一定数量的虚值期权合约进行风险管理。适度延后期权合约最后交易日，更好满足临近交割月套保需求。

（四）优化交割业务模式

2022年，郑商所主动调研市场需求，持续完善交割业务体系，确保全年库容充足和交割渠道顺畅，服务大宗商品稳产、保供、稳价。

1. 完善交割布局，积极服务国家战略

一是将进口菜粕纳入交割品范围，增设进口菜粕贸易商厂库，有效助力进口菜粕经营企业开展套期保值业务，提高菜粕市场的资源配置效率，助力国内油脂油料安全。二是将尿素交割区域扩至湖北和江苏两省，尿素“商储无忧”试点扩展至上述区域，满足尿素产业客户风险管理需求，为尿素保供稳价贡献期货力量。三是在新疆增设红枣和棉花交割仓库，带动新疆农产品加工、仓储等行业的发展，把产业

链主体留在县域，把就业机会和产业链增值收益留给农民。四是将花生交割区域扩展至辽宁、吉林两省，进一步扩大花生期货可供交割量，助力花生期货平稳运行。

2. 创新交割服务，确保交割流程顺畅

郑商所创新工作方式顺利应对了新冠疫情管控下物流不畅和人员管制对交割工作带来的挑战。一是针对棉花、红枣等品种交割库现场考察难题，创新开展线上考核流程，保障了交割库的库容供给。二是针对硅铁质检送样受阻，协调不同地区交割库、质检机构“五方接力送样”，圆满完成样品交接。三是针对尿素现场采样困难，创新采用视频方式监控采样，保障了期货仓单正常生成。四是针对部分仓库因疫情提货困难，延长提货通知单有效期，确保提货方合法权益。五是开展交割库线上年审工作，有效规避疫情对材料邮寄的影响。

3. 优化交割规则，提高市场服务质量

一是顺应云南白糖物流变化趋势，调升大理地区白糖交割库升贴水，为产业客户参与白糖期货提供便利。二是贴合现货存储特点，增加花生恒温库临时存储费，提高花生配合检验费，调升玻璃期货仓储费，提高交割库服务质量和工作积极性。三是增设PTA、纯碱、锰硅等品种的免检品牌，有效降低了仓单注册成本和时间，助力行业降本增效。

（五）加强交割仓库管理

2022年，郑商所共设置463家交割库（按品种计算），日均仓单量131万吨，为确保仓库和仓单安全，郑商所重点加大了日常监管力度，提高了科技监管水平，签订了仓单财产险和责任险，开展了交割商品抽检工作，保障了全年仓单安全零风险。

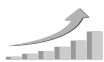
1. 分类监管与科技监控相结合，高效防范仓库风险

郑商所针对270余家交割仓库（按法人计算）开展年审工作和交割仓库分类评级工作，针对考核存在问题的重点仓库及时采取应对处置措施，持续提升交割库队伍抗风险能力。

除常规监管手段外，郑商所持续探索提升科技监管水平。一方面，在棉花、白糖、PTA、菜油等品种上有序推广交割智慧监管平台应用，完成31家交割仓库的科技改造与接入；另一方面，平台动态跟踪交割仓库工商、司法、舆情等信息，对异常情况自动预警，做到风险早识别、早处置。

2. 提高仓单检查频率，保障仓单数量和质量安全

一是在新冠疫情期间提高视频查库的频率，充分发挥视频查库时效性强、效率高的优势，累计开展500余次线上检查工作。二是抓住疫情间隙通过郑商所查、会员查、第三方专业机构查等方式开展现场查库，累计开展线下检查100余次。线上与线下相结合有效确保了仓单数量安全。三是持续开展质检工作，对注册成仓单的交割商品，全年累计抽检500余份样品，保障了仓单的质量安全，为交割业务顺畅



开展奠定了坚实的基础。

3. 投保仓单统一保险，加固仓单安全保障体系

经与多家保险公司反复谈判磋商，顺利签订2023—2025年期货仓单统一保险，本期保险同时涵盖财产险和责任险，为期货市场服务实体经济打上“双保险”。在将期货仓单风险保险转移和分散至保险市场的同时，实现财产险费率进一步降低、责任险保额大幅提高。

2022年郑商所交割仓（厂）库库容变化情况见表3-2-2。

表3-2-2 2022年郑州商品交易所交割仓（厂）库库容变化情况

类别	2021年	2022年	同比变化（%）
农业品交割仓库总库容（万吨）	404	431	6.68
工业品交割仓库总库容（万吨）	432	447	3.47
工业品交割品牌总量（个）	59	63	6.78
工业品保税库交割仓库总库容（万吨）	2	2	0.00

（六）提升产业客户参与度情况

1. 优化套保审核机制，便利产业客户套保交易

2022年，郑商所进一步扩大按品种方式申请套保额度范围，调整甲醇、短纤品种适用按品种方式申请一般月份套保额度，加强套期保值基础性研究，持续优化套保审核流程，提高套保审核效率。全年共受理474个客户的2996份套保申请，申请量1654万手，审批量1489万手。

2. 为龙头企业提供精准服务

一是创新开展产业服务专项支持计划。根据品种禀赋因品施策，在14个期货品种和7个期权品种上创新开展产业服务专项支持计划，以项目的方式支持会员定点开发和服务产业企业，引导企业利用期货、期权工具管理生产经营风险，成功引入龙头企业80余家。二是把31家大型龙头企业建设成为产业基地，认真总结产业基地企业参与期货和衍生品市场典型模式和案例91个，为产业企业风险管理提供鲜活案例。

3. 举办央企、国企和上市公司系列培训

一是分别与豫、浙、新、徽、渝等国资委合作举办“国有企业期货业务培训班”6场，培训国企400余家。二是分别与中石化、招商局集团联合举办4次“郑商所走进央企”活动，开展集团内部期货业务培训。三是与深交所建立合作机制，全面合作开展深市上市公司系列培训。四是联合桂、厦、新、豫、沪、徽、渝等地方证监局举办上市公司培训7场，培训上市公司1500余家。五是分别与中国大连高级经理学院、深交所、上交所合作录制并上线期货衍生品业务课程。

4. 开展多项主题活动，搭建期现合作平台

联合粤、苏、鲁、川等证监局和中国期货业协会举办“大宗商品风险管理论

坛”4期共33场。联合中国期货业协会举办“疫情下企业风险管理”主题活动2期共15场，针对企业急难愁盼问题提供期货解决方案。聚焦场内期权、企业间接参与期货市场、期货和衍生品法、场外衍生品等主题，持续开展线上圆桌论坛10期共81场。支持会员举办“走进产业、贴近行业、服务企业”活动1385场。

分别联合中国铁合金工业协会、中国植物油协会、中国氮肥工业协会、中国食品土畜进出口商会、中国果品流通协会等，举办铁合金（锰硅和硅锰）、菜系（菜油和菜粕）、煤化工（尿素和甲醇）和特色农产品（苹果、红枣和花生）期货衍生品产业大会4场，为产业链企业搭建期现合作平台。

5. 积极融入地方经济发展，助力行业绿色发展

为落实河南省政府《关于支持郑州商品交易所优势再造的意见》，推动郑州市“期货+”战略实施，郑商所发挥属地优势，积极与河南省国资委、农业农村厅、财政厅、金融局、证监局等部门联动，聚焦河南省尿素、纯碱、花生等优势品种，举办系列产业服务活动，例如省管国有企业培训班、期货服务乡村振兴论坛、上市公司培训等。

积极服务绿色发展和对外开放战略，为期货市场服务实体经济增添有力抓手。助力行业绿色发展，总结推广典型案例，持续提升光伏玻璃企业利用纯碱期货保障供应链稳定成效，我国排名前10位的光伏玻璃企业中已有7家参与了纯碱期货交易。

6. 总结典型案例积极主动做好品种功能发挥宣传

梳理总结企业参与模式，编撰8个品种的17种典型模式，向中国期货业协会提供《企业参与期货市场最佳实践案例》并印刷成册，及时反映企业参与期货市场成效。

聚焦棉花期货准确反映市场趋势、纯碱赋能绿色发展、短纤团体标准解决产业难题等亮点，通过内参等多种渠道实现宣传出圈。其中，《PTA期货助力现货产业高质量发展》一文被收录进“学习强国”平台。

三、大连商品交易所服务实体经济

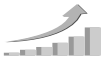
（一）期货、期权品种创新

1. 积极推进集装箱运力期货研发上市工作

2022年，大商所密切跟踪集装箱运力现货市场情况，赴港口、船公司等产业第一线走访调研，组织多次模拟交割及市场论证，与相关部委、行业协会、产业客户、期货公司等市场主体进行沟通和交流，完成实物交割制度、风控制度、交割标准等一整套合约规则设计方案。

2. 积极推进再生钢铁原料期货研发工作

2022年大商所赴废钢加工基地、钢厂等产业前线开展实地调研，探索利用智能



检验技术在期货交割的应用，组织多次品质摸底、检验对标、模拟交割和市场论证，保持与相关部委和龙头企业的沟通交流。为服务保供稳价、应对市场变化，大商所以对合约规则制度进行系统优化，扩充交割品，扩大交割区域，拓宽产业服务面。

3. 加快推动纯苯期货研发

开展纯苯现货市场研究，根据现货特点完成纯苯期货合约及规则方案设计草案，通过线上方式邀请生产、消费、贸易、仓储等企业开展市场论证会，优化和完善合约设计方案。

4. 深入推动硫黄期货研发

开展硫黄现货市场研究，以线上线下相结合的方式对硫黄生产、消费、贸易企业进行全产业链调研，深入了解商品属性、质量标准、供需结构、贸易定价模式、行业政策等现货市场情况，依据调研反馈完善现货市场报告，优化硫黄期货合约设计方案。

5. 大力推动石油焦期货品种研发工作

深入开展石油焦现货市场研究，通过调研与座谈等方式，摸清石油焦的生产、消费和贸易等实际情况与特点，不断完善现货市场报告，并根据现货实际，起草期货合约规则设计方案。

6. 持续推动冰醋酸品种研发工作

积极加快冰醋酸品种研究工作，已完成现货市场研究报告初稿。深入江苏、山东、河北、广东等地开展产业链企业调研，已完成30余家包括生产企业、贸易商、消费企业、仓储企业等相关企业调研，重点了解冰醋酸生产工艺、质量标准、定价机制、贸易流向、运输与仓储等关键问题。

7. 三个豆系期权顺利上市，大豆产业再添期权新工具

2022年8月8日，黄大豆1号、黄大豆2号和豆油期权同步上市交易，加上2017年上市的豆粕期权，豆系期权实现了大商所大豆产业链相关产品的全覆盖，搭建起大豆产业完备的风险管理工具体系。

8. 豆系期权引入境外交易者

2022年12月26日，黄大豆1号、黄大豆2号、豆粕、豆油4个豆系期权成功引入境外交易者，服务全球油脂油料产业风险管理需求。

9. 优化期权交易规则，推动期权规则体系持续完善

2022年8月25日，《大连商品交易所期权交易管理办法》第二十六条经修订后正式实施，对期权最小下单手数进行了规定，使期权交易规则更加完善，为交易所根据市场需求调整期权最小下单数量提供了制度依据。

10. 稳步推进乙二醇、苯乙烯期权上市工作

大商所完成乙二醇、苯乙烯两个期权品种上市之前的市场意见征求、系统测试、市场宣传、合约规则报备等各业务条线的准备工作，拟在中国证监会统筹安排下，稳步实现乙二醇和苯乙烯的期权上市。

（二）促进合约连续活跃

1. 促进合约连续活跃的措施

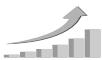
一是持续深化“一品一策”，紧盯重点品种、重点合约，推进做市业务，制订做市业务内部管理流程，做到管理规范。同时，根据市场运行情况和品种特点，差异化、精细化、动态化制订做市方案。每月对17个品种的市场运行情况进行全面分析，根据品种情况差异化确定各品种做市重心和方案目标，按照活跃目标为每一个合约量身定制做市参数，建立起每日、周、月、年度的动态化、系统化、全方位评估体系，及时跟踪掌握方案效果，确保做市方案符合活跃工作需要。最后根据评估结果，灵活调整做市参数，进行做市商微观管理。另外，2022年大商所对做市业务开展内部审计，为合约连续活跃工作做好“体检”，确保管理科学到位。

二是重大品种攻坚克难，提升铁矿石期货临近交割合约代表性。为提升铁矿石期货近月合约价格的连续性、合理性和代表性，大商所研究并引入具有产业背景的做市商，破冰对临近交割合约做市。目前，大商所已延长包括铁矿石在内的15个期货品种的做市时间至交割月前月第十个交易日，大幅改善了交割月前月合约的价差和深度，有效满足了产业企业利用近月合约套期保值的需求，未来将根据品种运行情况将交割月做市逐步推广至其他品种。

三是新增生猪期货做市。2022年7月，为进一步提高生猪期货市场运行质量、更好地服务实体经济，大商所在生猪期货上引入做市商。为维护市场稳定运行，大商所制订出优化合约价格曲线和流动性期限结构的方案，即要求做市商在各合约上提供报价服务，为合约提供持续稳定的流动性，引导市场参与者根据实际生产需求开展交易。至此，在大商所21个期货品种中，除两板外其他19个品种全部引入做市商，品种覆盖率90%，率先实现主要品种做市业务全覆盖。

四是强化技术系统建设与优化。2022年，为适应衍生品发展过程中丰富的做市业务场景及灵活的做市商制度，大商所启用DCE交易7.0系统新接口，提高技术服务能力，优化有效报价评估和交易手续费减免方式，有效促进做市商提高报价质量，降低做市商交易成本，全面提升做市水平。同时，针对做市交易机制特点，大商所开发了批量双边报价指令、一键撤单和做市商保护等技术支持措施，未来将根据业务发展的需求适时启用。

五是全方位打造舒适环境，多措并举促进连续活跃。以重点品种铁矿石为例，2022年，大商所大力完善交割业务，进一步提高铁矿石近月合约参与的便利性和可行性，解决产业客户后顾之忧，延迟近月合约移仓换月时间，提高合约连续活跃效果。其一，铁矿石品种重大合约修改落地实施，经济交割品更加丰富。其二，持续增加铁矿石可交割品牌和交割库，增加国产矿品牌，增厚经济交割品资源。其三，实施滚动交割制度，推广仓库免检交割，推出协议交收和厂库自报升贴水制度，降低交割相关费用，提高交割便利性。另外，大商所汝乐组合保证金系统已在仿真系



统上线，并对做市商开展相关培训。同时，持仓增量减收措施结合鼓励做市合约持仓的目标，对做市合约的持仓赋予更高的权重，进一步推动合约连续活跃工作。

2. 促进合约连续活跃的效果

一是合约形态明显改善。2022年，大商所在17个品种^①上开展做市交易，各品种合约形态出现明显改善，彻底摆脱以往交易集中于1/5/9合约，非1/5/9合约“零成交、无持仓”，主力合约1/5/9轮换、移仓换月早等现象。

二是市场质量显著提升。2022年，大商所持续改善各品种近月合约不活跃和主力合约不连续现象，优化市场交易结构，提升期货市场运行质量，便于实体企业更好地利用期货市场：其一，做市合约成交、持仓规模稳步提升。大商所做市合约日均成交量和日均持仓量同比增长显著；苯乙烯等主力合约逐月轮换品种做市合约成交、持仓占比提高。其二，做市合约价差、订单深度持续改善。做市合约最优买卖价差缩小，五档订单深度增加，铁矿石、豆粕等品种做市合约流动性质量显著提高。其三，做市合约客户参与度大幅提升。做市合约参与交易的法人客户数、个人客户数显著增加，做市合约的非做市商客户平均成交提升。其四，交割前月合约流动性明显改善。交割前月合约的买卖价差、深度均改善5倍以上，买卖价差稳定，价格毛刺现象（价格噪声）明显减少，合约订单深度大幅增加，订单分布更加均匀。其五，交割月合约价格连续性改善。铁矿石期货试点交割月做市，铁矿石品种交割月合约盘面报价价差由上百元缩窄至10元左右，价格更加合理连续，价格代表性得到提升。

三是生态环境建设提质增效。2022年，在大商所、做市商及市场各方的共同努力下，合约连续活跃工作也为期货市场生态建设带来积极影响。

（三）修改合约规则

一是全面调整生猪期货地区升贴水。2022年5月13日，大商所发布《关于调整生猪期货交割区域升贴水的公告》，对生猪期货交割区域升贴水进行调整。

二是调整豆油仓单有效期。2022年8月12日，大商所发布关于修改《大连商品交易所豆油期货业务细则》的公告，将豆油期货标准仓单的有效期限由最长12个月缩短至最长4个月。

三是全面优化鸡蛋合约规则。2022年1月25日，大商所发布《关于修改〈大连商品交易所鸡蛋期货业务细则〉等规则的公告》，继续优化鸡蛋期货交割结算相关规则。2022年12月2日，大商所发布《关于修改〈大连商品交易所生猪期货业务细则〉和〈大连商品交易所鸡蛋期货业务细则〉的公告》，鸡蛋期货增加了因不可抗力导致指定质量检验机构无法到场检验的相关处理措施。

^① 大商所共21个品种，其中，胶合板、纤维板未开展做市交易，焦煤、焦炭由于品种风控原因自2021年8月20日起暂停做市。

四是修改黄大豆1号等品种规则。2022年12月16日，大商所发布公告修改《大连商品交易所交割管理办法》和黄大豆1号等品种细则，增加了黄大豆1号、黄大豆2号、豆粕、豆油等品种不能接收或者开具增值税发票的单位客户持仓不得交割，以及相关品种不可交割持仓处理、发票资质验证的规定。

五是调整焦煤交割质量标准，优化地点升贴水。2022年大商所顺应现货市场变化，优化焦煤期货合约和地点升贴水体系。修改焦煤交割质量标准，将交割标的由进口焦煤变为国产主流现货。将山西调整为交割基准地，港口升水170元/吨。

六是优化塑化品种交割品牌工作办法，方便龙头企业申请交割品牌资格。大幅优化《大连商品交易所期货交割注册品牌工作办法》，简化申请材料、降低资质门槛、取消免检品牌风险抵押金等。

七是紧跟行业发展趋势，通过扩大苯乙烯交割区域提升产业客户参与积极性。新增辽宁、河北、安徽、山东4省为交割区域，增设后覆盖苯乙烯九成的生产和消费。

（四）优化交割业务模式

一是推出生猪期货协议交收业务。2022年9月27日，大商所发布《关于生猪期货协议交收有关事项的通知》，开展生猪期货协议交收业务，包括提货地点协议交收和白条猪肉协议交收两项具体业务，即日起在现有合约上实施。

二是推出铁矿石期货协议交收及厂库动态升贴水业务，提高服务产业能力。2022年，大商所推出铁矿石协议交收及厂库动态升贴水业务。交割配对后的交割、提货环节，双方可协商确定交收商品质量、数量、品牌等，完成实物交收。同时，为进一步服务国产矿发展，在不影响沿海交割体系的基础上扩大铁矿石交割区域，大商所推出铁矿石厂库动态升贴水提货地点业务。

三是实施焦煤协议交收，便利产业客户参与。针对交割厂库多元生产和下游焦化厂对交割品的个性需求，大商所于2022年12月29日落地协议交收制度，允许交割厂库和标准仓单持有人就交收商品的质量、数量、地点、价差等信息进行协商。

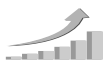
四是以聚氯乙烯品种为试点，推出化工品种集团化交割制度。大商所于2022年6月发布公告，在聚氯乙烯品种上引入集团化交割制度，并征集集团交割库。

（五）加强交割仓库管理

一是提高生猪交割仓库服务产业能力。2022年在湖南、四川、江西、河北、内蒙古5省区增加交割库，目前生猪交割库共分布在11个省区。

二是优化豆粕、豆油交割仓库布局。2022年，增加了6家豆粕交割库、6家豆油交割库，取消了1家豆油交割库；首次在广西设立了豆油交割厂库，实现华东、华北、华南等主要产区的全覆盖。

三是调整鸡蛋交割厂库和车板交割场所，优化交割布局。2022年调整5家鸡蛋



交割库（新增鸡蛋指定厂库2家，取消鸡蛋指定厂库3家）。

四是完成交割仓库现场检查、考察，共增加指定交割仓库和指定车板交割场所62家，主动扩充交割库容。

五是完善煤焦矿指定交割仓库和注册品牌。设有新设铁矿石指定交割仓库，还取消了1家；新设焦煤指定交割仓库4家，取消1家；新设焦炭指定交割仓库2家，取消1家。注册品牌方面，铁矿石增设注册品牌4个。2022年大商所增加国产矿品牌，助力基石计划。12月7日，大商所发布公告，自I2312合约起增加太钢精粉、马钢精粉、五矿标准粉、SP10粉4个矿种为铁矿石期货可交割品牌。至此，铁矿石期货共有21个可交割品牌，年可交割资源达6.9亿吨。

六是加强疫情期间交割仓库管理，防范交割风险，强化廉洁纪律。在疫情期间，要求各交割仓库第一时间上报受疫情影响情况，每日坚持交割仓库风险“0报告”。对于处在疫情风险地区的交割仓库，要及时做好相关提示，保证了2022年交割未出现任何风险。

七是加强交割库日常管理和现场检查。以化工品种指定交割仓库为例，全年完成现场检查65家。

2022年大连商品交易所交割仓（厂）库库容变化情况见表3-2-3。

表3-2-3 2022年大连商品交易所交割仓（厂）库库容变化情况

项目	2021年	2022年	同比变化（%）
工业品交割仓（厂）库总库容（万吨）	3 216.47	3 075.83	-4.37
工业品交割品牌总量（个）	68	82	20.59
工业品保税交割仓库总库容（万吨）	78	75	-3.85
农业品交割仓（厂）库总库容（万吨）	578.78	656.57	13.45

注：2021年工业品交割仓（厂）库总库容数据剔除重合库容。

数据来源：大连商品交易所。

（六）提升产业客户参与度

一是明确目标和举措，从产业客户数、产业日均持仓等4个维度设定工作目标；围绕市场服务、规则制度等6个方面确定43项攻坚克难项目；每月测算指标，跟进项目进展。

二是深化“一品一策”，贴近现货实际，推进生猪、焦煤、铁矿石、化工等品种合约规则和交割制度优化；逐步将各品种做市时间延长至交割前月第十个交易日，并率先实施交割合约做市交易，提高近月合约流动性和期货价格有效性。

三是强化产业服务力度，班子成员包干28家龙头企业，开展高层互访；为350家龙头企业、上市公司提供“一对一”服务；“大商所企风计划”支持开展343个项目，服务304家企业；引导292家企业首次参与。

四是助力品牌活动提质增效，落地备案制，提高会员组织活动的积极性，全年

举办1840场活动；增设40家产融基地，举办120场产融基地活动，覆盖830余家企业；凝聚多方合力，举办产业大会及各项专项活动。

五是不断拓展场外内涵，上线大宗商品仓单登记中心，与中国人民银行动产融资统一登记公示系统联通；率先推出协议交收库业务，建立“期货交割库+协议交收库”的多层次仓库服务体系；上线太钢、九三场外交易专区。

六是降低产业客户参与成本，以塑料品种为试点实施差异化保证金，开展套保交易手续费减收和方式优化，继续减收免收交割手续费等各类费用。

七是坚决维护市场平稳运行，妥善应对交割违约潜在风险和玉米等品种大量交割挑战；针对部分大宗商品价格持续大幅上涨风险，坚决果断出台52项风险防控措施，大豆、玉米、铁矿石等重要品种期货价格的涨幅低于境外。

四、广州期货交易所服务实体经济情况

（一）期货、期权品种创新

1. 期货品种创新

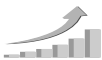
（1）工业硅期货挂牌上市。2022年12月22日，广期所上市工业硅期货，这是我国首个挂牌交易的新能源金属期货品种，积极服务硅能源产业发展。上市以来，工业硅期货成交规模不断增长，产业客户参与意愿浓厚，为上下游相关企业规避价格波动风险、稳定企业生产经营提供了工具，并通过规范包装和质检流程，引导产业向高质量、规范化的方向发展。

（2）推进碳酸锂品种上市工作。一是完成碳酸锂期货期权注册材料；二是赴青海、四川、江西等主要产销区调研10余次，开展线上交流20余次，与50余家企业和机构座谈，完成合约规则的设计和论证工作；三是完成现货质量摸底检验，188个检验样本覆盖国内碳酸锂总产能80%的企业；四是针对部委和行业关心的资源对外依存度较高、价格上涨较快等问题形成了专题报告；五是两次在行业会议宣讲期货功能和期货设计思路，并举办合约规则论证会，积极开展市场培育，听取行业的意见和建议。

（3）推进多晶硅期货研发工作。持续开展多晶硅产业调研工作，参与硅业大会和多晶硅产业大会，并做主题演讲，提高产业企业对期货工具规避价格风险的认识，广泛征求产业链相关企业的意见，完善多晶硅期货合约制度的设计思路。

（4）推进商品指数品种上市工作。一是完成商品指数期货立项申请材料；二是广泛征求市场意见，已开展17（轮）次集中调研与市场活动，覆盖150家期货公司和约50家产业与市场机构；三是完成产品研发和合约设计工作，针对关键问题深入开展专项研究，完成23项专题研究，形成40余份报告。四是推进业务技术准备，强化指数期货交割结算价运行保障。

（5）持续调研碳电品种。一是持续开展碳排放权和电力期货调研、合约规则设



计和论证工作，走访南方电网、国家电网、五大电力集团、大型地方能源集团、电解铝、石化等行业龙头企业 50 余家；二是与生态环境部直属的国家应对气候变化战略研究和国际合作中心、信息中心、中电技协开展课题合作，提升品种研究深度；三是积极参与国际期货大会、国际金融论坛及生态环境部、国家发改委直属智库、南方电网等单位组织的研讨会，交流期货市场在助力碳排放权、电力市场体系建设中的重要作用。

(6) 探索国际市场产品互挂类品种。一是持续与港交所深入合作商讨互挂方案，召开产品合作工作会议，系统讨论研究互挂方案细节；二是持续开展市场调研，完成广州、上海地区机构交流，了解各类机构投资者对互挂品种的需求；三是全面开展合约规则设计探讨和论证工作。

(7) 持续调研铂钯品种。一是应邀参加了上海铂金周的活动，并在会上做了期货市场助力铂族金属高质量发展的主题演讲；二是就铂钯现货市场的情况与广东黄金协会、粤宝黄金开展交流。

(8) 跟踪研究高粱品种。一是开展高粱现货市场调研，参加高粱产业链年度论坛并调研赤峰当地的高粱种植情况，掌握国内高粱市场的基本情况；二是加强与行业重要资讯机构交流，梳理高粱现货产销数据，持续推进高粱期货标的选择、合约规则设计等专题研究。

2. 期权品种创新

为进一步提升服务实体经济的深度和广度，利用期权更好助力期货功能发挥，丰富风险管理工具，2022 年广期所上市工业硅期权，并持续推进中证商品指数、碳酸锂等储备品种期权的研发工作。

(1) 工业硅期权挂牌上市。2022 年 12 月 23 日，广期所工业硅期权与工业硅期货同步上市，对于完善工业硅价格形成机制、提升市场主体风险管理能力和助力我国低碳经济发展具有积极意义，同时也符合广州期货交易所服务绿色发展的定位。上市以来，工业硅期权市场运行平稳，截至 2022 年底，共计 6 个交易日内，工业硅期权成交量超 3 万手，法人客户持仓量占比 91.40%。

(2) 推进碳酸锂期权上市工作。完成碳酸锂期权合约规则设计，并开展市场意见征求，通过举办规则论证会和线上调研交流等方式，听取了 30 余家产业企业、投资机构以及做市商的意见和建议。根据市场反馈以及碳酸锂价格运行特点，调整和优化期权合约的行权间距、最小变动价位等设计。

(3) 推进商品指数期权上市工作。一是完成商品指数期权立项申请材料，完成期权合约规则设计和论证；二是完成市场调研，征求超过 200 家市场机构意见；三是持续推进业务技术系统评估、测试和优化，保障系统满足期权品种业务运行需求。

(二) 促进合约连续活跃

工业硅上市初期，挂牌合约月份较远，为提高期货合约的连续性，考虑推动工

业硅期货引入做市商，通过对申请主体的公司资质、系统硬件、做市经验以及内部风险控制制度综合评判，筛选出优秀期货做市主体，为提高工业硅期货合约活跃性做好保障。

（三）优化交割业务模式

一是科学布局交割库，确保交割资源充足。针对工业硅主产、主销区分散的特点，以交割平稳为目标，遵循贴近现货贸易习惯、降低交割成本、防范交割风险的原则，选择江苏、上海、浙江（华东地区），天津，广东，云南，新疆，四川等工业硅主要生产、消费地为交割区域，兼顾保证交割安全和满足交割需求。

二是“仓库+厂库”并举，积极服务实体经济。基于工业硅产业特点，“仓库+厂库”并行，提升产业客户参与交割业务便利程度。此外，顺应现货市场习惯，厂库推行“贸易、消费型厂库为主，生产型厂库为辅”的模式，有效引导现货资源进入期货市场，扩大仓单形成的现货基础，同时可满足下游有机硅、多晶硅等企业的个性化需求。

（四）加强交割仓库管理

2022年，广州期货交易所持续推进交割准备工作，全年新设首批交割仓库12家、存放点20个，合计最低保障库容18.5万吨。

1. 建立交割管理制度体系

一方面，制定《广州期货交易所交割管理办法》《广州期货交易所指定交割仓库管理办法》等6个相关业务制度，为交割业务稳定运行提供制度保障。另一方面，成立交割业务审核小组，正式规范了交割业务审核工作程序，明确审核机制。基于专业性、全面性、公权力监督三个方面，推进评议过程和结果的科学性及其有效性。

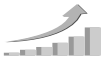
2. 完成首批交割仓库和质检机构的设置

品种上市之前，完成江苏、上海、浙江、广东、四川、新疆6省市指定交割仓库和质检机构的批设工作。覆盖工业硅现货主要产销地，合计提供最低保障库容18.5万吨，更好地满足产业客户需求，为稳妥审慎开展首次交割奠定基础。此外，更加注重指定交割库的风险防范，扩大重大变更事项类型。要求指定交割库需按月向交易所报告所涉重大变更事项是否发生变化的情况，提高汇报频率。

》》》 第三节 金融期货服务宏观经济情况

一、股指期货服务宏观经济

我国股指期货市场发展10余年来，市场运行平稳，功能逐步发挥，产品体系日



益丰富，机构投资者占比不断增加，为股票等权益类资产提供了重要的风险管理工具。2022年，作为金融期货服务实体经济过程的纽带，各类专业机构投资者积极使用股指期货助力资本市场稳定、上市公司融资发展和居民理财保值增值，在促进资本市场、实体经济和民生领域高质量发展方面的积极作用逐步显现。

（一）股指期货产品不断丰富，进一步满足投资者多样化的风险管理需求

2022年7月22日，中证1000股指期货在中国金融期货交易所上市，中证1000指数成分股在市值规模、行业分布与现有沪深300、上证50和中证500指数形成一定互补，标的指数的市值覆盖度进一步提升。产品上市以来，成交活跃度适中，持仓量稳步增加，截至2022年底，中证1000股指期货日均成交量5.56万手，日均持仓量9.62万手，较好满足了投资者对中小盘股票的风险管理需求。投资者基于中证1000股指期货开发市场中性、多头替代等多种交易策略，实现了增加超额收益、降低跟踪误差的效果，投资者多样化风险管理需求得到进一步满足。

（二）股指期货机构投资者占比增加，服务实体经济高质量发展的水平有所提高

目前，股指期货市场机构化程度相对较高，机构投资者理性参与。截至2022年底，股指期货机构投资者日均成交占比超过50%，日均持仓占比超过70%，机构成交、持仓占比较上年度均有所提升。年金、公募基金等机构投资者可以使用股指期货管理风险，参与上市公司新股发行和定增再融资，中证1000股指期货上市后，部分机构投资者使用股指期货有效对冲了股票持仓风险，对提高中证1000成分股的持股规模，活跃相关股票成交，提升定价效率，便利公司未来融资发展起到了积极的作用。

（三）发挥风险对冲功能，维护现货市场稳定，增强市场韧性

2022年股市波动较大，股指期货作为基础风险管理工具保持稳健运行，市场持仓量多次创新高，稳步发挥风险管理等市场功能，在促进投资者稳定持股等方面发挥了积极作用。例如，4月股市大幅波动时，机构投资者持有的股指期货空头持仓金额占投资者持有的对应成分股及基金市值比例均有提升，通过在股指期货市场对冲部分股票头寸，投资者可降低其直接出售股票的规模，在一定程度上有利于其稳定持股。

二、国债期货服务宏观经济

2022年，国债期货市场运行平稳有序，国债期货价格紧紧跟随现券，成交、持仓规模稳步提升，功能发挥进一步凸显；第二批保险机构和第二批试点银行获准参与国债期货交易，国债期货投资者结构进一步完善。

（一）市场规模稳步提升，功能发挥进一步凸显

2022年国债期货成交量、持仓量均有较大幅度增长，日均成交量16.04万手，较2021年增加5.73万手，增幅55.58%，日均持仓量35.52万手，较2021年增加10.92万手，增幅44.39%。全年市场运行平稳有序，与国债现货价格紧密联动，上市以来，2年、5年、10年期国债期货与对应现券的价格相关性分别为99.00%、98.96%、99.44%。2022年，在境内外多重因素交织影响下，债券利率呈现震荡走势，波动逐步加大，投资者风险管理需求增强。同时，积极财政政策发力，国债发行规模大幅增长，地方政府债发行提速增量。市场避险需求上升和利率债供给增加等因素驱动国债期货成交、持仓规模显著增长。国债期货在服务国债、地方债一级发行，提升债券二级市场流动性，助力实体企业融资，平抑资管产品净值波动等方面发挥了积极作用。

（二）投资者结构不断丰富，促进期现货市场协同发展

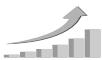
2022年，机构投资者在国债期货市场的参与度稳步提升，日均持仓占比91.39%，较2021年提高2.98个百分点；日均成交占比75.47%，较2021年提高9.95个百分点。国债期货市场投资者结构更加多元，中长期资金参与程度持续深化，尤其是与民生保障紧密相连的保险资金，对居民财富实现长期保值增值具有重要的支撑作用。在首批7家保险机构稳定参与国债期货市场的同时，第二批保险机构实现入市，第二批试点银行——渣打银行（中国）获准参与。此外，私募基金参与国债期货规模也持续提升。

三、股指期权服务宏观经济

2022年，股指期权新产品平稳起步，产品体系进一步完善，3个股指期权产品总成交量3855万手、权利金成交额2643亿元，市场规模稳中有升。投资者结构进一步完善，机构投资者参与度提高，成交量及持仓量占比均超六成，合格境外机构投资者（QFII）和人民币合格境外机构投资者（RQFII）参与股指期权业务正式落地，更多中长期机构投资者有序参与。2022年股票市场整体呈现震荡调整行情，投资者风险对冲需求加大，股指期权产品持仓量多次创新高，风险管理功能逐步显现，对于促进投资者稳定持股发挥了积极作用。

（一）股指期权产品体系进一步完善，深化期货期权一体化发展

2022年7月22日，中证1000股指期权在中国金融期货交易所上市；12月19日，上证50股指期权上市。新产品的上市进一步扩大了股指期权产品标的指数的覆盖范围，满足了投资者日益多元化的风险管理和财富管理需求。中证1000股指期权丰富了小盘股风险管理工具，产品上市后日均受保市值超百亿元，期货与期权同步上市有利于发挥产品协同作用，促进构建期货期权一体化风险管理体系。上证50



指数标的成分股均为优质大盘蓝筹企业，上证 50 股指期货与上证 50 股指期货、上证 50ETF 期权协同发展，可以更好地发挥风险管理的合力，进一步提升上证 50 指数风险管理市场的整体承载能力。

（二）合格境外机构投资者和人民币合格境外机构投资者参与股指期货正式落地，对外开放进程加快

根据中国证监会统一部署，2022 年 9 月 2 日，中国金融期货交易所发布《关于合格境外机构投资者和人民币合格境外机构投资者参与股指期货交易有关事项的通知》，正式受理合格境外机构投资者和人民币合格境外机构投资者股指期货套期保值额度申请，进一步丰富了境外交易者的风险管理工具，有利于促进境外资金持续稳定配置境内股票资产，对优化股指期货和期权市场生态，吸引更多中长期机构投资者参与资本市场具有积极意义。

（三）股指期货保险功能进一步发挥，促进投资者稳定持股

股指期货推出后，投资者可以通过配置股指期货达到类似于为股票资产购买一份“保险”的效果，即在不放弃股票资产上涨收益的同时，对其下跌风险进行有效保护。投资者可通过买入股指看跌期权在市场下跌的行情中降低股票资产的损失，降低投资组合的净值波动。

2022 年，股指期货日均约为 400 亿元的股票资产提供下跌保护。在股市波动较大期间，投资者的避险需求进一步增加，股指期货有效地发挥了保险功能，在一定程度上稳定了投资者的持股信心。

》》 第四节 场外市场服务实体经济情况

一、上海期货交易所场外市场服务实体经济

2022 年，上期综合业务平台（以下简称“平台”）积极落实习近平总书记讲话精神和《关于支持浦东新区高水平改革开放打造社会主义现代化建设引领区的意见》中“开展期货保税仓单业务”要求，不断完善平台功能，上线 20 号胶保税标准仓单交易业务，更好服务实体经济。

（一）上期综合业务平台运行情况

1. 平台成交活跃，报价资源丰富

2022 年平台成交业务 18 335 笔，共计 68.60 万张仓单，成交重量 135 万吨，成

交金额 1 229.78 亿元。其中，成交仓单数量同比增幅 66%，成交金额同比增幅 7%。自 2018 年成立以来，累计成交业务 89 874 笔，共计 204.67 张仓单，成交重量 1 503.10 万吨，成交额 6 161.84 亿元。

2022 年浙油中心报价专区报价 3 423 笔，累计报价 13 622 笔。2022 年欧冶云商报价专区报价 17 405 笔，累计报价 66 073 笔。期转现报价专区累计报价 31 笔。保税仓单转让报价专区累计报价 3 笔。山东国际大宗报价专区累计报价 10 笔。

2. 签约交易商数量持续增长，结构合理

2022 年平台新增签约交易商 62 家，增幅 7%。至此，平台累计签约交易商 621 家。其中，产业链生产企业 133 家，占比 21%；产业贸易商 401 家，占比 65%；风险子公司 73 家，占比 12%；金融机构 14 家，占比 2%。

3. 结算稳定有序，质押规模稳步扩大

平台资金、仓单数量充足。2022 年入金 528.06 亿元，出金 529.74 亿元。2022 年日均可用资金 5.65 亿元，日均可用仓单数量 1 596 张。

平台线上质押进一步拓展，2022 年完成 140 笔共 16 亿元成交，增幅 2%。自上线以来，质押业务累计完成 340 笔，共计仓单 13 732 张，仓单重量 11.11 万吨，贷款金额超 32.91 亿元，质押规模稳步扩大，平均利率整体低于行业平均水平。

（二）不断丰富产品供给

平台从完税标准仓单起步，逐步向延伸仓单、保税标准仓单、场外衍生品领域发展，积极拓展期货市场服务实体经济的深度和广度。目前，平台已上线铜、铝、锌、铅、镍、锡、白银、螺纹钢、线材、热轧卷板、不锈钢、天然橡胶、石油沥青、纸浆、20 号胶 15 个品种的标准仓单交易和天然橡胶延伸仓单交易业务，正在积极开展商品互换、基差交易、品种交易专区等业务的研究和上线准备。

（三）推动数字化仓单发展

党的二十大报告提出“加快发展数字经济，促进数字经济和实体经济深度融合”要求，平台依托交易所技术公司的研发力量，与全国性大宗商品仓单注册登记中心（以下简称“全仓登”）合作，积极探索区块链技术在仓单领域的运用，推动数字化仓单发展，并在此基础上推出区块链仓单交易的应用场景。

（四）广泛开展合作，打造大宗商品交易生态圈

平台加强与浙江省、山东省政府的联系，持续推动区域经济合作，落实长三角一体化发展等国家战略。平台积极参与长三角油气期现一体化市场建设，贯彻落实战略入股浙油中心，委派干部任职浙油中心高管，“浙油中心报价专区”“浙油仓单在上期所挂牌”“产能预售”“保税仓单登记系统建设”等重点合作项目取得突破性进展，先后入选长三角、上海国际金融中心和浙江自贸区优秀典型案例。平台与中



国宝武集团设立欧冶云商交易专区，服务黑色金属产业链发展；上线山东国际大宗报价专区，促进区域经济发展，更好服务实体经济。

二、郑州商品交易所场外市场服务实体经济

（一）持续扩大业务规模

平台成交额 249.45 亿元，增长 38.13%；新增开户数 120 家，增长 19.83%。其中，仓单交易成交 120.18 万吨、184.59 亿元，泛糖专区成交 4.02 万吨、2.33 亿元，中华棉专区成交 0.26 万吨、0.42 亿元，场外期权备案名义本金 62.11 亿元。

（二）不断深化“平台+”建设

总结中华棉和泛糖专区业务发展经验，完善基差贸易业务流程，修订基差贸易和泛糖专区业务指引，降低泛糖专区保证金，探索多日点价模式，“‘平台+’期现联动模式”获评 2022 年河南省自贸区改革创新案例。

（三）助力企业纾困解难

支持银行开展买断式回购业务，着力缓解产业企业融资难、融资贵问题，为 31 家产业企业提供融资 89.92 亿元，同比增长 89.69%，平均融资成本低于 4%。

（四）升级平台功能架构

上线电子结算单、分批摘牌等 59 项功能，推动基差贸易、中华棉专区和泛糖专区升级为 BS 架构，开发上线极星客户端场外版和上海 CA 数字证书发证系统。

（五）多措并举加大宣传

利用场外网站、微信公众号开展对外宣传，阅读量超过 4.6 万次，网站访问量 16.7 万次，场外微信公众号 2 029 人关注；通过“走进产业、贴近行业、服务企业”活动、会员“线上面对面”“期货名家讲堂”等形式推介场外业务 38 场，观看超过 2 万人次；编写印刷场外宣传手册，制作基差贸易、泛糖专区和联动点价宣传动画，通过《证券日报》《期货日报》等刊发 14 篇系列宣传稿。

三、大连商品交易所场外市场服务实体经济

2022 年，大商所持续推动“一圈两中心”建设和场内外互联互通。一方面，大商所携手各方深化大宗商品生态圈建设，扎实推进各类基础设施优化完善，夯实场外业务发展基础；另一方面，以《期货和衍生品法》出台为契机，启动大宗商品仓单登记中心建设，落地多层次仓库体系，研发储备新工具新机制，积极谋划具有大

商所特色的场外市场发展之路，建设综合平台业务。

1. 成交规模超 690 亿元，期现结合业务规模突破 1 600 万吨，场外市场服务能力有效提升

2022 年新增产业交易商 111 家，累计达到 303 家，开户企业数量近千家。全年场外业务成交额超过 690 亿元，同比增长 13%；期现结合业务成交 1 600 余万吨，实现同比翻一番；参与主体数量同比增长 56%，覆盖广、参与众、氛围浓的场外市场逐渐形成。其中，基差交易业务成交额 274 亿元，同比增长 88%，成交量 829 万吨，同比增长 91%，更多市场主体及现货交易使用期货定价。平台首次实现了进口非转基因大豆依据国内期货定价，对进一步推广和普及非转基因大豆基差交易，提升我国期货市场价格影响力具有重要意义。

标准仓单业务成交额 192 亿元，同比增长 4%，成交量 442 万吨，同比增长 34%，维持在较为稳定的水平，部分品种交易活跃，形成了较为连续的价格曲线，为市场定价及场内升贴水设置提供了一定参考。

与北铁中心合作深化，铁矿石非标仓单业务成交 32 亿元，同比增长 15 倍，成交量 373 万吨，同比增长 25 倍，进一步贴合现货企业实际需求，交易规模增长明显。

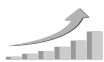
为银行开展融资提供支持服务，5 家银行落地融资 1.57 亿元，为企业融资开辟新途径，并积极构建以龙头产业为核心、由现货平台和银行机构等多方赋能的良好生态。

2. 上线一体化数字化大宗商品仓单登记中心，促进全国统一大市场建设

12 月，一体化数字化大宗商品仓单登记中心上线，聚合联通所内外信息系统，助力深化期货市场功能发挥，促进仓单交易和融资提质、降本、增效，推动大宗商品行业数字化转型。仓单登记中心与仓库数字化平台连通，与中国人民银行动产融资登记公示系统实现对接，计划引入政府信用数据，提供仓单登记及精细化查询，可为交易融资提供一体化支撑。已有 630 余家仓库、900 余家产业链企业可以登录使用。截至 2022 年底，仓单登记中心的标准仓单和非标仓单合计 280 万吨，涉及玉米、铁矿石等 16 个品种。依托大宗商品仓单登记中心开展 4 笔仓单质押融资业务，为实体企业发放贷款 388 万元，相关质权自动向中国人民银行动产融资统一登记公示系统进行了登记。商业银行通过使用仓单登记中心查询和综合服务平台交易功能，开展了 2 笔仓单买断式回购，合计 5 600 余万元。

3. 交易专区重磅落地，下沉产业、扎根需求，推动产业龙头企业与场外市场融合发展

8 月和 11 月，太钢、九三交易专区分别实现业务上线，恒力石化交易专区正在推进建设。交易专区旨在贴合现货实际，深度根植于企业日常经营管理诉求，致力于将真实贸易场景线上化，通过龙头企业的示范效应，推动产业链参与，同时服务构建“现货贸易、期货定价、风险管理”一体化的场外综合服务平台。专区业务自



上线以来至 2022 年底，累计交易现货超过 1 万吨，金额 1 200 余万元。加强交易结算实际、上线协商互动功能，全面提升产业参与便利性。

四、中国期货市场监控中心交易报告库建设情况

（一）持续加强交易报告库系统建设

2022 年 9 月，中国期货市场监控中心（以下简称“中国期货监控”）交易报告新版场外衍生品数据报送系统正式上线，在收集成交、持仓、资金明细等结构化数据基础上，新增收取主协议、补充协议、交易确认书等非结构数据。建立多重数据校验机制，持续提升交易报告库数据质量。

（二）国际编码标准中国化工作取得新进展

一是中国期货监控牵头起草的唯一交易标识（Unique Transaction Identifier, UTI）行业标准，已经全国金融标准化技术委员会审查通过，现已进入正式报批程序。二是中国期货监控加入我国 UTI 国家标准起草工作组，参与 UTI 国家标准的研讨与起草工作。三是全球法人识别编码（Legal Entity Identifier, LEI）体系监管委员会组建了国际衍生品数据要素行业专家组（DDE IRG），中国期货监控 2 名员工成功入选。

（三）风险管理公司场外衍生品业务服务实体经济数据统计

风险管理公司场外衍生品业务服务实体企业家数、次数、金额等同比显著提升。2022 年，风险管理公司累计服务实体企业 2 709 家，同比增加 931 家，增幅为 52.4%；累计新增 14.3 万笔交易，同比增加 2.7 万笔，增幅为 23.3%；累计新增 9 189.0 亿元名义金额，同比增加 1 935.4 亿元，增幅为 26.7%。风险管理公司场外衍生品业务服务实体经济以中小微企业为主，2022 年服务中小微企业 2 679 家，占服务实体经济总家数的 98.9%。

五、期货风险管理公司场外衍生品业务服务实体经济情况

场外衍生品业务是期货风险管理公司主营业务之一，是期货公司个性化、精准化服务实体经济风险管理需求的重要渠道和有力抓手。近年来，期货公司场外衍生品业务规模稳步增长，盈利水平显著提升。截至 2022 年底，共有 73 家期货风险管理公司备案了场外衍生品业务。2022 年，场外衍生品新增名义金额 20 470.37 亿元，同比增加 25.41%；年末存续名义金额 3 198.26 亿元。

2022 年，从标的类型看，风险管理公司场外衍生品业务商品类累计新增名义本金为 15 838.28 亿元，占比为 77.37%；权益类累计新增名义本金为 4 319.11 亿元，

占比为 21.1%。2022 年商品类持仓规模占比有所下降，权益类场外衍生品持仓规模增长迅速，2022 年末持仓名义金额 1 550.51 亿元，占比为 48.48%，上涨 4 个百分点。

从客户结构看，风险管理公司始终坚持以商品类场外为主业，深耕实体产业。2022 年共服务产业客户 3 153 家，其中 85% 为中小微企业。中小微企业场外衍生品业务全年累计新增名义金额 6 711.46 亿元，占比 42%；年末存续名义金额 728.39 亿元，占比 46%。上市公司场外衍生品全年累计新增名义金额 2 225.88 亿元，占比 14%；年末存续名义金额 244.03 亿元，占比 16%。

>>> 第五节 期货市场服务乡村振兴战略情况

一、上海期货交易所服务乡村振兴战略

（一）2022 年“保险 + 期货”情况

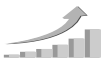
1. 项目运行情况

2022 年 2 月 22 日，中央一号文件提出优化完善“保险 + 期货”模式。为贯彻落实中央一号文件精神，积极响应党中央、国务院及中国证监会号召，发挥期货市场服务实体经济功能，助力农业风险管理，于 2022 年继续开展天然橡胶“保险 + 期货”试点，积极落实资本市场服务乡村振兴战略，巩固拓展脱贫攻坚成果同乡村振兴战略有效衔接。2022 年上期所天然橡胶“保险 + 期货”获批项目共 75 个，参与期货公司共 50 家，共覆盖云南省、海南省 21 个县市，挂钩天然橡胶现货产量约 17.25 万吨，总体可受益胶农约 17 万户次，理赔总额约为 1.2 亿元，平均赔付率达 90%。其中，在云南地区开展试点项目共 33 个，覆盖天然橡胶现货产量 8.25 万吨，赔付金额共计 6 011 万元；在海南地区开展试点项目共 42 个，覆盖天然橡胶现货产量约 9 万吨，赔付金额共计 6 411 万元。

2. 工作成效

一是助力乡村振兴战略，完成重点支持 160 个国家乡村振兴重点帮扶县中云南澜沧县、金平县和绿春县；二是覆盖区域不断扩大，“保险 + 期货”试点项目全覆盖支持地区数量达到历年之最，共计 11 县 1 村；三是保障效果历年最好，“保险 + 期货”试点项目平均赔付率为历年最高，项目效果和影响力不断显现。

此外，近年来通过上期所不断加强宣导工作，广大农户对“保险 + 期货”模式在农业生产经营风险管理中发挥作用的认知不断加深，也提升了农户对保险产品规避风险功能的认识。2022 年，西盟县参保胶农自缴、景谷县合作社出资共计近 110



万元保费购买橡胶价格保险。同时，华联期货、国元期货以及倍特期货三家期货公司自筹资金124万元参与天然橡胶“保险+期货”试点项目，纳入上期所统一管理，平均赔付率达到90%。

（二）场外期权服务乡村振兴

为进一步探索期货市场多模式助力脱贫攻坚，扩大受益胶农覆盖面，切实帮助广大贫困胶农早日脱贫，2019年，上期所积极探索天然橡胶价格保险业务创新模式，试点天然橡胶场外期权产业扶贫项目。该模式旨在帮助橡胶企业筑建产业扶持平台，保障天然橡胶原料货源，稳定天然橡胶产业的生产第一线队伍，切实帮助广大贫困胶农稳定收入。2022年，上期所正式确立“期权稳产行动”品牌。

2022年，天然橡胶“期权稳产行动”获批项目共17个，合作胶企共3家，参与期货公司共9家，累计投入支持资金约3100万元，与海南橡胶、云胶集团和广垦橡胶分别开展7个、6个、4个项目，共覆盖橡胶现货产量约4.3万吨。其中，海南橡胶扶持试点挂钩天然橡胶产量1.67万吨，云胶集团扶持试点挂钩天然橡胶产量1.53万吨，广垦橡胶扶持试点挂钩天然橡胶产量1.11万吨。

“期权稳产行动”项目累计产生期权行权收益近2890万元，平均收益率约93%。其中，海南橡胶项目产生期权行权收益约1020万元，平均收益率约85%；云胶集团项目产生期权行权收益约1057万元，平均收益率近96%；广垦橡胶项目产生期权行权收益约812万元，平均收益率近102%。

在“期权稳产行动”项目运行模式中，项目参与主体在节省保险运营费用的同时，通过发挥场外期权的灵活性进一步提高对胶农收入的保障水平。海南橡胶、云胶集团和广垦橡胶将场外期权产生的正收益通过“二次结算”等方式补贴给割胶农户，一方面直接保障了割胶农户的收益，促进其割胶、售胶的积极性，另一方面保障了胶企有稳定的橡胶原材料来源，从而发挥龙头企业产业的带动和辐射作用，促进当地橡胶产业发展。

二、郑州商品交易所服务乡村振兴战略

（一）2022年“保险+期货”情况

2022年，郑商所共支持开展“保险+期货”项目21个，涉及棉花、白糖、苹果、红枣、花生5个品种，覆盖陕西、甘肃、云南、广西、山东、河南、辽宁、新疆8省区。其中，陕西、甘肃、云南、新疆4省区由郑商所主导建设，侧重于继续探索优化业务模式；辽宁、山东、河南、广西4省区采取与省级政府部门联合建设的形式，侧重于推动形成财政资金常态化支持机制。此外，还有湖北、山东等地方政府自行主导开展棉花“保险+期货”项目，甘肃自行主导开展苹果“保险+期货”项目。交易所主导先行先试、联合政府边试边推、地方政府自觉开展的建设格

局已初具规模。

郑商所支持开展的21个项目保费总计2.76亿元，分别承保棉花3.03万吨、白糖33.09万吨、苹果19.44万吨、红枣3.77万吨、花生16.61万吨，为约16.28万农户（约2.11万已脱贫帮扶户）及61个新型农业经营主体（合作社、家庭农场等）提供风险保障金额58.72亿元。资金方面，郑商所为21个项目提供保费支持资金近1.2亿元，占项目总保费的42.51%，农户自缴费用占约15.37%，财政及社会资金约占42.12%。总体赔付1.73亿元，总赔付率为62.71%。

2022年，郑商所“保险+期货”试点项目优化成效明显，引领示范作用更加突出。郑商所通过“保险+期货”模式服务红枣、苹果、棉花、白糖、花生等农业特色品种的“农险无忧”品牌路线已初步形成，与服务国家化肥商业储备的“商储无忧”品牌一起，形成了郑商所助力农业发展、服务乡村振兴的名片。

（二）2022年工作成效

1. 改进价格险模式，贴近农业保险的一般做法

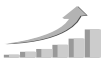
2022年，郑商所以推动“保险+期货”模式中保险与期货功能的深度融合为目标，探索优化价格险业务模式。引导试点项目在保障程度上倾向浅虚值，保障农户基本合理收益的同时有效控制费率成本，产品结构上针对中小农户需求简化设计，更加简明易懂。风险管理方面，尝试通过组合使用风险自留、购买期权方式，探索更加有效的风险转移路径，推动提升保险公司在项目运作中的主动性。

2. 探索收入险模式，推动风险管理服务迭代升级

郑商所根据政策导向、品种特性、试点区域政府积极性等因素，在2022年试点中稳步探索增加收入险项目。一是继续开展苹果收入险项目，为林果作物收入险积累先行经验。郑商所于2021年首次在陕西黄陵探索开展苹果收入险项目，尝试在林果作物上以损失率作为间接核定产量损失的依据。在取得初步经验的基础上，2022年郑商所继续在黄陵稳步探索巩固苹果收入险项目。二是积极开展花生收入险项目，为保障油料安全提供创新贡献。为积极响应中央关于油料产能提升及供给保障安全的政策精神，2022年郑商所在河南花生价格险项目基础上，在山东、辽宁两个花生主产区进一步探索收入险模式，为花生种植户提供更加全面的风险管理服务。三是在广西开展糖料蔗订单收入保险项目，配合糖料蔗价格形成机制改革。自2019年起广西取消糖料蔗收购政府指导价，以订单农业为核心推进糖料蔗价格形成机制改革。为落实中央一号文件关于“探索糖料蔗收入保险”的政策精神，郑商所在广西探索开展了糖料蔗订单收入保险，结合糖料蔗订单收购的产业特征，探索在订单价格基础上，根据糖料蔗收获期白糖期货市场行情，给予蔗农更高价格水平的收入保险保障。

3. 深化与地方政府联合共建

2022年郑商所在项目实施过程中，重点强调深化与地方政府联合共建。一是与河南、山东、广西、辽宁等省级政府部门联合发文部署试点建设，对接引入政



府资金、强化项目组织保障，合力助推试点扩围。二是推动期货价格作为特色农产品价格指数保险价格因子的做法的实施，提高保险采价的合理性和科学性。如2022年新疆兵团、湖北等地开展的棉花价格保险试点，均以棉花期货价格作为保险结算价（部分）计算依据，期货价格在新型农业保险中的应用日益增多，其权威性、代表性得到越来越多的地方政府、产业主体的认可。

4. 兼顾脱贫户和新型农业经营主体

近年来，家庭农场、合作社等新型农业经营主体数量增长较快。在此背景下，郑商所自2020年开始设置专项项目支持新型农业主体，并在政府联合开展项目中明确优先扶持合作社、家庭农场，增强其现代意识、市场意识、风险意识，帮助其赢得更大的生存与发展空间，在项目服务对象上兼顾脱贫户和新型农业经营主体。如2022年郑商所与河南省财政厅联合开展的花生项目，除脱贫户外，参保对象均为种植面积在10亩以上的规模户；与山东省农业农村厅联合开展的苹果项目中，参保对象基本上是家庭农场、合作社。“保险+期货”项目的实施，在新型农业经营主体中普及了期货的风险管理功能，有力助推了试点县域在新型农业经营主体中培育现代经营理念的工作。

（三）场外期权服务乡村振兴

郑商所在2022年度“保险+期货”项目建设过程中，利用综合业务平台为“保险+期货”项目提供场外期权交易合同线上备案、资金划转、了结等服务。通过搭建金融基础设施和技术赋能，为“保险+期货”项目提供有力技术支撑，有效提升了参与者风险再对冲环节的合同签订和资金划转效率。2022年，综合业务平台场外期权备案名义本金62.11亿元。

三、大连商品交易所服务乡村振兴战略

为贯彻中央一号文件精神，巩固和拓展脱贫攻坚成果，全面落实乡村振兴战略，落实国务院及中国证监会有关工作部署，引导期货市场更好地服务“三农”，助力相关农产品保供稳价，在中国证监会的正确领导下，2022年大商所继续开展了“大商所农民收入保障计划”（以下简称“大商所农保计划”）。

（一）2022年“保险+期货”的基本情况

2022年，“大商所农保计划”持续实践、不断探索、多措并举，将期货市场功能发挥和农业风险管理相融合，促进农民增收、稳定农业生产，特别是在支持大豆扩种、生猪“保供稳价”、地区乡村振兴等方面发挥了积极作用。以“重点集中，广泛布局”，通过四大板块全年完整运行362个项目，其中，大豆振兴项目11个、生猪专项项目19个、养殖分散项目309个，在新疆、西藏和大连落地的地区专项项目23个，项目个数为历年最多，同比增长51%，所有项目为535个合作社和15.64

万农户的205.76万吨生猪、大豆等作物提供风险保障，总保费7.16亿元，理赔3.52亿元，理赔率49%，预计大商所支持金额约2.68亿元。在农业种养风险管理、激发政府管理效能及助力农业保险高质量发展等方面取得了卓越成效。

（二）工作成效

一是紧盯政策导向，精准布局项目板块，自筹比例创历史新高，大商所资金撬动作用凸显。2022年“大商所农保计划”继续通过种植类和养殖类项目服务乡村产业发展，在助力大豆扩种和保护生猪基础产能方面发挥市场机制作用，以“一个额度分档、两个品种聚焦、三个地区专项”为思路开展项目。其一，专设大豆振兴项目，重点服务国家大豆扩种计划；其二，专设“生猪专项”项目，重点服务生猪“保供稳价”；其三，专设分散项目，支持项目常态化开展，引导机构聚焦项目覆盖面和帮扶效果；其四，专设新疆、西藏和大连地区专项项目，更好地服务区域经济发展。2022年“大商所农保计划”预算3.04亿元，预计实际支持2.68亿元，占总保费的37.46%，全年开展362个项目，总保费7.16亿元，自筹比例达62.54%，为历年最高，体现了地方政府、农户等主体对“保险+期货”的充分认可。所有项目共计实现理赔3.52亿元，在生猪、大豆价格持续上涨的情况下，实现阶段性有效保障服务主体收益，大商所补贴效率高达131%。

二是大豆振兴，夯实豆农扩种信心，保障大豆种植收益。2022年“大商所农保计划”通过“保险+期货”收入保险模式专设大豆振兴项目，在7个大豆主产区联合地方政府作为项目管理方成功落地了11个大豆收入保险项目，覆盖种植面积161万亩。在投保端稳定豆农种植预期，根据各地亩产水平，给予农户亩均收入756元，较2021年提高15%，且以更低的费率（8.35%）为农户扩种大豆、相应大豆振兴计划提供“定心丸”。同时，撬动5200余万元各级财政资金的支持，参保农户自缴2079万元（仅相当于总保费的约20%），农户自缴比例贴近政策性农险水平。在理赔端保障豆农种植收益。2022年个别项目地区地块受到水灾影响，导致减产严重，在“保险+期货”的保护下，当地参保农户依然能够获得较为稳定的种植收益，最终11个大豆振兴项目合计赔付额达到近3000万元。以农户角度测算，相当于获得144%的投保收益。在政策端给予豆农投保补贴，2022年大豆振兴项目的自筹比例为历年最高，主要源自财政资金的介入，自筹比例71.86%，其中，约51%为财政补贴，同时，一些非传统主产区的地方政府也对“保险+期货”项目的开展给予了政策性支持。

三是生猪专项，市场机构积极参与，地方政府高度重视，保障效果良好。为配合生猪“保供稳价”并保护好养殖户收益，2022年“大商所农保计划”聚焦保费自筹比例高、政府高度重视的生猪类价格险项目给予专项支持。具体表现为：其一，市场机构积极参与。自项目通知发布之日起，大商所收到来自22个省区的86个生猪专项项目申请。最终共预立项19个项目（13个价格险、6个养殖利润险），涉及

广东、广西、河南、湖南、辽宁、吉林、山东、陕西8省区，由10家期货公司牵头申请，23家公司参与申请，6家保险公司承保。其二，地方政府高度重视。19个立项项目中，总保费3.27亿元，共计引导各级财政1.38亿元给予保费补贴，占总保费的42.13%。其三，保障效果良好。19个生猪项目累计实现赔付1.76亿元，投保生猪370万头，头均赔付47元，平均农户每头猪投入保费18元，相当于帮助农户每头猪增收29元。部分项目精准选择入场出单时机，实现较高理赔率。例如，建信期货在7月11日完成的保单，实际理赔237万元，理赔率为108%；银河期货10月17日完成的辽宁省丹东市生猪价格保单，实际理赔487.1万元，理赔率为162.37%。

四是养殖分散，持续助推会员拓展业务，全国范围多点开花，通过差异化支持巩固脱贫攻坚成果。全年共64家期货公司以牵头和参与公司的身份落地309个养殖类分散项目，覆盖全国25个省区，项目数量较2021年增加126个，增幅69%。其一，生猪项目占绝大多数。309个项目中，生猪项目（含生猪收益、生猪利润）216个，占比70%。其他如饲料项目78个，占比25%；鸡蛋项目（含蛋鸡收益）13个，占比4%；指数项目（大商所猪饲料成本指数）2个，占比0.6%。其二，保障和理赔效果良好，各方投保、补贴效率较高。309个项目中，有271个项目发生理赔，合计发生理赔1.37亿元。其中，理赔率超过100%的有68个项目，占总数的22%，理赔率超过200%的有3个，理赔率最高达217.82%；理赔额超过农户自缴额度的有178个项目，占总数的57.61%；理赔额超过财政补贴的有192个，占总数的62.14%；理赔额超过大商所补贴的有152个，占总数的49.19%。其三，引导项目落地西部12省区及原挂牌督战贫困县，做好脱贫攻坚成果与乡村振兴战略的衔接工作。养殖分散项目通过差异化保费补贴比例引导110个项目落地西部12省区，有18个项目落地原挂牌督战贫困县，有129个项目落地原国家级贫困县，为超2万农户实现4463.36万元理赔额。

五是地区专项，有效服务区域发展，持续助力乡村振兴。全年共14家期货公司落地23个地区专项项目，其中，大连专项项目2个、新疆专项项目14个、西藏专项项目7个。特别是新疆和西藏作为西部边疆地区，畜牧养殖收益是当地居民尤其少数民族居民的主要收入来源。在2022年饲料价格趋涨、生猪价格波动剧烈、养殖利润压缩、养殖户面临前端饲料成本上涨和后端销售价格下跌的双重风险的情况下，地区专项强化了新疆和西藏地区脱贫攻坚成果与全面推进乡村振兴之间的有效衔接，使欠发达地区与发达地区同享发展成果，加速推进农业农村现代化，保障农户收入，稳住农业基本盘，为区域发展提供了内生动力。

四、中国期货业协会服务乡村振兴战略

拓展“保险+期货”模式，服务“稳产保供”和乡村振兴。一是发布《期货行业全面推进乡村振兴助力实现共同富裕倡议书》，修订乡村振兴、“保险+期货”业

务评价方案，完成年度业务评价工作。强化“保险+期货”业务指标导向性，统一规范业务数据线上采集渠道，建立业务数据审核机制。完成首份“保险+期货”业务运行情况报告，并得到中国证监会领导批示。二是牵头行业机构在新疆巴楚、陕西延长、甘肃礼县、黑龙江宁安等地开展期货专业帮扶示范项目。在广东、四川、湖南、湖北四省主产区开展服务生猪产业专项工作。在各项目中探索开展“保险+期货+订单”“保险+期货+合作社+农户”等服务模式，利用期货市场为农企订单收购提供风险管理、指导农户开展点价，引入卫星遥感技术辅助期货定价，将生产、收购、销售环节与期货市场紧密结合，进一步提升了服务农业产业链的长度和深度。联合9家期货公司设立初始规模900万元的“新疆棉花期货公益专项基金”。三是面向行业举办8期“期货服务乡村振兴”系列直播培训，开展针对新型农业经营主体的农产品“保险+期货”线上公益讲座。关于期货服务新型农业经营主体的有关情况被新华社旗下新华财经专题报道。目前，127家期货经营机构与519个脱贫县（乡、村）签署了1029份结对帮扶协议。行业累计投入帮扶资金达14.63亿元。通过“保险+期货”模式承保货值约547.60亿元；为农企农户提供合作套保、点价、场外期权等风险管理服务方案名义本金约39.99亿元。

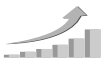
》》 第六节 期货市场服务中小微企业

一、上海期货交易所服务中小微企业

近年来，大宗商品价格波动剧烈，给中小微企业正常生产经营带来了较大挑战。《国务院办公厅关于进一步加大对中小企业纾困帮扶力度的通知》以及中国证监会发布的《关于进一步发挥资本市场功能，支持受疫情影响严重地区和行业加快恢复发展的通知》都提到要发挥期货功能应对大宗商品价格波动风险。2022年，上期所积极响应政策号召，持续推出多项支持政策，服务民营和中小微企业经营稳定。

（一）“期货稳价订单”项目助力企业稳定经营

2022年，受疫情影响，行情波动加大，企业避险需求急剧增加，“期货稳价订单”项目业务影响力持续扩大。参与企业借助衍生品工具有效对冲了螺纹钢、热轧卷板、石油沥青等价格波动的风险，对企业的稳健经营起到了积极的作用。项目启动以来共保障热轧卷板、螺纹钢现货16.1万吨，保障石油沥青现货2.79万吨，项目赔付2575.76万元，共19家企业参与了试点项目，其中，钢厂5家，中小型钢铁加工企业9家，能化企业5家。其中，与浙江国际油气交易中心的合作模式将“期货稳价”与浙油中心的产能预售创新模式相结合，鼓励引导相关企业利用衍生



品工具管理价格波动风险，有效帮助企业拓宽销售渠道，降低风险管理成本。

（二）开展期权“走进企业、服务实体”活动

上期所积极开展期权“走进企业、服务实体”试点实践活动，支持产业企业利用场内期权产品进行风险管理，通过鼓励企业积极运用场内期权工具，降低企业套保成本，为企业持续健康运营保驾护航。2022年，共有120个项目入围该活动，对应127家实体企业参与，较2021年的支持项目数量65个，增长幅度85%。其中，上市公司项目17个、中小微企业项目39个、专精特新企业项目3个、中西部地区项目15个及生产消费企业项目38个。

（三）强化市场培育，加强对中小微企业的服务力度

以重要产业链为突破，以产业培训基地为依托，开展有针对性的企业培训活动。与中国钢铁工业协会、中国船舶工业协会联合举办“船企—钢企合作协调对接会”“海上新能源装备发展论坛”引导船舶行业运用钢材期货管理价格风险。

二、郑州商品交易所服务中小微企业

我国中小微企业绝大部分为民营企业，且多处于产业链中下游。受人才缺乏、资金不足等因素影响，中小微企业的风险管理意识不强，抵御风险的能力较弱，通过期货和衍生品对冲风险的需求旺盛。2022年，受国内外多重因素影响，大宗商品价格波动加剧，中小企业面临的生产经营困难增多。郑商所积极发挥期货市场功能，持续推出多项支持政策，帮扶中小微企业纾困解难。

（一）开展期货服务中小企业主题活动

郑商所与中国中小企业协会、中国期货业协会建立合作机制，联合举办“保供稳价背景下期货服务中小企业”主题活动共8期81场，支持风险管理公司、产业基地企业等发挥优势，帮助中小企业积极利用场外期权、基差贸易、仓单交易等模式参与期货市场。活动通过期货公司、期现机构、龙头企业、行业协会等组织，在10余家网络平台同步直播，持续扩大活动受众面。活动在《中国改革报》《期货日报》等重要媒体展开系列宣传，影响力和知名度不断提升。

（二）产业专项中专设“中小型企业”项目

郑商所在产业服务专项支持计划中专门设立“中小型企业”项目类型，支持会员引导中小企业直接参与期货市场，帮助纺织、化工、冶金、果品、油脂油料等重要产业链的中下游中小企业更好地管理生产经营风险。1700余家中小企业完成项目备案，积极通过套期保值方式管理风险。

（三）发挥龙头企业“大手牵小手”带动作用

2022年，郑商所努力发挥产业基地龙头示范效应，支持开展产业链中小企业培育活动171场，引导中小企业正确认识和利用期货市场。同时，积极总结、认真宣传“产业基地”利用期货市场案例，为中小企业风险管理提供重要参考。

（四）找准新常态下企业痛点难点，为风险管理提供更多新思路新模式

多维度强化与行业协会的交流合作，产融协同引导企业参与。强化期现结合研究支撑，围绕“期货服务实体经济”主题与行业协会、产业基地开展8项课题合作，总结企业参与期货市场的路径模式，探索为中小微企业纾困解难。巩固对外发声平台，持续在协会网站开办期货专栏，向《中国煤炭工业年鉴》《中国钢铁工业年鉴》提供动力煤、铁合金相关资料，期货知识和品种功能的宣传持续增强。引导企业科学运用期货期权，联合协会合办纯碱、铁合金线上培训20期，产业培育的覆盖面和成效不断扩大。

（五）举办河南省中小企业期货业务培训班

为落实河南省政府优势再造政策，服务郑州市“期货+”战略，郑商所联合河南省金融局、河南证监局举办“河南中小企业期货业务培训班”10期，聚焦尿素、甲醇、花生、纯碱等河南特色优势品种，帮助煤化工、盐化工、农产品等产业链中小微企业更好地管理生产经营风险，助力中原地区广大中小微企业稳健经营。

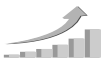
（六）举办“间接参与期货市场”专场主题活动

针对中小微企业参与期货市场难点痛点，郑商所坚持问题导向，精准施策，持续举办“企业间接参与期货市场”专场主题活动20场，发挥期货公司、风险管理公司优势，引导中小企业以基差贸易、仓单服务、场外衍生品等间接方式参与期货市场。

三、大连商品交易所服务中小微企业

（一）积极面向龙头企业开展定制化服务

一方面，大商所党委班子成员牵头，聚焦重点企业精准开展“一对一”服务，针对农产品、化工、黑色三大板块28家龙头企业对期货市场认识不深等问题，建立班子成员包干制，每人4至5家，主动上门提供定制化服务，其中包括四川高金食品、通威集团以及山西凯嘉集团等11家大型民营企业。另一方面，持续开展龙头企业“一对一”交流活动，2022年年初通过征集会员单位产业客户服务计划，遴选337家龙头企业作为“一对一”重点拓展对象，定期与企业开展座谈交流，并持续



跟进企业参与市场的情况，协助期货公司及时解决企业面临的问题等。其中，337家龙头企业中的70%为大型民营企业，如桂林力源粮油、禾丰牧业、恒力石化、鲁泰化学以及大北农等。

（二）发挥产融基地作用，助力中小微企业纾困发展

2017年，大商所开始设立产融培育基地。多年来，产融培育基地通过“大手拉小手”“期现手拉手”，厚植了期货土壤，在强化中小微企业风险管理意识、丰富风险管理手段、提升风险管理能力方面发挥了重要作用。2022年大商所多措并举，进一步发挥产融基地服务中小微企业的作用。

一是招募新一批产融基地。2022年，启动新一轮产融基地招募工作，共102家单位递交了申请材料，经过初审、复审，40家单位获批产融基地。目前，大商所产融基地数量累计达107家，包括龙头企业、行业协会、现货平台、信息机构、金融机构等多类型市场主体，遍布22个省区市，覆盖全部已上市期货品种。

二是强化基地日常管理。2022年，为进一步发挥产融基地“传帮带”作用，加强了对产融基地的日常管理。具体如下：（1）组织召开了产融基地座谈会，听取基地单位介绍了服务产业链企业的成功经验、面临的问题，以及关于基地建设和交易所发展的意见建议。（2）组织基地单位制订了年度活动计划，提升了活动的预期性和计划性。（3）强化对产融基地品牌的塑造，要求所有基地活动均需冠名“DCE·产业行——走进产融培育基地”。（4）组织基地单位提交了半年和年度活动总结，梳理了活动开展情况、工作亮点、难点障碍等，强化了基地管理的规范性。（5）启动优秀产融培育基地评选工作，进一步调动了基地单位开展活动的积极性。

三是组织基地开展市场活动。2022年，大商所对产融基地设置了活动数量硬性指标，产融基地每年组织活动数量不少于1次，产业类基地的活动覆盖产业企业数量全年累计不少于50家。全年，产融基地共开展活动120场，同比增长532%；覆盖企业9000余家次，培训人员2.8万余人，较2021年均有翻倍增长。

（三）利用“企业风险管理计划”搭建产业客户实践平台，服务中小微企业

2022年，大商所“企业风险管理计划”进一步扩容升级，一方面重点引导产业企业尝试利用衍生工具管理风险，支持企业迈出参与期货市场的第一步，新增期货项目。另一方面，为积极贯彻落实党中央、国务院的决策部署和中国证监会支持创新型发展的有关要求，推出“专精特新”专项项目，面向“创新型中小企业”“专精特新中小企业”“专精特新小巨人企业”等特设“专精特新”专项项目。

2022年全年，大商所“企业风险管理计划”共支持开展343个项目，服务304家企业。其中，“企业风险管理计划”项目服务中小微企业成效显著，304家企业中有234家为中小微企业，占参与企业总数的77%。新增期货项目助力中小微企业直接进场参与，迈出利用期货工具进行风险管理的第一步，首次参与的中小微企业

226家，占比达到97%，首次开立期货账户的中小微企业147家，占比63%；在“专精特新”专项项目中，全部中小微企业参与的项目共计实现期现结合损益约1.5亿元，交易所支持资金4600余万元，表明项目在帮扶中小微企业稳健运营方面发挥一定作用。

四、广州期货交易所服务中小微企业

2022年12月22日，广期所首个品种——工业硅期货和期权上市，市场运行平稳，市场功能逐步发挥。围绕工业硅产业以中小民营企业为主的特点，广期所突出中小企业导向，始终坚持服务产业企业理念，助力实体经济高质量发展。

（一）结合中小企业特点，加强对中小微企业的服务力度

广期所工业硅品种研发上市期间，对各类型企业，特别是工业硅产业链相关中小民营企业加强了走访调研，了解企业经营风险特点，并在合约设计中充分考虑了中小微企业的需求。工业硅期货上市前后，组织期货公司分析师、风险管理公司、期现公司等开展云南、四川、华东等工业硅产业集中地区的企业调研，了解行业现状、中小民营企业经营特点和痛点，为有针对性地开展企业服务打好基础。

（二）支持会员单位线上线下开展中小产业企业培育

截至2022年年底，持续支持会员单位开展线上、线下培训活动175场，参与人数超过4.5万人次，通过讲解合约规则设计、产业参与期货市场模式等内容，提高产业企业对期货工具的理解和认识。

五、中国期货业协会服务中小微企业

中期协积极引导期货公司以服务实体经济为发展着力点，提升服务效能。

（一）积极发挥风险管理功能服务企业发展

2022年全年，风险管理公司与实体产业客户开展基差贸易的累计贸易额4827.55亿元，其中为中小微企业提供服务累计贸易额2235.29亿元，占比46%。累计服务中小微企业28011家次，占比66%。通过仓单约定购回等形式，为实体企业提供资金支持，有效满足了中小微企业的融资需求。2022年仓单服务累计购销规模327.89亿元，其中为中小微企业提供仓单服务规模227.82亿元，占比70%；累计提供资金支持162.86亿元，其中为中小微企业提供资金112.14亿元，占比69%。共计服务中小微企业1063家次，占比73%。在基差贸易服务基础上，风险管理公司逐步探索现货贸易和场外衍生品工具相结合的含权贸易模式，全年累计贸易额45.60亿元，其中为中小微企业提供服务累计贸易额23.57亿元，占比52%。累计

服务中小微企业 434 家次，占比 62%。

（二）促进行业深化产业链、供应链风险管理

与多家现货行业协会签署战略合作协议，共同举办系列主题活动 50 余场次。广泛面向实体企业宣讲期货功能，扎实推动企业运用期货工具开展套期保值，管理产业供应链风险。完成期货市场重点课题“企业参与商品期货市场最佳实践”，选编 31 个优秀案例。首次开展期货风险管理业务服务中小微企业成效专项评价，连续 5 年开展期货经营机构服务实体经济优秀案例征集与评审。2022 年聚焦服务中小企业的 29 个案例入围中期协“服务实体经济优秀案例库”。

第四章

2022年中国期货市场监督 及自律情况

>>> 第一节 期货市场概况

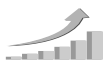
2022年，中国证监会坚决贯彻落实党中央、国务院的决策部署，坚持稳字当头、稳中求进，在期货监管工作中统筹协调，充分发挥期货市场“五位一体”监管合力，综合施策、分类指导，依法严格监管，有效地服务大宗商品保供稳价，保障了期货市场平稳有序运行。

一、完善期货市场规则体系，夯实市场发展制度基石

2022年，《期货和衍生品法》颁布实施，配套法规“立、改、废”工作接续推进，期货市场规则体系不断完善。集中全行业力量推动《期货和衍生品法》颁布实施。推进配套法规“立、改、废”工作，废止、修订14件法规制度。实施期货期权品种注册管理制度，重点推进《期货交易所管理办法》《期货公司监督管理办法》的修订工作。积极推动《期货市场持仓管理暂行规定》《期货从业人员管理办法》的制定修订，不断增加期货市场法治供给。

二、加强预研预判和监控监测，维护期货市场平稳运行

2022年以来，受新冠疫情反复、地缘政治冲突、全球气候变化等多种不确定因



素叠加影响，大宗商品价格波动加剧，中国证监会及时加强预研预判和市场监管监控，指导各期货交易所及时采取风控措施，坚决抑制过度投机，取得明显效果，有力维护了期货市场平稳运行。同时，强化期货市场日常监管，及时有效应对市场风险，对大宗商品价格走势和风险点进行研判，统筹各期货交易所及时采取风控措施。坚持查处违法违规行为零容忍，全年各期货交易所共处理异常交易行为1 969次，发现违规线索203条，自律处罚88起。移送线索3起，立案1起，对1起涉及铝等期货品种的虚假申报案件没收违规所得1 030万元，为期货市场自律处罚最高记录。加强期货公司风险监管指标日常监测，完成期货公司监管综合系统（FISS）的重构工作，进一步丰富风险监测指标体系，促进监管效能提升。加强科技监管，持续推进期货监管系统建设，提升智能化监管能力。

三、积极防控市场风险，抓紧风险处置工作

2022年，期货市场监控中心共向15家派出机构发送预警信息43份，涉及42家期货公司。同时，中国证监会进一步强化期货公司风险防控，指导派出机构全面摸排行业机构风险，建立重点公司监测监控及信息共享机制，切实防范风险。按期完成不合规资管产品的整改，截至2022年末，整改规模较新规实施时下降98.6%，未完成整改的1家期货公司纳入个案处理。稳妥处置个案风险，有序推进个案风险处置工作，督促相关期货公司进一步提升资本实力和治理水平。

》》 第二节 期货市场监测监控情况

2022年，在中国证监会党委的领导下，中国期货监控以习近平新时代中国特色社会主义思想为指导，深入学习贯彻党的十九大、十九届历次全会和二十大精神，认真落实党中央、国务院和中国证监会党委各项重大决策部署，高效统筹巡视整改和疫情防控工作，积极服务实体保供稳价，有效发挥辅助监管职能，为推动期货市场高质量发展作出了积极贡献。

监管履职方面，一是持续做好保证金监控工作，服务期货市场创新发展，配合结算风险隔离、客户移仓、组合保证金等业务做好资金监控准备。二是持续做好期货经营机构监测监控，启动新一代FISS系统建设，助力期货监管数字化、智能化转型。三是持续做好期货交易者保障基金筹集、管理、使用，推动期货公司风险处置。

风险控制方面，一是进一步加强市场监控研判风险的能力。持续监控投资者结构变化引起的风险情况，加强预警信息的关联分析。加强资本市场跨境资金流动监测，研究制订《期货市场跨境资金流动风险监测方案》，积极研判外资“大进大出”

风险。二是配合解决客户结算账户被紧急止付问题，高效精准开展疑似诈骗账户筛查工作。研究制订中央企业参与期货市场监控预警方案。三是创建风险监测指标体系，为上级研判风险提供重要参考。

系统运行方面，一是强化科技监管，深化数据治理。高效完成新一代 FISS 系统项目、场外衍生品市场监测平台、数据质量监控系统三期建设。二是完成期货互联网开户系统等国产商用密码改造。三是圆满完成党的二十大、北京冬奥会等重点时期的安全保障。

业务发展方面，一是推动场外衍生品市场监测平台优化项目顺利上线。报告库数据质量和统计效率大幅提升，数据资源有效拓展。二是及时修改期货开户业务配套指引，完善合格境外投资者开户规则，支持场外衍生品业务开立场内专户。三是全力推进广期所客户开户、私募基金期货市场统一账户工作机制等专项工作。四是多维度加强我国大型企业参与期货市场情况分析。

》》 第三节 期货市场法治建设情况

一、上海期货交易所贯彻落实《期货和衍生品法》情况

（一）协助推动期货市场基础法律制度建设

《期货和衍生品法》的出台实施，使期货市场基础性制度日益完备。上期所以《期货和衍生品法》出台实施为契机，认真配合做好《期货和衍生品法》配套规则的“立、改、废”工作，协助推进《期货交易所管理办法》《期货公司监督管理办法》的修改工作；推动《衍生品交易监督管理办法》《期货市场持仓暂行管理规定》《期货期权品种注册管理暂行规定》等部门规章和规范性文件的制定工作；大力支持《最高人民法院〈关于审理期货和衍生品纠纷案件若干问题的规定〉》的修订工作。协助推动资本市场法律体系“四梁八柱”基本建成。

（二）优化业务规则体系，完善市场运行机制

认真落实《期货和衍生品法》要求，对合约及规则进行梳理，形成 2023 年规则制定、修改工作计划，包括业务规则层面 15 项、合约层面 17 项；修订上期能源章程、交易规则、上期所交易细则、期权管理办法；制定发布《上期所信息管理办法》；完善《黄金交割实施细则》等制度。业务规则得到体系化改善，市场运行质量进一步提升。



（三）组织开展《期货和衍生品法》学习和培训

针对内部监管干部开展集中培训和学习，邀请参与立法工作的领导、专家举办四场《期货和衍生品法》专题培训会，保障全覆盖、多角度、深层次的学习效果。面向产业客户开展七场专题培训会，促进社会充分认识期货市场和衍生品市场的功能和价值。根据中国证监会的统一部署，先后配合《期货日报》《金融时报》《人民日报》（海外版）等媒体进行宣传。结合“12·4国家宪法日”举办“松林杯”投资者保护动画决赛作品展映会，重点围绕《期货和衍生品法》最新规定，选出一批优秀的法治动漫微视频，为市场带来丰富多彩的“普法视听大餐”。

二、郑州商品交易所贯彻落实《期货和衍生品法》情况

2022年，郑商所修订了《郑州商品交易所期货交割细则》《郑州商品交易所标准仓单管理办法》，《郑州商品交易所干制红枣期货合约》及相关规则，以及《郑州商品交易所期权交易管理办法》和已上市品种期权合约。制定了《郑州商品交易所调解委员会调解规则》《郑州商品交易所菜籽油期权合约》《郑州商品交易所花生期权合约》。

此外，为全面提升业务规则体系的拓展性和兼容性，更好地适应期货市场高质量发展的需要，郑商所于2022年8月31日发布了《关于优化业务规则体系的公告》。本次规则体系优化工作按照“业务办法+品种细则”框架，对原规则体系进行了大幅改造与重新构建，把针对所有上市品种都适用的共性规定保留在各业务办法中，把针对具体上市品种适用的个性化规定体现在各品种期货业务细则中。优化过程涉及原《郑州商品交易所交易细则》《郑州商品交易所期货交割细则》《郑州商品交易所标准仓单管理办法》《郑州商品交易所期货交易风险控制管理办法》4个业务规则，需将其内容进行拆分，新制定了23个已上市品种的业务细则，废止了原《郑州商品交易所夜盘交易细则》和《郑州商品交易所保税交割实施细则》2个业务规则，并对原《郑州商品交易所期货结算细则》《郑州商品交易所指定商品交割仓库管理办法》等7个业务规则及22个期货合约文本进行了规范表述等相关配套修订，共包含58个合约规则的“立、改、废”工作。

4月20日《期货和衍生品法》颁布后，郑商所紧紧抓住新法颁布实施前后的关键时期，制订学习贯彻《期货和衍生品法》的工作方案，通过线上线下结合方式，发挥内外部专家力量，组织开展多场内外部集中培训，逐条解读释义《期货和衍生品法》内容。郑商所联合中国期货业协会等单位在微信公众号、手机微信端等新媒体发布《期货和衍生品法》的系列宣传海报，举办多期《期货和衍生品法》基础知识有奖竞答活动，吸引广大社会公众的积极参与，累计近万人次参与答题活动。上线“期货和衍生品法律网”，设立法治动态、法律评述、学术研究、法律法规、自律规则、典型案例六大板块，致力于为全行业提供开放式的期货和衍生品法律宣传

与研究的重要阵地、交流平台。2022年的中国（郑州）国际期货论坛举办了法律专场，出版《“漫”话期货和衍生品法》和《郑商所·〈期货和衍生品法〉专刊》。制作普法微视频、系列漫画在自媒体平台发布，累计触达量达3万人次。

三、大连商品交易所贯彻落实《期货和衍生品法》情况

（一）实行“立、改、废”清单

为认真落实《期货和衍生品法》要求，大商所积极对合约及规则进行了梳理，拟修改规则44项，主要包括以下三个方面内容：一是章程和交易规则（2项），包括增加交易所职责的列举、完善自律管理依据、明确品种注册制、账户实名制等规定；二是《期货和衍生品法》相关的表述类规则修改（39项），包括交割库概念体系、标准仓单定义、期货公司会员注册资本等设立条件等；三是风险管理相关规则（3项），包括持仓限额、套保制度、实控账户、大户报告等。

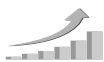
（二）计划落实情况

2022年，大商所开展了《期货和衍生品法》配套交易所规则修改工作，对包括章程、交易规则、业务办法、品种细则、业务规定和业务通知等进行全面梳理，形成了修改草案，确保新的规则制度真正体现《期货和衍生品法》在发展理念、监管思路等方面的革新精神。此外，大商所还积极配合中国证监会参与了《衍生品市场监督管理办法》的制定以及《期货交易所管理办法》《期货公司监督管理办法》的修订工作。同时，就研究制定期货品种上市机制、合约外挂监管等有关《期货和衍生品法》配套规定进行了专项课题研究，努力将《期货和衍生品法》的制度优势转换为创新发展的新动能。

（三）推广宣传情况

大商所召开了理论中心组（扩大）学习会议，认真学习《期货和衍生品法》相关规定以及易会满主席关于《期货和衍生品法》的重要讲话。组织全所干部职工完成《期货和衍生品法》培训课程，面向全所开展读《期货和衍生品法》、“期货法你听我说”系列宣传展等活动，推动学习宣传入脑入心。

针对市场多方主体的学习需要，撰写《〈期货和衍生品法〉开启期货市场高质量服务实体经济新篇章》等文章，发表于《清华金融评论》等媒体，并转载于新华社等媒体。同时，利用交易所官方微信公众号等多种媒介发布或者转发宣传图片及新华社、中国证监会等相关新闻15次。为使普法宣传活动更接地气、聚人气、有生气，大商所精心录制10期“法律会客室”视频，举办了30场《期货和衍生品法》系列专题讲座，从立法宗旨、衍生品市场监管、结算交割、交易者保护、风险防控等多角度，对《期货和衍生品法》进行全方位解读，助力全市场营造“期货法亮点



人人关注，期货法成果人人共享”的良好氛围。

四、中国金融期货交易所贯彻落实《期货和衍生品法》情况

（一）积极配合期货规章制度修订制定，夯实期货市场法治基础

根据中国证监会统一部署，中金所积极配合做好配套部门规章、规范性文件及司法解释的“立、改、废”工作。协助推进《期货交易所管理办法》《期货公司监督管理办法》《期货期权品种注册管理暂行规定》《期货市场持仓管理暂行规定》《衍生品交易监督管理办法》以及《最高人民法院〈关于审理期货和衍生品纠纷案件适用法律若干问题的规定〉》等修订制定工作，推动进一步完善市场基础法律制度，夯实期货市场法治基础。

（二）认真组织配套业务规则修订，优化自律监管工作效能

中金所及时组织开展配套业务规则修订工作，以贯彻和落实《期货和衍生品法》为契机，进一步推动完善市场基础运行机制，优化业务规则体系。结合《期货和衍生品法》《期货交易所管理办法》《期货公司监督管理办法》（征求意见稿）和交易所业务发展实际，全面系统梳理拟配套《期货和衍生品法》修订的业务规则20余项，形成业务规则修订工作规划和修订方案。

（三）大力开展期货法治宣传，凝聚依法治市合力

《期货和衍生品法》出台后，中金所第一时间组织学习，并邀请法律专家权威解读；组织系列立法培训，开展境外和衍生品业务、会员法律合规等专题辅导；大力拓展投教宣传深度广度，制作原创短视频、长图文、普法动漫视频和宣传口袋书等系列优质宣传作品；拓展普法宣传形式，利用“12·4国家宪法日”“5·15全国投资者保护宣传日”，举办“快闪空间”等宣传投教活动。

（四）以《期货和衍生品法》为抓手，积极搭建学术交流平台

启动中金所主办学术集刊《期货和衍生品法律评论》征稿出版工作，开辟新法解读专栏；联合上海市法学会金融法研究会举办线上研讨会，与全国司法系统、高校、监管部门、市场机构就新法的理解和适用进行深入研讨；以“中金所杯”为抓手，推动新法进校园，培育懂法守法的期货人才；与中国证监会在沪系统单位开展联学联建，深入探讨市场立法与监管工作方向。

五、广州期货交易所贯彻落实《期货和衍生品法》情况

（一）积极参与《期货和衍生品法》配套制度的全面梳理和意见征集

为贯彻落实《期货和衍生品法》，中国证监会开展了相关配套制度的“立、改、废”工作。在这一过程中，广期所积极参与，配合开展相关工作。一是对中国证监会所征求意见的《期货交易所管理办法》《期货公司管理办法》等配套制度的修订稿进行全面梳理，从合法性、合理性等角度提出相关建议意见。二是配合起草持仓管理、场外衍生品监管、品种注册专门文件，梳理境内外成熟做法，结合实际业务需要，起草相关核心条款建议材料，参加相关起草工作的汇报研讨，并进一步配合就相关征求意见稿进行梳理反馈。

（二）借鉴既有实践，结合业务实际，搭建完整的规则体系

2022年，广期所先后完成了《广州期货交易所股份有限公司章程》以及《广州期货交易所交易规则》《广州期货交易所会员管理办法》等23项业务规则的制定。以《广州期货交易所交易规则》为纲领，以《广州期货交易所会员管理办法》等19项通用业务规则以及工业硅品种合约和细则为基础，广期所构建了一套具有稳定性、可预见性、可持续发展的科学的业务规则体系，确保业务规则体系的拓展性强、兼容度高、可读性强。

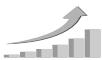
在制定业务规则过程中，恰逢《期货和衍生品法》颁布，广期所积极贯彻落实工作，扎实做好实施细则的对照梳理和衔接安排，为年内上市品种后，依法履行自律管理职能，压实一线监管责任，筑牢规范基础。

（三）组织开展《期货和衍生品法》学习和宣传

2022年，广期所组织开展了一系列《期货和衍生品法》的学习和宣传活动。一是扎实开展全员学习，依托创新理论学习读书班，2022年5月由所内法律职能部门专题领学《期货和衍生品法》的立法指导思想和主要内容，编写领学材料，各部门结合自身业务开展深入自学和集中研讨。二是邀请专家专题讲解，邀请知名律所专家围绕国际证监会组织（IOSCO）《商品衍生品监管原则》修订稿和《期货和衍生品法》内容开展对比解读，组织业务骨干参加中国证监会法律部视频培训学习，组织干部员工积极参与面向全市场开展的《期货和衍生品法》重点内容解读培训。三是开展“投资明风险，守护千万家”主题宣传活动，结合《期货和衍生品法》和世界投资者周，在广州期货交易所官方网站和微信公众号发布三期主题内容。

六、中国期货市场监控中心贯彻落实《期货和衍生品法》情况

2022年，中国期货监控进一步提高政治站位，强化责任担当，立足监测监控本



职，有步骤、有重点地推进法治政府建设各项任务，持续加大法治宣传力度。

期货监管制度建设方面，一是制定《期货和衍生品法》配套“立、改、废”清单目录。二是参与《期货公司监督管理办法》和《期货交易所管理办法》修订工作，认真研究提出修订意见。三是就涉及期货公司代销金融产品业务的相关规定从资金监控角度研究并反馈意见。

相关法规落实方面，为更好履行“按照规定及时向市场披露有关信息”这一《期货和衍生品法》相关规定的交易报告库法定职责，更好发挥交易报告库服务市场的功能，已立项建设中心官网“交易报告库”一级板块。细化公开披露信息内容，提高场外衍生品市场的透明度，保证投资者能够及时通过公开渠道了解场外市场的风险概况。2022年，中国期货监控已按照《期货和衍生品法》对期货开户业务配套指引进行修订并发布实施。

期货法规宣传方面，通过官网和微信公众号等渠道宣传《中华人民共和国反垄断法》《中华人民共和国期货和衍生品法》《实际控制关系及相关法律法规》等；通过微信公众号开展《期货和衍生品法》有奖知识竞答，向近三万粉丝推送了《〈期货和衍生品法〉舆情传播走势分析》等文章。

七、中证商品指数公司贯彻落实《期货和衍生品法》情况

2022年，中证商品指数公司认真贯彻落实中国证监会党委统一部署，切实履行自身职责，组织开展《期货和衍生品法》学习宣传。一是组织开展员工学习。要求员工结合公司业务开展资本市场相关法规自学，并通过员工培训、外部专家讲座等形式，强化员工对资本市场相关法规的学习，增强法治意识。二是通过公司微信公众号、官网等渠道发布《期货和衍生品法》等相关法规及分析解读，积极向市场参与者推广普及法律知识。三是从指数业务出发，领会贯彻落实《期货和衍生品法》的基本原则，规范指数业务流程，构建公允的市场基准，为场内外产品提供客观公正的跟踪标的，服务期货和衍生品市场健康有序发展。

八、中国期货业协会贯彻落实《期货和衍生品法》情况

（一）制定“立、改、废”清单

1. 《期货和衍生品法》出台前，提前着手梳理期货法律监管制度

结合期货法二审稿要求，对涉及期货行业的19个行政法规、司法解释、国务院文件和148个部门规章和规范类文件进行逐一梳理、逐条对比，对其中6个行政法规、司法解释、国务院文件和60个部门规章和规范类文件，根据轻重缓急程度提出调整建议和理由，积极协助监管部门做好制度准备。

2. 《期货和衍生品法》出台后，进一步完善协会自律规则体系规划

协会于年初制订协会2022年度自律规则“立、改、废”计划，并在此基础上，于《期货和衍生品法》出台后对现行自律规则和通知类规范文件进行了全面梳理，形成《中国期货业协会〈期货和衍生品法〉配套规则立改废清单》。按照“归类整合，减少规则数量”的原则，进一步完善协会自律规则体系规划。结合中国证监会规章等上位法修改情况，确定力争2022年完成重点落实项目。

（二）计划落实情况

2022年，协会共发布自律规则3个，包括《中国期货业协会失信及违规处理办法（试行）》《期货公司财务处理实施细则》《中国期货业协会团体标准管理办法》。另外，重点推进《衍生品市场重要参与者自律管理办法》《期货风险管理公司衍生品交易业务管理办法》《期货公司为证券公司提供中间介绍业务指引》《〈期货经纪合同〉指引》《期货投资咨询服务合同指引》《衍生品交易业务产品结构及风险揭示必备条款》等业务规范的制修订工作，充分向行业征求意见，多次讨论《中国期货业协会章程》《中国期货业协会会员管理办法》《中国期货业协会会费收取办法》《期货经营机构及其工作人员廉洁从业实施细则》等规则的修订思路和内容，完善会员和从业人员管理。

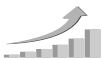
（三）推广宣传情况

1. 《期货和衍生品法》出台后，组织开展学习宣传活动

一是2022年5月5日组织召开座谈会，邀请中国证监会副主席方星海出席，证监会法律部和期货部、期货系统会管单位、期货经营机构等50余家参会，凝聚行业共识，征求法律贯彻落实建议。二是邀请行业专家学者，连续开展8期专题宣讲解读培训，市场反应热烈，通过线上方式参加培训的累计超过53 000人次。同时，组织编辑、购买《期货和衍生品法》宣传资料及释义，供行业期货经营机构学习。

2. 定期发布期货和衍生品行业监管动态

为进一步发挥协会自律管理职能，夯实行业法治建设，2022年3月创办电子期刊《期货和衍生品行业监管动态》，绘制工作流程图，对格式和内容进行严格把控，明确内部责任分工，每周定期进行校对、复核，每期进行整体统稿。2022年共发布10期电子期刊，编辑校译393条境内外资讯，其中，境外资讯198条，境内资讯195条，主要涵盖美国、欧盟、英国、新加坡、中国香港等境外金融监管当局的动态资讯，以及中国人民银行、证监会、期货交易所、行业协会等境内监管机构和自律组织发布的重要信息，10期电子期刊的期货和衍生品监管全球动态约30万字。



》》 第四节 期货交易所自律监管情况

一、上海期货交易所自律监管情况

（一）依法从严监管，维护良好交易秩序

1. 全面贯彻“零容忍”监管理念

上期所坚持依法从严治市，规范交易行为。全年共处理异常交易行为 715 起，对日常监控中发现的 88 起涉嫌违规线索进行排查，并采取自律监管措施，对 23 起涉嫌违规线索立案调查；对 321 名客户发起实控账户协查申请，净增实控账户 1 769 组，新增疑似实控账户 176 组；在 2021 年试点超额信息量收取申报费的基础上，2022 年在全品种实施超额信息量申报费，并定期要求重点客户上报程序化交易相关信息。

2. 公正高效审理违规案件，提升案件审理质量

全年审理违规案件共 21 件，其中虚假申报 4 件，自成交案件 2 件，对敲及损公肥私类案件 14 件，拒不配合调查 1 件，共处理涉案自然人 43 人次、法人 3 家。“零容忍”的执法震慑作用进一步彰显，市场生态持续净化。

3. 加强诚信建设，推进市场诚信约束和激励

全年使用资本市场诚信信息数据库共 10 批次，查询 89 家法人近三年系统内的违法违规情况，其中，拟申请标准仓单交易平台交易商 63 家、做市商 26 家；监管检查差别对待共 6 批次，为 15 家期货公司查询诚信信息；全年共有 26 份“违规案件处理决定书”录入资本市场诚信信息数据库。此外，6 家期货公司按要求主动报备 6 项行政监管措施决定书。

4. 加强交割仓库管理，提升风险治理能力

一是开展交割仓库全面风险排查，针对潜在风险建立监测清单。对未达标仓库发出整改通知书，限期整改，定期验收。二是督导交割仓库强化内部监督及制度约束，要求各库建立并迅速落实单证员、库管员等一线重点岗位人员轮岗工作制度，切实加强内部监督，防范道德风险。相关内部监督机制和轮岗制度纳入交易所检查范围。三是向交割仓库担保单位发送风险提示函，压实担保单位对交割仓库资信、财务、经济纠纷、交割业务开展等事项的监督责任。

（二）深化政治意识宣传教育，加强权力制约监督

深化政治意识宣传教育，突出业务工作的政治性、人民性，着力提升领导干部

政治意识、公权力意识、服务意识和规矩意识；根据创新业务及部门职责调整情况，动态更新公权力清单，进一步提升权利运行质效；压实公权力监督主体责任，开展公权力清单执行情况自查，不断完善制度流程；加强监督检查力度，开展重点领域廉政风险点专项检查，优化制度建设、制度执行。

（三）畅通投资者诉求处理渠道，提高投资者诉求处理质效

1. 持续提升信访工作质效，保护投资者合法权益

加强信访业务规则和标准的宣导，在严格执行标准的同时，通过热情、友善的交流方式，及时妥善反馈，快速响应投资者诉求，不断提高信访服务水平，进一步提升市场服务满意度。

2. 充分发挥市场服务中心源头治理功能，有效化解市场矛盾

全年市场服务中心受理投资者意见建议共1340件，通过不断优化内部架构、服务流程，投资者满意度达97%。同时，做好与中国证监会12386热线的对接，确保转办事项按时高质量完成。全年市场服务中心投资者诉求反馈速度和综合分析能力显著提高。

（四）提升数字化水平，运用科技手段实施有效监管

1. 推进数字化监管系统建设，提升监管质效

加快推进新一代 Truths 监查系统建设，突出系统功能化、流程化和可视化；交割仓库监控报警系统1.0版本上线，加强对交割仓库资信状况的智能化检测；官网上线货位信息查询功能；推进智慧仓储体系建设，以试点库起步探索形成科技监管标准。

2. 加强大数据应用，提升决策和监管效能

启动数字化转型战略，开展数字化转型咨询项目，初步落地数字化协同平台，进行数字化人才培养；启动大数据基座项目建设、智能风控辅助平台建设，完成云计算平台二期项目、区块链平台试运行，不断推进金融科技基础应用研究；启动有色金属数据系统建设，完成数据智能化应用项目二期，进一步丰富数据服务模式。

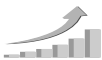
二、郑州商品交易所自律监管情况

2022年，郑商所以习近平新时代中国特色社会主义思想为指导，坚决贯彻落实党中央决策部署和中国证监会工作安排，深入学习宣传贯彻党的二十大精神，坚决服从服务国家战略与经济大局，加强期货市场一线监管，稳妥应对各类风险挑战，持续深化产品业务创新，增强服务实体经济能力，推进期货市场高质量发展。

（一）加强市场监管，维护市场良好秩序

1. 严查异常交易行为，对违法违规行为零容忍

郑商所持续加强市场监管，切实履行一线监管职责。2022年，共处理异常交易



340起；审理违反交易所自律管理规则案件18起，对涉案的31个自然人及11个法人给予警告、暂停开仓、没收违规所得等纪律处分。全年共认定实际控制关系账户1183组，涉及3163个客户。充分发挥“五位一体”监管协作体系优势，积极配合相关监管部门严厉打击操纵市场等违法违规行为，切实维护公开、公平、公正的市场秩序。

2. 坚持科技赋能监管，推进数字化转型发展

2022年，郑商所制订信息科技发展总体规划，深化金融科技应用，持续提升科技监管水平。有序推进新一代交易系统上线工作，完成组合保证金与标准仓单登记查询系统上线，丰富大数据信息平台与市场监查平台各项功能指标，助力高效化业务运营。持续健全数据基础制度体系，开展国债估值系统直连、全景数据分析、市场交易智能分析、业务流程协同电子化等项目建设，进一步提升市场运行综合分析效能。

3. 强化交割仓库管理，提升服务水平

郑商所聚焦重点、精细化管理，保障交割平稳、货物安全，坚守交割商品零风险底线。2022年，顺利完成271家交割库年审工作，对15家存在风险隐患的仓库及时采取措施。有序推广智慧监管平台应用，完成31家交割仓库的科技改造与监管平台接入。构建现场查库、第三方协助检查、视频查库等多层次查库体系，全年完成交割仓库现场检查80次。对76家仓库财务数据进行专项排查，强化交割仓库合规运营理念。开展仓单统一保险，建立仓单安全社会屏障。

4. 加大业务检查力度，促进会员及做市商合规运作

2022年，郑商所对上海、重庆、浙江、河南、广东等地区的16家期货公司会员进行年度合规业务运作检查，及时发现并纠正存在的问题，督促会员合规运作。加强与会员的交流，联合中期协、湖北证监局举办期货公司首席风险官培训班，持续组织开展会员“线上面对面”和会员中层业务培训，增强期货市场各类参与者的合规经营意识和风险管理能力。加强做市商交易行为监管，因品、因时、因势动态调整做市政策，促使做市商不断发挥作用。

（二）防范市场风险，保障市场稳健运行

1. 提升全面风险管理能力，坚决筑牢安全生产防线

2022年，郑商所坚持稳字当头、稳中求进，强化系统观念，守牢风险底线。有序推进全面风险管理体系建设，积极塑造全面风险管理文化，提升全员全流程风险管理能力。持续强化安全生产工作，加强重点环节风险隐患排查治理，细化预警性、苗头性信息预研预判和靠前处置。做好疫情防控系列工作，参加省部联合防汛演练，进一步强化内外部协同联动能力，保障市场平稳运行。

2. 坚持科学监管、分类监管，精准防控市场风险

2022年，郑商所持续加强风险预警监测，密切关注宏观经济形势和期现货市场

变化，及时制定风险预防和处置措施。对部分品种出现的阶段性风险隐患，坚持科学监管、分类监管，持续丰富监管工具箱，采取提高交易保证金标准、扩大涨跌停板幅度、提高交易手续费标准、实施交易限额和差异化申报费等措施，稳妥有效化解市场风险隐患，牢牢守住不发生系统性风险底线，全力服从服务国家战略与经济大局。

3. 优化交割风险防控，不断增强运维保障能力

郑商所始终把防控市场风险、保障稳定运行作为工作底线。2022年，持续优化交割风险防控，针对疫情影响下棉花等品种运输、检验遇阻的情况，协调当地政府开设“绿色通道”，创新质检机构“接力送样”、延长提货通知单有效期等服务方式，有效克服疫情影响，保障交割平稳顺畅。持续加强运维保障建设，落地交易参数大运维，进一步降低操作风险。结合全市场测试，开展关键设备故障、主备中心应急切换自动化等场景应急演练，持续提升交易结算连续性和安全生产保障水平。

4. 加强资金风险管理，切实履行中央对手方职责

郑商所通过事前监测、事中测算、事后跟踪，强化资金风险管理，确保资金安全。着力提升资金风险监测自动化水平，设置风险管理指标及阈值，对资金风险及时预警。持续优化压力测试场景，研判资金风险状况。强化长假前后资金流动性管理，实现跨行资金调拨功能，有效防范流动性风险。按照金融市场基础设施原则（PFMI）要求，定期完成合格中央对手方信息披露。

三、大连商品交易所自律监管情况

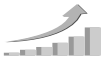
2022年，大商所坚持以习近平新时代中国特色社会主义思想为指引，全面学习贯彻落实党的二十大精神，健全风险预防预警处置制度，以零容忍态度查处违规行为，持续推进科技监管建设，切实履行市场一线监管责任，牢牢守住不发生系统性风险的底线，坚决维护市场安全平稳运行。

（一）积极做好市场风险防控，全力保障市场功能发挥

2022年，坚决贯彻党中央、国务院、中国证监会的决策部署，成功应对俄乌冲突、疫情反复等引发的市场波动。累计对玉米、棕榈油和铁矿石等15个品种采取风控措施52次，积极引导市场预期，针对重大事件窗口拟定风控预案。密切跟踪各类措施效果，动态评估调整部分品种风控措施。主动加强与宏观管理部门沟通汇报，形成期现联动监管合力。就铁矿石期现联动监管进行座谈，不定期沟通风控和监管政策调整情况，强化期现措施协调配合，获得宏观管理部门高度认同。累计报送重点品种市场运行和监管动态200余份。

（二）贯彻“建制度”监管理念，加强重点客户群体监控

持续优化风险管理机制，深入开展持仓监管研究，配合中国证监会期货部制定



期货市场持仓管理暂行规定；优化大户持仓报告制度，加强头部持仓客户监管；优化套期保值制度，配套建立内部制度和外部指南，提升服务产业水平；优化强制减仓规则，更加有序稳妥应对极端市场行情。

健全监控预警线索移交标准，完善各类违规案件立案标准。建立违规案件线索定期会议机制，进一步提高办案效率。以实控账户管理为抓手，深入摸排资本动向和风险底数。建立机构客户、境外客户、高频客户和产业客户等监测指标体系和行为分析报告机制，为监管精准聚焦提供抓手。

（三）落实“零容忍”监管要求，履行一线监管职责

1. 加强市场监控，保护投资者合法权益

违规行为方面，2022年，大商所共排查处理违规线索76起，包括涉嫌自成交或约定交易影响合约价格27起、涉嫌对敲转移资金40起、涉嫌虚假申报2起和其他类型违规线索7起，对16起违规线索进行所内立案调查。着力查办重大疑难案件，配合调查机构完成前期报送3起操纵、1起内幕交易案件的调查取证、案情研讨和违规所得计算等工作。

实控账户排查方面，2022年，大商所共发出市场监查问询函1185份，涉及204组客户，新增1334组3612名客户申报实际控制关系账户。

异常交易监控方面，2022年，大商所共处置异常交易759起，其中，自成交超限352起，频繁报撤单超限365起，大额报撤单超限42起，对39名客户或实际控制关系账户组采取限制开仓的监管措施。

程序化交易报备和高频交易管理方面，2022年，共有12573名客户向大商所进行程序化交易报备，涉及会员单位146家。2022年，在期货部的统筹指导下，持续推进高频交易监管工作，新增7个申报收费品种，并优化棕榈油期货收费标准，在棕榈油、玉米、液化石油气期货实施交易限额政策。

2. 做实现场检查工作，及时回应市场关切

大商所深入落实中国证监会“五位一体”监管模式要求，持续推动建立“以监管会员为中心”的监管体系，2022年围绕7类业务32项工作完成18家期货公司会员的现场检查并反馈意见建议。创新投教形式，利用会员单位首席风险官监管业务培训、产业客户套保业务培训、定期推送监管报告、发布典型违规案例等方式传递交易所监管理念，提升市场合规意识。

2022年，大商所重视市场声音，完善投诉、举报和信访的内部处理工作流程，及时处理涉及铁矿石、焦煤、焦炭等各类信访事项163件。落实“我为群众办实事”项目，解决市场关切问题，并延长一般月份套保额度申请时间和程序化客户报备的反馈时间，便利市场参与者，提高市场服务效果。

大商所开展套保额度使用情况专项检查，共检查了20家套保客户，并对其中8名客户采取自律管理措施，切实履行一线监管职责，促进期货市场基础功能的有效

发挥。

（四）推动监查业务数字化转型，站稳监管的人民立场

完成新一代监查系统（DCE 监查 7.0）主体建设，以数字化思维推动业务创新，加快信息系统建设向数字化和智能化方向发展。新一代监查系统（DCE 监查 7.0）核心功能基本建成，实现市场监管范围、效率与精度的全面提升。拓展客户画像业务应用场景，丰富指标数据体系，围绕市场主体构建起数字化监管能力。结合业务实践迭代关联账户系统功能，增强系统融合使用多源数据能力，同步实现实控关系的智能化排查和数字化取证。推进监查业务条线全流程电子化系统建设，实现违规线索发现、排查、移交全流程管理。注重数字化建设质量，牵头推进看穿式监管数据质量改进工作，进一步推动期货公司信息采集修订工作。

四、中国金融期货交易所自律监管情况

2022 年，中金所积极构建全面风险管理体系，不断夯实市场法治基础，加强科技监管能力建设，严厉查处市场违法违规行为，进一步发挥监管合力，保障期货市场平稳有序运行。

（一）构建全面风险管理体系，筑牢安全生产防线

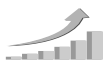
积极推动构建全面风险管理体系，成立全面风险管理领导小组，设立市场风险管理工作专班，制定《全面风险管理办法》《全面风险管理清单说明书》《全面风险管理清单手册》，为防范和化解各类风险提供操作指南。细致开展风险隐患排查，持续完善风险防控工具箱，探索构建涵盖多个关键指标及风险场景的相关金融期货产品风险指数，稳步推动风险监测实现数字化、自动化、可视化。

（二）落实“零容忍”要求，打击市场违规行为

严格查处市场违规行为，查处 1 起对敲牟取不当利益案件，积极稳妥推进 1 起国债期货违法违规案件线索的查审工作，扎实做好新型违规案件的研究评估。对 74 名客户开展实控关系问询；对 1 170 名客户发送程序化问询函；对 854 名客户发送期权交易信息报备告知函；处理 155 起异常交易行为、58 起违反交易限额行为和 71 起套保套利期现不匹配行为，共采取 164 次限制开仓和 120 次电话提醒措施。

（三）夯实市场法治基础，强化市场制度保障

配合中证 1000 股指期货和期权、上证 50 股指期权上市，组织制定修订相关业务规则 6 个、业务通知 8 个，持续加强制度供给，进一步夯实自律监管制度基础。全力配合期货立法工作，协助中国证监会推动《期货和衍生品法》顺利出台实施，积极参与配套规章制度“立、改、废”工作，做好自律规则与上位法的有序衔接。



组织制定内部《公平竞争审查办法》，强化业务规则的公平竞争审查。

（四）做实做细检查宣教，引导共建合规环境

在期货部统一部署和具体指导下，认真制订会员合规现场检查工作方案，悉心组织完成对 23 家期货公司会员的现场检查工作，规范执行期货市场自律监管任务，督促会员合规运作。严格落实自律监管信息通报等工作要求，通过中金所官网“自律监管专栏”“交易所公告”栏目，及时发布监管信息。积极拓宽行业合规交流渠道及合规培训方式，线上线下多方式开展业务介绍及规则宣讲，切实提升会员风控及合规管理水平。

（五）积极推动监管协作，促进监管合力发挥

在中国证监会、地方证监局、交易所、监控中心和期货业协会“五位一体”监管框架下，积极开展监管协作。一是强化与沪深交易所“期现联动”，优化升级交换数据接口，重构客户分类标准，加强重点时段联动分析，常态化交换重点关注名单。二是深化与商品市场“期期联动”，识别跨市场重点客户，提升期货市场一体化监控效能。三是全面落实衍生品场内外联动风险监测工作机制，组织与证券业协会、中证报价、中证数据等健全常态化数据共享。四是稳步推进国债期现跨市场协作，与外汇交易中心就跨市场监管备忘录、数据交换格式等达成共识。五是探索与基金业协会搭建数据共享路径，促进私募基金类型识别，研究构建量化私募风险画像。

（六）落实科技赋能战略，持续提升监管效能

扎实推进监管科技应用，统筹提高监查系统建设、平台建设，促进实现监管数字化、监控可视化，全面提升科技监管水平。一是升级新一代监查系统架构，应用国产 Gbase 分布式数据库，实现系统容量扩充、处理速度跃升，主要性能指标达到行业领先水平。二是落地多维度关联账户识别指标，完善违规违约平台关联分析板块建设，提升历史监测功能的自动化和智能化水平，上线多项系统功能，强化科技对业务的有效支撑。三是上线舆情信息监测分析系统、智能分析中台，提升立体化市场风险监测和数据智慧自助查询，建设支持高效数据加工数据仓库，推进金融大数据平台建设。

五、广州期货交易所自律监管情况

2022 年，广期所持续推进业务规则体系建设、业务系统开发测试、监管框架体系构建等，顺利实现首个品种上市交易，保障市场平稳运行。

（一）全面建设业务规则体系，筑牢自律监管制度基础

2022年，广期所积极推进《广州期货交易所股份有限公司章程》《广州期货交易所股份有限公司交易规则》（以下简称《交易规则》）行政审批，于4月获得中国证监会批复。广期所结合境内外最佳实践，构建以《交易规则》为统领、业务管理办法为主体、品种合约细则和指引通知为补充的四层级规则体系。《交易规则》《交易管理办法》《结算管理办法》《风险管理办法》等19项业务办法及《工业硅期货、期权合约细则》在完成向中国证监会备案后在官网发布实施。为提升广期所的服务水平，便利投资者参与交易，广期所累计发布21个业务指引，指导会员和投资者参与市场、办理各项业务。广期所通过建设相对完善的业务规则体系，夯实自律监管基础，为履行监管职能提供了制度遵循。

（二）构建监查业务监管框架，明确上市品种监管标准

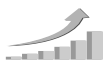
为维护市场良好生态，明确和统一监管标准，广期所在吸收期货市场监管经验的基础上，结合交易所上市品种期现货市场特征，确立了产品上市后各项监管工作标准，包括期货期权套保管理思路、实际控制关系账户组认定和管理标准、高频程序化交易行为监管思路、异常交易认定标准和监管措施、违规交易案件调查流程和立案标准等。为规范交易所运转，维护系统安全平稳运行，广期所推进自律监管规范化、标准化建设，制定市场监查业务工作流程，包括调整保证金标准和涨跌停板幅度、调整持仓限额、异常交易管理、违规违约案件调查等。广期所构建明确的监管框架和监管标准，理顺业务流程，清晰岗位职责。

（三）大力做好系统开发测试，提高科技监管水平

2022年，广期所根据信息系统开发、建设进展，分多个阶段深入开展交易系统测试工作，确认不同场景下各模块对应功能的正常运行，反复检验系统运行对自律监管的保障作用，同时向市场传递广期所做好自律监管工作的态度和决心，为品种上市营造良好的市场环境。广期所积极发挥信息科技在服务自律监管中的重要作用，持续推进监查系统和大数据平台建设。引进成熟稳定的监查系统，对监查系统及周边辅助系统进行充分测试和验证，并根据广期所业务需求完成优化、升级和改造；开发建设并运营大数据监管平台，助力提升监管效能。

（四）切实履行一线监管职责，维护市场良好秩序

2022年，首个品种工业硅期货、期权上市后，广期所切实履行一线监管职责，保障市场平稳运行。异常交易监控方面，广期所共处理异常交易4起，其中，自成交达标1起、频繁报撤单达标3起。实控账户排查方面，累计新增1216组2324名客户申报实际控制关系账户。程序化交易报备方面，共有847名客户向广期所进行



程序化交易报备，涉及会员单位 79 家。

》》 第五节 中国期货业协会自律管理情况

在中国证监会的领导下，在全体理事、会员单位的共同努力下，中国期货业协会以习近平新时代中国特色社会主义思想为指导，深入学习宣传贯彻党的二十大精神，认真落实党中央、国务院关于金融和资本市场工作的重大决策部署和中国证监会党委的工作安排，立足“自律、服务、传导”职能，坚持自律管理与行政监管的差异化定位，强化行业自律，发挥传导作用，积极推动行业高质量发展。

一、深化党建引领，推动高质量发展

（一）加强政治引领，推动期货行业迅速掀起学习宣传贯彻党的二十大精神热潮

面向行业发布学习宣传贯彻党的二十大精神系列课程，先后 5 次组织行业开展专题学习，分 8 个主题开展征文，汇总 140 余家（次）会员单位学习情况，编发理事会通讯。

（二）聚焦高质量发展，促进行业在服务“国之大者”上彰显期货担当

面向行业发布全面深化党建引领促进高质量发展、全面推进乡村振兴助力共同富裕、加强行业文化建设的三份倡议书和有关工作指引，召开行业党建工作座谈会，引领行业将坚持党的全面领导融入公司治理、内部管理和具体业务。制定评价期货行业党建引领成效的三大项共 36 项分项指标，完成配套党建指标数据采集系统建设。首次将行业党建工作纳入期货公司分类专项评价，开展党建优秀案例征集。

二、切实做好会员服务，为行业高质量发展提供有力支撑

（一）积极倾听会员诉求，推动解决会员反映问题

积极做好减负工作，2022 年度减免会员会费 800 万元。制定理事代表意见建议任务清单，持续做好监管部门和有关部门的沟通协调工作，推动完善法律法规、解决制约行业发展的有关体制机制问题。截至 2022 年底，针对理事会提出的、协会牵头负责落实的 34 条意见建议已办结 17 条，5 条意见建议因涉及与《期货公司监督管理办法》的修订保持协调，还要持续跟进，另有 12 条涉及中长期落实的意见建议，已取得阶段性成果，相关工作目前正有序开展。

（二）支持行业进一步高质量发展

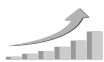
一是制修订《期货公司互联网开户规则》等 10 余项业务制度，为期货公司转型发展提供制度保障。二是加快制定《期货风险管理公司衍生品交易业务管理办法》，优化风险管理公司备案流程和会员注册系统建设。2022 年，行业新增 3 家风险管理公司、45 项业务备案。三是进一步促进资产管理业务提质增效。对 15 家私募基金管理人合规情况和展业情况进行持续跟踪，推动限仓制度、豁免制度、合格投资者库建设，私募基金产品备案系统 11 月份正式上线运行。四是发布期货经营机构 2021 年度资产管理业务信用报告、首期风险管理公司会员信用信息报告，得到了行业广泛好评。

（三）大力促进行业实现数字化转型

开展协会会员注册系统升级改版，实现会员管理数字化转型，促进会员入会登记、会籍管理、信息变更等全流程标准公开、线上运行，协会内部审核互相制衡。目前，最新版的会员管理系统已进入测试运行阶段。持续推动行业信息系统接口开放，计划开放的 222 个接口已有 193 个完成开放。克服疫情影响完成第八届证券期货科技奖承办工作。设置期刊专栏，组织开展主题征文、宣讲等行业数字化转型宣传活动。建设协会团体标准工作机制、制定发布团体标准管理办法、完成会员登记及数据报送 3 项团体标准起草工作，提升数据标准化、规范化程度。首次开展期货公司信息技术建设专项评价，推动全行业提前完成商用密码应用改造任务。研究技术服务商自律管理方式举措，以纠纷调解机制为切入点加强自律管理。组织开展行业网络安全评估，编制期货公司网络安全三年提升计划。

（四）持续打造一站式官网，讲好期货故事

在协会官网定期发布“期货行业服务实体经济数据月报”“全国期货市场月度交易数据报告”“期货市场半年度和年度专项报告”，对宣传期货市场服务实体经济成果、提升行业形象发挥有利作用。2022 年，协会网站关注度排名从 5 825 名提升至 1 789 名，全年点击率增长 556%，日均浏览量同比增加 201%，媒体主动查阅信息开展报道增加近 20%。集中做好党的二十大精神、《期货和衍生品法》等重点宣传工作，央视总台《新闻联播》《人民日报》和新华社等重点中央媒体报道行业相关新闻 300 余次，通过新华社参编渠道报送动态清样内参 2 篇，微信粉丝达 29 万，同比增长 29.4%。



三、稳步推进人才培养和文化建设，扎实做好投资者教育保护，积淀行稳致远发展根基

（一）围绕培育信义义务、提升专业能力深化行业培训

2022年全年共开展5个系列28场直播培训，上线8个系列219门149.8学时的点播课程，90余万人次参与培训，完成108万培训学时。克服考试经费压降和疫情影响，7月在金融行业率先举办全国考试，全年顺利开展3次全国统考及1次期货居间人专场考试。完善FDA系列课程，在I级课程中丰富法规解读、案例分析等内容，11月底上线FDA II级课程，为培养具有定价分析能力，严守信义义务的行业人才提供有力支持。

（二）围绕行业关注热点问题，提升研究工作质量

完成共计10万字的《期货公司功能定位》课题研究。围绕提升行业定价分析能力，开展金融衍生品分析、股指期货及衍生品价格发现功能、大宗商品期货价格预测、卫星遥感技术在棉花期货风险管理中的应用4个专项课题研究。加大了对行业研究经费的资助力度，2022年13个课题获得了经费资助，成果导向性和实用性进一步增强。组织翻译了60万字的《美国期货市场持仓监管制度》，发布9期38万字的电子期刊《期货和衍生品监管全球动态》。归纳期货公司1018份诉讼文书并发布《期货公司法律诉讼数据分析报告》，受到会员单位广泛好评。

（三）深入推进文化建设落实落细

在协会官网上线党建和文化建设专题页面，开展行业文化建设实践评估。丰富行业文化建设专题网络课程，累计开设99门课程，参培人员77.5万人次。修订《期货经营机构及其工作人员廉洁从业实施细则》，建立期货行业廉洁从业风险台账，持续引导营造良好行业生态。编撰了《信义义务》一书，将信义义务贯穿于行业文化建设。加强对行业文化建设优秀案例的宣传推广，多家期货公司获得金融系统文化建设优秀单位，协会荣获“2022年全国金融系统思想政治工作和文化建设优秀调研成果”二等奖。加大了行业文化建设的宣传力度，与央视总台央广经济之声合作全年滚动播出行业文化建设音频，录制上线《期货学堂》50余期，触达听众3亿人次。

附录

附录 1 2022 年全球期货及其他 衍生品行业发展报告

附录 1 2022 年全球期货及其他衍生品行业发展报告

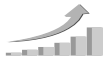
>>> 第一节 全球期货及其他衍生品市场交易概况

一、全球期货及其他场内衍生品市场总体发展概况

2022 年，全球期货及其他场内衍生品成交量大幅增长。根据国际期货业协会（Futures Industry Association, FIA）对全球 86 家交易所中期货与期权成交量统计结果显示，2022 年全球交易所合约成交量 838.48 亿手，相较 2021 年的 625.85 亿手，增长幅度为 33.98%。

在 2022 年的场内衍生品成交细分数据中，期货成交量相较 2021 年上升了 0.14%，至 293.15 亿手，期权成交量比 2021 年上升了 63.71%，至 545.32 亿手。期货和期权成交分布中，亚太市场占比均继续保持全球第一的地位，市场占比达 60.39%。

分大类来看，金融衍生品在 2022 年市场活跃度继续增加，除个股外，股指、外



汇和利率类衍生品的成交量均有所增长。其中，股指类衍生品成交量增幅 72.89%，至 486.19 亿手，占场内衍生品市场份额为 57.99%；外汇类成交量增幅 38.84%，至 77.14 亿手；利率类成交量增幅 12.42%，至 51.46 亿手。商品衍生品成交量都有所下降，农产品类、非贵金属、能源类和贵金属类衍生品的成交量分别下降 15.07%、18.69%、24.20% 和 25.78%。

2013—2022 年全球交易所期货和期权成交量对比见图 1。

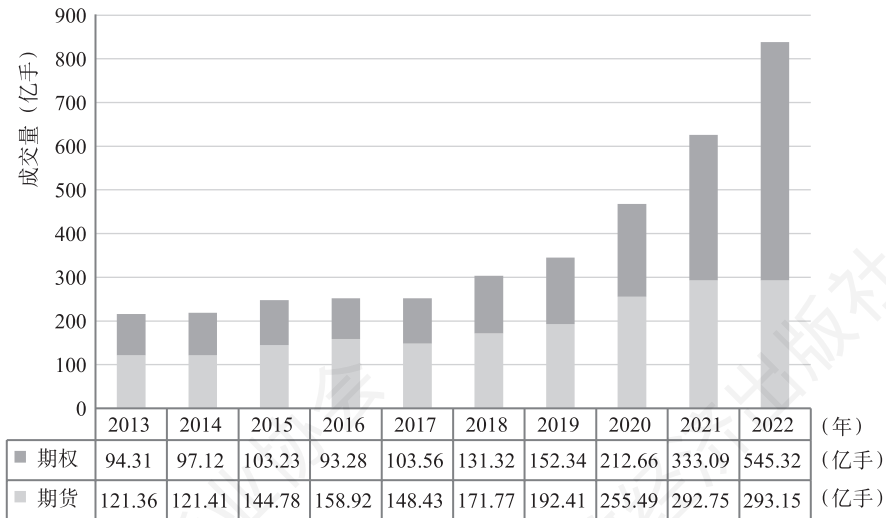


图 1 2013—2022 年全球交易所期货和期权成交量对比

数据来源：FIA。

（一）全球期货及其他场内衍生品成交量地域分布

2022 年亚太和北美市场仍占据全球前两位，亚太市场成交量增幅 65.74%，至 506.34 亿手，北美市场成交量增幅 9.27%，至 168.07 亿手（见表 1）。

表 1 2022 年全球期货及其他场内衍生品成交量分地区比较情况

地区	2022 年成交量（手）	2021 年成交量（手）	同比变化（%）
亚太	50 634 253 866	30 549 801 661	65.74
北美	16 807 149 751	15 381 696 997	9.27
拉美	8 624 373 629	8 893 935 540	-3.03
欧洲	4 802 600 636	5 451 777 446	-11.91
其他	2 979 319 590	2 307 353 319	29.12
全球	83 847 697 472	62 584 564 963	33.98

数据来源：FIA。

拉美市场成交量有所下降，降幅为 3.03%，至 86.24 亿手。欧洲市场成交量降幅 11.91%，至 48.03 亿手。其他地区成交量增幅 29.12%，至 29.79 亿手（见图 2）。

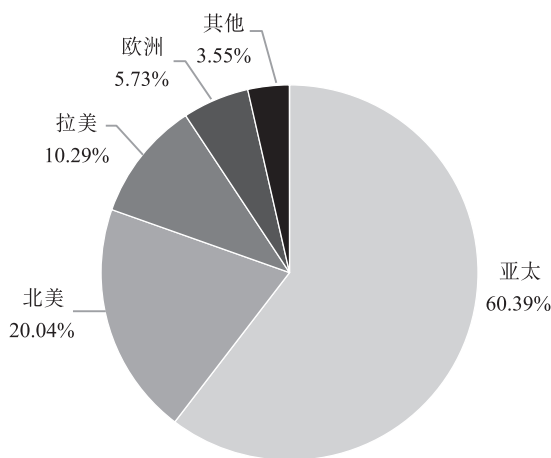


图2 2022年全球期货及其他场内衍生品成交量地域分布

数据来源：FIA。

（二）全球各交易所期货及其他场内衍生品成交量概况

在2022年全球各交易所期货及其他衍生品成交量排名中，印度国家证券交易所（NSE）继续位居第一，成交量相较2021年大幅增长，增幅达到120.88%，至381.14亿手。巴西证券期货交易所（B3）成交量有所下降，降幅5.05%，至83.14亿手，排名第二。芝加哥商业交易所集团（CME Group）成交量增幅18.28%，至58.46亿手，排名第三。

郑州商品交易所、大连商品交易所和上海期货交易所（包含上海国际能源交易中心）的成交量均出现了不同程度的下降。郑州商品交易所成交量降幅7.15%，排名下降1位，到第8位；大连商品交易所成交量降幅3.77%，排名与2021年持平，排在第9位；上海期货交易所成交量降幅20.54%，排名下降4位，至第12位。中国金融期货交易所成交量增幅24.44%，至1.52亿手，排名由第27位上升到第26位。

2022年全球各交易所/交易所集团期货及其他衍生品成交量前20名见表2。

表2 2022年全球各交易所/交易所集团期货及其他衍生品成交量前20

排名	交易所/交易所集团名称	2022年成交量 (亿手)	2021年成交量 (亿手)	同比变化 (%)
1	印度国民证券交易所（NSE）	381.14	172.55	120.88
2	巴西圣保罗证券期货交易所（B3）	83.14	87.56	-5.05
3	芝加哥商业交易所集团（CME）	58.46	49.43	18.28
4	芝加哥期权交易所集团（CBOE）	34.76	30.96	12.29
5	洲际交易所（ICE）	34.35	33.18	3.53
6	纳斯达克集团（NASDAQ Group）	31.48	32.93	-4.41



续表

排名	交易所/交易所集团名称	2022 年成交量 (亿手)	2021 年成交量 (亿手)	同比变化 (%)
7	伊斯坦布尔交易所 (BIST)	27.27	20.81	31.03
8	郑州商品交易所 (ZCE)	23.98	25.82	-7.15
9	大连商品交易所 (DCE)	22.75	23.64	-3.77
10	韩国交易所 (KRX)	20.58	22.82	-9.80
11	德意志交易所集团 (DBG)	19.75	17.17	15.00
12	上海期货交易所 (SHFE)	19.43	24.46	-20.54
13	印度孟买证券交易所 (BSE)	16.09	16.08	0.09
14	迈阿密国际证券交易所集团 (MIAX)	12.99	13.38	-2.90
15	莫斯科交易所 (MOEX)	12.68	21.02	-39.65
16	多伦多证券交易所集团 (TMX Group)	7.61	6.13	24.12
17	香港交易所集团 (HKEX)	4.55	4.33	4.98
18	日本交易所集团 (JPX)	3.92	3.34	17.54
19	台湾期货交易所 (TAIFEX)	3.84	3.92	-1.97
20	阿根廷布宜诺斯艾利斯—罗萨里奥期货交易所 (MATba ROFEX)	3.00	1.30	131.37

数据来源：FIA。

2022 年各交易所集团旗下交易所成交概况见表 3。

表 3 2022 年全球各交易所集团旗下交易所成交概况

交易所/交易所集团	2022 年成交量 (亿手)	2021 年成交量 (亿手)	同比变化 (%)
印度国民证券交易所 (NSE)	381.14	172.55	120.88
巴西圣保罗证券期货交易所 (B3)	83.14	87.56	-5.05
芝加哥商业交易所集团 (CME Group)	58.46	49.43	18.28
芝加哥商业交易所 (Chicago Mercantile Exchange)	32.63	24.65	32.36
芝加哥期货交易所 (Chicago Board of Trade)	19.44	17.88	8.74
纽约商业交易所 (New York Mercantile Exchange)	5.14	5.56	-7.58
纽约商品交易所 (Commodity Exchange, COMEX)	1.25	1.33	-6.11
芝加哥期权交易所集团 (CBOE)	34.76	30.96	12.29
Cboe 期权交易所 (Cboe Options Exchange)	16.99	15.16	12.10
Cboe BZX 期权交易所 (Cboe BZX Options Exchange)	7.41	7.90	-6.19
Cboe EDGX 期权交易所 (Cboe EDGX Options Exchange)	5.74	3.64	57.82
Cboe C2 期权交易所 (Cboe C2 Options Exchange)	4.07	3.68	10.54

续表

交易所/交易所集团	2022 年成交量 (亿手)	2021 年成交量 (亿手)	同比变化 (%)
Cboe 期货交易所 (CBOE Futures Exchange)	0.55	0.58	-5.65
Cboe 欧洲衍生品交易所 (Cboe Europe Derivative Exchange)	0.00	0.00	2 148.19
ErisX 数字交易所 (ErisX)	0.00	0.00	-61.10
洲际交易所 (ICE)	34.35	33.18	3.53
纽约证券交易所高增长长期权市场 (NYSE Arca)	11.92	10.55	13.00
洲际交易所欧洲分所 (ICE Futures Europe)	10.71	11.14	-3.88
纽约证券交易所泛美证券交易所 (NYSE Amex)	7.21	7.50	-3.89
洲际交易所美国分所 (ICE Futures U.S.)	3.94	3.33	18.17
洲际交易所欧洲大陆能源交易所 (ICE Endex)	0.53	0.62	-14.06
洲际交易所新加坡分所 (ICE Futures Singapore)	0.03	0.02	21.71
洲际交易所阿布扎比分所 (ICE Futures Abu Dhabi)	0.01	0.01	16.98
纳斯达克集团 (NASDAQ Group)	31.48	32.93	-4.41
纳斯达克 PHLX 交易所 (Nasdaq PHLX)	11.17	11.60	-3.70
纳斯达克期权交易所 (Nasdaq Options Market)	7.64	7.62	0.35
纳斯达克 ISE 交易所 (Nasdaq ISE)	5.52	6.27	-11.94
纳斯达克 BX 期权交易所 (Nasdaq BX Options)	2.72	1.29	111.59
纳斯达克 GEMX 交易所 (Nasdaq GEMX)	2.18	3.99	-45.31
纳斯达克 MRX 交易所 (Nasdaq MRX)	1.53	1.51	1.47
纳斯达克北欧交易所 (Nasdaq Exchanges Nordic Markets)	0.71	0.66	7.40
纳斯达克商品交易所 (Nasdaq Commodities)	0.00	0.01	-46.27
伊斯坦布尔交易所 (BIST)	27.27	20.81	31.03
郑州商品交易所 (ZCE)	23.98	25.82	-7.15
大连商品交易所 (DCE)	22.75	23.64	-3.77
韩国交易所 (KRX)	20.58	22.82	-9.80
德意志交易所集团 (DBG)	19.75	17.17	15.00
欧洲期货交易所 (Eurex)	19.56	17.03	14.83
欧洲能源交易所 (European Energy Exchange, EEX)	0.12	0.08	58.74
节点交易所 (Nodal Exchange)	0.07	0.06	8.15
上海期货交易所 (SHFE)	19.43	24.46	-20.54
上海期货交易所 (Shanghai Futures Exchange)	18.23	23.71	-23.09
上海国际能源交易中心 (Shanghai International Energy Exchange)	1.20	0.75	59.73
印度孟买证券交易所 (BSE)	16.09	16.08	0.09
印度孟买证券交易所 (BSE)	14.17	14.35	-1.27



续表

交易所/交易所集团	2022 年成交量 (亿手)	2021 年成交量 (亿手)	同比变化 (%)
印度孟买证券交易所 (India International Exchange)	1.92	1.72	11.43
迈阿密国际证券交易所集团 (MIAX)	12.99	13.38	-2.90
迈阿密期权交易所 (MIAX Options)	5.49	5.23	5.01
迈阿密珍珠交易所 (MIAX Pearl)	4.38	4.27	2.60
迈阿密绿宝石交易所 (MIAX Emerald)	3.12	3.89	-19.59
莫斯科交易所 (MOEX)	12.68	21.02	-39.65
多伦多证券交易所集团 (TMX Group)	7.61	6.13	24.12
波士顿期权交易所 (Boston Options Exchange)	6.10	4.63	31.84
蒙特利尔交易所 (Montreal Exchange)	1.50	1.50	0.31
香港交易所集团 (HKEX)	4.55	4.33	4.98
香港交易所 (Hong Kong Exchanges and Clearing)	3.21	2.88	11.26
伦敦金属交易所 (London Metal Exchange)	1.34	1.45	-7.50
日本交易所集团 (JPX)	3.92	3.34	17.54
大阪交易所 (Osaka Exchange)	3.90	3.30	18.22
东京商品交易所 (Tokyo Commodity Exchange)	0.02	0.04	-38.16
台湾期货交易所 (TAIFEX)	3.84	3.92	-1.97
阿根廷布宜诺斯艾利斯—罗萨里奥期货交易所 (MAT-ba ROFEX)	3.00	1.30	131.37
新加坡交易所 (SGX)	2.60	2.32	12.09
印度大宗商品交易所 (ICEX)	2.18	1.77	23.37
约翰内斯堡证券交易所 (JSE)	2.05	1.76	16.68
澳大利亚证券交易所集团 (ASX)	2.02	1.99	1.23
澳大利亚证券交易所 24 (ASX 24)	1.35	1.38	-1.74
澳大利亚证券交易所 (ASX)	0.66	0.61	7.89
泛欧交易所 (Euronext)	1.79	1.89	-5.51
泛欧交易所 (Euronext Derivatives Market)	1.52	1.64	-7.61
意大利证券交易所 (Borsa Italiana, IDEM)	0.27	0.25	8.29
中国金融期货交易所 (CFFEX)	1.52	1.22	24.44
泰国期货交易所 (TFEX)	1.36	1.35	0.98
东京金融交易所 (TFX)	1.05	0.68	55.59
特拉维夫证券交易所 (TASE)	0.39	0.39	0.45
西班牙期货交易所 (MEFF)	0.33	0.33	-0.24
印度大都会证券交易所 (MSE)	0.21	0.15	42.79
马来西亚衍生品交易所 (MDEX)	0.19	0.18	3.73

续表

交易所/交易所集团	2022 年成交量 (亿手)	2021 年成交量 (亿手)	同比变化 (%)
FairX 加密货币衍生品交易所 (FairX)	0.18	0.01	2 983.56
华沙证券交易所 (GPW)	0.16	0.12	30.11
墨西哥衍生品交易所 (MexDer)	0.10	0.08	26.35
布达佩斯证券交易所	0.09	0.08	14.14
雅典衍生品交易所 (ADEX)	0.09	0.12	-28.22
北美衍生品交易所 (Nadex)	0.08	0.10	-16.03
迪拜黄金及商品交易所 (DGCX)	0.08	0.07	16.44
印度国家商品及衍生品交易所 (NCDEX)	0.06	0.12	-51.40
LedgerX 加密货币衍生品交易所 (LedgerX)	0.05	0.06	-24.00
明尼阿波利斯谷物交易所 (MGEX)	0.03	0.04	-14.95
巴基斯坦商品交易所 (PMEX)	0.03	0.03	24.36
新加坡亚太交易所 (APEX)	0.02	0.04	-60.46
迪拜商业交易所 (DME)	0.01	0.01	10.82
印尼商品及衍生品交易所 (ICDX)	0.01	0.01	47.14
哥伦比亚证券交易所 (BVC)	0.01	0.01	20.99
小型交易所 (Small Exchange)	0.00	0.01	-38.03
CurveGlobal 利率衍生品交易所 (CurveGlobal)	0.00	0.09	-99.75
Bitnomial 加密货币衍生品交易所 (BTNL)	0.00	0.00	331.62
大阪堂岛商品交易所 (ODEX)	0.00	0.01	-99.98
澳大利亚 FEX 全球交易所 (FEX)	0.00	0.00	-46.67
印度商品交易所	0.00	0.00	-100.00

数据来源: FIA。

(三) 全球期货及其他场内衍生品交易品种成交量分布

由于期货和期权表现迥异,各个期货及其他场内衍生品交易品种在期货、期权市场的表现也值得关注。

1. 期货方面

2022 年全球期货各品种成交量情况见表 4。

表 4 2022 年全球期货各品种成交量情况

品种种类	2022 年成交量 (亿手)	2021 年成交量 (亿手)	同比变化 (%)
股指期货	80.13	78.69	1.83
个股期货	43.61	39.36	10.81
利率期货	43.16	37.89	13.92

续表

品种种类	2022 年成交量 (亿手)	2021 年成交量 (亿手)	同比变化 (%)
外汇期货	42.30	35.84	18.03
其他期货	23.74	22.18	7.00
农产品期货	21.31	26.33	-19.06
能源期货	18.04	25.48	-29.20
非贵金属期货	15.43	19.55	-21.08
贵金属期货	5.43	7.43	-26.93
期货合计	293.15	292.75	0.14

数据来源: FIA。

2022 年全球期货成交量品种分布见图 3。

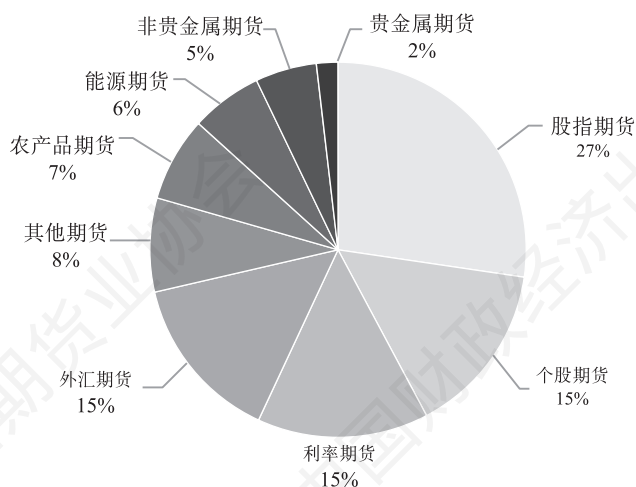


图 3 2022 年全球期货成交量品种分布

数据来源: FIA。

2. 期权方面

2022 年全球期货各品种成交量情况见表 5。

表 5 2022 年全球场内期权衍生品各品种成交量情况

品种种类	2022 年成交量 (亿手)	2021 年成交量 (亿手)	同比变化 (%)
股指期权	406.06	202.53	100.50
个股期权	88.55	98.01	-9.65
外汇期权	34.84	19.72	76.65
利率期权	8.30	7.89	5.22
能源期权	2.63	1.79	47.01
农产品期权	2.62	1.85	41.78
其他期权	1.24	0.65	92.15
非贵金属期权	0.88	0.50	75.06

续表

品种种类	2022年成交量（亿手）	2021年成交量（亿手）	同比变化（%）
贵金属期权	0.21	0.17	25.15
期权合计	545.32	333.09	63.71

数据来源：FIA。

2022年全球场内期权衍生品成交量品种分布见图4。

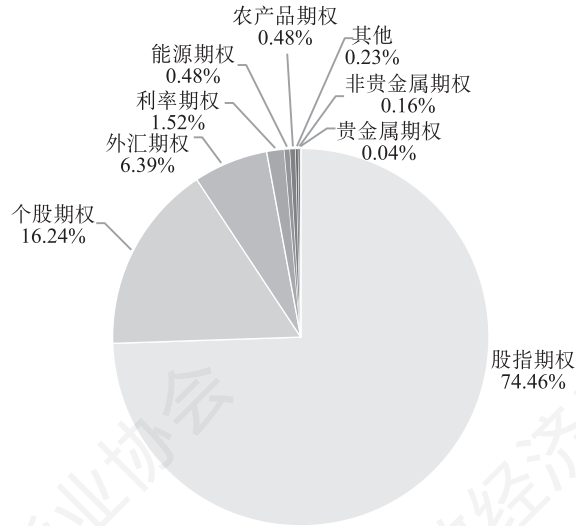


图4 2022年全球场内期权衍生品成交量品种分布

数据来源：FIA。

2021—2022年全球期货及其他场内衍生品各品种成交量对比见图5。

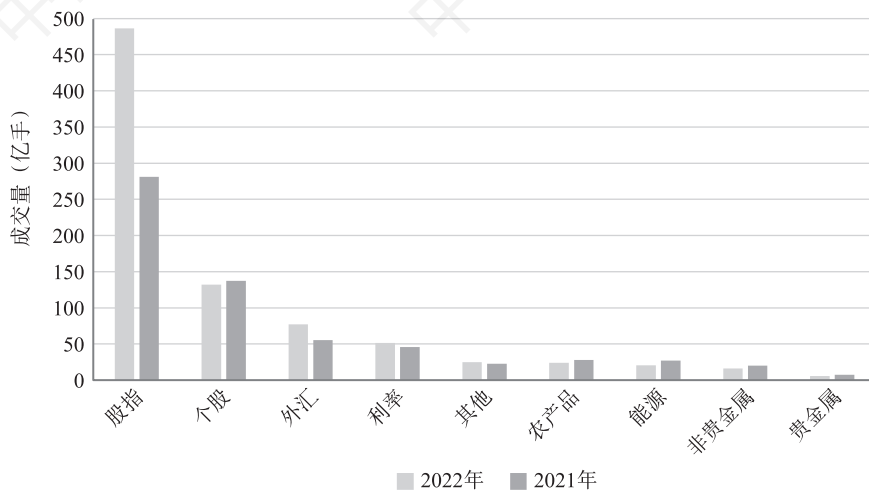


图5 2021—2022年全球期货及其他场内衍生品各品种成交量对比

数据来源：FIA。

2022 年全球期货及其他场内衍生品各品种成交量分布见图 6。

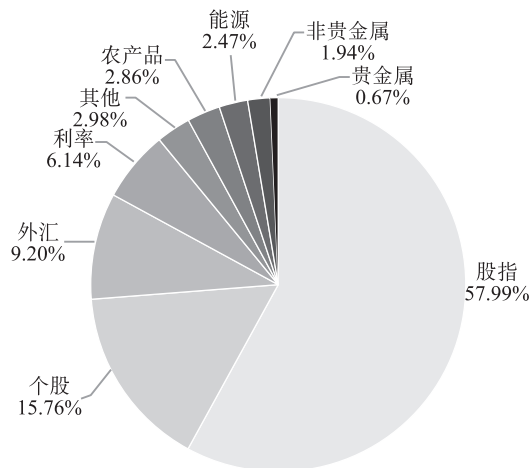


图 6 2022 年全球期货及其他场内衍生品各品种成交量分布

数据来源：FIA。

2022 年全球股票指数、利率、外汇、能源、农产品、金属期货及期权成交量排名前 5 位合约见表 6 ~ 表 11。

表 6 2022 年全球股票指数期货及期权成交量排名前 5 位合约

排名	交易品种	上市交易所	2022 年成交量 (手)	2021 年成交量 (手)	同比变化 (%)
1	银行 Nifty 指数期权	印度国民证券交易所 (NSE)	17 779 731 636	8 536 738 069	108.27
2	印度 CNX Nifty 指数期权	印度国民证券交易所 (NSE)	13 672 844 647	5 497 680 235	148.70
3	巴西迷你 Ibovespa 指数期货	巴西圣保罗证券期货交易所 (B3)	4 095 005 435	4 622 466 696	-11.41
4	Nifty 金融服务指数期权	印度国民证券交易所 (NSE)	1 118 457 216	7 182 326	15 472.35
5	标普 500 指数期权	芝加哥期权交易所集团 (旗下 CBOE)	558 418 890	344 700 599	62.00

数据来源：FIA。

表 7 2022 年全球利率期货及期权成交量排名前 5 位合约

排名	交易品种	上市交易所	2022 年成交量 (手)	2021 年成交量 (手)	同比变化 (%)
1	隔夜同业拆解利率期货	巴西圣保罗证券期货交易所 (B3)	656 637 806	654 265 238	0.36
2	10 年期美国国债期货	芝加哥商业交易所集团 (旗下 CBOT)	462 598 970	469 746 624	-1.52

续表

排名	交易品种	上市交易所	2022 年成交量 (手)	2021 年成交量 (手)	同比变化 (%)
3	3 月期 SOFR 利率期货	芝加哥商业交易所集团 (旗下 CME)	418 851 540	34 115 452	1 127.75
4	欧洲美元期货	芝加哥商业交易所集团 (旗下 CME)	394 589 787	610 431 078	-35.36
5	5 年期美国国债期货	芝加哥商业交易所集团 (旗下 CBOT)	326 810 568	281 860 840	15.95

数据来源: FIA。

表 8 2022 年全球外汇期货及期权成交量排名前 5 位合约

排名	交易品种	上市交易所	2022 年成交量 (手)	2021 年成交量 (手)	同比变化 (%)
1	美元/印度卢比期权	印度国民证券交易所 (NSE)	3 080 871 113	1 458 035 383	111.30
2	美元/印度卢比期货	印度国民证券交易所 (NSE)	1 063 201 931	664 212 770	60.07
3	迷你美元期货	巴西圣保罗证券期货交易所 (B3)	863 261 010	825 061 535	4.63
4	美元/俄罗斯卢布期货	莫斯科交易所 (MOEX)	587 166 808	786 281 346	-25.32
5	美元/印度卢比期货	印度孟买证券交易所 (BSE)	559 568 032	347 479 246	61.04

数据来源: FIA。

表 9 2022 年全球能源期货及期权成交量排名前 5 位合约

排名	交易品种	上市交易所	2022 年成交量 (手)	2021 年成交量 (手)	同比变化 (%)
1	Brent 原油期货	洲际交易所 (旗下 ICE Europe)	235 372 047	243 666 353	-3.40
2	燃料油期货	上海期货交易所 (SHFE)	210 455 099	276 993 809	-24.02
3	WTI 原油期货	芝加哥商业交易所集团 (旗下 NYMEX)	205 997 830	248 314 481	-17.04
4	石油沥青期货	上海期货交易所 (SHFE)	162 578 252	140 463 222	15.74
5	北美天然气期货	洲际交易所 (ICE U.S.)	153 325 323	132 086 711	16.08

数据来源: FIA。

表 10 2022 年全球农产品期货及期权成交量排名前 5 位合约

排名	交易品种	上市交易所	2022 年成交量 (手)	2021 年成交量 (手)	同比变化 (%)
1	豆粕期货	大连商品交易所 (DCE)	325 094 536	360 388 172	-9.79
2	棕榈油期货	大连商品交易所 (DCE)	241 582 846	226 614 036	6.61
3	豆油期货	大连商品交易所 (DCE)	183 506 353	229 383 502	-20.00
4	菜籽粕期货	郑州商品交易所 (ZCE)	144 878 671	268 927 210	-46.13
5	玉米期货	大连商品交易所 (DCE)	134 357 515	189 287 113	-29.02

数据来源: FIA。

表 11 2022 年全球金属期货及期权成交量排名前 5 位合约

排名	交易品种	上市交易所	2022 年成交量 (手)	2021 年成交量 (手)	同比变化 (%)
1	螺纹钢期货	上海期货交易所 (SHFE)	525 178 157	655 986 710	-19.94
2	铁矿石期货	大连商品交易所 (DCE)	221 120 805	174 412 025	26.78
3	白银期货	上海期货交易所 (SHFE)	188 771 497	231 457 606	-18.44
4	热轧卷板期货	上海期货交易所 (SHFE)	142 061 100	220 715 917	-35.64
5	铝期货	上海期货交易所 (SHFE)	99 975 095	131 457 870	-23.95

数据来源: FIA。

二、美国期货及其他场内衍生品市场发展概况

(一) 美国期货及其他场内衍生品成交量在各交易所的分布情况

2022 年, 美国期货及其他场内衍生品市场成交量为 166.57 亿手, 较 2021 年上升 9.36%, 占全球市场份额的 19.87%。

四大交易所集团, 芝加哥商业交易所集团 (CME Group)、芝加哥期权交易所集团 (CBOE Holdings)、纳斯达克集团 (NASDAQ Group 美国市场) 及洲际交易所

(ICE 美国市场)，在美国场内衍生品市场依旧占据领导地位，包揽了超过 80% 的成交量（见图 7）。

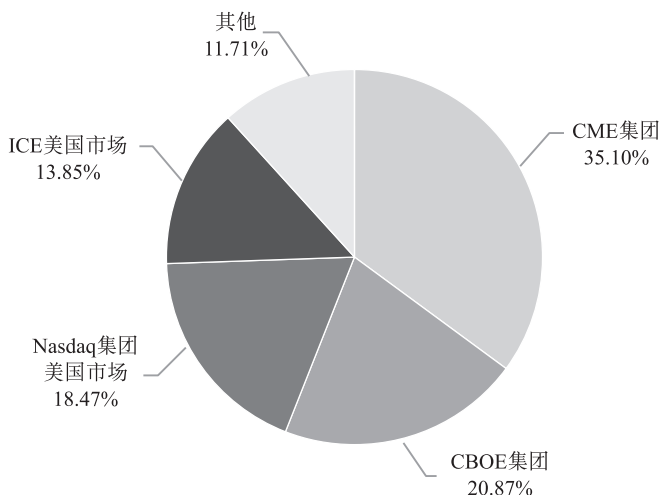


图 7 2022 年美国各主要交易所/交易所集团成交量分布

数据来源：FIA。

芝加哥商业交易所集团（CME Group）继续把持行业龙头位置，但占比有明显下滑，总成交量达到 58.46 亿手，同比上涨 18.28%，占美国期货及其他场内衍生品市场总成交量的 35.10%；该集团旗下芝加哥商品交易所（CME）和芝加哥期货交易所以（CBOT）在 2022 年成交量均有所增加，增幅分别为 32.36% 和 8.74%，而纽约商业交易所（NYMEX）和纽约商品交易所（COMEX）的成交量有所下降，降幅分别为 7.58% 和 6.11%。

2022 年美国主要交易所/交易所集团成交量情况见表 12。

表 12 2022 年美国市场各主要交易所/交易所集团成交量对比

交易所/交易所集团	2022 年成交量 (亿手)	2021 年成交量 (亿手)	同比变化 (%)
芝加哥商业交易所集团 (CME)	58.46	49.43	18.28
芝加哥商业交易所 (Chicago Mercantile Exchange)	32.63	24.65	32.36
芝加哥期货交易所以 (Chicago Board of Trade)	19.44	17.88	8.74
纽约商业交易所 (New York Mercantile Exchange)	5.14	5.56	-7.58
纽约商品交易所 (Commodity Exchange, COMEX)	1.25	1.33	-6.11
芝加哥期权交易所集团 (CBOE)	34.76	30.96	12.29
Cboe 期权交易所 (Cboe Options Exchange)	16.99	15.16	12.10
Cboe BZX 期权交易所 (Cboe BZX Options Exchange)	7.41	7.90	-6.19
Cboe EDGX 期权交易所 (Cboe EDGX Options Exchange)	5.74	3.64	57.82



续表

交易所/交易所集团	2022 年成交量 (亿手)	2021 年成交量 (亿手)	同比变化 (%)
Cboe C2 期权交易所 (Cboe C2 Options Exchange)	4.07	3.68	10.54
Cboe 期货交易所 (CBOE Futures Exchange)	0.55	0.58	-5.65
ErisX 数字交易所 (ErisX)	0.00	0.00	-61.10
纳斯达克集团 (NASDAQ Group)	30.76	32.26	-4.65
纳斯达克 PHLX 交易所 (Nasdaq PHLX)	11.17	11.60	-3.70
纳斯达克期权交易所 (Nasdaq Options Market)	7.64	7.62	0.35
纳斯达克 ISE 交易所 (Nasdaq ISE)	5.52	6.27	-11.94
纳斯达克 BX 期权交易所 (Nasdaq BX Options)	2.72	1.29	111.59
纳斯达克 GEMX 交易所 (Nasdaq GEMX)	2.18	3.99	-45.31
纳斯达克 MRX 交易所 (Nasdaq MRX)	1.53	1.51	1.47
洲际交易所 (ICE)	23.07	21.38	7.88
纽约证券交易所高增长板期权市场 (NYSE Arca)	11.92	10.55	13.00
纽约证券交易所泛美证券交易所 (NYSE Amex)	7.21	7.50	-3.89
洲际交易所美国分所 (ICE Futures U.S.)	3.94	3.33	18.17
迈阿密国际证券交易所集团 (MIAX)	12.99	13.38	-2.90
迈阿密期权交易所 (MIAX Options)	5.49	5.23	5.01
迈阿密珍珠交易所 (MIAX Pearl)	4.38	4.27	2.60
迈阿密绿宝石交易所 (MIAX Emerald)	3.12	3.89	-19.59
多伦多证券交易所集团 (TMX Group)	6.10	4.63	31.84
FairX 加密货币衍生品交易所 (FairX)	0.18	0.01	2 983.56
北美衍生品交易所 (Nadex)	0.08	0.10	-16.03
德意志交易所集团 (DBG)	0.07	0.06	8.15
LedgerX 加密货币衍生品交易所 (LedgerX)	0.05	0.06	-24.00
明尼阿波利斯谷物交易所 (MGEX)	0.03	0.04	-14.95
小型交易所 (Small Exchange)	0.00	0.01	-38.03
Bitnomial 加密货币衍生品交易所 (BTNL)	0.00	0.00	331.62

数据来源：FIA。

（二）美国期货及其他场内衍生品市场主要品种合约成交概况

2022 年全球六个品种合约成交量前 20 位排行榜中，来自美国市场的合约占据了较多位置。其中，芝加哥商业交易所集团（CME Group）的合约占据了美国市场合约排名中的绝大多数位置，且各自分工明确：芝加哥商业交易所（CME）在股指、外汇方面表现突出，芝加哥期货交易所（CBOT）是农产品、利率市场的巨头，纽约商业交易所（NYMEX）在能源领域占据重要地位，而金属合约品种排名中，

纽约商品交易所（COMEX）上市的品种合约有一定优势。

表 13 2022 年美国股指合约成交量排名进入全球前 20 位情况

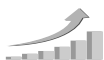
排名	交易品种	上市交易所	2022 年成交量 (手)	2021 年成交量 (手)	同比变化 (%)
5	标普 500 指数期权	芝加哥期权交易所集团（旗下 CBOE）	558 418 890	344 700 599	62.00
8	电子迷你标普 500 指数期货	芝加哥商业交易所集团（旗下 CME）	503 953 011	403 640 014	24.85
9	微型电子迷你纳斯达克 100 指数期货	芝加哥商业交易所集团（旗下 CME）	364 950 140	239 115 577	52.62
10	微型电子迷你标普 500 指数期货	芝加哥商业交易所集团（旗下 CME）	343 974 047	218 602 634	57.35
17	电子迷你纳斯达克指数期货	芝加哥商业交易所集团（旗下 CME）	176 874 262	140 406 331	25.97
18	电子迷你标普 500 指数期权	芝加哥商业交易所集团（旗下 CME）	148 165 159	83 666 476	77.09
19	CBOE 波动率指数期权	芝加哥期权交易所集团（旗下 CBOE）	133 663 358	131 664 284	1.52

注：本排名不包括 ETF 基金期货及期权。

数据来源：FIA。

表 14 2022 年美国利率合约成交量排名进入全球前 20 位情况

排名	交易品种	上市交易所	2022 年成交量 (手)	2021 年成交量 (手)	同比变化 (%)
2	10 年期美国国债期货	芝加哥商业交易所集团（旗下 CBOT）	462 598 970	469 746 624	-1.52
3	3 月期 SOFR 利率期货	芝加哥商业交易所集团（旗下 CME）	418 851 540	34 115 452	1 127.75
4	欧洲美元期货	芝加哥商业交易所集团（旗下 CME）	394 589 787	610 431 078	-35.36
5	5 年期美国国债期货	芝加哥商业交易所集团（旗下 CBOT）	326 810 568	281 860 840	15.95
8	2 年期美国国债期货	芝加哥商业交易所集团（旗下 CBOT）	169 859 549	115 497 784	47.07
9	10 年期美国国债期权	芝加哥商业交易所集团（旗下 CBOT）	164 562 163	159 684 869	3.05
11	欧洲美元期权	芝加哥商业交易所集团（旗下 CME）	143 316 865	64 034 656	123.81



续表

排名	交易品种	上市交易所	2022 年成交量 (手)	2021 年成交量 (手)	同比变化 (%)
14	3 月期 SOFR 利率期权	芝加哥商业交易所集团 (旗下 CME)	110 381 998	8 956	1 232 392.16
15	30 年期美国国债期货	芝加哥商业交易所集团 (旗下 CBOT)	97 395 496	113 446 877	-14.15
16	10 年超长期美国国债期货	芝加哥商业交易所集团 (旗下 CBOT)	95 651 184	93 791 008	1.98
18	联邦基金期货	芝加哥商业交易所集团 (旗下 CBOT)	83 830 540	27 474 138	205.13
20	欧洲美元 Mid - Curve 期权	芝加哥商业交易所集团 (旗下 CME)	65 828 332	202 913 484	-67.56

数据来源: FIA。

表 15 2022 年美国外汇合约成交量排名进入全球前 20 位情况

排名	交易品种	上市交易所	2022 年成交量 (手)	2021 年成交量 (手)	同比变化 (%)
12	欧元期货	芝加哥商业交易所集团 (旗下 CME)	61 532 694	49 200 550	25.07
14	日元期货	芝加哥商业交易所集团 (旗下 CME)	39 570 152	27 101 037	46.01
16	英镑期货	芝加哥商业交易所集团 (旗下 CME)	31 235 384	24 246 009	28.83
19	澳元期货	芝加哥商业交易所集团 (旗下 CME)	25 495 794	24 590 713	3.68

数据来源: FIA。

表 16 2022 年美国能源合约成交量排名进入全球前 20 位情况

排名	交易品种	上市交易所	2022 年成交量 (手)	2021 年成交量 (手)	同比变化 (%)
3	WTI 原油期货	芝加哥商业交易所集团 (旗下 NYMEX)	205 997 830	248 314 481	-17.04
5	北美天然气期货	洲际交易所 (ICE U.S.)	153 325 323	132 086 711	16.08
7	亨利港天然气期货	芝加哥商业交易所集团 (旗下 NYMEX)	85 875 540	97 588 795	-12.00
14	RBOB 汽油期货	芝加哥商业交易所集团 (旗下 NYMEX)	41 039 130	47 837 998	-14.21

续表

排名	交易品种	上市交易所	2022年成交量 (手)	2021年成交量 (手)	同比变化 (%)
16	取暖油期货	芝加哥商业交易所集团(旗下NYMEX)	39 668 782	38 711 497	2.47
19	WTI 微型原油期货	芝加哥商业交易所集团(旗下NYMEX)	30 080 874	8 368 659	259.45
20	原油期权	芝加哥商业交易所集团(旗下NYMEX)	28 931 828	30 006 061	-3.58

数据来源：FIA。

表 17 2022 年美国农产品合约成交量排名进入全球前 20 位情况

排名	交易品种	上市交易所	2022年成交量 (手)	2021年成交量 (手)	同比变化 (%)
11	玉米期货	芝加哥商业交易所集团(旗下CBOT)	77 881 115	86 901 950	-10.38
13	大豆期货	芝加哥商业交易所集团(旗下CBOT)	51 720 820	53 324 458	-3.01
17	11 号白糖期货	洲际交易所(ICE)	32 750 113	31 002 757	5.64
20	豆油期货	芝加哥商业交易所集团(旗下CBOT)	30 052 077	32 675 376	-8.03

数据来源：FIA。

表 18 2022 年美国金属合约成交量排名进入全球前 20 位情况

排名	交易品种	上市交易所	2022年成交量 (手)	2021年成交量 (手)	同比变化 (%)
8	黄金期货	芝加哥商业交易所集团(旗下COMEX)	54 261 767	58 464 997	-7.19

数据来源：FIA。

三、欧洲期货及其他场内衍生品市场发展概况

(一) 欧洲期货及其他场内衍生品成交量在各交易所的分布情况

2022年，欧洲期货及其他场内衍生品市场成交量有所下降，与2021年相比，跌幅为11.91%，成交量为48.03亿手。

欧洲市场主要的交易所/交易所集团分别为德意志交易所集团（DBG）、莫斯科交易所（MOEX）、洲际交易所（ICE 欧洲市场）、泛欧交易所（Euronext）、伦敦金属交易所（LME）以及纳斯达克集团（NASDAQ Group 欧洲市场）等（见图8）。

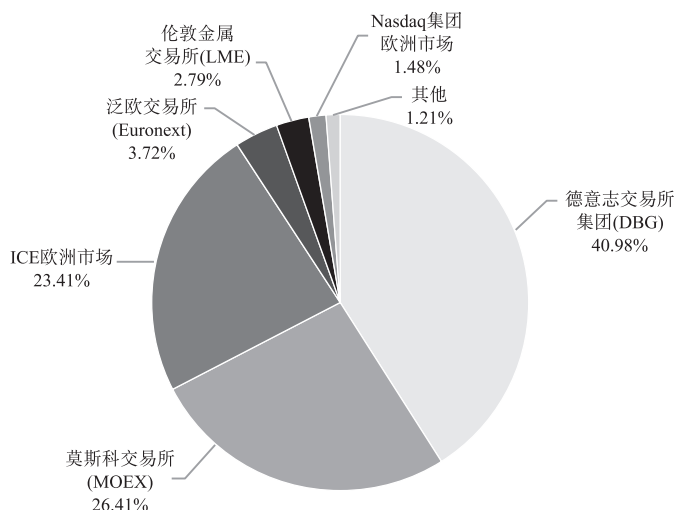


图8 2022年欧洲主要交易所/交易所集团成交量分布

数据来源：FIA。

其中，德意志交易所集团（DBG）、莫斯科交易所（MOEX）和洲际交易所（ICE 欧洲市场）这三大交易所/交易所集团的成交量份额占欧洲市场总成交量的90.80%。2022年德意志交易所集团成交量涨幅15.03%，至19.68亿手，在欧洲市场中位列第一，占比40.98%。莫斯科交易所成交量跌幅较大，同比下降39.65%，至12.68亿手，位列第二，占比为26.41%。而洲际交易所集团欧洲市场以11.24亿手的成交量在欧洲市场中位列第三，占比为23.41%。

2022年欧洲主要交易所/交易所集团成交量情况见表19。

表19 2022年欧洲主要交易所/交易所集团成交量情况

交易所/交易所集团	2022年成交量 (亿手)	2021年成交量 (亿手)	同比变化 (%)
德意志交易所集团 (DBG)	19.68	17.11	15.03
欧洲期货交易所 (Eurex)	19.56	17.03	14.83
欧洲能源交易所 (European Energy Exchange, EEX)	0.12	0.08	58.74
莫斯科交易所 (MOEX)	12.68	21.02	-39.65
洲际交易所 (ICE)	11.24	11.76	-4.42
洲际交易所欧洲分所 (ICE Futures Europe)	10.71	11.14	-3.88
洲际交易所欧洲大陆能源交易所 (ICE Endex)	0.53	0.62	-14.06
泛欧交易所 (Euronext)	1.79	1.89	-5.51
泛欧交易所 (Euronext Derivatives Market)	1.52	1.64	-7.61
意大利证券交易所 (Borsa Italiana, IDEM)	0.27	0.25	8.29
伦敦金属交易所 (LME)	1.34	1.45	-7.50

续表

交易所/交易所集团	2022年成交量 (亿手)	2021年成交量 (亿手)	同比变化 (%)
纳斯达克集团 (NASDAQ Group)	0.71	0.66	6.97
纳斯达克北欧交易所 (Nasdaq Exchanges Nordic Markets)	0.71	0.66	7.40
纳斯达克商品交易所 (Nasdaq Commodities)	0.00	0.01	-46.27
西班牙期货交易所 (MEFF)	0.33	0.33	-0.24
华沙证券交易所 (GPW)	0.16	0.12	30.11
布达佩斯证券交易所	0.09	0.08	14.14

数据来源：FIA。

(二) 欧洲期货及其他场内衍生品市场主要品种合约成交概况

2022年欧洲市场各品种合约的表现基本延续了2021年的表现，除了农产品合约外，其他品种均有进入全球成交量前20位的合约。表20至表24依次列出了在股指类、利率类、外汇类、能源类及金属类品种成交量全球排名前20位中欧洲市场的情况。

表 20 2022年欧洲股指合约成交量排名进入全球前20位情况

排名	交易品种	上市交易所	2022年成交量 (手)	2021年成交量 (手)	同比变化 (%)
11	欧洲 Stoxx 50 指数 期货	德意志交易所集团 (旗下 Eurex)	285 374 104	223 870 918	27.47
14	欧洲 Stoxx 50 指数 期权	德意志交易所集团 (旗下 Eurex)	246 750 813	227 092 142	8.66

数据来源：FIA。

表 21 2022年欧洲利率合约成交量排名进入全球前20位情况

排名	交易品种	上市交易所	2022年成交量 (手)	2021年成交量 (手)	同比变化 (%)
6	3月期欧元同业拆借利率 (Euribor) 期货	洲际交易所 (旗下 ICE Europe)	282 744 713	186 747 304	51.40
7	长期欧元债券期货	德意志交易所集团 (旗下 Eurex)	216 253 462	202 679 077	6.70
10	中期欧元债券期货	德意志交易所集团 (旗下 Eurex)	158 390 078	124 722 358	26.99
12	短期欧元债券期货	德意志交易所集团 (旗下 Eurex)	142 374 584	85 564 863	66.39
19	3月期英镑隔夜指数平均 (SONIA) 期货	洲际交易所 (ICE Europe)	71 446 563	33 718 180	111.89

数据来源：FIA。

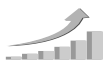


表 22 2022 年欧洲外汇合约成交量排名进入全球前 20 位情况

排名	交易品种	上市交易所	2022 年成交量 (手)	2021 年成交量 (手)	同比变化 (%)
4	美元/俄罗斯卢布期货	莫斯科交易所 (MOEX)	587 166 808	786 281 346	-25.32
15	欧元/俄罗斯卢布期货	莫斯科交易所 (MOEX)	32 005 028	51 506 136	-37.86
17	欧元/美元期货	莫斯科交易所 (MOEX)	26 148 718	38 695 412	-32.42

数据来源: FIA。

表 23 2022 年欧洲能源合约成交量排名进入全球前 20 位情况

排名	交易品种	上市交易所	2022 年成交量 (手)	2021 年成交量 (手)	同比变化 (%)
1	Brent 原油期货	洲际交易所 (旗下 ICE Europe)	235 372 047	243 666 353	-3.40
6	Brent 原油期货	莫斯科交易所 (MOEX)	88 531 089	579 590 791	-84.73
9	汽油期货	洲际交易所 (旗下 ICE Europe)	61 735 509	82 713 016	-25.36
11	WTI 原油期货	洲际交易所 (旗下 ICE Europe)	46 113 505	51 721 597	-10.84
13	荷兰 TTF 天然气期货	洲际交易所 (旗下 ICE Endex)	41 607 968	39 310 020	-5.52
17	亨利港天然气期货	莫斯科交易所 (MOEX)	34 019 888	15 876 019	114.28
18	Brent 原油期货	洲际交易所 (旗下 ICE Europe)	31 480 762	29 017 774	8.49

数据来源: FIA。

表 24 2022 年欧洲金属合约成交量排名进入全球前 20 位情况

排名	交易品种	上市交易所	2022 年成交量 (手)	2021 年成交量 (手)	同比变化 (%)
11	铝期货	香港交易所集团 (旗下 LME)	52 047 727	57 670 339	-9.75
19	A 级铜期货	香港交易所集团 (旗下 LME)	29 377 190	29 691 402	-1.06

数据来源: FIA。

四、亚太地区期货及其他场内衍生品市场发展概况

（一）中国境内、香港和台湾地区

中国境内地区以商品期货交易为主，2022年成交量有所下跌，降幅9.93%，至74.73亿手。中国香港地区和中国台湾地区以金融期货、期权交易为主。

中国境内地区，郑州商品交易所成交量下降7.15%，至23.98亿手，位列全球第8位；大连商品交易所成交量下降3.77%，至22.75亿手，位列全球第9位；上海期货交易所（包含上海国际能源交易中心）成交量下降20.54%，至19.43亿手，位列全球第12位；中国金融期货交易所成交量增长24.44%，至1.52亿手，位列全球第26位；广州期货交易所于2022年12月上市工业硅期货，成交量19.36万手（见表25）。

此外，台湾期货交易所成交量同比下降1.97%，至3.21亿手，在全球交易所成交量位列全球第19位；香港交易所成交量3.21亿手，同比上升11.26%。

表 25 2022年中国境内、香港和台湾地区主要交易所成交量情况

全球排名	交易所	2022年成交量	2021年成交量	同比变化 (%)
8	郑州商品交易所 (ZCE)	23.98 亿手	25.82 亿手	-7.15
9	大连商品交易所 (DCE)	22.75 亿手	23.64 亿手	-3.77
12	上海期货交易所 (SHFE)	19.43 亿手	24.46 亿手	-20.54
19	台湾期货交易所 (TAIFEX)	3.84 亿手	3.92 亿手	-1.97
—	香港交易所集团 (HKEX)	3.21 亿手	2.88 亿手	11.26
26	中国金融期货交易所 (CFFEX)	1.52 亿手	1.22 亿手	24.44
—	广州期货交易所 (GFEX)*	193 636 手	—	

注：*香港交易所集团在全球交易所集团排名第17位，其中包含香港交易所和伦敦金属交易所。

数据来源：FIA、各交易所网站。

（二）亚太其他地区主要交易所成交量概况（印度、韩国、日本、新加坡、澳大利亚、泰国）

2022年，亚太其他市场期货及其他场内衍生品市场中，大部分国家成交量出现增长。其中，印度市场成交量同比增加109.62%，日本市场成交量同比增加23.76%，新加坡市场成交量同比增加10.84%。韩国市场出现下滑，成交量同比下降9.80%（见表26）。

2022年，印度市场在股指和外汇品种中均有表现十分出彩的合约。其中，印度国家证券交易所（NSE）的银行指数期权合约成交量同比增长108.27%，至177.80亿手，在全球股指类合约中位列第一，美元/印度卢比期权合约成交量同比增长111.30%，



表 26 2022 年亚太其他国家主要交易所/交易所集团成交量情况

国家	交易所	2022 年成交量 (亿手)	2021 年成交量 (亿手)	同比变化 (%)
印度	印度国民证券交易所 (NSE)	381.14	172.55	120.88
	印度孟买证券交易所 (BSE)	16.09	16.08	0.09
	印度大宗商品交易所 (ICEX)	2.18	1.77	23.37
	印度大都会证券交易所 (MSE)	0.21	0.15	42.79
	印度国家商品及衍生品交易所 (NC-DEX)	0.06	0.12	-51.40
	印度商品交易所	0.00	0.00	-100.00
韩国	韩国交易所 (KRX)	20.58	22.82	-9.80
日本	日本交易所集团 (JPX)	3.92	3.34	17.54
	东京金融交易所 (TFX)	1.05	0.68	55.59
	大阪堂岛商品交易所 (ODEX)	0.00	0.01	-99.98
新加坡	新加坡交易所 (SGX)	2.60	2.32	12.09
	新加坡亚太交易所 (APEX)	0.02	0.04	-60.46
澳大利亚	澳大利亚证券交易所集团 (ASX)	2.02	1.99	1.23
	澳大利亚 FEX 全球交易所 (FEX)	0.00	0.00	-46.67
泰国	泰国期货交易所 (TFEX)	1.36	1.35	0.98
马来西亚	马来西亚衍生品交易所 (MDEX)	0.19	0.18	3.73

数据来源: FIA。

至 30.81 亿手, 在全球外汇类合约中位列第一。而在能源和金属品种中, 印度市场也有进入全球前 20 位的品种合约。2022 年印度合约成交量排名进入全球前 20 位情况见表 27。

表 27 2022 年印度合约成交量排名进入全球前 20 位情况

类别	排名	品种	上市交易所	2022 年成交量 (手)	2021 年成交量 (手)	同比变化 (%)
股指	1	银行 Nifty 指数期权	印度国民证券交易所 (NSE)	17 779 731 636	8 536 738 069	108.27
	2	印度 CNX Nifty 指数期权	印度国民证券交易所 (NSE)	13 672 844 647	5 497 680 235	148.70
	4	Nifty 金融服务指数期权	印度国民证券交易所 (NSE)	1 118 457 216	7 182 326	15 472.35
	6	标普 Sensex 指数期权	印度孟买证券交易所 (BSE)	526 191 077	614 527 737	-14.37
	16	印度 50 指数期权	印度孟买证券交易所 (旗下 India INX)	182 583 048	166 689 177	9.54

续表

类别	排名	品种	上市交易所	2022 年成交量 (手)	2021 年成交量 (手)	同比变化 (%)
外汇	1	美元/印度卢比期权	印度国民证券交易所 (NSE)	3 080 871 113	1 458 035 383	111.30
	2	美元/印度卢比期货	印度国民证券交易所 (NSE)	1 063 201 931	664 212 770	60.07
	5	美元/印度卢比期货	印度孟买证券交易所 (BSE)	559 568 032	347 479 246	61.04
	6	美元/印度卢比期权	印度孟买证券交易所 (BSE)	326 857 171	426 595 296	-23.38
	9	英镑/印度卢比期货	印度国民证券交易所 (NSE)	85 715 715	83 295 871	2.91
	10	欧元/印度卢比期货	印度国民证券交易所 (NSE)	73 715 804	44 750 790	64.73
	18	日元/印度卢比期货	印度国民证券交易所 (NSE)	25 881 415	14 081 051	83.80
能源	8	原油期货	印度大宗商品交易所 (ICEX)	68 523 274	15 798 979	333.72
金属	9	微型白银期货	印度大宗商品交易所 (ICEX)	52 632 005	47 357 929	11.14

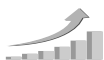
数据来源：FIA。

五、其他国家期货及其他场内衍生品市场发展概况

根据 FIA 公布的 2022 年成交量数据，其他国家的期货及其他场内衍生品市场（包括巴西、土耳其、阿根廷、南非和以色列）的交易所成交表现中，巴西圣保罗证券期货交易所（B3）同比下降 5.05%，至 83.14 亿手，在全球排名中位列第 2 位；土耳其伊斯坦布尔交易所（BIST）同比上涨 31.03%，至 27.27 亿手，位列第 7 位；阿根廷布宜诺斯艾利斯—罗萨里奥期货交易所（MATba - ROFEX）同比上涨 131.37%，至 3.00 亿手，位列第 20 位；南非约翰内斯堡证券交易所（JSE）同比上涨 16.68%，至 2.05 亿手，位列第 23 位；以色列特拉维夫证券交易所（TASE）同比上涨 0.45%，至 0.39 亿手，位列第 29 位（见表 28）。

表 28 2022 年其他国家期货及其他场内衍生品交易所成交量

全球排名	交易所	2022 年成交量 (亿手)	2021 年成交量 (亿手)	同比变化 (%)
2	巴西圣保罗证券期货交易所（B3）	83.14	87.56	-5.05



续表

全球排名	交易所	2022 年成交量 (亿手)	2021 年成交量 (亿手)	同比变化 (%)
7	土耳其伊斯坦布尔交易所 (BIST)	27.27	20.81	31.03
20	阿根廷布宜诺斯艾利斯—罗萨里奥期货交易所 (MATba ROFEX)	3.00	1.30	131.37
23	南非约翰内斯堡证券交易所 (JSE)	2.05	1.76	16.68
29	以色列特拉维夫证券交易所 (TASE)	0.39	0.39	0.45

数据来源：FIA。

在交易品种方面，巴西圣保罗证券期货交易所（B3）的金融类衍生品成交量排名靠前。股指类合约中，巴西圣保罗证券期货交易（B3）Bovespa 迷你期货成交量同比下降 11.41%，达到 40.95 亿手，位列全球股指类合约成交量排名第 3 位；利率类合约中，巴西圣保罗证券期货交易（B3）的 1 天期银行间存款期货和 1 天期银行间存款平均指数期权的成交量分别为 6.56 亿手和 0.91 亿手，位列全球利率类合约成交量排名第 1 位和第 17 位。外汇类合约中，巴西圣保罗证券期货交易（B3）的迷你美元期货成交量同比增长 4.63%，至 8.63 亿手，位列全球外汇类合约成交量排名第 3 位（见表 29）。

表 29 2022 年其他国家市场合约成交量排名进入全球前 20 位情况

类别	排名	品种	上市交易所	2022 年成交量 (手)	2021 年成交量 (手)	同比变化 (%)
股指	3	巴西迷你 Ibovespa 指数期货	巴西圣保罗证券期货交易所 (B3)	4 095 005 435	4 622 466 696	-11.41
利率	1	1 天期银行间存款期货	巴西圣保罗证券期货交易所 (B3)	656 637 806	654 265 238	0.36
	13	Ledes Bond	阿根廷布宜诺斯艾利斯—罗萨里奥期货交易所 (MATba ROFEX)	123 600 000	15 901 300	677.29
	17	1 天期银行间存款平均指数期权	巴西圣保罗证券期货交易所 (B3)	90 766 883	142 423 687	-36.27
外汇	3	迷你美元期货	巴西圣保罗证券期货交易所 (B3)	863 261 010	825 061 535	4.63
	7	美元期货	阿根廷布宜诺斯艾利斯—罗萨里奥期货交易所 (MATba ROFEX)	173 766 952	110 753 360	56.90
	11	美元/巴西雷亚尔期货	巴西圣保罗证券期货交易所 (B3)	67 537 340	70 925 462	-4.78

续表

类别	排名	品种	上市交易所	2022年成交量 (手)	2021年成交量 (手)	同比变化 (%)
外汇	13	土耳其里拉/美元 期货	伊斯坦布尔交易所 (BIST)	58 810 016	84 828 671	-30.67
	20	美元/南非兰特期货	约翰内斯堡证券交易所 (JSE)	25 373 920	23 502 088	7.96
金属	9	黄金期货	伊斯坦布尔交易所 (BIST)	39 005 008	93 557 193	-58.31

数据来源：FIA。

六、全球场外衍生品市场发展概况

场外衍生品市场是全球金融市场的重要组成部分，其合约制定及交易的灵活性受到广大投资者及投资机构的认可与欢迎。国际结算银行（Bank for International Settlements, BIS）收集全球各地区央行关于场外衍生品市场交易的数据，每半年公布相关统计结果，旨在为市场持续提供较全面的关于场外衍生品市场规模及市场结构的信息。现已有 63 家央行向国际结算银行提供相关数据。

国际结算银行每半年公布的数据中包括场外衍生品市场未结算交易的合约面值及市场总值。其中，合约面值，是指截至报告日，已经发生但仍未到期结算的所有交易的合约总面值，通过合约面值的数据可以了解场外衍生品交易的市场规模；而合约市场总值则是所有开仓合约的绝对价值总和，即如果重新购买该合约需要付出的成本。

从表 30 中可以看出，截至 2022 年 6 月底，国际结算银行统计的全球场外衍生品市场未结算交易的合约面值为 632.24 万亿美元，比 2021 年 12 月底增加 5.65%。利率类场外衍生品仍是场外市场的最主要合约品种，截至 2022 年 6 月，场外利率合约未结算交易的合约面值为 502.59 万亿美元，在整个场外衍生品市场中占比 79.49%，占有绝对的主导地位（见表 31、图 9）；其次是外汇类合约，份额为 17.33%（见表 32）。

表 30 2019—2022 年场外衍生品市场未结算交易合约面值（单位：十亿美元）

品种种类	2022年6月	2021年12月	2021年6月	2020年12月	2020年6月	2019年12月
利率	502 586	475 271	488 099	466 494	495 141	448 966
外汇	109 587	104 249	102 471	97 549	93 811	92 179
信用	9 542	9 061	9 121	8 649	9 050	8 119
股票相关	6 988	7 280	7 506	7 084	6 457	6 874
商品	2 962	2 218	2 453	2 051	2 099	2 129
其他	574	337	347	227	262	246
合计	632 238	598 416	609 996	582 055	606 821	558 513

数据来源：国际结算银行（BIS）。

表 31 2022 年 6 月底利率类场外衍生品未结算交易合约面值细分情况

(单位: 十亿美元)

合约类型	美元	欧元	日元	英镑	瑞士法郎	加拿大元	瑞典克朗	其他	总计
远期利率协议	14 687	30 269	31	110	10	83	1 549	2 619	49 358
利率掉期	168 907	104 758	21 350	32 741	3 174	17 118	4 174	62 002	414 223
期权	20 275	14 569	1 118	2 039	20	40	90	647	38 798
总计	203 870	149 596	22 499	34 890	3 203	17 240	5 812	65 476	502 586

数据来源: 国际结算银行 (BIS)。

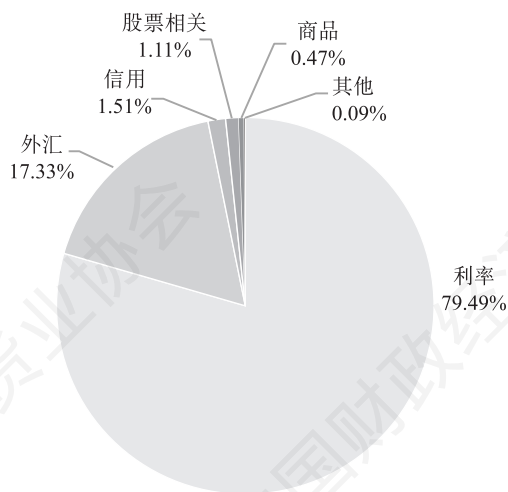


图 9 2022 年 6 月底场外衍生品市场各品种未结算交易合约面值分布

数据来源: 国际结算银行 (BIS)。

表 32 2022 年 6 月底外汇类场外衍生品未结算交易合约面值细分情况

(单位: 十亿美元)

合约类型	美元	欧元	日元	英镑	瑞士法郎	加拿大元	瑞典克朗	其他	总计
远期及外汇掉期	59 223	18 516	8 590	7 235	3 422	3 372	1 329	30 980	66 333
货币互换	26 246	11 760	4 532	5 043	1 212	2 026	651	9 091	30 280
期权	10 978	4 203	2 364	886	560	764	94	6 051	12 951
总计	96 448	34 479	15 487	13 164	5 194	6 161	2 075	46 166	109 587

数据来源: 国际结算银行 (BIS)。

截至 2022 年 6 月底, 各类信用违约掉期和与股票相关类场外衍生品未结算合约面值情况见表 33、表 34。

表 33 2022 年 6 月底各类信用违约掉期场外衍生品未结算交易合约面值

(单位：十亿美元)

合约类型	报告交易商	其他金融机构						非金融机构	总计
		CCPs	银行和证券公司	保险和财务担保公司	SPVs、SPCs 和 SPEs	对冲基金	其他		
信用违约掉期	1 178	8 013	6 129	828	120	83	391	462	9 316

数据来源：国际结算银行（BIS）。

表 34 2022 年 6 月底各股票相关类场外衍生品未结算交易合约面值

(单位：十亿美元)

合约类型	美国股票	欧洲股票	日本股票	其他亚洲国家股票	拉美国家股票	其他	总计
远期和互换	1 414	1 124	180	264	233	298	3 512
期权	2 035	831	52	97	112	349	3 476
总计	3 449	1 955	232	361	345	647	6 988

数据来源：国际结算银行（BIS）。

>>> 第二节 全球期货及其他衍生品行业发展概况

一、全球期货及其他衍生品市场主体类别

鉴于美国衍生品市场是全球范围内历史较为悠久、发展相对成熟和开放的市场之一，参考美国市场主体的设置可以对全球衍生品行业机构的情况有基本了解。2008 年金融危机发生后，美国不断加强对衍生品市场的监管。此前在美国商品期货交易委员会（CFTC）注册的市场主体主要为衍生品中介机构，其中包括：业务代理机构，如期货佣金商（FCM）、场内经纪商（FB）以及场内交易商（FT）；客户开发机构，如介绍经纪商（IB）和助理中介人（AP）；管理服务型中介机构，如商品交易顾问（CTA）以及商品基金经理（CPO）。2010 年 11 月 23 日，美国商品期货交易委员会（CFTC）建议新增掉期交易商（SD）以及掉期交易大户（MSP）两项注册类别，以期加强对参与掉期交易相关机构的监管。随着《多德 - 弗兰克法案》的逐步实施，交易主体如指定合约交易市场（DCM）、掉期执行系统（SEF）与海外交易平台（FBOT）；结算主体如衍生品结算机构（DCO），以及掉期数据库（SDR）等被逐步列为美国商品期货交易委员会的监管主体。

美国商品期货交易委员会（CFTC）《2022 年财务信息汇报》中公布的监管主体数据如表 35 所示。注册中介机构中，场内经纪商（FB）和场内交易商（FT）数量分别同比下降了 57.81% 和 75.27%。



表 35 美国商品期货交易委员会（CFTC）监管下市场主体注册数据

	数据截至 2022 年 9 月
交易主体	
指定合约交易市场（Designated Contract Market, DCM）	16
掉期执行系统（Swap Execution Facility, SEF）	19
海外交易平台（Foreign Board of Trade, FBOT）	24
结算主体	
衍生品结算机构（Derivatives Clearing Organization, DCO）	15
免税衍生品结算机构（Exempt Derivatives Clearing Organization, Exempt DCO）	4
系统重要性衍生品结算机构（Systemically Important DCO, SIDCO）	2
数据存储库	
掉期数据库（Swap Data Repository, SDR）	4
注册期货业协会	
全国期货业协会（National Futures Association, NFA）	1
注册中介机构	
期货佣金商（FCM）	58
掉期交易大户（MSP）	0
外汇零售商（RFED）	4
掉期交易商（SD）	107
商品基金经理（CPO）	1 256
商品交易顾问（CTA）	1 686
助理中介人（AP）	42 790
介绍经纪商（IB）	993
场内经纪商（FB）	1 086
场内交易商（FT）	114

数据来源：美国商品期货交易委员会（CFTC）《2022 年财务信息汇报》。

二、期货佣金商（FCM）发展概况

（一）2022 年主要期货佣金商客户权益情况对比

根据美国商品期货交易委员会（CFTC）公布的 2022 年 12 月 31 日期货佣金商（FCM）客户权益数据显示，2022 年，摩根大通证券继续位居客户权益第一位。近年来主要期货佣金商仍是以综合性投资银行为主，如摩根大通、高盛、摩根士丹利等综合性跨国投资银行，这些机构资金实力雄厚，业务多元化，是全球金融市场的主要参与者。其中大多数机构既是美国商品期货交易委员会注册的期货佣金商，也是美国证券交易委员会注册的证券经纪商。2013 年，美国商品期货交易委员会新增了掉期交易商的注册，高盛、摩根大通、摩根士丹利、花旗及瑞穗证券美国公司等

率先进行注册，展开掉期交易商的业务，在榜单中，专业型期货佣金商如艾地盟的客户权益排名稳定地维持在前十位（见表36）。

表 36 2022 年美国期货佣金商客户权益排名前 20 位

2022 年排名	期货佣金商 (FCM) 公司名称	注册类别	2022 年客户权益 (亿美元)	2022 年净资本 (亿美元)	2021 年排名	2021 年客户权益 (亿美元)
1	摩根大通证券 (JP MORGAN SECURITIES LLC)	FCM BD SD	429.72	249.89	1	524.78
2	高盛 (GOLDMAN SACHS & CO LLC)	FCM BD SD	377.13	222.14	2	363.80
3	摩根士丹利 (MORGAN STANLEY & CO LLC)	FCM BD SD	276.77	172.24	3	244.47
4	美国银行证券 (BOFA SECURITIES INC)	FCM BD	267.37	175.06	4	224.14
5	法兴证券美国公司 (SG AMERICAS SECURITIES LLC)	FCM BD	190.90	50.89	6	164.12
6	花旗全球市场 (CITIGROUP GLOBAL MARKETS INC)	FCM BD SD	177.43	125.70	5	198.89
7	巴克莱资本 (BARCLAYS CAPITAL INC)	FCM BD	157.31	74.76	8	90.62
8	瑞穗证券美国公司 (MIZUHO SECURITIES USA LLC)	FCM BD	128.05	16.14	7	119.63
9	艾地盟 (ADM INVESTOR SERVICES INC)	FCM	89.75	5.12	10	72.50
10	盈透证券 (INTERACTIVE BROKERS LLC)	FCM BD	83.57	21.73	9	81.47
11	法国巴黎银行机构经纪公司 (BNP PARIBAS SECURITIES CORP)	FCM BD	80.85	64.25	12	60.71
12	奥布莱恩联合经营 (RJ O'BRIEN ASSOCIATES LLC)	FCM SD	65.17	3.45	13	60.21
13	瑞银证券 (UBS SECURITIES LLC)	FCM BD	64.74	104.09	11	62.30
14	美国汇丰证券 (HSBC SECURITIES USA INC)	FCM BD	61.17	46.65	21	35.16
15	STONEX 金融公司 (STONEX FINANCIAL INC)	FCM BD	55.82	4.43	15	48.08
16	富国证券 (WELLS FARGO SECURITIES LLC)	FCM BD	50.87	30.19	14	59.42
17	加拿大皇家银行资本市场公司 (RBC CAPITAL MARKETS LLC)	FCM BD	48.15	6.06	16	45.10



续表

2022 年 排名	期货佣金商（FCM） 公司名称	注册类别	2022 年 客户权益 （亿美元）	2022 年 净资本 （亿美元）	2021 年 排名	2021 年 客户权益 （亿美元）
18	美国麦格理期货（MACQUARIE FUTURES USA LLC）	FCM	46.15	15.14	18	40.98
19	MAREX 北美（MAREX NORTH AMERICA LLC）	FCM	43.33	7.14	20	35.81
20	荷兰银行芝加哥结算公司（ABN AMRO CLEARING CHICAGO LLC）	FCM BD	42.42	2.47	17	43.83

注：2022 年排名基于 2022 年 12 月 31 日数据，2021 年排名基于 2021 年 12 月 31 日数据。

数据来源：美国商品期货交易委员会（CFTC）。

（二）期货佣金商的经营概况

近年来，期货佣金商中客户权益总量维持高位，截至 2022 年 12 月，客户权益总量同比增长 5.7%，达到 2 961.34 亿美元。

期货佣金商的数量方面，近年呈现连年减少后逐渐平稳的趋势（见图 10）。根据美国商品期货交易委员会公布的数据，2022 年底美国期货佣金商的数量共 63 家。自 2008 年金融危机以来，期货佣金商所面临的最大挑战是太低的利率，这意味着太低的收入和越来越高的成本：日益严苛的监管制度及合规成本、资金成本、技术成本，以及交易所费用结构难以商议，这些都导致佣金商难以寻求利润。中小型佣金商选择退出或者被并入大型佣金商，佣金商数量有所减少。

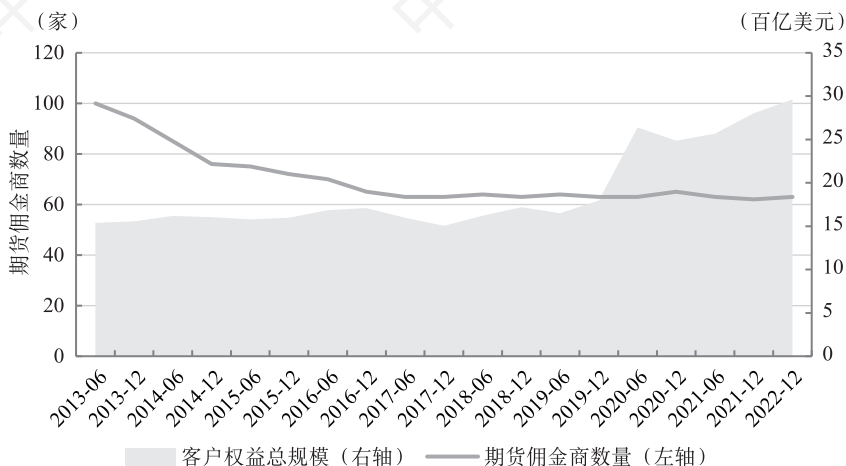


图 10 2013—2022 年美国期货佣金商数量及客户权益变动

数据来源：美国商品期货交易委员会（CFTC）。

期货佣金商的客户权益集中度方面，2021年相较2020年略有下降。其中前5名期货佣金商客户权益占比52.07%，第6名至第10名的市场份额为21.48%，其他期货佣金商的客户权益总占比为26.45%（见图11）。

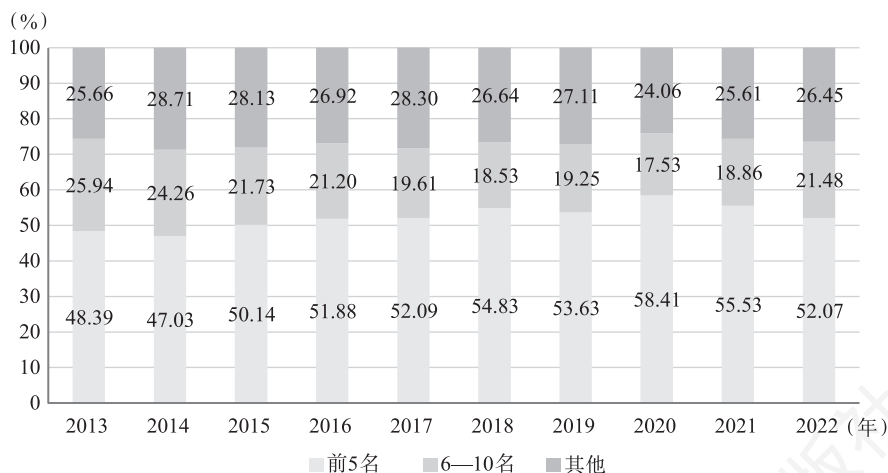


图11 2013—2022年美国期货佣金商中客户权益分布情况

数据来源：美国商品期货交易委员会（CFTC）。

不同类型的佣金商对利率和成本问题的反应也不尽相同：对于大型银行佣金商来说，尤为棘手。清算机构保证金对于它们的资产报表冲击较大，而对于非银行佣金商来说机会较好。银行对客户的要求较为严格，导致为不符合银行要求客户服务的中层市场的形成，而非银行佣金商在这个市场如鱼得水。

三、全球期货及其他衍生品机构投资者发展概况

机构投资者是全球期货及其他场内衍生品市场的投资主力，一般来说，相对于个人投资者，机构投资者拥有更加雄厚的资金实力、丰富的投资经验以及研究实力，能够更加准确地把握市场脉搏。机构投资者按运作方式的不同主要分为管理期货基金、对冲基金、共同基金及养老基金等。但由于共同基金及养老基金一般不直接参与期货或其他衍生品的交易，而是通过前两种机构投资者进行投资，因此，投资期货及其他衍生品的基金主要集中在管理期货基金及对冲基金上。

（一）管理期货基金（Managed Futures）

管理期货基金行业最初专注于投资商品期货领域，因此被称为商品交易顾问（Commodity Trading Advisor, CTA），随着市场衍生品品种的不断丰富，商品交易顾问的投资领域也不再局限在商品期货。管理期货基金需要在美国商品交易委员会及美国国家期货协会注册，定期向监管机构提交相关的数据与信息。管理期货基金为投资者，特别是高净值投资者提供投资传统品种以外领域的机会。

根据管理期货基金投资领域的不同，巴克莱对冲把管理期货基金细分为农产品类投资型、货币类投资型、金融/金属类投资型以及没有特定品种类型的分散化投资型。而根据管理期货基金作出投资决策的方式的不同，巴克莱对冲把管理期货基金分为自主式投资型和系统化投资型。

CTA 指数是衡量管理期货/CTA 行业表现的重要指标。巴克莱 CTA 指数是行业使用最久的一个衡量 CTA 业绩的指标。该公司于每年年初审查调整 CTA 的数目，该指数涵盖的 CTA 需要具备 4 年的历史业绩。同时，符合条件的 CTA 新推出的投资项目运行 2 年后才会加入指数的统计中。

2022 年 CTA 综合指数表现为 7.11%，较 2021 年有所上升，为 2015 年以来最高值，如图 12 所示。除了计算综合指数外，巴克莱对冲还计算各种投资领域的细分指数，其中按照标的类型分类有农产品交易指数、货币交易指数、金融/金属交易指数、分散投资交易指数，按照交易方式分类有自主型交易指数及系统化交易指数。从图 13 和图 14 可以看出，2022 年，所有类型指数均取得正收益，除农产品指数外，其他类型均较 2021 年收益率有所回升。其中，按照标的类型分类，货币、分散投资类型的收益表现超过了 CTA 综合指数，分别为 8.98% 和 9.88%；按照交易方式分类，自主型交易、系统化交易的收益表现均超过了 CTA 综合指数，分别为 9.12% 和 7.48%。

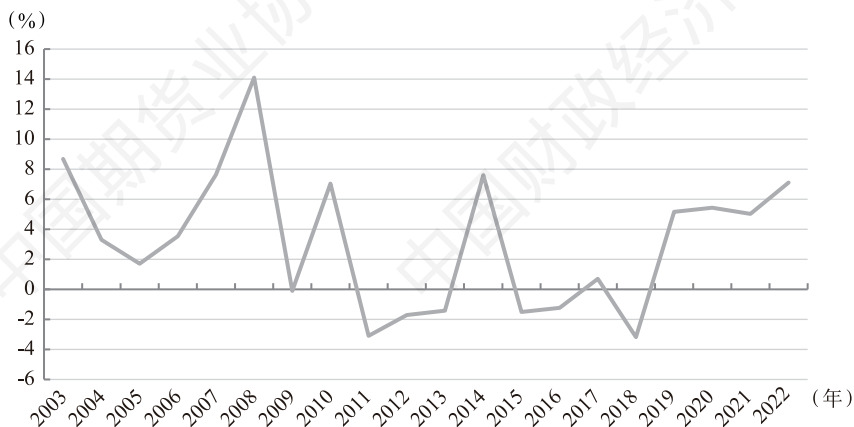


图 12 2003—2022 年巴克莱 CTA 综合指数表现

数据来源：巴克莱对冲（Barclay Hedge）。

（二）对冲基金（Hedge Fund）

一直以来对冲基金行业在市场中都占据重要的位置，根据巴克莱对冲公布的统计数据，2022 年对冲基金业绩下降明显，多数策略收益为负值。2022 年巴克莱对冲基金指数收益为 -8.21%，是 21 世纪以来第二低的一年，仅次于 2008 年（-21.63%）。

在各细分策略指数中，多数策略的收益表现低于 2021 年。19 个细分策略指数

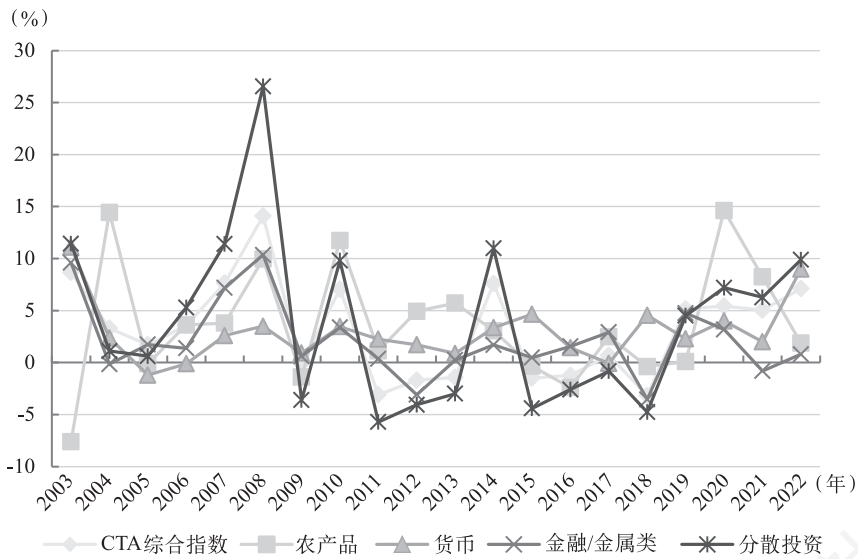


图 13 2003—2022 年 CTA 综合指数及其细分指数表现 (投资标的类型分类)

数据来源: 巴克莱对冲 (Barclay Hedge)。

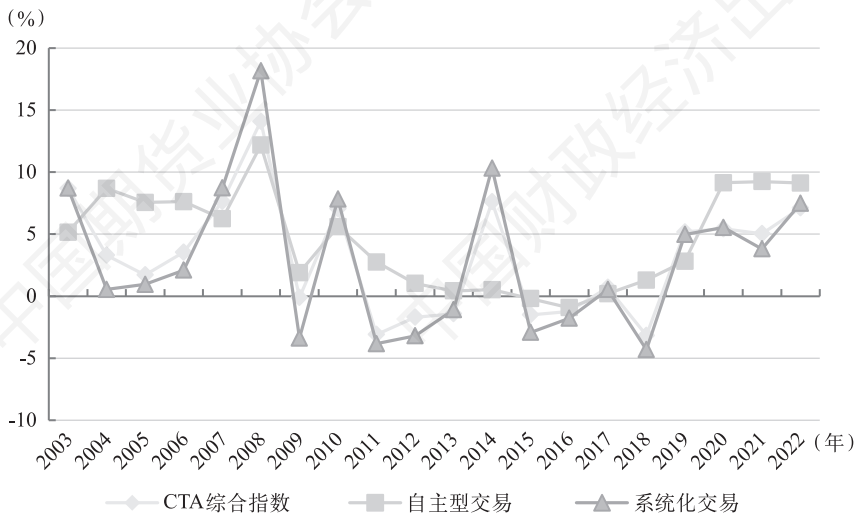


图 14 2003—2022 年 CTA 综合指数及其细分指数表现 (交易方式分类)

数据来源: 巴克莱对冲 (Barclay Hedge)。

中, 除固定收益套利指数、全球宏观指数、医疗生科指数外, 其余 16 个策略的收益均低于 2021 年。除股市多/空策略指数、股市中性策略指数、欧洲股市指数、全球宏观指数、并购套利指数外, 其余 14 个策略均为负收益。其中, 收益率最高的为全球宏观指数, 达 6.36%, 收益率最低的为技术指数, 为 -24.50% (见表 37)。

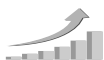


表 37 2020—2022 年巴克莱对冲基金指数及其主要细分策略指数表现对比

序号	指数类别	2022 年指数 表现 (%)	2021 年指数 表现 (%)	2020 年指数 表现 (%)
1	巴克莱对冲基金指数 (BARCLAY HEDGE FUND INDEX)	-8.21	10.22	11.14
2	股债均衡指数 (BALANCED (STOCKS & BONDS) INDEX)	-14.75	9.90	7.14
3	可转换证券套利指数 (CONVERTIBLE ARBITRAGE INDEX)	-1.09	7.12	15.53
4	困境证券指数 (DISTRESSED SECURITIES INDEX)	-6.74	20.30	13.18
5	股市偏多策略指数 (EQUITY LONG BIAS INDEX)	-13.63	17.08	16.31
6	股市多/空策略指数 (EQUITY LONG/SHORT INDEX)	0.18	10.65	9.27
7	股市中性策略指数 (EQUITY MARKET NEUTRAL INDEX)	3.24	8.05	-1.29
8	欧洲股市指数 (EUROPEAN EQUITIES INDEX)	1.98	12.29	5.33
9	事件导向指数 (EVENT DRIVEN INDEX)	-6.21	12.30	11.12
10	固定收益套利指数 (FIXED INCOME ARBITRAGE INDEX)	-1.60	0.97	10.46
11	基金中基金指数 (FUND OF FUNDS INDEX)	-6.35	4.60	9.75
12	全球宏观指数 (GLOBAL MACRO INDEX)	6.36	8.79	10.06
13	医疗生科指数 (HEALTHCARE & BIOTECHNOLOGY INDEX)	-16.49	-0.85	26.47
14	并购套利指数 (MERGER ARBITRAGE INDEX)	0.94	7.69	9.18
15	综合策略指数 (MULTI STRATEGY INDEX)	-3.10	9.94	4.23
16	期权策略指数 (OPTION STRATEGIES INDEX)	-3.87	12.07	8.87
17	环太平洋股市指数 (PACIFIC RIM EQUITIES INDEX)	-10.24	12.61	4.70
18	技术指数 (TECHNOLOGY INDEX)	-24.50	14.46	34.50
19	波动率交易指数 (VOLATILITY TRADING INDEX)	-3.40	7.01	15.87
20	新兴市场指数 (EMERGING MARKETS INDEX)	-13.84	4.07	15.52

数据来源：巴克莱对冲 (Barclay Hedge)。

附录 2

期货市场履行社会责任情况

>>> 第一节 投资者教育与投资者保护情况

一、上海期货交易所投资者教育与投资者保护情况

(一) 助力实体经济做强，服务企业高质量发展

上期所以新发展理念为指导，进一步做好期货市场服务实体经济的功能宣传，着力服务现代产业体系的加快构建。

一是加强实体投教基地建设，促进期现信息互通。目前上期所共建设投资者教育基地、产业培训基地 20 余个，包括江西铜业、铜陵有色等行业标杆企业，京博石化、金光纸业、海胶集团等领军企业，相关投教基地兼具地域及行业特色，功能辐射全国，有利于更好引导交易者通过理论学习和现场教学结合的方式，增强服务实体质效。

二是联合上交所、深交所、上市公司协会、资本市场学院等单位，推出“车轮上的上期所”市场服务品牌。针对衍生品市场，建立有效的产品、研究、培育等方面的全面战略合作机制，搭建课程体系，增进上市公司高管群体对期货等衍生品市场的理解，更好帮助上市公司学习并合规使用衍生品工具进行风险管理，实现平稳经营。



三是协同会员单位开展市场培育，针对各类市场参与者，开展线上直播、产业调研、产业沙龙等形式活动，进一步提高期货市场影响力，深化产业服务质效，全年开展各类市场活动 891 场。其中，调研活动 50 场，面向专精特新、中小企业等产业客户提供了一对一的指导服务。

（二）打造“上期投保”品牌，丰富投教产品供给

一是在中国证监会期货部和投保局的大力支持和指导下，以“明晰风险、了解法规，正确理性参与期货和衍生品市场”为主题，举办首届“松林杯”投保动画作品大赛。立足投资者保护工作新要求，结合期货市场发展动态，围绕《期货和衍生品法》宣贯、期货市场基础知识等投保重点内容，发挥市场合力，提醒交易者防范风险、理性交易，开展普惠性宣传教育，得到了广大会员单位、行业协会和创作者们的热情参与，共收到 59 家单位推荐的优质投保作品 113 件，35 万余人参与公开展示和投票，24 件作品从题材、内容、创意等方面脱颖而出，获得优秀作品奖，受到行业内外广泛关注。

二是寓教于乐，设计开展包括“3·15”投保系列、防非宣传月、“5·15”投保系列、金融知识普及月、世界投资者周等丰富多彩的投保活动。在“3·15”国际消费者权益日期间推出了“理性认识市场，投资量力而行”投保主题教育系列活动，其中“上期投保我来说——‘3·15’有奖问卷调查”活动，吸引了近万名交易者参加活动，共收取有效答卷 4 872 份，为上期所更有效地开展投保和宣传教育提供了依据。在 2022 年全国防范非法证券期货宣传月及“‘5·15’全国投资者保护宣传日”期间，开展“5·15”投保期货知识有奖竞答，共吸引 7 798 名交易者参加。在金融知识普及月，组织了“松林杯”投保作品展示，提升了公众自我保护意识及对期货市场的整体认知。开展“世界投资者周活动”相关活动，拍摄反映上期所国际化发展的微电影《成长》，制作发布“投资明风险，守护千万家”活动主题海报，制作《〈期货和衍生品法〉之期货跨境交易与监管知多少》，与上海证监局联合推出 MG 动画。

三是开展“上期投保接力”活动，形成接力效应。3 月中旬至年底，通过每月举办投保主题活动，扎实做好交易者教育宣传工作，加速形成投保合力。联合近 30 余家会员单位及地方证监局、行业协会等单位，在全国范围内开展 54 场“上期投保接力”活动。扎实做好投资者保护工作，助力期货市场平稳健康发展。9 月，联合上海证监局开展“防非普法，期市清朗，美好生活”上期投保接力“金融知识普及月”专题活动，加强知识普及和风险提示，增强交易者识别风险和防范风险的能力，帮助交易者提高警惕、远离陷阱。

四是制作形式多样的投教投保作品，在国家级投教基地以及交易所官方新媒体平台等渠道进行宣传。采用以往投保活动中征集的交易者最喜爱的投保金句，推出 5 期主题宣传海报；制作 6 期金融知识普及、世界投资者周长图文，包含口号海报、

名词解析、知识背景、安全小锦囊、非法金融活动案例、互动问答等，宣传《期货和衍生品法》条文；制作防非风险提示系列海报、防非以及“5·15”投资者保护主题宣传语海报等；制作投保周边产品，向会员单位进行发放。

（三）推动纳入国民教育，倡导正确风险管理理念

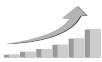
贯彻《国务院办公厅关于进一步加强资本市场中小投资者合法权益保护工作的意见》精神，落实中国证监会关于投资者教育纳入国民教育体系部署，通过高校合作普及资本市场“三公”原则，引导正确风险管理理念，有助于高校师生在进入市场前，树立正确的价值观、财富观，构建资本市场健康生态。

一是多种形式开展高校人才培养，在已有高校合作课程的基础上，拓宽合作形式。与浙江大学开展中小企业参与期货市场方面的课题研究，产、学、研深度融合助产业创新发展；与中国石油大学（北京）合作开设能源金融交易模拟课程；与武汉大学经管学院合作开设金融工程实践实务课程、期货与衍生品实践学分课程，围绕湖北省产业分布、风险子公司业务介绍、期货研究与框架，及CTA策略开展主题讲座。

二是以会员单位为抓手，进一步在全国范围内探索以多种形式开展高校人才培养活动，截至2022年底，累计合作院校包括中国石油大学、清华大学、香港大学等超20所，开展学分课程、讲座、风险警示类活动70余场，课程覆盖超5000人次。通过不同的合作模式，稳步推进对高校学生开展期货知识普及教育，引导学生学以致用、期货公司反哺社会和实体，为期货市场的发展建立社会化人才培养体系。

（四）满足市场诉求，加大市场宣传力度

市场服务中心（MSC）将日常工作与“为群众办实事”的实践要求紧密结合，落实落细基本职责，更好维护交易者合法权益。一是疫情期间，MSC保持在线状态，确保市场服务畅通，始终以饱满的工作态度提供优质服务。处理了关于会员单位审计机构办理询证、交割月零星头寸事项等诉求，回复12386平台反馈问题，解决群众急难愁盼问题。二是优化操作流程，梳理交易者问题，形成答复口径，做好信息传导，形成问题—解决—改进的正向循环。举办“‘3·15’消费者权益日市场服务中心特别活动”，为交易者介绍上期所市场服务项目，展示上期所及上期能源市场信息查询方式，解答常见疑问，回应市场关切。三是做好交易者风险警示工作。根据交易者反映，因点击交易所钓鱼网站或轻信交易平台遭遇电信诈骗而蒙受财产损失的情况，及时在上期所、上期能源官网挂出风险提示，提醒交易者辨识正规交易场所，采用合法参与方式理性交易，增强交易者防范风险意识和自我保护能力。MSC全年各渠道共受理市场咨询和意见建议1584件次，答复率100%，满意度97%。



二、郑州商品交易所投资者教育与投资者保护情况

2022年，郑商所深入贯彻中央经济工作会议精神，坚持稳字当头、稳中求进工作总基调，深化期货市场功能发挥，持续深化投资者教育与保护各项工作。

（一）履行自律监管责任，进一步落实适当性制度

为做好引入境外特殊参与者相关工作，郑商所认真梳理适当性制度的适用范围，持续推进《郑州商品交易所期货交易者适当性管理办法》修订工作。根据郑商所自律规则，2022年共对16家会员单位开展检查，切实督促会员单位严格落实投资者适当性管理等制度。

（二）积极开展各类投教工作，增强投资者风险意识

郑商所牢固树立“大投保”理念，坚持“投教先行，服务市场，保障权益”的原则，贯彻落实“全国投资者保护宣传日”“国际消费者权益日”“世界投资者周”“金融知识普及月”等投教活动部署，通过多种形式积极开展投资者保护宣传工作。推出“‘3·15’特别策划”系列条漫、“‘5·15’投资者保护我知道”系列长图、“防非指南一点通”系列互动海报、“金融知识备忘录”系列长图、“防非小剧场”系列动画等投教产品30余种，向投资者充分揭示市场风险，提升投资者风险防范和自我保护意识，确保主题投保宣传活动落到实处、突出实效。

创新举办“期货影响力——郑商所‘投教先锋’”评选活动，引导参评单位“聚焦《期货和衍生品法》”“期货助力乡村振兴”等主题创作短视频，共有63家单位围绕六大主题提交了149个原创短视频投教产品。依托网站及自媒体平台，紧跟新媒体平台发展趋势，持续拓宽宣传渠道制作系列图文、短视频、课程等投教产品100余种，以通俗易懂的方式向投资者和公众普及《期货和衍生品法》以及期货和衍生品的基础知识，引导投资者树立理性交易理念。

同时，郑商所积极引导组织会员等合作单位开展各类投教活动。2022年，郑商所举办“期货知识进校园”、投资者教育专项活动等各类知识讲座1025场，累计参与约26万人次；支持会员单位举办“走进产业 贴近行业 服务企业”（简称“三业”）市场活动1385场，累计参与约40万人次，为各类市场主体参与期货市场提供参考。

（三）举办第五届“郑商所杯”模拟交易大赛，助力投资者教育纳入国民教育体系

在中国证监会期货监管部、投资者保护局、证监会团委指导下，郑商所联合中国期货业协会成功举办第五届“郑商所杯”全国大学生金融模拟交易大赛，共吸引国内外2160所高校的51455人报名，参赛高校及学生数均创历史新高，高校认可度明显提升，以赛促学、为期货市场引智成果更为突出。

（四）多措并举加大市场培育力度，推进投资者教育工作

2022年，创新实施“产业服务专项支持计划”，帮助产业企业合理利用期货市场管理风险。持续丰富“稳企安农 护航实体”品牌内涵，全年举办“疫情下企业风险管理”“保供稳价背景下期货服务中小企业”等主题活动合计209场；举办“郑商所走进央企”、国有企业期货业务培训、上市公司风险管理培训等活动，持续提升市场参与主体风险管理意识和能力；建设“产业基地”31家，支持举办产业服务活动171场；聚焦铁合金、氮肥、油脂油料等产业，举办期货衍生品特色产业大会4场，积极服务产业高质量发展。

（五）认真对待投资者反馈，建立健全沟通反馈渠道

郑商所妥善处理相关诉求、纠纷、调解、风险处置等事宜，依托市场意见反馈平台，及时受理、办结、回复市场意见。2022年，共受理并办结有效诉求事项67件（举报18件、信访3件、12386平台等渠道转办件46件）。

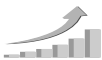
联合有关政法部门印发《关于建立期货纠纷诉调对接工作机制的实施意见（试行）》《关于建立维护期货市场秩序及加强安保工作联防联控联动机制的实施意见（试行）》，加强与司法机关、执法机关的沟通联动。在“全国证券期货在线调解平台”完善调解员相关信息，制定《郑州商品交易所调解委员会调解规则》，与郑州市中级人民法院建立、健全有机衔接、高效便民的期货纠纷诉调对接工作机制，积极宣传调解委员会的功能及作用，畅通交易者诉求表达和权利救济渠道，保护交易者的合法权益。

三、大连商品交易所投资者教育与投资者保护情况

2022年，大商所在不断完善工作机制的基础上，扎实开展基础投教工作，有效利用丰富的市场品牌优势，面向全市场、全行业有针对性地积极开展了一系列投资者教育和投资者保护活动。

（一）投资者教育全面升级见实效开新局

一是建立投资者保护领导小组，明确工作机制。为加强大商所投保工作的组织领导和协调机制，于4月底正式成立了由党委书记冉华担任组长的大商所投资者保护工作领导小组。同时，从总体要求、工作任务、职能分工等角度进一步明确了投资者保护工作机制。大商所投资者保护工作领导小组的成立和相关配套工作机制的出台是落实以人民为中心的发展思想、服务期货市场高质量发展做出的一项重要机制安排，不仅切实加强了大商所投保工作的组织领导，健全了沟通协调机制，提高了各业务、各产品、各环节投资者保护工作的整体性和协同性，更有利于构建互促共进、齐抓共管的“大投保”格局。



二是上线投教基地，推出投教知识产权（IP）形象。2022年5月15日，大商所互联网交易者教育基地“期货学苑”正式上线运营，致力于面向期货交易者开展知识普及、信息政策宣导、风险提示等教育服务活动，囊括各类视频课程、海量图文资讯等多类学习资源，目前运行平稳，已成为期货交易者教育为主的综合型一站式学习平台。同时，大商所推出了以大豆形象和大商所标识（Logo）为创意初衷的卡通人物“大衍”作为投教吉祥物，并制作《大衍成长记》《听听大衍怎么说》等数件通俗易懂、趣味性强的投教作品。

三是策划特色主题，丰富产品体系。针对不同类型市场参与者的需求和特点，大商所打造了“微课堂”“DCE·图数馆”“DCE·云课”投教品牌，共制作200余件原创投教材料，帮助投资者全方位了解大商所各品种合约和运行情况、各条线业务介绍及规则解读等信息，初步形成了较为全面、多层次的投教产品体系。围绕“‘3·15’国际消费者权益日”“‘5·15’投资者权益保护宣传日”“世界投资者周”“金融知识普及月”等主题开展丰富多彩的投资者保护及风险警示教育活动，引导投资者敬畏市场、识别风险、理性参与，同时策划推出“漫话监管”“企风零距离”“投保小词典”等多个特色主题投教系列。特别是在宣传贯彻我国《期货和衍生品法》方面，2022年，大商所积极利用网站、微信公众号等多媒介发布相关宣传材料，助力全市场营造“期货法亮点人人关注，期货法成果人人共享”的良好氛围。为了使普法宣传活动更接地气、聚人气、有生气，大商所还跟踪市场关注热点，通过搭建“普法长廊”、摄制推出“法律会客室”系列节目、举办《期货和衍生品法》专题系列讲座等方式，对《期货和衍生品法》主要内容进行全方位体系化解读。

（二）利用期货学院平台做好从业人员培养

自2006年成立至2022年底，大商所依托各地期货业协会，在全国31个中心城市设立了期货学院分院（教学点），建立起覆盖全国的培训网络，并由此形成了“以一地为现场培训点+各分院视频同步培训”的培育模式，组建了教委会，聘请以期货公司高管人员为主体的教学委员100余人，累计培训期货公司从业人员、产业客户、政府及媒体等各类市场人员超过4万人次。2022年，大商所期货学院选择关联性较高的油脂油料板块期货品种，针对期货分析师开展了为期两周的产业链专题培训，来自全国期货公司的3000余从业人员报名参加，评出近300名优秀学员。另外，大商所依托期货学院，联合13家证监局及地方证券、期货、基金和上市公司协会开展特色培训及市场培育活动26场，线上线下累计培训超过6.5万人次。

（三）推进高校项目产学研一体化

一是大商所持续开展高校期货人才培育项目（以下简称“高校项目”），助力推进将期货衍生品知识纳入国民教育体系，为行业培育储备人才。2022全年，大商所

对51个高校课程类项目给予立项，高校课程类项目累计开班数量达到了299个，培训人数达到2万人次。高校项目整体质量和实际效果得到了显著提升，进一步得到了学校师生的普遍欢迎和认可。

二是为进一步做精做深高校期货人才培育工作，积极发挥高校科研资源和优势，大商所在高校课程类项目的基础上启动了高校研究类项目，对中央民族大学、山东大学、南京大学、武汉大学4所高校申请的研究项目给予立项。目前，所有项目已经完成研究初稿，其中，山东大学项目成果已在《International Journal of Financial Engineering》（即《国际金融工程杂志》）上发表。同时举办了第五届大商所高校教师衍生品研修班，来自60所院校的170名教师报名参加培训。

三是为响应国家“将投资者教育纳入国民教育体系”的政策倡导，构建多层次期货衍生品人才培养体系，2022年，在中国证监会期货监管部和投资者保护局的指导下，大商所首创“young”帆期海——大商所首届大学生衍生品实践大赛，由一家期货公司，协调一支高校队伍，对接一家产业企业或期货公司风险管理子公司，联合指导参赛学生对实体企业利用衍生工具开展风险管理的方案设计、项目实施、经验总结等进行全流程深度参与。在实践环节，大学生们可以通过实地调研、座谈等，与产业企业负责人面对面地了解产业情况，向期货公司专业人员学习风险管理经验，并通过参与实体企业风险管理方案设计，切实提升自身的理论水平和实践能力，为期货衍生品行业人才造血机制的建立提供了坚实的人力资源保障。首届比赛由46支队伍报名参赛，30支晋级初赛队伍以线上直播形式角逐10强，直播在线观看人数达6.3万人，得到了高校和市场的一致好评。

四、中国金融期货交易所投资者教育与投资者保护情况

2022年，中金所深入落实中国证监会系统工作会议部署和投资者保护重点工作安排，充分认识投资者合法权益的重要性，在所内成立中金所投资者保护工作领导小组，并持续强化投资者教育和保护，原创开发了内容丰富、形式多样的投教投保作品，动员市场各方力量开展大范围、多层次、广覆盖的投教投保活动。

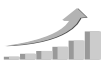
（一）开辟投教宣传新平台，广泛开展期现联动合作

一是积极开拓投资者教育渠道，入驻微视频号、期货日报App、财联社投教基地、喜马拉雅App、阿基米德App、资本市场学院网上授课平台等媒体平台。

二是与上海证监局联动，共同制作防非主题节目。与上海证监局联合开发音频广播节目——《防非宣传二三事儿》，该作品在喜马拉雅App、上海人民广播电台音频社区、第一财经广播电台同步上线。

三是与四川证监局、四川证券期货业协会联合开展“金融期货杯”四川高校短视频大赛，共收到四川各大高校优质参赛作品投稿50余件。

四是与上交所联合开展“投资者服务周”四川站、安徽站活动，将金融期货服



务科创板内容嵌入相关宣讲活动。

五是与投服中心联动，将金融期货和《期货和衍生品法》相关内容嵌入“股东来了”全国总决赛。

六是与全国各投教基地联动，建设金融期货学习专区。以定制的投保信息平台为载体，通过文章、地图、图片、音视频等多种形式向投资者普及金融期货知识。

（二）联合高校、机构、会员开展广覆盖、大范围的投教合作

一是在中国证监会期货监管部、投资者保护局和证监会团委指导下，在各证监局、各地证券期货协会的协力支持下，中金所和中期协联合主办的第八届“中金所杯”全国大学生金融知识大赛成功举办。本届大赛共 28 403 人报名参赛，参与考生来自全国 29 个省市的 730 家高校，最终 1 375 人获奖。

二是积极推动将投资者教育纳入国民教育体系，与武汉大学、四川大学、东北财经大学开展金融国民教育进课堂活动。金融业界专家进课堂的教学安排提高了大学生的金融素养，树立了金融服务实体经济的正确价值观。

三是围绕中长期资金入市，多措并举提高机构服务和投资者培育效能。优化升级金融衍生品管理课程，培训 180 余人次；打造“金融期货进机构”服务品牌，开展专题业务培训 8 场；组织中证 1000 股指期货期权新产品上市首月“机构思享会”。

四是联合会员开展多种形式的投教活动，引导会员围绕银保机构、长期资金入市、金融期货新品种等方面积极开展系统化机构投资者培育。本年度共联合 128 家会员单位开展 4 832 场线上投教活动，制作通俗易懂的投教作品 547 件。

五是顺利开展首届金融期货会员优秀分析师团队评选。本届评选以“金融期货服务实体经济能力”为导向，最终，来自 8 家会员的 10 个团队获得了“金融期货优秀分析师团队”称号。

六是打造“会员之声”平台，做好双向宣传。对优秀会员开展一对一专访，在上海证券报和中金所公众号等媒体发表专访文章 14 篇，引导会员共建金融期货发展良好生态，支持会员以多种形式制作 562 件投教作品并向市场投放。

（三）持续强化投资者教育和保护，用好中金所期货期权学院投教基地，向大众普及宣传金融期货知识

一是认真落实中国证监会投保局部署，抓住关键时间节点开展“‘3·15’国际消费者权益日”“‘5·15’全国投资者保护宣传日”“防非宣传月”“金融知识普及月”和“世界投资者周”专项投保投教系列活动。活动类型包括金融期货知识竞答、留言有奖、会员优秀作品展和投保投教专项问卷调查，共计 400 余万人次参与。

二是探索“掌上投教+扶贫”投教模式，将投教活动与公益扶贫相结合。一方面，采购定点帮扶县延长县特色农产品用于活动奖励。另一方面，在活动宣传中放

入延长县全品种特色农产品的展示销售二维码，让更多人了解关注延长县。

三是深入挖掘金融期货服务国民经济案例，拓展现货市场培育广度。本年度共筛选出了21个金融期货典型案例，形成了《金融期货案例看市场功能——金融期货功能作用发挥典型案例集》。

四是结合中金所内重点业务和产品，通过短视频动画、长图文、纪录片、互动页面（H5）等多种形式制作发布了一大批自主开发的精品课程。全年共制作完成了《〈期货和衍生品法〉微课堂》《业务规则大讲堂》《中金所业务规则一本通》《防非宣传歌》《股指期货与股指期货百问百答》等11个系列，共计216件投教作品。

（四）坚持服务至上，畅通多平台投资者咨询服务渠道

一是扎实开展投资者咨询服务工作。2022年度共接收到768个交易日咨询电话、87封咨询邮件、3例中国证监会投保局12386热线平台咨询，其中，有效咨询为326例。全部咨询问题均已按时保质答复。

二是持续拓宽投资者服务渠道。在所内交易、结算、监查、国际发展、技术等业务部门均建立了常态化与投资者互动沟通的渠道和机制，相关渠道已公布于官网。

三是主动对投资者状况进行调查，了解投资者的需求与意见建议等。通过中金所期货期权学院微信公众号开展了系列有奖问卷调查，2022年共开展4次调查，回收有效问卷18.6万份，并进行了评价分析和情况报告。

四是建立完善的投资者权益损害保护机制，与中国证监会信访办、上海市信访办、地方公安派出机构保持实时沟通和联系，发生投资者权益损害事件时，能做到早发现、早报告、早处理。

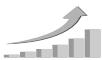
（五）突破“圈层”开展正面宣传，提升各类市场参与主体对金融期货的认知

一是开展媒体培训交流。围绕新业务及重点工作，与资本市场学院联合举办“中金所—沁园金融媒体研修班”。全年培训媒体120余家次、记者140余人。

二是稳妥做好中证1000股指期货和股指期货、上证50股指期货产品上市宣传。面向主流媒体和新媒体，第一时间组织召开新闻通气会和媒体培训会，沟通报道方向、提供相关素材、协调专家采访。

三是聚焦金融期货市场高质量发展，贯彻落实二十大精神，策划组织“中金所优秀会员系列报道”。组织《上海证券报》走访优秀会员期货公司，围绕金融期货市场发展和功能发挥，以视频文字相结合等形式策划报道十多年来金融期货市场高质量发展的成果。

四是多角度讲好金融期货故事，做好主题宣传。生动宣传中金所助力延长县巩固拓展脱贫攻坚成果，全面推进乡村振兴的奋斗故事，组织《三联生活周刊》《中国证券报》和《上海证券报》推出相关主题报道稿件。积极开展《期货和衍生品法》宣传，解读该法的出台对于金融期货市场的重要意义。



五、广州期货交易所投资者教育与投资者保护情况

2022年，广期所围绕工业硅期货和期权上市，线上、线下开展工业硅品种分析师和交易、结算、交割等业务人员培训，提高市场服务能力，并充分利用可视化宣传方式，拓展宣传平台，创新开展投教工作，提升投资者对期货市场的认识和参与能力。

（一）围绕工业硅期货和期权上市，加强针对期货公司各类人员的培训，为期货市场服务新能源等品种领域储备行业人才

一是充分利用线上方式，高频率开展市场培训，覆盖约3万人次，包括面向期货公司和全市场开展15次工业硅期货期权线上系列培训，提高从业人员和投资者对工业硅产业发展及合约规则设计的认识和理解；开展5期广期所交易、结算、风险控制 and 交割规则培训，并对《期货和衍生品法》重点内容进行讲解，提高期货公司人员对期货行业法律的认识和对广期所规则的理解；开展5期商品指数线上培训，为下一步商品指数期货上市打下基础。二是举办为期两天的工业硅分析师系统性培训，培养工业硅分析师，提高研发和产业服务能力。

（二）以视频、长图、漫画、海报、品种手册等形式为载体，形成丰富的投教产品，面向全市场广泛宣传

一是加强《期货和衍生品法》实施宣传，在广州塔塔身发布“广州期货交易所热烈祝贺《中华人民共和国期货和衍生品法》正式施行”公益广告，并制作航拍视频，获得热烈反响。二是围绕工业硅期货及期权投放MG动画视频、沙画视频、自述风格视频、工业硅百问百答连载等内容。三是制作现货报告、交易手册、产业套保手册等系列手册，在官网和线下渠道同步投放。

（三）完善市场服务渠道，拓展宣传投教平台

一是通过官网改版，增设各类信息发布栏目，及时向投资者发布品种和市场动态信息，并发布了广期所交易、结算、监查、交割、市场等各相关业务的联系电话，建立与市场及时沟通机制。二是通过增加视频号，进一步完善公众号设置，与媒体合作开设投教专栏，连载品种基础知识，极大地拓展了投教渠道，起到较好效果。

（四）落实各项主题投教活动部署，扎实推进投资者宣传和教育工作

广期所认真落实中国证监会在投资者教育与保护方面的工作部署，围绕“理性认识市场 投资量力而行”“选择合法机构，远离非法主体，坚持理性投资，谨防上当受骗”“投资明风险，守护千万家”等主题，在“‘3·15’国际消费者权益日”“‘5·15’全国投资者保护宣传日”“防范非法证券期货宣传月”“世界投资者

周”“金融知识普及月”等主题活动期间，开展主题海报、系列漫画、长图知识宣传、有奖知识问答和问卷等活动。

六、中国期货市场监管中心投资者教育与保护情况

2022年，中国期货监控在中国证监会的指导下，践行“以人民为中心”的发展理念，坚持将“大投保”理念贯穿于工作始终，扎实推进期货市场投资者教育保护工作，充分利用期货市场客户资源优势，不断畅通沟通渠道，切实保护投资者利益，提升投资者服务质量。

（一）聚焦主责主业，不断拓展投保工作广度和深度

1. 不断完善投资者保护工作机制，形成全方位保护体系

中国期货监控不断完善投资者保护工作机制，注重将投资者保护与发挥中国期货监控各项职能相结合，建立起以统一开户为基础，以保证金监控、市场监测监控、机构监测监控、场外衍生品监测为抓手，以保障基金参与期货公司风险处置为落脚点的全方位投资者保护体系，涵盖了投资者从市场进入到退出的全过程。

2. 利用期货市场客户资源优势，精准化投资者教育保护工作

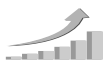
利用期货市场客户资源优势，借助技术手段形成特色的线上线下相结合投教模式。一是不断完善“期货市场调查平台”建设，在中国期货监控官网期货市场调查平台的热点调查、专项调查、调查报告三个栏目中及时更新问卷调查内容以及研究成果，提升投资者调查参与度，增加用户黏性。二是依托“投资者查询服务系统”，精准覆盖期货市场200余万个有效客户，持续面向期货从业人员、期货投资者收集调查问卷，全年共撰写投资者月度调查报告9篇，及时反映投资者对宏观经济、市场及期货品种的预期和看法，为监管机构决策提供参考。

3. 发挥期货交易保障基金作用，积极维护投资者合法权益

中国期货监控积极推进嘉陵期货破产清算工作，督促行政清理组完成嘉陵期货破产申请资料收集及其他相关准备工作，完成清算前首笔费用支付，向法院正式提交立案材料。推进现场工作组各方对北亚期货破产财产处置和职工安置问题达成共识，根据哈中院要求，在破产清算立案前发布债权人公告，摸清北亚期货潜在债务情况。

4. 畅通投资者诉求解决渠道，不断拓宽投资者服务渠道，提升投资者满意度

聚焦日常开户业务中的难点、疑点问题，及时调整期货市场统一开户业务常见问题的解答，帮助期货公司、投资者准确理解开户规则，同时进一步提升开户效率。充分利用“两微一端”等新媒体投资者互动平台，发送期货市场快讯、交易报告库市场数据信息披露等内容，打造期货市场服务窗口。持续做好期货市场日常开户运维工作，及时解答期货公司电话咨询，排查系统卡点问题，确保开户业务平稳运行。做好开户数据统计，定期报告市场开户情况。积极配合投资者核查账户信息，协调



相关期货公司做好客户服务工作。

（二）多方形成合力，不断扩大宣传覆盖面和影响力

1. 加强系统内资源通力合作，合力形成投资者保护和教育矩阵

积极部署“全国投资者保护宣传日”“国际消费者权益日”“世界投资者周”“金融知识普及月”等投教活动，联合黑龙江证监局、贵州证监局、北京证监局、北京期货商会等，开展线上线下投教宣传讲座17期，累计超2万人次参与，制作和发放投教宣传实物2万余件。在中国证监会投保局的组织指导下，中国期货监控牵头开展“2021年度全国期货市场交易者状况调查”，其中，主观调查共回收问卷6034份，个人客户5351份，单位客户683份，在此基础上，完成客观数据调查分析和主观调查报告的汇总撰写，形成调查总报告，上报证监会投保局。

2. 加大对期货市场经营主体及其从业人员的投资者保护和教育培训投入

与派出机构、地方行业协会和期货经营机构合作联合开展投资者教育和保护活动，举办6场投资者教育活动，邀请行业专家就大宗商品价格走势、期货市场服务实体产业以及“保险+期货”案例等内容进行详细讲解，邀请当地种粮大户、涉农企业、政府有关工作人员等参加会议。举办期货经营机构培训班，邀请辖区证监局监管人员讲解投资者适当性等合规要点，邀请头部期货公司营业部、子公司分享开展“保险+期货”培训的经验和案例。

3. 重视投资者教育与保护走进高校，培育壮大高质量投资者队伍

积极主动与高校合作，建立常态化合作机制，连续多年开展投教活动进校园，联合哈尔滨金融学院举办“期货及衍生品精品课程系列讲座”，邀请行业专家面向在校大学生讲解期货及衍生品知识，提高在校大学生对期货市场的了解。

（三）适应市场需求，不断创新投教产品和活动形式

以解读期货交易者保障基金制度、读懂上市公司报告、了解《上市公司投资者关系管理工作指引》、理性看待基础设施公募REITs等为主题，设计制作6期“中国期货监控微课堂”原创投教漫画长图，通过中国期货监控的微信公众号、官方网站、投资者查询服务系统进行发布，精准覆盖期货市场200余万个有效客户。设计并制作印有投教宣传语的一米线地贴、口罩、环保折叠袋、桌面鼠标垫等4.7万余件投教宣传产品，将专业的金融知识转化为易于理解、简单实用的宣传产品，让投资者看得懂、记得住、用得上，联合多家派出机构、地方协会、期货经营机构、金融博物馆、在京高校等协助发放，扩大线下实物投教宣传力度，提升活动宣传影响力。结合《期货和衍生品法》的发布实施，专题开展《期货和衍生品法》线上知识竞答，累计吸引近2.4万人次参与知识竞答，辅助推动社会各方了解立法精神，认识期货和衍生品市场的功能和价值。积极配合、支持中国投资者网站建设，加入投资者网站交流群，及时接受反馈相关信息，主动联络投服中心工作人员，向中国投

投资者网投稿3期原创漫画长图，进行集中展示和宣传。

七、中证商品指数公司投资者教育与投资者保护情况

2022年，在中国证监会党委的领导下，中证商品指数公司结合业务发展和投资者需求，制定了《投资者保护工作管理办法》，组织开展了一系列具有针对性的投资者教育和保护活动。

（一）多渠道规范开展投资者保护工作

制定并发布《中证商品指数公司投资者保护工作管理办法（试行）》，规范指数公司投资者保护管理工作；制定并发布《中证商品指数公司外部咨询与投诉建议处理办法》，妥善处理投资者咨询与投诉建议等事项。通过公司官网、微信平台、对外热线和信访邮箱等方式多渠道开展投资者保护和服务工作。

（二）积极开展投资者保护专题活动

按照中国证监会相关部门要求，结合公司业务、市场热点、投资者需求，开展了“‘3·15’投资者保护主题教育”“防范非法证券期货宣传月”“‘5·15’全国投资者保护日”“世界投资者周”“公平竞争政策宣传周”“金融知识普及月”等专题活动。

（三）加强商品指数宣传与推广

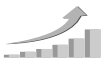
举行中证商品期货指数线上发布仪式，传播指数声音，增强市场影响。与《中国证券报》《期货日报》和万得资讯、新华财经等媒体合作宣传指数上线发布，向投资者普及商品指数相关基础知识。

八、中国期货业协会交易者教育与交易者保护情况

2022年，在中国证监会的指导下，中期协坚持和加强党的领导，促进党建和业务融合发展，从交易者保护实际出发，严格落实自律监管职责，不断提升服务水平。在创新交易者教育手段，组织行业向交易者传播期货知识，受理交易者诉求、及时化解行业矛盾，加强产业交易者服务和教育，与主流媒体合作、宣传期货市场发展成绩，推动行业文化建设、夯实高质量发展基础等方面持续发力，交易者服务工作取得了较好的成效。

（一）创新方式方法，开展交易者教育保护工作

推动交易者适当性制度建设与落实，配合开展适当性检查调研与违规处理。在“3·15”“5·15”等交易者保护重要时间节点组织行业开展形式多样的投教活动。



运营和完善国家级证券期货投教基地“期货投教网”，打造交易者一站式网上学习平台，在中国证监会年度考核中获得“良好”等次。以交易者适当性制度为核心落实行业交易者保护，首次开展调研并发布2021年全国期货市场交易者状况调查报告。与4家合作法院建立线上特邀关系，加大防范非法期货活动宣传力度，按月监测报送涉非线索，共计301条。免费向交易者发放投教书籍6730本、实物投教产品1.57万件。开展“期货行业优秀投教案例征集”活动，推动期货纳入国民教育体系。打造协会投教品牌，与中央人民广播电台合作设立《期货学堂》专栏，传播知识、提示风险，其中，部分词条内容在央广经济之声节目黄金时段循环播放。

（二）及时处理交易者诉求，优先运用调解手段化解纠纷

优化受理条件和注意事项，持续通过电话、网络、邮箱、现场等方式接收交易者诉求，接受交易者投诉举报692件，开展调解281件，达成和解152件，和解率54.1%，为近三年新高，为交易者挽回合理补偿742.63万元。通过跨部门有效沟通合作，解决涉居间人投诉风险265件。对协会无法受理的问题提供法律咨询援助，化解多起偏激、威胁、闹访类案件。打造线上诉求办理平台，优化“诉求处理”模块，将包括投诉、举报、咨询及申请调解等所有类别的交易者诉求信息打包接收，接收—转办—办理—反馈—回访等环节全线上全过程留痕。高度关注涉居间人投诉举报，统计诉求数量，及时总结上报新情况，为协会出台居间人管理补充规定提供依据。在全国证券期货在线调解平台上登记33名协会调解员信息，与4家合作法院建立线上特邀关系，发挥调解委员会专家委员作用，委托办理调解案件2件，开展调解员培训，选派指导5名调解员在协会现场开展投诉处理和纠纷调解工作。

（三）探索创新产业交易者教育方式方法，加强产业交易者服务

积极引导产业交易者正确参与期货市场，加强产业交易者教育。依托协会评选的期货经营机构服务实体经济优秀案例，分三批录制成宣传视频16期，通过第三方自媒体平台投放，播放量达到168.86万次，号召会员单位进行集中投放，形成宣传合力。加大交易者投教产品供给，打造协会投教品牌。持续出版期货投教丛书，2022年正式出版8种《期货投资者教育系列丛书》，至此已出版《期货投资者教育系列丛书》77种。制作并在协会官网发布贵金属、黑色金属、金融期货、有色金属、能源化工、农产品系列电子书共52本。结合《期货和衍生品法》、中国证监会最新出台的部门规章和规范性文件、典型案例、市场数据等撰写并出版新版《期海护航》。购买6730本投教书籍通过会员单位发放给产业交易者和个人交易者，普及期货基础知识，引导产业交易者树立风险意识。

（四）积极推动行业正面宣传，有效处置负面舆情

加强与主流媒体合作，围绕行业发展重点，配合各部门向主流媒体供稿，集中

做好党的二十大精神、《期货和衍生品法》等重点宣传，央视总台的《新闻联播》和《人民日报》、新华社等重点中央媒体报道协会相关新闻300余次，通过新华社参编渠道报送动态清样内参2篇，微信粉丝达29万，同比增长29.4%，促进期货声音向上向外“出圈”。继续做强做优协会门户网站，扩大信息公开范围，增加专业研报，紧跟行业要闻，开展专题宣传，全面展示期货市场功能和协会核心价值观，打造期货领域“一站式信息供给平台”。2022年网站关注度排名从5825名提升至1789名，日均浏览量同比增加201%，媒体主动查阅信息开展报道增加近20%。录制服务实体经济优秀案例视频16期，播放量共168万次，制作电子书52本，开发102种电子产品。组建含微信、微博、视频号、抖音的协会自媒体矩阵，成为行业重要宣传渠道。及时关注、处置突发负面和敏感舆情，持续监测发酵情况，做好两会期间、《期货和衍生品法》的发布、大宗商品价格剧烈波动、居间人问题、考试通知发布及调整，以及党的二十大召开前后的舆情监测与应对。起草舆情专项报告和监测页面11期，上报监管部门舆情日报、周报、月报、专报共600余篇次。

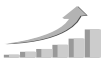
（五）推动行业文化建设，夯实高质量发展基础

推动党建引领行业文化建设，深入领会“两个结合”要求，倡导经营机构尊崇法治、恪守信义义务，修订发布《期货行业文化建设工作规划纲要》，编辑和完成《信义义务》书籍初稿。与央广经济之声合作播出行业文化建设音频144天次，录制上线《期货学堂》共46集。落实巡视整改任务，开展首次行业文化建设评估，形成报告报送中国证监会。通过完善自律规则体系将信义义务变成制度要求，探索机构不同业务条线信义义务的落实内涵，强化风险揭示。对照《期货和衍生品法》，以落实信义义务为目标加快行业自律规则体系建设，全力推动制定完善经纪、交易、服务、资管四大类合同指引，引导行业机构在“卖者尽责，买者自负”的基础上，提升定价和风险管理能力，保护交易者合法权益。推荐两家期货公司参与并荣获2021—2022年金融系统文化建设优秀单位，协会荣获中国金融思想政治工作研究会组织评选的“2022年全国金融系统思想政治工作和文化建设优秀调研成果”二等奖。

>>> 第二节 职工教育培训情况

一、上海期货交易所职工教育培训情况

2022年，面对新冠疫情对线下培训的影响，上海期货交易所围绕“建设世界一流交易所”的目标，在遵守防疫政策的前提下，围绕党性修养、综合素质、业务创



新，以及增强自信心、使命感等方面，对全所员工进行了多形式、分层次、有针对性的境内外培训。

（一）组织二十大精神学习，增强干部员工理论素养

一是按照中国证监会工作部署，通过证监会网络培训平台，组织中层及以上干部开展十九届六中全会及二十大精神网络轮训，共计59人完成34门课程60.5课时的学习。二是组织交易所集团各支部书记和部分党务工作人员进行党务干部专题培训，共计68人完成5门课程10课时的学习。三是开展创新理论学习“读书班”，以交易所会管干部、中层干部为重点，示范带动全员广泛参与。通过指定书单目录和每月学习主题，要求各级干部和员工将创新理论学习融入日常、抓在经常，通过个人自学、专题讲座、脱产培训、现场观摩、网络平台等方式，结合每月主题开展学习。2022年底，中层及以上干部提交书面学习成果并通过内刊《家园》组织征文，在交易所内进行成果共享。此外，在中层干部、新员工培训等常规培训中增加二十大精神等党性修养内容。

（二）持续推进常规培训，提升员工通用能力

一是组织中层及业务骨干培训，通过线上形式，组织交易所中层干部及业务骨干培训，内容涉及宏观大势、党性修养、前沿信息、领导力提升、二十大精神学习等方面，共12场，全集团共计2500人次参训。二是组织2022年入职的能源中心合署新员工14人参加时长2周的培训，内容包括交易所业务规则、规章制度、综合素质、通用能力、行业实操、廉政教育、线上游戏化培训、闭卷考试等，建立“双导师”机制，做好新老员工传帮带工作。三是邀请美国行业专家，通过线上形式，进行关于能源产品、宏观经济分析、交易所国际化推广、会员管理、衍生品、清算、交易监管等主题的培训，共20场，全集团共计1270人次参训。四是开展线下公开课。根据培训商提供的课表，每名员工选择一门课程，赴市内的授课地点参加线下培训，共有122名员工完成所选课程的学习。五是组织员工参加通用能力提升训练营。训练营以内训师、沟通、公文写作为主题，共计9场次195人次参训。其中，内训师项目还举办了集团微课大赛，共有19名员工参赛，形成精品微课19门。

（三）组织年轻员工赴行业企业以岗代训

2022年组织13名年轻的业务骨干“下基层，接地气”，赴3家行业实体企业以岗代训，加强各部门业务骨干、年轻员工对市场的直观认识，解决“本领恐慌”问题，提升服务实体企业的能力。实训结束后，每位员工都撰写了一篇调研报告，在交易所内共享实训成果。

（四）根据“后疫情”时代特点，运用好线上培训工具

一是英语在线学习。与“流利说”合作开展英语在线学习，学习内容为一对一

真人口语课和阅读解析，学习周期为6个月，共84人报名，学习结束并通过考核后报销其学费。二是开通交易所内部培训线上平台。与外部服务商合作，开发上线了交易所培训平台，目前已上传700多门课程，帮助员工利用碎片时间，以移动学习的方式提升学习效率。

二、郑州商品交易所职工教育培训情况

2022年，郑商所培训工作坚持党建引领、党建与业务深度融合，聚焦提升政治意识、提升职业能力、开拓视野思路、抓好源头培养、保障心理健康，以落地“学习地图”为抓手，以在线学习平台、“远航未来”训练营、员工交流论坛等为载体，健全干部队伍素质培养体系，提高教育培训工作的系统性、针对性、有效性。

（一）坚持把党的创新理论学习放在首位

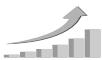
一是开展党的十九届六中全会精神、二十大精神等专题学习。通过党委会第一议题、中层干部创新理论学习“读书班”、专家辅导、青年理论小组集体学习、“三会一课”、支部联学联建等多种形式，党委率先垂范，全员、全面、全力深化对党的二十大精神的学习宣传贯彻工作，开展“坚定不移走中国特色现代期货市场发展之路”大讨论，切实把学习成果转化为推动郑商所工作高质量发展的实际成效。二是分类分层制定党务工作者、发展党员等“教育套餐”。按照务实管用、分类指导、按需施教的原则，组织开展各党支部书记、副书记、委员和专职从事党务工作的人员参加党务工作专题培训，组织15名发展对象及党支部重点培养的入党积极分子集中培训，深入推动学习教育深入人心、常态长效。三是聚焦提升政治意识，开展证监会网校专题学习、中组部调训，参加“红色领导力”领航学习班学习。围绕企业文化季、伦镍热点事件、投身新时代、风险管理、期权研究等主题，举办6期系列员工交流论坛，35名员工进行主题发言，1074人次员工参与交流，提升员工从讲政治高度看监管、做研究、干工作的本领。

（二）持续强化廉政纪律及保密安全培训

在学习平台开设廉政警示教育、保密教育、网络安全教育等专栏，上线8个系列廉政教育、5个系列保密安全教育和1个系列网络安全教育课程，配套开展廉政纪律、保密、机要密码、国家安全和网络安全小测验，学测结合，全面加强国家安全、廉洁从政教育，提升各级领导干部统筹发展和安全能力，增强全员国家安全意识和素养，确保守牢廉政、保密、机要密码和国家安全底线。

（三）不断提升员工专业素质和实操技能

一是聚焦提升职业能力，开展“远航未来”训练营活动，设立沟通表达、数字化思维、项目管理等子训练营，参训292人次；开展“繁星计划”内训师选拔培养



项目，以专业内训师队伍建设为抓手，不断丰富内部课程库，新增内部课程微课40多门，学习平台新增外采课程“职场必学”系列9门，上线党校学习、干部七种能力、企业文化、业务知识、“自我发展”系列培训等专项课程38门，累计访问14 941人次。二是聚焦抓好源头培养，在新员工成长起步阶段，突出政治素质和基础要求，把员工的“底子”搞扎实。首次联合下属公司组织56人次参加中国证监会系统初任培训、新员工入职集中培训。培训内容涵盖政治理论学习、监管文化宣贯、廉政保密培训、工作制度要求、期货基础知识、职业素养、素质拓展训练等内容。三是聚焦开拓视野思路，开展国际形势、宏观经济分析等公益讲座，开展英语培训，组织开展品种国际化、全面风险管理、金融科技、指数期货及场外衍生品等主题境外培训（线上），373人次参训。四是聚焦保障心理健康，开展心理疏导、运动健康、情绪管理讲座7次，共有2 668人次参训，充分关心关爱员工，尽力保障员工身心健康。特别是5月、11月郑州静态管理期间，郑商所迅速联系全国知名心理专家开展心理疏导讲座，有效缓解员工焦虑情绪，保障队伍健康稳定。

三、大连商品交易所职工教育培训情况

2022年，按照中国证监会培训工作总体要求，结合巡视整改相关内容，以及新冠肺炎疫情防控形势，大商所以政治建设为统领，围绕重点工作需要，利用“大商所云课堂”在线学习平台，通过“线上平台+线下讲授”“所内统一+部门自主”的培训方式，不断拓展培训资源，进一步加强全集团统筹，开展党性教育培训、重点业务培训、综合素质培训、国际化英语培训、管理能力培训、新员工入职培训、部门自主培训七大类培训。

一是印发《关于进一步加强并规范理论学习的意见》，启动党委会第一议题、创新理论学习读书班、青年理论学习小组等创新学习形式，全年开展党委会学习、党委中心组学习、读书班学习累计50余次。围绕党的二十大和十九届六中全会精神，立足“大讨论”、深化政治意识教育和巡视整改要求，通过在交易所党委、各党支部、党员干部等各个层面落实党支部集中学习研讨制度、组织参加证监会系统网络培训、启动脱产培训系列课程、设置线上线下政策理论宣教专区等方式，打造全方位、立体化的教育培训体系，不断提升干部员工的党性修养和理论水平。

二是深入开展业务知识培训，开展员工综合素质培训。围绕各部门工作重点，结合时事热点，围绕《期货和衍生品法》解读，新品种设计重难点问题和思考，中央对手方视角下风险管理，提升铁矿石定价影响力、服务国家战略，不断深化监管、促进期货市场高质量发展，交割规则与实务，指数期货市场功能、发展趋势，交易业务、场外业务介绍等，录制相关视频课程。为帮助员工形成对数据科学知识体系及其应用领域框架性的认知，了解中国能源战略与形势、双碳政策与高质量发展、碳达峰、碳中和的机遇，开阔数字化转型视野与底层逻辑、思维模式、数字化变革管理等，开展数字化转型、大数据、碳中和、元宇宙四大主题系列课程培训，提升

岗位胜任力。

三是开展管理能力提升培训，组织开展新员工入职培训。大商所系统中层干部开展管理提升系列视频课程，包括管理理念、战略思维、决策思维、团队建设、领导艺术、沟通艺术等内容，加强干部队伍建设。对新员工开展应知应会课程培训、业务知识培训、通用类业务培训、入职引导人专项辅导四大类内容，帮助新员工尽快完成角色转变。

四是开展国际化英语培训，统筹开展部门自主培训项目。为满足国际化过程中对语言提升的迫切诉求，实现英语水平的有效提高，继续开展线上英语培训项目，并组织完成更新“大商所实用英语 100 句”，营造良好英语学习氛围，为交易所国际化提供有力保障。针对部门特点的个性化学习需求，统筹组织交易所内各部门开展 169 项自主培训，内容涵盖政治素养、业务知识、办公技能、综合素质等方面，满足部门层面业务及综合素质提升需求，使培训更有针对性，培训效果更为直接。

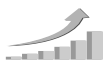
四、中国金融期货交易所职工教育培训情况

（一）坚持把学习贯彻习近平新时代中国特色社会主义思想作为加强干部员工培训工作的主线，持续加强政治建设和思想建设

交易所始终把学习贯彻习近平新时代中国特色社会主义思想作为干部员工培训工作的主线，深入学习党的十九届六中全会精神和党的二十大精神，研究制定学习宣传贯彻工作方案，通过专题学习、交流研讨、专家辅导等形式掀起学习热潮。领导班子带头开展强化政治意识专项教育，面向交易所讲授主题党课，进一步强化全所干部员工的政治意识、公权力意识和规矩意识。持续加强理论武装，将学习对象扩大到中层干部，由“关键少数”带动“绝大多数”。

（二）搭建职业全面发展平台，多渠道加强干部培养锻炼，提升干部履职能力建设

一是建立健全员工自主培训体系，增强培训针对性。根据《岗位培训及资格考试费用报销指引》，支持相关部门开展部门岗位培训。做好培训资料的汇总与分享，跟进培训参与情况与学习成果，推进培训成果转化。加强培训日常管理，维护办公自动化（OA）系统培训资料专区，做好培训成果的存档与分享工作。二是切实落实证监会系统优秀干部培养机制。做好 2022 年度证监会系统优秀年轻干部培养工作，选派 12 名干部员工借调证监会机关及系统单位工作。三是持续探索创新交易所内干部员工培训工作。组织开展交易所集团新员工培训、干部员工英语能力培训、中层干部政治能力和监管能力培训、11 期中金所大讲坛专题讲座、8 期“先锋月月讲”活动，指导并协助各部门组织开展部门岗位培训和业务培训。四是积极对接上海市金融人才发展工作。组织 2 人参加上海金融人才实践基地挂职锻炼，择优选拔推荐



青年干部申报上海市“三类金才”开发计划。

（三）重视青年员工培训教育工作，多措并举做好严管厚爱

针对青年员工，深化培训教育工作，持续做好严管厚爱。在各党支部成立青年理论学习小组，每月下发学习要点，收集青年员工学习心得，提升理论学习的计划性和系统性。结合党的二十大学习教育举办微宣讲比赛、知识竞赛、“揭榜行动”等活动，引导青年赓续前行，踔厉奋发。开展员工身心关爱计划，推进 EAP 心理咨询疏导服务、“青柚计划”等措施，丰富党委信箱、合理化建议征集、员工匿名留言“小树洞”等反映意见渠道，广泛听取员工心声。把落实监管文化建设要求作为培训教育抓手，通过内刊、主题展览等加强文化建设，凝练核心价值观，提升干部员工认同感、荣誉感，调动干部员工工作积极性、创造性，教育引导广大干部员工担当作为、干事创业，为金融期货事业发展凝聚合力。

五、广州期货交易所职工教育培训情况

2022 年是广期所事业开局之年，结合初创交易所人员特点，全年培训工作围绕夯实员工业务基础，以保障系统安全生产为重点，始终坚持“艰苦奋斗、规范运作、只争朝夕”的理念，多措并举、求实创新，初步搭建起具有广期所自身特色的员工培训体系。

（一）持续加强政治意识教育

通过系列学习深入领会十九届六中全会精神，全方位开展党的二十大精神学习，因地制宜利用广州丰富的红色教育基地资源的优势，通过创新活动激发党员干部的学习热情。

（二）打造特色培训品牌

搭建员工学习交流的有效平台，围绕工业硅等品种研究、资本市场热点问题、《期货和衍生品法》等专题进行交流讨论；开展业务规则“大比武”活动，以学习竞赛的方式夯实员工期货知识基础，全方位提升业务能力。

（三）坚持“请进来”和“走出去”相结合

把证监会系统内业务专家请进来，通过集中授课、业务研讨、点对点辅导、实操演练相结合的形式开展培训。同时让“期货新兵”走出去，深入开展市场调研、以岗代训等，通过实践学习提升专业能力。

（四）分层分类建立立体培训形式

开展管理人员政治能力和管理能力提升专项培训，组织新员工专项培训，从入

口关严格管理要求；利用云端培训平台整合课程资源，为干部员工自我提升提供支持，全面补强综合素质。

六、中国期货市场监控中心职工教育培训情况

中国期货监控扎实开展员工培训和锻炼，采取“请进来 走上台”的方式，使外部专家和内部员工讲授相结合，积极开展各类培训。一是为深入学习贯彻党的二十大精神，把广大干部员工的思想统一到党的二十大精神上来，把力量凝聚到党的二十大确定的各项任务上来，中国期货监控党委研究制订了党的二十大精神培训方案，组织全体干部利用6个半天时间听取中央党校和北京大学4位知名专家的线上授课培训。同时，中国期货监控领导分别围绕党的二十大精神为全体员工讲授线上专题党课。二是为进一步加深中心员工对新《反垄断法》的理解和把握，中国期货监控邀请中国政法大学专家围绕新《反垄断法》的基本原则、核心要义和主要内容，反垄断执法经典案例以及新《反垄断法》与资本市场的实际结合等，为中心员工进行线上讲解。三是为进一步做好场外衍生品交易报告库建设工作，增加员工对证券公司和期货公司风险管理公司场外衍生品业务的深入了解，中国期货监控邀请行业专家为中心员工开展6期场外衍生品业务系列讲座。四是为进一步做好疫情期间的心理健康疏导工作，引导中心员工以积极心态面对疫情，从容应对疫情背景下的工作生活，提高员工的心理调节能力，中国期货监控邀请北京师范大学专家结合相关心理咨询及教研工作案例，围绕疫情背景下的情绪识别、情绪管理与自我调控等对中心员工进行线上讲解。2022年，中国期货监控共开展包括党建、业务、心理健康、“场外衍生品大讲堂”等各类培训近20次。

七、中证商品指数公司职工教育培训情况

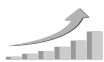
2022年，中证商品指数公司党委认真谋划，坚持党建引领，持续加强干部队伍教育、管理和培养，组织开展了党课教育培训、新员工入职培训、业务知识技能培训、企业文化培训等多层次针对性培训。公司全年累计参训939人次。

（一）坚持党建引领，强化理论武装

多举措学习宣传贯彻党的二十大精神，通过中心组学习、讲党课、支部学习、领导与干部谈心谈话、读书班、知识竞赛、演讲比赛、评优评先等形式，持续推动党史学习教育常态化长效化，强化理想信念教育和政治引领，提高员工队伍党的理论知识水平和党性修养。

（二）组织开展新员工入职培训

培训内容包括各部门业务及职责介绍、指数相关业务基础知识、公司组建历程



和重要意义、公司领导讲党课等，帮助新员工了解公司各项制度和业务，迅速适应岗位，为建设高质量的干部队伍打牢基础。

（三）深入开展业务知识技能培训

邀请行业内专家，针对宏观及大宗商品市场分析和未来展望、指数研发管理系统、网络安全、企业文化等主题进行培训，增强员工队伍对宏观形势的敏锐度，持续提升业务水平和综合素养。

八、中国期货业协会职工教育培训情况

翻译《美国期货业规则手册》等一系列成熟市场的期货交易法规和自律管理规则，在协会办公系统上传 17 部境外规则与规章汇编，促使全员充分学习借鉴成熟市场治理体系经验及国际公认监管标准，为协会完善自律规则体系建设提供参考。邀请衍生品法律专家解读《IOSCO 商品衍生品市场监管原则》，邀请基金业协会专家就管理人登记系统和会员管理系统进行交流分享，组织开展《期货和衍生品法》系列培训研讨等系列内训。用好纪检、党务、审计、信访等岗位，加强对员工特别是长期在业务部门工作的年轻干部的政治锤炼。2022 年抽调 1 名业务骨干到证监会整改办工作，3 名业务骨干分批次参加证监会办公厅信访办“以岗代训”，1 名财务岗员工参加财务功能性检查。

附录 3

2022 年中国期货市场大事记

1月，中金所贯彻易会满主席批示精神，在证监会帮扶办的统筹指导下，捐赠501万元专项资金及一批急需防疫物资驰援延长县疫情防控阻击战。

1月10日，大商所同中国物流与采购联合会在大连签署战略合作协议。

1月14日，中金所发布通知，对2022年会员股指期货交易手续费、国债期货手续费实施减收。预计全年可减收手续费15亿至20亿元。

1月19日，广期所与德意志交易所集团线上签署谅解备忘录。

1月20日，上海期货交易所发布《上海期货交易所商品互换业务管理办法》。

1月21日，中期协发布《期货行业全面推进乡村振兴助力实现共同富裕倡议书》。

2月15日，全国政协经济委员会副主任夏德仁一行到大商所调研。

2月15日，中国期货监控与广期所正式签署《进一步加强研究交流合作备忘录》。

2月17日，大商所召开干部大会，中国证监会副主席赵争平同志视频出席会议并讲话，严绍明同志任大连商品交易所党委副书记、总经理。

2月18日，中国证监会副主席赵争平一行莅临中证商品指数公司调研座谈。

2月23日，中国有色金属工业协会与中期协在北京签署战略合作协议。

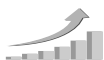
4月，工商银行、交通银行、民生银行成为上期所商品互换指定存管银行。

4月19日，郑商所通过线上方式召开第十次会员大会。

4月19日，广期所官网上线。

4月20日，第十三届全国人大常委会审议通过《期货和衍生品法》。

4月21日，中期协与中国石油和化学工业联合会在北京签署战略合作协议。



4月22日，河南省人民政府印发《关于支持郑州商品交易所优势再造的意见》。

4月25日，中金所对受新冠疫情影响严重的陕西、河南、天津会员实施手续费专项减收措施。

4月29日，《广州期货交易所交易规则》《广州期货交易所会员管理办法》对外发布。

5月5日，中国证监会副主席方星海出席中期协组织召开的《期货和衍生品法》座谈会并讲话。

5月13日，中国期货监控修改并发布《境外交易者统一开户业务操作规则》《期货市场统一开户业务操作指引》《特殊单位客户统一开户业务操作指引》。

5月16日，上期所召开第十一次会员大会。

5月19日，中期协发布《期货经营机构全面深化党建引领，促进高质量发展倡议书》。

6月1日，郑商所与波罗的海交易所信息服务有限公司签署谅解备忘录。

6月6日，中共中央政治局常委、国务院副总理韩正在辽宁考察期间专程视察大商所并作重要指示：“要高质量建设期货市场，更好服务实体经济，为大宗商品保供稳价发挥积极作用。”大商所党委书记、理事长冉华作汇报工作。

6月6日，《广州期货交易所交易管理办法》《广州期货交易所结算管理办法》《广州期货交易所风险管理办法》《广州期货交易所期货交易者适当性管理办法》《广州期货交易所做市商管理办法》等12项业务规则对外发布并实施。

6月16日，辽宁省政协主席、党组书记周波一行到大商所调研。

6月22日，上期所与中国物流集团有限公司签署战略合作协议。

6月24日，由中期协主办的第十四届中国期货分析师暨场外衍生品论坛以线上形式顺利召开。

6月30日，郑商所与深圳证券交易所建立合作机制，合作开展上市公司系列培训。

7月10日，交通运输部副部长赵冲久在大连调研东北亚国际航运中心建设期间，专门听取大商所业务发展汇报。

7月12日，上期所及其子公司上海国际能源交易中心与马来西亚衍生产品交易所签署了谅解备忘录。

7月15日，中证商品指数公司与郑商所易盛公司签订2022年技术合作协议。

7月22日，中金所挂牌上市中证1000股指期货、中证1000股指期权。

7月25日，首届陆家嘴金融交易科技节以线上方式拉开帷幕。本次科技节由中国证监会指导，上交所、上期所、中金所联合主办。

8月1日，国务院发展研究中心党组成员、副主任余斌带队到广期所调研。

8月8日，黄大豆1号、黄大豆2号和豆油期权在大商所挂牌上市。

8月8日，中国矿产资源集团党组书记、董事长姚林一行到访大商所。

8月12日，中国证监会发布《关于修改部分证券期货规章的决定》《关于修改部分证券期货规范性文件的决定》。

8月15日，郑商所上线国内首个标准仓单登记查询系统。

8月15日，郑商所对白糖、PTA和甲醇品种做市商开展组合保证金业务，系国内期货市场首推。

8月19日，中证商品指数公司与中国糖业协会签署战略合作框架协议。根据协议，双方将以课题合作为切入点探索开展食糖价格指数编制工作。

8月26日，郑商所正式挂牌交易菜籽油、花生期权。

8月26日，由上期所主办的第十九届上海衍生品市场论坛以线上形式举行。中国证监会党委委员、副主席方星海，上海市委常委、常务副市长、市政府党组副书记吴清出席并致辞。

9月1日，在2022年中国国际服务贸易交易会“环境服务·双碳经济论坛”上，大商所与国家气象中心（中央气象台）正式发布“中央气象台—大商所温度指数”。

9月2日，2022年期货公司分类评价结果公布。

9月2日，上期所、郑商所、大商所、中金所发布公告，宣布即日起QFII/RQFII可参与黄金、PTA、铁矿石、股指期权等41个期货和期权品种合约交易。

9月2日，中国期货监控两位专家入选国际衍生品数据要素行业专家组（DDE IRG）。

9月6日—8日，郑商所以线上方式举办2022中国（郑州）国际期货论坛，中国证监会副主席方星海、河南省政府副省长费东斌出席并致辞。

9月7日，第三届中日资本市场论坛以视频方式举行。中国证监会副主席方星海，日本金融厅长官中岛淳一、证券交易监视委员会委员长谷川充弘出席论坛并致辞。论坛期间，中金所与日本交易所集团宣布签署合作谅解备忘录。

9月16日，中国证监会就《期货交易所管理办法（征求意见稿）》公开征求意见。

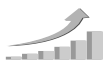
9月16日，中国证监会副主席方星海主持召开2022年上半年期货品种功能评估专家评审会。

9月19日，上交所中证500ETF期权和深交所创业板ETF、中证500ETF期权上市交易。

9月19日，与场内场外联动风险监测机制相衔接的中国期货监控交易报告库（TR）新版数据报送系统正式启用。

9月22日，中国氢价指数体系发布暨上期所和上海环境能源交易所战略合作协议签约活动成功举行。

9月26日，中国期货监控期货市场统一开户系统和期货互联网开户系统顺利完成广期所功能上线，正式受理客户申请广期所交易编码并成功完成开立。



10月13日，上海市政协副主席寿子琪一行专题调研中金所。

10月20日，中国证监会副主席赵争平赴中国期货监控专题调研场外衍生品交易报告库（TR）工作。

11月7日，郑商所联合河南省发改委、河南省物流与采购联合会发布国内首个冷链物流运价指数。

11月8日，中金所数据有限公司正式揭牌。

11月10日，大商所联合马来西亚衍生产品交易所通过线上形式成功举办第16届国际油脂油料大会。

11月18日，中国证监会发布《证券期货业机构内部接口证券交易》等7项金融行业标准。

11月23日，全国性大宗商品仓单注册登记中心启动。

12月8日，广期所与新疆维吾尔自治区政府签订战略合作备忘录。

12月9日，大商所大宗商品仓单登记中心上线。

12月12日，深证100ETF期权上市交易。

12月12日，广期所举办期货保证金存管业务启动活动，广东省人民政府副省长张新出席。

12月15日，上期所上期综合业务平台上线保税标准仓单交易，首个上线交易标的为20号胶保税标准仓单。

12月18日，广东省省委常委、广州市市委书记林克庆，广州市市委副书记、市长郭永航带队，到广期所现场调研。

12月19日，中金所挂牌上市上证50股指期货。

12月20日，中国期货监控正式启动向上期所、郑商所、大商所、广期所4家商品期货交易所的场外衍生品交易信息常态化共享机制。

12月22日，广期所举办工业硅期货和期权上市活动，工业硅期货顺利上市交易。中国证监会方星海副主席以视频连线方式出席活动并致辞，广东省副省长张新和广州市市长郭永航现场出席并致辞。

12月23日，工业硅期权在广期所挂牌交易。

12月26日，螺纹钢期权和白银期权在上期所挂牌交易。

12月26日，大商所黄大豆1号、黄大豆2号、豆粕、豆油期货和期权正式引入境外交易者参与交易。中国证监会副主席方星海通过视频连线致辞。

12月28日，中证商品指数公司中证商品期货指数系列正式发布。

12月30日，中国期货监控正式上线新一代期货公司监管综合信息系统（FISS系统）。

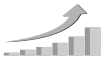
12月31日，郑商所数据智能分析与服务平台获中国人民银行、中国证监会联合组织评选的“2021年度金融科技发展奖”一等奖。

附录 4

文件汇编

上海期货交易所（含上海国际能源交易中心）发布文件

发文日期	文号	文件标题	主要内容
2022 年 2 月 22 日	[2022] 12 号	关于发布《上海国际能源交易中心交易规则》（修订版）的公告	完善市场出现异常情况的临时处置措施
2022 年 2 月 7 日	[2022] 14 号	关于发布《上海期货交易所交易细则（修订版）》的公告	完善交易席位申请条件、材料等规则
2022 年 3 月 22 日	[2022] 31 号	关于发布《上海期货交易所信息管理办法》和相关实施细则修订版的公告	<ol style="list-style-type: none"> 1. 制定《上海期货交易所信息管理办法》，全面规定信息内容及发布、信息服务、信息使用、收费标准等内容 2. 删除《上海期货交易所交易细则》《上海期货交易所期权交易管理办法》信息管理的条款，相关内容并入《上海期货交易所信息管理办法》 3. 在《上海期货交易所交易细则》增加行权量的定义，将《上海期货交易所期权交易管理办法》行权量的定义并入《上海期货交易所交易细则》
2022 年 6 月 17 日	[2022] 49 号	关于发布《上海期货交易所阴极铜期货合约（修订版）》的公告	修订《上海期货交易所阴极铜期货合约》交割品级的规定，并对合约附件涉及交割品级的表述做相应修改



续表

发文日期	文号	文件标题	主要内容
2022年7月 22日	[2022] 75号	关于修订《上海期货交易所黄金期货交割实施细则（试行）》的公告	完善签发标准仓单程序以及入库、出库等规则
2022年8月 4日	[2022] 26号	关于发布《上海国际能源交易中心股份有限公司章程》修订版的公告	将上期能源的注册资本由50亿元调整至100亿元
2022年12月 2日	[2022] 129号	关于发布《上海期货交易所阴极铜期货期权合约》修订版的公告	修改行权价格覆盖范围
2022年12月 20日	[2022] 142号	关于发布螺纹钢期货期权合约和白银期货期权合约的公告	上市螺纹钢期权和白银期权

郑州商品交易所发布文件

发文日期	文号	文件标题	主要内容
2022年1月 7日	公告〔2022〕 1号	关于调整指定白糖交割仓库升贴水的公告	将指定白糖交割仓库云南广大铁路物资储运有限公司的升贴水由-170元/吨调整至-140元/吨，自2022年12月1日起执行
2022年1月 10日	公告〔2022〕 2号	关于动力煤期货2301合约有关事项的公告	动力煤期货2301合约的交易保证金标准为30%，涨跌停板幅度为10%。动力煤期货2301合约的交易手续费标准为120元/手，日内平今仓交易手续费标准为120元/手。非期货公司会员或者客户在动力煤期货2301合约上单日开仓交易的最大数量为50手
2022年1月 20日	公告〔2022〕 3号	关于指定硅铁、锰硅交割厂库中证寰球商贸（上海）有限公司变更名称的公告	指定硅铁、锰硅交割厂库“中证寰球商贸（上海）有限公司”现更名为“中信寰球商贸有限公司”，厂库简称变更为“中信寰球”，联系人和联系方式保持不变
2022年1月 28日	公告〔2022〕 5号	关于2022年2月期货品种做市合约和重点合约的公告	公布2022年2月各期货品种做市合约和重点合约

续表

发文日期	文号	文件标题	主要内容
2022年2月10日	公告〔2022〕6号	关于动力煤期货2302合约有关事项的公告	动力煤期货2302合约的交易保证金标准为30%，涨跌停板幅度为10%。动力煤期货2302合约的交易手续费标准为120元/手，日内平今仓交易手续费标准为120元/手。非期货公司会员或者客户在动力煤期货2302合约上单日开仓交易的最大数量为50手
2022年2月16日	公告〔2022〕7号	关于调整泛糖专区保证金的公告	将综合业务平台泛糖专区基差贸易保证金调整为300元/吨，自2022年2月17日起执行
2022年2月18日	公告〔2022〕8号	关于调整动力煤期货合约交易指令每次最小开仓下单量和最大下单量的公告	自2022年2月21日当晚夜盘交易起，动力煤期货合约交易指令每次最小开仓下单量调整为2手，限价指令每次最大下单量调整为50手，市价指令每次最大下单量调整为10手
2022年2月23日	公告〔2022〕10号	关于调整玻璃期货仓单仓储费标准的公告	玻璃期货仓单仓储费标准由0.25元/吨·天调整为1.2元/吨·天，该调整自2023年3月第16个交易日起实施
2022年2月25日	公告〔2022〕11号	关于河南国储物流股份有限公司变更指定棉花、棉纱、尿素交割仓库主体的公告	指定棉花、棉纱、尿素交割仓库“河南国储物流股份有限公司”主体变更为“国家粮食与物资储备局河南局四三二处”，交割仓库简称变更为“四三二处”，交割仓库的权利和义务由四三二处承继，交割仓库编号和联系人及联系方式保持不变
2022年2月28日	公告〔2022〕12号	关于2022年3月期货品种做市合约和重点合约的公告	2022年3月各期货品种做市合约和重点合约
2022年3月4日	公告〔2022〕13号	关于动力煤期货2303合约有关事项的公告	动力煤期货2303合约的交易保证金标准为40%，涨跌停板幅度为10%。非期货公司会员或者客户在动力煤期货2303合约上单日开仓交易的最大数量为50手
2022年3月7日	公告〔2022〕15号	关于调整部分期货合约交易指令每次最小开仓下单量的公告	自2022年3月8日当晚夜盘交易起，动力煤期货合约交易指令每次最小开仓下单量调整为4手。自2022年3月9日起，强麦期货2205、2207、2209、2211及2301合约交易指令每次最小开仓下单量调整为10手

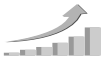


续表

发文日期	文号	文件标题	主要内容
2022年3月9日	公告〔2022〕16号	关于对菜粕期货2205合约实施交易限额的公告	自2022年3月10日当晚夜盘交易时起，非期货公司会员或者客户在菜粕期货2205合约上单日开仓交易的最大数量为1000手
2022年3月11日	公告〔2022〕17号	关于对动力煤期货部分合约实施交易限额的公告	自2022年3月14日当晚夜盘交易时起，非期货公司会员或者客户在动力煤期货2204、2205、2206、2207、2208、2209、2210、2211、2212、2301、2302及2303合约上单日开仓交易的最大数量为20手
2022年3月14日	公告〔2022〕18号	关于指定PTA交割厂库福化工贸（漳州）有限公司变更名称的公告	PTA交割厂库“福化工贸（漳州）有限公司”更名为“福建海裕石化有限公司”，厂库简称由“福化工贸（漳州）”变更为“福建海裕”，联系人和联系方式保持不变
2022年3月23日	公告〔2022〕20号	关于指定PTA交割品牌生产厂家珠海碧辟化工有限公司变更名称的公告	PTA交割品牌生产厂家“珠海碧辟化工有限公司”名称变更为“珠海英力士化工有限公司”，品牌简称为“珠海英力士”
2022年3月25日	公告〔2022〕21号	关于增设指定花生交割厂库与车（船）板服务机构的公告	增设山东金胜粮油食品有限公司为指定花生交割厂库与车（船）板服务机构；增设浙江杭实善成实业有限公司为指定花生交割厂库；增设河南丰盛农业开发有限公司、济宁市第一粮库有限公司、青岛中储物流有限公司为花生车（船）板服务机构
2022年3月30日	公告〔2022〕22号	关于2022年4月期货品种做市合约和重点合约的公告	2022年4月各期货品种做市合约和重点合约
2022年4月8日	公告〔2022〕24号	关于动力煤期货2304合约有关事项的公告	动力煤期货2304合约交易保证金标准为50%，涨跌停板幅度为10%。非期货公司会员或者客户单日开仓交易的最大数量为20手
2022年4月15日	公告〔2022〕25号	关于暂停指定红枣期货质检机构的公告	暂停中国检验认证集团新疆有限公司的红枣期货质检业务
2022年4月19日	公告〔2022〕26号	关于对菜粕期货部分合约实施交易限额的公告	自2022年4月20日当晚夜盘交易时起，非期货公司会员或者客户在菜粕期货2205、2207、2208、2209及2211合约上单日开仓交易的最大数量为500手

续表

发文日期	文号	文件标题	主要内容
2022年4月 22日	公告〔2022〕 27号	关于增设指定红枣交割仓库的公告	增设喀什新鑫果业有限公司、新疆中麦开发实业有限公司、新疆乐优食品有限公司为指定红枣交割仓库，自2022年5月24日启用
2022年4月 25日	公告〔2022〕 29号	关于取消强麦车（船）板交割服务机构资格的公告	取消河南东方粮食贸易有限公司延津分公司的郑州商品交易所指定强麦车（船）板交割服务机构资格
2022年4月 28日	公告〔2022〕 30号	关于2022年5月期货品种做市合约和重点合约的公告	公布2022年5月各期货品种做市合约和重点合约
2022年4月 28日	公告〔2022〕 31号	关于调整普麦期货合约交易指令每次最小开仓下单量的公告	自2022年5月5日起，普麦期货合约交易指令每次最小开仓下单量调整为10手
2022年4月 29日	公告〔2022〕 32号	关于增设PTA免检品牌的公告	增设江苏虹港石化有限公司、浙江独山能源有限公司、福建福海创石油化工有限公司生产的PTA为指定PTA期货免检品牌
2022年4月 29日	公告〔2022〕 33号	关于调整指定棉花交割仓库的公告	取消中储棉绍兴有限公司指定棉花交割仓库资质，暂停中储棉徐州有限公司、中储棉如皋有限公司指定棉花交割仓库交割业务，暂停中储棉菏泽有限责任公司、中储棉武汉有限公司棉花期货入库业务
2022年5月 6日	公告〔2022〕 34号	关于调整部分期货合约交易指令每次最小开仓下单量的公告	自2022年5月10日起，强麦、早籼稻、粳稻及晚籼稻期货合约交易指令每次最小开仓下单量调整为10手
2022年5月 10日	公告〔2022〕 36号	关于动力煤期货2305合约有关事项的公告	交易保证金标准为50%，涨跌停板幅度为10%。非期货公司会员或者客户单日开仓交易的最大数量为20手
2022年5月 12日	郑商发〔2022〕 112号	关于发布《郑州商品交易所调解委员会调解规则》的公告	制定了《郑州商品交易所调解委员会调解规则》，现予发布
2022年5月 13日	公告〔2022〕 39号	关于增设指定棉纱交割仓库的公告	增设河南豫棉物流有限公司为指定棉纱交割仓库，自2022年6月21日启用
2022年5月 18日	公告〔2022〕 44号	关于取消指定早籼稻交割仓库资格的公告	取消株洲、禄口国家粮食储备库的指定早籼稻交割仓库资格
2022年5月 23日	公告〔2022〕 45号	关于修订《郑州商品交易所基差贸易业务指引》的公告	对《郑州商品交易所基差贸易业务指引》进行了修订，予以发布



续表

发文日期	文号	文件标题	主要内容
2022年5月30日	公告〔2022〕46号	关于2022年6月期货品种做市合约和重点合约的公告	公布2022年6月各期货品种做市合约和重点合约
2022年6月7日	公告〔2022〕48号	关于动力煤期货2306合约有关事项的公告	交易保证金标准为50%，涨跌停板幅度为10%。非期货公司会员或者客户单日开仓交易的最大数量为20手
2022年6月8日	公告〔2022〕49号	关于中粮食品（山东）有限公司、中纺粮油（湛江）有限公司变更名称的公告	“中粮食品（山东）有限公司”更名为“中粮山萃花生制品（威海）有限公司”“中纺粮油（湛江）有限公司”更名为“中粮油脂（湛江）有限公司”，联系人与联系方式均保持不变
2022年6月10日	公告〔2022〕50号	关于调整甲醇、短纤品种套期保值持仓额度申请及使用方式的公告	甲醇、短纤品种适用按品种方式申请一般月份套期保值持仓额度
2022年6月24日	公告〔2022〕51号	关于发布菜油期货业务规则修订案的公告	对《郑州商品交易所期货交割细则》《郑州商品交易所标准仓单管理办法》中菜油期货相关内容进行了修订，自菜油期货2307合约起施行
2022年6月28日	公告〔2022〕52号	关于2022年7月期货品种做市合约和重点合约的公告	公布2022年7月各期货品种做市合约和重点合约
2022年6月30日	公告〔2022〕53号	关于取消指定棉纱交割厂库资格的公告	取消伟嘉纺织集团有限公司的指定棉纱交割厂库资格
2022年6月30日	公告〔2022〕54号	郑州商品交易所关于优化业务规则体系征求市场意见的公告	优化涉及《郑州商品交易所期货交割细则》《郑州商品交易所标准仓单管理办法》等6个规则的整合和拆分，以及整合现有上市品种合约及规则拆分内容形成的23个品种细则
2022年6月30日	公告〔2022〕55号	关于期货做市商增补名单的公告	公布增补的各期货品种做市商名单
2022年7月1日	公告〔2022〕56号	关于征集2022年期货和衍生品法律研究课题合作单位的公告	拟公开征集课题合作单位，现将有关事项公告
2022年7月1日	公告〔2022〕57号	关于增设指定尿素交割仓（厂）库和提货点的公告	增设中农云仓物流（宜昌）有限公司、国家粮食和物资储备局湖北局七三六处为指定尿素交割仓库；增设湖北三宁化工股份有限公司、江苏农垦农业服务有限公司为指定尿素交割厂库；增加中化化肥有限公司、成都云图控股股份有限公司、四川农资化肥有限责任公司指定尿素交割厂库提货点

续表

发文日期	文号	文件标题	主要内容
2022年7月6日	公告〔2022〕58号	关于动力煤期货2307合约有关事项的公告	动力煤期货2307合约的交易保证金标准为50%，涨跌停板幅度为10%。非期货公司会员或者客户单日开仓交易的最大数量为20手
2022年7月18日	公告〔2022〕59号	关于白糖质检机构变更名称的公告	白糖质检机构“广东省科学院生物工程研究所”现更名为“广东省科学院生物与医学工程研究所”
2022年7月22日	公告〔2022〕60号	关于增设指定玻璃交割厂库与提货点的公告	增设石家庄玉晶玻璃有限公司为指定玻璃交割厂库。增加浙江永安资本管理有限公司玻璃交割厂库当阳提货点
2022年7月27日	公告〔2021〕61号	关于2022年8月期货品种做市合约和重点合约的公告	公布2022年8月各期货品种做市合约和重点合约
2022年8月4日	公告〔2022〕62号	关于动力煤期货2308合约有关事项的公告	动力煤期货2308合约交易保证金标准为50%，涨跌停板幅度为10%。非期货公司会员或者客户单日开仓交易的最大数量为20手
2022年8月15日	公告〔2022〕64号	关于上线标准仓单登记查询系统的公告	进一步完善郑州商品交易所标准仓单登记查询服务，郑商所于8月15日上线标准仓单登记查询系统
2022年8月16日	公告〔2022〕65号	关于增设纯碱免检品牌的公告	增设江苏苏盐井神股份有限公司的“井神”牌、青海发投碱业有限公司的“羚路”牌、重庆湘渝盐化有限责任公司的“万湘”牌为纯碱期货免检品牌
2022年8月19日	公告〔2022〕66号	关于调整花生车（船）板交割部分项目服务费的公告	花生车（船）板交割的配合检验费调整为20元/吨；同时增设恒温库临时存储费，标准为1.5元/吨·天
2022年8月19日	公告〔2022〕67号	关于发布菜籽油、花生期权合约的公告	发布《郑州商品交易所菜籽油期权合约》《郑州商品交易所花生期权合约》
2022年8月19日	公告〔2022〕68号	关于挂牌菜籽油、花生期权合约有关事项的公告	公告挂牌菜籽油、花生期权合约有关事项
2022年8月25日	公告〔2022〕69号	关于菜籽油期权、花生期权做市商名单的公告	现将菜籽油期权、花生期权做市商名单公布
2022年8月26日	公告〔2022〕70号	关于2022年9月期货品种做市合约和重点合约的公告	公布2022年9月各期货品种做市合约和重点合约



续表

发文日期	文号	文件标题	主要内容
2022年8月26日	公告〔2022〕71号	关于调整锰硅期货免检品牌的公告	暂停宁夏晟晏实业集团能源循环经济有限公司的“晟晏”牌锰硅期货免检品牌资格。批准内蒙古普源铁合金有限责任公司的“蒙普源”牌和重庆大朗冶金新材料有限公司的“博赛集团”牌为锰硅期货免检品牌
2022年8月26日	公告〔2022〕72号	关于调整部分交割仓（厂）库的公告	取消青岛嘉德瑞工贸有限公司短纤交割厂库资格；暂停厦门银祥油脂有限公司、中粮油脂（湛江）有限公司菜籽粕交割仓库及厂库业务；暂停厦门银祥油脂有限公司、中粮油脂（湛江）有限公司菜籽油交割厂库业务；暂停河南濮阳皇甫国家粮食储备库有限公司尿素交割仓库业务
2022年8月26日	公告〔2022〕73号	关于征集指定玻璃交割厂库的公告	公开征集指定玻璃交割厂库
2022年8月31日	公告〔2022〕74号	关于优化业务规则体系的公告	按照“业务办法+品种细则”的架构对规则体系进行了优化
2022年9月2日	公告〔2022〕75号	关于增设花生期货车（船）板交割服务机构的公告	增增益海嘉里（盘锦）食品工业有限公司、辽宁正业花生产业发展有限公司、阜新市农牧产业（集团）有限公司、营口锦豪农贸有限公司为花生车（船）板交割服务机构。以上新增车（船）板交割服务机构自2022年9月1日起开展花生期货交割业务
2022年9月2日	公告〔2022〕76号	关于合格境外机构投资者和人民币合格境外机构投资者参与商品期货、期权合约的公告	合格境外机构投资者和人民币合格境外机构投资者可以参与郑州商品交易所相关商品期货、期权合约的交易
2022年9月6日	公告〔2022〕77号	关于动力煤期货2309合约有关事项的公告	交易保证金标准为50%，涨跌停板幅度为10%。非期货公司会员或者客户单日开仓交易的最大数量为20手
2022年9月14日	公告〔2022〕78号	关于征集硅铁锰硅指定交割仓（厂）库及启用时间的公告	公开征集硅铁、锰硅指定交割仓（厂）库
2022年9月16日	公告〔2022〕79号	关于增设指定菜籽粕交割厂库的公告	增设厦门建发物产有限公司、厦门市明穗粮油贸易有限公司为指定菜籽粕交割厂库，自2022年12月1日起开展菜籽粕期货交割业务

续表

发文日期	文号	文件标题	主要内容
2022年9月 16日	公告〔2022〕 80号	关于取消指定红枣交割仓库资格的公告	取消新疆枣都现代农业股份有限公司的指定红枣交割仓库资格
2022年10月 12日	公告〔2022〕 82号	关于调整内地指定棉花交割仓库升贴水的公告	公告调整内地指定棉花交割仓库升贴水标准,自2022年10月18日开始执行
2022年10月 13日	公告〔2022〕 83号	关于动力煤期货2310合约有关事项的公告	动力煤期货2310合约交易保证金标准为50%,涨跌停板幅度为10%。非期货公司会员或者客户单日开仓交易的最大数量为20手
2022年10月 17日	公告〔2022〕 84号	关于增设指定尿素交割仓(厂)库的公告	增设河南豫棉物流有限公司、江阴市协丰棉麻有限公司为指定尿素交割仓库;增设浙江永安资本管理有限公司、浙江景诚实业有限公司为指定尿素交割厂库
2022年10月 28日	公告〔2022〕 85号	关于修订红枣期货合约及相关业务规则的公告	对红枣期货合约及相关业务规则进行了修订
2022年10月 28日	公告〔2022〕 86号	关于发布红枣期货替代交割品升贴水的公告	对红枣期货替代交割品升贴水公告,适用于红枣期货2312及后续合约,自红枣期货2312合约挂牌之日起施行
2022年11月 4日	公告〔2022〕 87号	关于增设指定白糖交割厂库的公告	增设广西糖业集团柳兴制糖有限公司为郑州商品交易所指定白糖交割厂库,自2022年12月1日起开展白糖期货交割业务
2022年11月 4日	公告〔2022〕 88号	关于修订期权合约及有关业务规则的公告	对期权合约及《郑州商品交易所期权交易管理办法》进行了修订
2022年11月 4日	公告〔2022〕 89号	关于动力煤期货2311合约有关事项的公告	动力煤期货2311合约交易保证金标准为50%,涨跌停板幅度为10%。非期货公司会员或者客户单日开仓交易的最大数量为20手
2022年11月 8日	公告〔2022〕 90号	关于调整棉花期货替代交割品升贴水的公告	对棉花期货替代交割品升贴水调整公告,自2023/2024年度生产的棉花开始实施
2022年11月 29日	公告〔2022〕 93号	关于2022年12月期货品种做市合约和重点合约的公告	公布2022年12月各期货品种做市合约和重点合约
2022年12月 2日	公告〔2022〕 94号	关于指定棉纱交割仓库浙江尖峰国际贸易有限公司变更名称的公告	指定棉纱交割仓库“浙江尖峰国际贸易有限公司”现更名为“浙江尖峰供应链有限公司”,仓库简称变更为“尖峰供应链”



续表

发文日期	文号	文件标题	主要内容
2022年12月 2日	公告〔2022〕 95号	郑州商品交易所关于就菜籽油、菜籽粕、花生仁期货及期权引入境外交易者相关业务规则修改公开征求意见的公告	郑州商品交易所拟修改《郑州商品交易所期权交易管理办法》《郑州商品交易所菜籽油期货业务细则》《郑州商品交易所菜籽粕期货业务细则》《郑州商品交易所花生仁期货业务细则》，公开征求市场意见
2022年12月 6日	公告〔2022〕 96号	关于动力煤期货2312合约有关事项的公告	动力煤期货2312合约交易保证金标准为50%，涨跌停板幅度为10%。非期货公司会员或者客户单日开仓交易的最大数量为20手
2022年12月 7日	公告〔2022〕 97号	关于修订《郑州商品交易所“三业”活动管理办法》的公告	对《郑州商品交易所“三业”活动管理办法》进行了修订
2022年12月 13日	公告〔2022〕 98号	关于调整红枣期货合约交易指令每次最小开仓下单量的公告	自2022年12月15日起，红枣期货合约交易指令每次最小开仓下单量调整为2手，其中红枣期货2301合约交易指令每次最小开仓下单量仍为4手
2022年12月 28日	公告〔2022〕 100号	关于2023年1月期货品种做市合约和重点合约的公告	2023年1月各期货品种做市合约和重点合约予以公布
2022年12月 28日	公告〔2022〕 101号	关于取消晚籼稻交割仓库资格的公告	取消中粮粮油安徽国家粮食储备库有限公司的指定晚籼稻交割仓库资格

大连商品交易所发布文件

发文日期	文号	文件标题	主要内容
2022年1月 11日	〔2022〕1号	关于修改《大连商品交易所指定交割仓库资格与监督管理规定》的公告	增加仓库担保单位为国有企业的担保材料相关要求
2022年1月 24日	〔2022〕4号	关于修改《大连商品交易所风险管理办法》的公告	适度收紧玉米品种一般月份持仓限额
2022年1月 24日	〔2022〕5号	关于修改《大连商品交易所套期保值管理办法》的公告	取消交割月份套保持仓“自动翻倍”的规定

续表

发文日期	文号	文件标题	主要内容
2022年1月25日	[2022] 7号	关于修改《大连商品交易所鸡蛋期货业务细则》等规则的公告	一是调整鸡蛋厂库仓单结算流程；二是允许在厂库开展车板交割；三是加强交割鸡蛋的食品安全管理；四是优化厂库发货和货主提货顺序；五是缩短从交收日到指定交割仓库、车板交割交货的时间间隔
2022年3月21日	[2022] 13号	关于修改《大连商品交易所风险管理办法》的公告	一是取消线型低密度聚乙烯、聚丙烯、聚氯乙烯3个品种交割月前月第15个交易日的梯度保证金；二是完善相关表述，明确开仓和结算时交易保证金计算标准，以及交易所可以另行规定并公布套期保值交易的保证金标准
2022年3月21日	[2022] 14号	关于修改《大连商品交易所套期保值管理办法》的公告	完善相关表述，明确交易所可以对全部或者部分品种、合约套期保值交易的保证金、手续费标准进行调整
2022年4月14日	[2022] 18号	关于修改《大连商品交易所焦煤期货业务细则》等规则的公告	调整焦煤交割质量标准
2022年4月15日	[2022] 20号	关于修改《大连商品交易所液化石油气期货业务细则》的公告	缩短液化石油气仓单有效期
2022年4月28日	[2022] 30号	关于修改《大连商品交易所标准仓单管理办法》和相关品种期货业务细则的公告	完善交割质量争议处理相关规则
2022年6月2日	[2022] 39号	关于修改部分场外业务规则的公告	延长标准仓单交易、基差交易、商品互换、场外期权的交易时间
2022年6月10日	[2022] 43号	关于制定和修改场外参与主体及业务规则的公告	整合场外主体架构，将场外参与主体简化为产业交易商、衍生品交易商、客户三类
2022年6月10日	[2022] 45号	关于修改《大连商品交易所聚氯乙烯期货业务细则》的公告	增加聚氯乙烯集团交割相关规定
2022年7月12日	[2022] 50号	关于修改《大连商品交易所结算管理办法》的公告	增加客户级别移仓相关规定
2022年7月29日	[2022] 54号	关于发布黄大豆1号、黄大豆2号、豆油期货期权合约的公告	发布黄大豆1号、黄大豆2号、豆油期货期权合约



续表

发文日期	文号	文件标题	主要内容
2022年8月12日	[2022] 56号	关于修改《大连商品交易所豆油期货业务细则》的公告	缩短豆油仓单有效期
2022年8月12日	[2022] 57号	关于修改《大连商品交易所铁矿石期货业务细则》的公告	增加铁矿石厂库动态升贴水提货地点相关规定
2022年8月17日	[2022] 59号	关于修改《大连商品交易所交割管理办法》的公告	增加协议交收相关规定
2022年8月18日	[2022] 61号	关于发布协议交收库相关管理办法的公告	增加交易所协议交收库管理相关规定
2022年8月25日	[2022] 66号	关于修改《大连商品交易所交易管理办法》和《大连商品交易所期权交易管理办法》的公告	增加最小下单数量相关规定
2022年12月2日	[2022] 92号	关于修改《大连商品交易所生猪期货业务细则》和《大连商品交易所鸡蛋期货业务细则》的公告	一是就生猪期货，针对质检机构无法到场的情况，增加远程视频或交易所认可的其他方式检验的规定；二是就鸡蛋期货，针对质检机构因不可抗力无法到场的情况，结合不同的检验指标增加远程视频检验或样品运出至合适地点由质检机构进行检验等规定
2022年12月6日	[2022] 93号	关于修改《大连商品交易所线型低密度聚乙烯期货业务细则》等规则的公告	一是对交割品牌相关概念重新定位；二是扩大交割品牌资格申请人范围；三是简化免检交割所需质量证明材料要求
2022年12月6日	[2022] 94号	关于发布《大连商品交易所合成树脂期货交割品牌工作办法》的公告	一是调整品牌制度定位；二是细化品牌日常管理；三是建立品牌制度与厂库制度的联系；四是简化免检交割流程奠定基础
2022年12月7日	[2022] 95号	关于发布《大连商品交易所大宗商品仓单登记中心业务管理办法（试行）》的公告	一是确定大宗商品登记业务的总体原则和基本概念；二是规范参与主体管理；三是规定登记业务和查询业务流程；四是明确参与主体的禁止行为与风险责任
2022年12月16日	[2022] 98号	关于修改《大连商品交易所套期保值管理办法》的公告	一是明确为产业提供风险管理服务的机构可以申请套期保值；二是明确套期保值持仓额度申请方式相关规定；三是调整一般月份套期保值持仓额度申请时间；四是完善套期保值监管规定

续表

发文日期	文号	文件标题	主要内容
2022年12月16日	[2022] 99号	关于黄大豆1号、黄大豆2号、豆粕、豆油期货合约及其期权合约引入境外交易者相关规则修改的公告	适应对外开放需要，增加不能接收或者开具增值税发票的黄大豆1号、黄大豆2号、豆粕和豆油单位客户不得交割的相关规定
2022年12月26日	[2022] 102号	关于修改《大连商品交易所标准仓单交易管理办法（试行）》的公告	增加标准仓单交易的结算方式，在原有通过平台直接结算的基础上，新增委托期货公司会员的结算方式

中国金融期货交易所发布文件

发文日期	文件标题	主要内容
2022年7月18日	关于发布中证1000股指期货和股指期权合约及相关业务规则的通知	《中证1000股指期货合约》《中证1000股指期权合约》《中国金融期货交易所中证1000股指期货合约交易细则》和《中国金融期货交易所股指期权合约交易细则》（修订版）已报告中国证监会，现予以发布。以上合约、细则自2022年7月22日起实施
2022年12月14日	关于发布上证50股指期权合约及相关业务规则的通知	《上证50股指期权合约》和《中国金融期货交易所股指期权合约交易细则》（修订版）已报告中国证监会，现予以发布。以上合约、细则自2022年12月19日起实施
2022年12月23日	关于减半收取2023年交割和行权（履约）手续费的通知	经研究决定，自2023年1月1日起至2023年12月31日止，减半收取股指期货和国债期货交割手续费、股指期权行权（履约）手续费

广州期货交易所发布文件

发文日期	文号	文件标题	主要内容
2022年4月29日	广期所发 [2022] 69号	关于发布《广州期货交易所交易规则》《广州期货交易所会员管理办法》的公告	《广州期货交易所交易规则》经广期所股东大会审议通过，并经中国证监会批准，现予以发布 《广州期货交易所会员管理办法》经广期所董事会审议通过，并报告中国证监会，现予以发布 以上规则自发布之日起实施



续表

发文日期	文号	文件标题	主要内容
2022年6月 6日	广期所发〔2022〕 96号	关于发布《广州期货交易所交易管理办法》等12项业务规则的公告	《广州期货交易所交易管理办法》等12项业务规则经广期所董事会审议通过，并报告中国证监会，现予以发布 附件：《1. 广州期货交易所交易管理办法》；2. 《广州期货交易所结算管理办法》；3. 《广州期货交易所风险管理办法》；4. 《广州期货交易所期货交易者适当性管理办法》；5. 《广州期货交易所做市商管理办法》；6. 《广州期货交易所境外特殊参与者管理办法》；7. 《广州期货交易所期货公司会员接受境外中介机构委托开展特定品种期货交易业务管理办法》；8. 《广州期货交易所指定存管银行管理办法》；9. 《广州期货交易所异常交易行为管理办法》；10. 《广州期货交易所实际控制关系账户管理办法》；11. 《广州期货交易所套期保值管理办法》；12. 《广州期货交易所套利交易管理办法》
2022年6月 20日	广期所函〔2022〕 165-305号	关于接受贵公司成为广期所会员的通知	根据《广州期货交易所会员管理办法》，经董事会批准，接收中泰期货股份有限公司等141家期货公司成为广期所会员
2022年7月 27日	广期所发〔2022〕 126号	关于发布《广州期货交易所风险准备金管理办法》等6项业务规则的公告	《广州期货交易所风险准备金管理办法》等6项业务规则经广期所董事会审议通过，并报告中国证监会，现予以发布 附件：1. 《广州期货交易所风险准备金管理办法》；2. 《广州期货交易所违规违约处理办法》；3. 《广州期货交易所交割管理办法》；4. 《广州期货交易所指定交割仓库管理办法》；5. 《广州期货交易所标准仓单管理办法》；6. 《广州期货交易所信息管理办法》
2022年9月 13日	广期所函 〔2022〕378号	关于接受贵公司成为广期所会员的通知	根据《广州期货交易所会员管理办法》，经董事会批准，接收山西三立期货经纪有限公司成为广期所会员
2022年12月 12日	广期所发〔2022〕 233号	关于同意10家银行为广期所期货保证金指定存管银行的公告	根据《广州期货交易所指定存管银行管理办法》规定，同意中国工商银行、中国农业银行、中国银行、中国建设银行、交通银行、中信银行、上海浦发银行、中国民生银行、兴业银行和广发银行为广期所期货保证金指定存管银行，准予其开展境内客户保证金存管业务

续表

发文日期	文号	文件标题	主要内容
2022年12月12日	广期所发〔2022〕234号	关于发布工业硅期货和工业硅期权合约及相关规则的通知	《广州期货交易所工业硅期货合约》《广州期货交易所工业硅期权合约》《广州期货交易所工业硅期货、期权业务细则》，已由广期所董事会审议通过，并报告中国证监会，现予以发布，自发布之日起施行。工业硅期货和工业硅期权合约上市交易时间及有关事项另行通知
2022年12月14日	广期所发〔2022〕239号	关于公布工业硅期权做市商名单的公告	根据《广州期货交易所做市商管理办法》等相关规定，经严格评审，广期所公布五矿产业金融服务（深圳）有限公司等19家工业硅期权做市商名单
2022年12月15日	广期所发〔2022〕241号	关于广期所业务系统上线运行有关事项的通知	广期所业务系统定于2022年12月22日正式上线运行
2022年12月15日	广期所发〔2022〕244号	关于工业硅期货合约上市交易有关事项的通知	工业硅期货合约自2022年12月22日（星期四）起上市交易。交易时间：每周一至周五（北京时间法定节假日除外）9：00—10：15、10：30—11：30和13：30—15：00，及交易所规定的其他时间。首批上市交易合约为SI2308、SI2309、SI2310、SI2311和SI2312
2022年12月15日	广期所发〔2022〕245号	关于工业硅期权合约上市交易有关事项的通知	工业硅期权合约自2022年12月23日（星期五）起上市交易，交易时间与工业硅期货合约交易时间一致。首批上市交易合约为以SI2308、SI2309、SI2310、SI2311和SI2312期货合约为标的的工业硅期权合约
2022年12月16日	广期所发〔2022〕246号	关于开展资产作为保证金业务有关事项的通知	自2022年12月22日起，广期所开展资产作为保证金业务。根据《广州期货交易所结算管理办法》相关规定，标准仓单以及财政部在境内发行的记账式国债可以作为保证金
2022年12月16日	广期所发〔2022〕247号	关于开展组合持仓保证金业务的通知	广期所将于2022年12月22日结算时起开展组合持仓保证金业务
2022年12月19日	广期所发〔2022〕252号	关于工业硅期货交割业务有关事项的通知	工业硅期货交割区域设置、指定交割库（交割仓库）、指定质检机构和交割费用标准等事项的通知



续表

发文日期	文号	文件标题	主要内容
2022年12月 21日	广期所发〔2022〕 253号	关于工业硅期货合约 挂牌基准价的通知	2022年12月22日,工业硅期货首批上市交易合约SI2308、SI2309、SI2310、SI2311和SI2312的挂牌基准价为18500元/吨

中国期货市场监控中心发布文件

发文日期	文号	文件标题	主要内容
2022年3月 15日	监控函〔2022〕 65号	关于发布《期货保证金监控系统数据报送接口(交易所5.3.1版)》的函	为配合广州期货交易所开业,履行好保证金安全存管监控职能,对数据报送接口进行修订
2022年3月 15日	监控函〔2022〕 66号	关于发布《期货保证金监控系统数据报送接口(期货公司4.5.1版)》的函	为配合广州期货交易所开业,履行好保证金安全存管监控职能,对数据报送接口进行修订
2022年5月 13日	监控函〔2022〕 131号	关于修改统一开户业务相关操作指引的函	对统一开户业务配套开户规则进行了修改
2022年5月 24日	监控函〔2022〕 145号	关于发布中国期货监控交易报告库数据报送接口V3.0的函	为进一步提升场外衍生品信息报送效率,提升数据质量,更新了交易报告库数据报送接口
2022年6月 20日	无	中国期货市场监控中心保证金监控预警年报(2021年)	对2021年保证金预警情况进行系统梳理,并就各类预警原因进行归纳分析,供各期货公司借鉴参考
2022年7月 15日	监控函〔2022〕 183号	关于发布《期货保证金监控系统数据报送接口(期货公司4.5.2版)》的函	结合大商所客户移仓业务监控需要,对数据报送接口进行修订
2022年7月 18日	监控函〔2022〕 184号	关于发布《期货保证金监控系统数据报送接口(交易所5.4版)》的函	结合大商所客户移仓业务监控需要,以及国债充抵保证金业务数据统计需要,对数据报送接口进行修订
2022年8月 12日	监控函〔2022〕 202号	关于开户云平台采集期货居间人信息业务相关测试及上线工作安排的函	组织期货公司在期货互联网开户云平台上线期货居间人信息采集功能
2022年8月 18日	监控函〔2022〕 209号	关于发布中国期货监控交易报告库数据报送接口V3.1的函	更新交易报告库数据报送接口至V3.1,停止采集现货数据
2022年9月 6日	监控函〔2022〕 221号	关于中国期货监控交易报告库(TR)新版数据报送系统上线的通知	对新版报送系统进行介绍,协调安排系统上线相关工作,安排新系统相关培训

续表

发文日期	文号	文件标题	主要内容
2022年11月11日	监控函〔2022〕278号	关于期货开户相关系统更新境内行政区划数据字典工作安排的函	根据国家统计局最新公布的行政区划划分标准，对期货市场统一开户系统及期货互联网开户云平台中使用的境内行政区划数据字典进行更新
2022年11月29日	签报〔2022〕2678号	关于修改发布《统一开户业务常见问题汇总》的请示	为进一步提升期货开户服务质量，结合日常工作中期货公司反馈较多的共性问题，对《统一开户业务常见问题汇总》（2020年5月版）进行修改完善并通过统一开户系统对外发布
每周	无	中国期货市场监控中心交易报告库市场数据信息披露	定期披露场外衍生品成交笔数、成交金额、持仓笔数、持仓金额等汇总数据

中国期货业协会发布文件

发文日期	文件标题	主要内容
2022年4月22日	关于发布《中国期货业协会失信及违规处理办法（试行）》的通知	为规范中国期货业协会（以下简称协会）依法依规履行自律管理职责，提高自律管理透明度，督促行业落实信义义务，加强行业诚信建设，协会制定了《中国期货业协会失信及违规处理办法（试行）》（以下简称《办法》）。《办法》已经第五届理事会第二十次会议审议通过，并报中国证监会备案，现予发布，自发布之日起施行
2022年4月29日	关于发布《中国期货业协会团体标准管理办法》的通知	为规范、培育、发展协会团体标准，健全团体标准工作程序，协会制定了《中国期货业协会团体标准管理办法》。经协会第五届理事会第二十次会议审议通过，并报中国证监会备案，现予发布，并自发布之日起实施
2022年6月14日	关于发布《期货公司财务处理实施细则》的通知	为进一步规范期货公司财务处理和信息披露要求，适应期货行业业务发展和监管需要，提升期货公司财务信息披露、披露质量，协会制定了《期货公司财务处理实施细则》。经协会第五届理事会第二十一次会议审议通过，并报中国证监会备案，现予发布。为保持年度会计核算的统一性，该细则自2023年1月1日起施行



附录 5

统计数据

附录 5-1 分品种类型数据^①

2022 年全国期货市场交易分布

类别	成交金额（万元）	比重（%）	成交量（手）	比重（%）
农产品	11 271 516 585	21.07	1 641 614 087	24.25
金属	11 364 600 219	21.24	1 253 529 802	18.52
能源化工及其他	17 516 954 037	32.75	3 333 965 081	49.26
金融	13 277 181 797	24.82	113 310 222	1.67
期权	63 722 072	0.12	425 882 543	6.29
总计	53 493 974 711	100.00	6 768 301 735	100.00

2022 年农产品期货交易分布

序号	品种	成交金额（万元）	比重（%）	成交量（手）	比重（%）
1	天然橡胶	1 043 829 436	9.26	79 639 372	4.85
2	苹果	415 564 716	3.69	47 538 645	2.90
3	棉花	1 015 596 473	9.01	128 304 288	7.82
4	红枣	27 301 768	0.24	4 581 043	0.28
5	棉纱	9 769 177	0.09	840 052	0.05
6	粳稻	5 819	0.00	986	0.00
7	晚籼稻	3 352	0.00	566	0.00
8	菜籽油	1 101 038 155	9.77	94 447 320	5.75

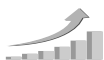
① 本部分数据进行了四舍五入处理。

续表

序号	品种	成交金额 (万元)	比重 (%)	成交量 (手)	比重 (%)
9	花生	154 181 727	1.37	31 616 105	1.93
10	普麦	6 951	0.00	471	0.00
11	早籼稻	2 366	0.00	403	0.00
12	菜籽粕	462 146 045	4.10	144 878 671	8.83
13	油菜籽	44 413	0.00	6 936	0.00
14	白糖	525 444 527	4.66	91 359 177	5.57
15	强麦	327 509	0.00	46 987	0.00
16	黄大豆1号	206 166 212	1.83	34 858 320	2.12
17	黄大豆2号	83 661 297	0.74	16 482 200	1.00
18	豆粕	1 278 655 688	11.34	325 094 536	19.80
19	豆油	1 805 838 259	16.02	183 506 353	11.18
20	玉米	380 548 271	3.38	134 357 515	8.18
21	玉米淀粉	145 760 461	1.29	46 197 613	2.81
22	棕榈油	2 251 742 147	19.98	241 582 846	14.72
23	鸡蛋	109 609 635	0.97	25 070 310	1.53
24	胶合板	775	0.00	39	0.00
25	纤维板	639 909	0.01	481 257	0.03
26	粳米	8 335 801	0.07	2 442 769	0.15
27	生猪	245 295 698	2.18	8 279 307	0.50
总计		11 271 516 585	100.00	1 641 614 087	100.00

2022年金属期货交易分布

序号	品种	成交金额 (万元)	比重 (%)	成交量 (手)	比重 (%)
1	白银	1 351 706 958	11.89	188 771 497	15.06
2	不锈钢	318 481 122	2.80	36 099 784	2.88
3	黄金	1 534 815 412	13.51	39 016 784	3.11
4	螺纹钢	2 208 002 181	19.43	525 178 157	41.90
5	铝	1 003 254 506	8.83	99 975 095	7.98
6	镍	969 969 780	8.54	52 088 887	4.16
7	铅	153 595 393	1.35	20 057 840	1.60
8	热轧卷板	618 118 149	5.44	142 061 100	11.33
9	铜	1 525 548 350	13.42	46 496 614	3.71
10	锡	669 112 831	5.89	29 708 330	2.37
11	线材	78 808	0.00	16 162	0.00
12	锌	846 639 637	7.45	68 330 390	5.45
13	铜 (BC)	163 701 070	1.44	5 551 326	0.44
14	工业硅	1 576 024	0.01	177 836	0.01
总计		11 364 600 219	100.00	1 253 529 802	100.00



2022 年能源化工及其他类期货交易分布

序号	品种	成交金额（万元）	比重（%）	成交量（手）	比重（%）
1	燃料油	686 339 873	3.92	210 455 099	6.31
2	石油沥青	637 517 051	3.64	162 578 252	4.88
3	纸浆	551 010 486	3.15	81 158 408	2.43
4	20 号胶	143 654 394	0.82	13 591 734	0.41
5	低硫燃料油	199 734 537	1.14	40 841 640	1.23
6	原油	3 490 998 928	19.93	53 580 837	1.61
7	玻璃	755 997 478	4.32	224 504 068	6.73
8	甲醇	1 056 379 167	6.03	395 548 508	11.86
9	短纤	248 220 699	1.42	66 500 236	1.99
10	纯碱	1 739 778 097	9.93	330 712 822	9.92
11	硅铁	300 531 018	1.72	68 899 336	2.07
12	锰硅	171 926 428	0.98	44 141 099	1.32
13	PTA	1 553 333 897	8.87	535 825 528	16.07
14	尿素	136 072 312	0.78	27 113 583	0.81
15	动力煤	3 735 786	0.02	479 453	0.01
16	聚乙烯	573 938 331	3.28	136 474 119	4.09
17	聚丙烯	706 910 550	4.04	171 146 563	5.13
18	聚氯乙烯	1 024 329 173	5.85	283 661 324	8.51
19	焦炭	281 592 399	1.61	9 257 450	0.28
20	焦煤	208 031 428	1.19	15 077 510	0.45
21	铁矿石	1 671 143 286	9.54	221 120 805	6.63
22	乙二醇	537 940 099	3.07	117 398 170	3.52
23	苯乙烯	354 660 000	2.02	79 407 098	2.38
24	液化石油气	483 178 619	2.76	44 491 439	1.33
	总计	17 516 954 037	100.00	3 333 965 081	100.00

2022 年金融期货交易分布

序号	品种	成交金额（万元）	比重（%）	成交量（手）	比重（%）
1	沪深 300 股指期货	3 314 382 063	24.96	26 749 442	23.61
2	上证 50 股指期货	1 288 701 792	9.71	15 407 689	13.60
3	中证 500 股指期货	3 228 887 413	24.32	26 221 072	23.14
4	中证 1000 股指期货	803 558 025	6.05	6 115 503	5.40
5	5 年期国债期货	1 183 977 685	8.92	11 665 561	10.30
6	10 年期国债期货	2 010 066 477	15.14	19 989 426	17.64
7	2 年期国债期货	1 447 608 342	10.90	7 161 529	6.32
	总计	13 277 181 797	100.00	113 310 222	100.00

注：成交量、成交金额均为单边数据，含期转现。

2022 年期权交易分布

序号	品种	成交金额（万元）	比重（%）	成交量（手）	比重（%）
1	螺纹钢期权	20 710	0.03	245 678	0.06
2	天胶期权	1 113 077	1.75	5 350 419	1.26
3	铜期权	3 273 831	5.14	12 114 450	2.84
4	锌期权	998 650	1.57	8 314 412	1.95
5	铝期权	1 080 400	1.70	11 396 512	2.68
6	白银期权	12 367	0.02	77 927	0.02
7	黄金期权	1 428 556	2.24	4 147 082	0.97
8	原油期权	6 359 140	9.98	6 600 819	1.55
9	菜籽油期权	218 094	0.34	2 594 210	0.61
10	PTA 期权	2 360 108	3.70	68 897 419	16.18
11	白糖期权	1 068 020	1.68	20 508 700	4.82
12	甲醇期权	1 363 212	2.14	40 233 223	9.45
13	动力煤期权	38 581	0.06	123 517	0.03
14	棉花期权	2 183 669	3.43	17 668 282	4.15
15	菜籽粕期权	479 426	0.75	7 989 933	1.88
16	花生期权	121 569	0.19	2 239 366	0.53
17	豆粕期权	3 477 971	5.46	53 407 941	12.54
18	玉米期权	852 631	1.34	30 429 497	7.15
19	棕榈油期权	3 443 073	5.40	26 708 730	6.27
20	聚乙烯期权	228 883	0.36	4 849 228	1.14
21	聚丙烯期权	166 018	0.26	3 545 659	0.83
22	聚氯乙烯期权	298 884	0.47	6 088 306	1.43
23	铁矿石期权	5 825 214	9.14	41 712 001	9.79
24	液化石油气期权	465 846	0.73	5 482 383	1.29
25	黄大豆1号期权	61 523	0.10	1 826 413	0.43
26	黄大豆2号期权	40 639	0.06	1 355 414	0.32
27	豆油期权	300 919	0.47	3 407 664	0.80
28	沪深300股指期权	20 550 589	32.25	31 553 468	7.41
29	上证50股指期权	79 076	0.12	200 627	0.05
30	中证1000股指期权	5 803 433	9.11	6 797 463	1.60
31	工业硅期权	7 965	0.01	15 800	0.00
	总计	63 722 072	100.00	425 882 543	100.00

注：成交量、成交金额均为单边数据。

附录 5-2 主要品种月度结算价及持仓量、成交量、成交金额的分布

2022 年主要品种月度结算价

品种	1月	2月	3月	4月	5月	6月	7月	8月	9月	10月	11月	12月
铜	70 368	71 202	72 735	73 896	71 646	69 179	57 938	61 727	61 459	62 481	65 274	65 952
铝	21 205	22 700	22 690	21 551	20 425	19 939	18 101	18 505	18 451	18 438	18 639	18 870
锌	24 710	25 148	25 879	27 871	25 859	25 465	22 846	24 742	24 288	24 425	23 654	24 144
铅	15 445	15 320	15 413	15 553	15 127	15 068	15 031	15 115	14 957	15 276	15 522	15 751
镍	162 156	174 614	218 446	224 955	207 095	199 581	164 921	173 010	183 076	183 375	196 898	216 529
锡	311 313	334 669	342 140	335 834	285 573	241 421	191 576	197 508	178 187	168 931	175 315	196 004
黄金	375	383	398	402	401	398	379	389	386	392	402	406
白银	4 813	4 883	5 109	5 091	4 770	4 686	4 222	4 390	4 338	4 484	4 842	5 272
螺纹钢	4 605	4 795	4 912	4 988	4 630	4 498	3 974	4 018	3 733	3 659	3 628	3 939
线材	4 877	5 119	5 497	5 444	5 124	4 999	4 476	4 537	4 479	4 354	4 350	4 687
热轧卷板	4 724	4 930	5 153	5 118	4 746	4 576	3 968	3 986	3 792	3 683	3 721	4 013
不锈钢	17 564	18 413	19 947	19 806	18 751	17 868	16 234	15 609	16 579	16 983	16 640	16 980
原油	525	574	690	660	701	733	665	686	654	677	642	544
燃料油	3 026	3 268	3 914	3 983	4 212	3 990	3 181	3 220	2 822	2 719	2 761	2 602
低硫燃料油	3 893	4 282	4 985	4 995	5 659	5 996	5 321	4 792	4 501	4 764	4 510	3 974
沥青	3 463	3 608	3 826	3 917	4 405	4 635	4 102	4 040	3 746	3 913	3 579	3 591
天然橡胶	14 744	14 313	13 619	13 296	12 975	12 981	12 301	12 795	12 816	12 528	12 560	12 873
20号胶	11 814	11 838	11 346	11 144	11 077	11 292	10 834	10 277	9 646	9 548	9 509	9 795
纸浆	6 135	6 476	6 939	7 037	7 269	6 941	6 702	6 706	6 772	6 784	6 844	6 855
国际铜	62 745	63 481	65 290	66 156	63 569	61 487	51 337	54 795	54 405	55 378	58 298	58 984
强麦	2 944	2 969	3 454	3 229	3 454	3 446	3 343	3 242	3 155	3 253	3 480	3 463
普麦	—	—	—	2 839	3 106	3 041	2 924	—	—	—	—	—
棉花	21 354	21 464	21 412	21 433	21 077	19 315	15 505	14 699	14 190	13 385	13 182	13 854
白糖	5 776	5 722	5 812	5 976	5 929	5 969	5 768	5 579	5 551	5 590	5 628	5 674
菜籽油	12 037	12 281	12 853	13 219	13 583	13 443	11 078	11 431	10 529	11 130	11 396	10 577
油菜籽	5 954	5 971	6 248	6 306	6 546	6 743	6 417	6 522	6 157	5 763	5 928	5 922
菜籽粕	2 970	3 495	3 969	3 748	3 697	3 508	2 764	2 842	3 049	3 075	3 067	3 064
粳稻	2 740	—	2 928	2 942	2 841	2 829	2 818	2 818	2 818	2 846	2 858	2 853
早籼稻	2 754	2 845	2 938	3 002	2 977	2 915	—	—	—	—	—	—
晚籼稻	—	—	2 999	—	2 718	2 579	—	—	—	—	—	—
棉纱	28 709	28 658	28 399	27 579	27 312	25 555	22 206	22 830	21 071	20 320	20 430	21 095
短纤	7 398	7 600	7 820	7 798	8 266	8 489	7 259	7 238	7 336	7 060	6 773	6 936
苹果	8 593	9 240	9 520	8 882	9 202	8 871	8 788	8 893	8 576	8 277	8 195	7 962
花生	7 997	8 082	8 915	9 333	10 201	10 080	9 464	9 628	10 490	10 833	10 691	10 201
红枣	13 190	13 756	12 180	11 852	12 310	11 183	11 359	12 007	12 106	11 478	11 055	10 560
PTA	5 288	5 612	6 048	6 104	6 603	6 983	5 849	5 589	5 546	5 389	5 234	5 255

续表

品种	1月	2月	3月	4月	5月	6月	7月	8月	9月	10月	11月	12月
甲醇	2 700	2 804	3 060	2 865	2 745	2 779	2 451	2 512	2 693	2 670	2 567	2 548
玻璃	2 006	2 142	1 977	2 000	1 795	1 718	1 521	1 511	1 491	1 469	1 384	1 532
动力煤	733	811	841	812	847	857	850	850	1 022	863	903	1 001
硅铁	8 805	9 209	9 600	10 509	8 960	8 942	7 752	7 845	8 139	8 160	8 331	8 349
锰硅	8 267	8 293	8 707	8 738	8 330	8 182	7 411	7 247	7 190	7 137	7 243	7 496
尿素	2 542	2 527	2 746	2 778	2 884	2 792	2 253	2 232	2 414	2 327	2 457	2 554
纯碱	2 530	2 878	2 653	3 042	2 924	2 917	2 572	2 373	2 352	2 445	2 535	2 659
玉米	2 724	2 786	2 874	2 962	2 978	2 863	2 672	2 723	2 812	2 851	2 868	2 806
玉米淀粉	3 078	3 216	3 396	3 375	3 315	3 187	3 056	3 036	3 010	2 958	3 018	2 935
黄大豆1号	5 918	6 180	6 222	6 188	6 268	6 139	5 826	6 087	5 904	5 705	5 601	5 344
黄大豆2号	4 377	4 996	5 214	5 145	5 320	5 267	4 687	5 019	5 252	5 477	5 151	5 029
豆粕	3 239	3 785	4 135	3 962	4 078	4 065	3 883	3 788	3 967	4 062	4 209	3 982
豆油	9 220	10 079	10 507	10 834	11 337	11 209	9 286	9 751	9 192	9 418	9 273	8 801
棕榈油	9 153	10 422	11 672	11 042	11 683	10 778	8 105	8 413	7 733	7 932	8 258	8 007
纤维板	1 300	1 289	1 393	1 321	1 382	1 364	1 388	1 364	1 277	1 255	1 237	1 212
胶合板	—	—	411	—	—	392	—	—	—	—	—	—
鸡蛋	4 108	4 255	4 363	4 835	4 764	4 662	4 352	4 126	4 282	4 444	4 334	4 318
生猪	13 835	14 355	13 174	15 793	19 024	19 504	21 597	22 578	22 884	23 235	21 288	17 638
粳米	3 351	3 452	3 442	3 395	3 429	3 353	3 346	3 383	3 403	3 391	3 397	3 373
聚乙烯	8 820	8 938	9 134	8 894	8 694	8 793	8 028	7 760	8 026	7 859	7 851	8 116
聚氯乙烯	8 608	8 828	9 048	9 004	8 491	8 033	6 559	6 480	6 259	5 933	5 860	6 236
聚丙烯	8 406	8 541	9 008	8 728	8 639	8 692	8 046	7 816	7 933	7 693	7 652	7 792
焦炭	3 046	3 207	3 632	3 922	3 390	3 359	2 780	2 786	2 620	2 661	2 675	2 783
焦煤	2 276	2 477	2 982	3 082	2 623	2 620	2 096	2 061	1 983	2 054	2 105	1 911
铁矿石	730	740	816	885	834	845	718	721	707	683	705	807
乙二醇	5 251	5 186	5 288	4 919	5 028	4 967	4 322	4 105	4 336	4 040	3 877	4 066
苯乙烯	8 633	9 108	9 794	9 726	10 079	10 594	9 117	8 305	8 769	8 259	7 914	8 179
液化石油气	4 715	5 471	6 211	6 008	6 087	5 797	5 425	5 358	5 365	5 048	5 032	4 519
工业硅	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	17 624
沪深300股指期货	4 785	4 598	4 264	4 075	3 962	4 254	4 291	4 131	3 960	3 709	3 772	3 917
中证500股指期货	7 025	6 775	6 337	5 829	5 733	6 167	6 261	6 294	5 986	5 856	6 128	6 028
上证50股指期货	3 202	3 121	2 919	2 846	2 740	2 891	2 896	2 755	2 687	2 476	2 510	2 654
中证1000股指期货	—	—	—	—	—	—	7 008	7 089	6 543	6 303	6 611	6 462
2年期国债期货	101.2	101.2	101.2	101.2	101.1	101.0	101.0	101.2	101.2	101.2	101.0	100.8
5年期国债期货	102.0	101.7	101.5	101.6	101.6	101.3	101.4	101.9	101.8	101.8	101.3	100.8
10年期国债期货	100.9	100.4	100.2	100.4	100.5	100.2	100.4	101.4	101.3	101.3	100.5	99.9

备注：1. 表中空缺，表示该品种个别月份无成交、无持仓，或未上市，无法计算结算价。

2. 各品种结算价单位请参考附录5-3对应的各期货合约。

3. 期货结算价指期货主力合约月度结算价均值。



2022年各月份期货品种持仓量占比情况 (%)

品种	1月	2月	3月	4月	5月	6月	7月	8月	9月	10月	11月	12月
铜	1.27	1.13	1.32	1.28	1.11	1.17	1.33	1.35	1.41	1.30	1.21	1.21
铝	1.82	1.65	1.58	1.63	1.37	1.37	1.28	1.15	1.34	1.22	1.20	1.05
锌	0.94	0.87	0.75	0.81	0.68	0.66	0.72	0.81	0.65	0.66	0.59	0.51
铅	0.38	0.36	0.34	0.28	0.30	0.32	0.29	0.28	0.24	0.26	0.39	0.45
镍	0.99	0.97	0.33	0.30	0.32	0.32	0.39	0.30	0.38	0.32	0.42	0.43
锡	0.24	0.21	0.18	0.16	0.17	0.26	0.37	0.26	0.29	0.27	0.26	0.28
黄金	0.70	0.80	0.83	0.92	0.74	0.75	0.88	0.88	0.93	0.82	0.87	0.80
白银	2.51	2.24	2.39	2.69	2.56	2.77	2.70	2.78	2.35	2.55	2.65	2.94
螺纹钢	8.30	10.53	9.03	8.51	8.82	9.39	9.50	9.74	8.17	8.37	8.36	8.42
线材	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00
热轧卷板	3.63	3.22	3.69	3.35	3.20	3.48	3.75	3.63	3.58	3.51	3.24	3.25
不锈钢	0.42	0.35	0.40	0.36	0.29	0.28	0.29	0.30	0.38	0.33	0.31	0.35
原油	0.24	0.26	0.20	0.20	0.24	0.23	0.26	0.25	0.19	0.17	0.21	0.17
燃料油	1.71	1.70	1.42	1.87	1.75	1.64	1.82	1.55	1.98	2.08	1.89	1.34
低硫燃料油	0.33	0.30	0.22	0.28	0.37	0.41	0.40	0.39	0.33	0.32	0.30	0.30
沥青	2.80	2.52	2.17	3.02	3.52	3.06	3.00	2.88	2.48	2.31	2.05	2.24
天然橡胶	1.35	1.32	1.23	1.18	1.02	0.99	0.82	0.87	0.76	0.90	0.87	0.94
20号胶	0.23	0.26	0.24	0.28	0.23	0.26	0.27	0.28	0.28	0.28	0.22	0.27
纸浆	1.29	1.34	1.07	1.03	1.06	1.28	1.28	1.10	1.14	0.96	0.96	0.70
国际铜	0.06	0.06	0.09	0.08	0.06	0.08	0.08	0.06	0.06	0.06	0.06	0.07
强麦	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00
普麦	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00
棉花	2.00	1.88	1.91	1.87	1.67	1.73	2.39	2.80	3.10	3.06	3.13	3.51
白糖	2.16	2.27	2.23	2.36	2.13	2.49	2.52	2.50	2.24	2.15	2.64	2.73
菜籽油	0.88	0.75	0.85	0.98	0.90	0.77	0.88	0.91	0.91	0.84	0.93	0.98
油菜籽	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00
菜籽粕	2.90	2.75	2.63	2.12	1.30	1.25	1.32	1.35	2.05	1.92	2.18	2.21
粳稻	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00
早籼稻	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00
晚籼稻	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00
棉纱	0.02	0.01	0.02	0.01	0.01	0.01	0.01	0.01	0.01	0.01	0.01	0.01
短纤	0.81	0.81	0.94	0.94	1.12	0.98	1.92	2.73	1.93	1.60	1.60	2.09
苹果	0.81	0.78	0.79	1.00	1.00	0.93	0.88	1.00	0.96	0.79	0.85	0.81
花生	0.76	0.65	0.29	0.34	0.45	0.52	0.43	0.53	0.55	0.55	0.54	0.38
红枣	0.25	0.21	0.19	0.17	0.16	0.19	0.15	0.14	0.11	0.10	0.10	0.15
PTA	7.46	6.96	7.03	7.62	8.89	8.34	9.03	9.49	8.53	8.96	8.93	9.51
甲醇	5.63	5.52	5.35	5.90	6.09	6.50	7.25	6.97	6.59	6.91	6.89	5.82

续表

品种	1月	2月	3月	4月	5月	6月	7月	8月	9月	10月	11月	12月
玻璃	1.55	1.89	2.78	2.93	4.06	4.38	3.53	3.81	3.30	3.44	3.78	3.35
动力煤	0.11	0.06	0.01	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00
硅铁	0.66	0.72	0.94	0.93	0.96	1.03	1.18	1.16	1.30	1.22	1.29	1.21
锰硅	0.91	0.86	0.97	0.95	0.89	0.98	0.99	0.97	1.14	1.16	0.88	1.06
尿素	0.48	0.47	0.54	0.59	0.48	0.47	0.47	0.45	0.61	0.71	0.84	0.77
纯碱	2.31	2.62	2.92	2.92	3.21	3.16	2.79	2.57	2.59	2.47	3.63	3.26
玉米	6.18	6.35	6.65	7.69	6.14	5.48	4.80	4.62	4.48	3.93	4.13	4.63
玉米淀粉	1.11	1.38	1.33	1.34	1.22	0.84	0.66	0.80	1.12	1.07	0.67	0.78
黄大豆1号	0.65	0.59	0.73	0.63	0.69	0.64	0.49	0.42	0.63	0.65	0.51	0.79
黄大豆2号	0.14	0.15	0.14	0.12	0.15	0.09	0.15	0.15	0.17	0.15	0.15	0.15
豆粕	8.36	8.94	9.57	7.62	7.70	6.63	6.45	5.71	7.04	7.20	6.99	6.16
豆油	2.99	2.70	2.73	2.43	2.41	2.11	1.87	1.97	2.22	1.99	2.05	1.94
棕榈油	2.71	2.46	2.21	1.85	1.89	1.85	2.00	1.82	2.40	2.16	2.21	2.10
纤维板	0.00	0.01	0.01	0.00	0.00	0.01	0.01	0.01	0.00	0.00	0.01	0.01
胶合板	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00
鸡蛋	0.81	0.79	0.63	0.48	0.48	0.65	0.56	0.52	0.69	0.63	0.63	0.58
生猪	0.45	0.36	0.44	0.35	0.33	0.35	0.29	0.27	0.24	0.23	0.22	0.22
粳米	0.09	0.09	0.11	0.10	0.11	0.10	0.10	0.10	0.09	0.09	0.08	0.08
聚乙烯	2.13	2.19	2.25	2.10	2.09	2.23	2.03	2.06	1.98	2.10	1.95	2.05
聚氯乙烯	2.37	2.47	2.69	2.46	2.61	3.12	2.87	2.72	3.34	4.29	3.90	4.12
聚丙烯	2.26	2.41	2.27	2.15	2.34	2.45	2.21	2.27	2.37	2.62	2.12	2.42
焦炭	0.11	0.13	0.14	0.11	0.11	0.12	0.13	0.13	0.13	0.12	0.11	0.10
焦煤	0.13	0.18	0.22	0.15	0.15	0.16	0.20	0.19	0.23	0.23	0.26	0.24
铁矿石	3.95	3.46	3.78	3.78	4.11	4.24	4.02	3.63	3.66	3.69	4.07	4.01
乙二醇	1.60	1.81	1.66	1.69	1.62	2.03	1.62	1.77	1.57	1.87	1.70	1.56
苯乙烯	0.77	0.66	0.68	0.73	0.96	0.69	0.66	0.79	0.65	0.72	0.64	0.84
液化石油气	0.44	0.39	0.38	0.35	0.34	0.36	0.29	0.39	0.40	0.30	0.30	0.43
工业硅	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	0.03
沪深300股指期货	0.83	0.72	0.76	0.87	0.76	0.72	0.63	0.59	0.60	0.56	0.55	0.60
中证500股指期货	1.25	1.06	1.16	1.36	1.19	1.16	1.03	1.05	1.09	0.94	0.87	0.94
上证50股指期货	0.47	0.36	0.34	0.44	0.37	0.37	0.32	0.38	0.40	0.38	0.37	0.36
中证1000股指期货	—	—	—	—	—	—	0.15	0.27	0.34	0.32	0.32	0.40
2年期国债期货	0.21	0.12	0.18	0.19	0.14	0.16	0.19	0.17	0.20	0.22	0.11	0.13
5年期国债期货	0.43	0.32	0.41	0.40	0.36	0.34	0.40	0.38	0.43	0.39	0.29	0.29
10年期国债期货	0.67	0.59	0.66	0.73	0.55	0.62	0.71	0.54	0.65	0.58	0.51	0.50

注：月末持仓占比，含自营。

2022 年各月份期权品种持仓量占比情况 (%)

品种	1月	2月	3月	4月	5月	6月	7月	8月	9月	10月	11月	12月
铜期权	1.26	1.05	0.94	1.53	1.17	1.22	1.21	2.23	2.11	1.75	1.21	1.34
黄金期权	0.73	0.99	0.74	1.57	0.81	1.06	0.78	1.66	1.16	1.21	0.66	1.36
天胶期权	1.96	1.93	2.09	2.08	1.97	2.12	2.33	1.69	1.51	1.58	1.43	1.21
锌期权	0.69	0.61	0.46	1.05	0.63	0.64	0.51	0.87	0.69	0.68	0.53	0.62
铝期权	1.21	1.29	1.11	1.58	1.38	1.05	1.07	1.34	1.18	1.02	1.28	1.33
原油期权	0.64	0.63	0.48	0.68	0.73	0.74	0.83	1.20	0.79	0.57	0.91	0.37
螺纹钢期权	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	2.21
白银期权	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	0.65
白糖期权	6.55	7.78	7.50	7.10	7.38	7.07	7.29	6.88	6.80	5.34	6.13	6.27
棉花期权	5.98	5.37	5.76	7.29	7.20	5.58	8.49	8.53	9.38	8.46	8.69	7.14
甲醇期权	3.89	4.19	4.68	4.82	4.49	4.52	4.94	4.97	5.46	6.30	6.50	5.77
PTA 期权	8.22	6.31	5.58	7.29	7.66	9.56	9.50	12.28	8.13	10.16	9.72	13.05
菜籽粕期权	2.59	3.15	3.25	3.00	2.67	1.93	1.56	2.04	2.23	1.89	2.42	1.97
动力煤期权	0.47	0.45	0.22	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00
花生期权	—	—	—	—	—	—	—	0.47	1.46	1.71	1.62	1.30
菜籽油期权	—	—	—	—	—	—	—	0.32	0.87	0.75	1.27	0.81
豆粕期权	16.60	16.29	20.12	20.26	19.46	20.19	19.07	18.02	21.13	18.14	15.77	10.51
玉米期权	21.49	19.20	20.04	18.76	21.83	18.58	16.62	11.36	9.85	8.71	10.24	10.96
铁矿石期权	8.33	9.76	9.07	6.64	7.72	10.43	10.25	9.45	9.39	12.06	12.74	13.86
液化石油气期权	0.51	0.57	0.54	0.96	0.88	1.16	0.70	1.21	0.95	0.70	0.77	1.39
聚丙烯期权	1.00	1.09	0.96	0.67	0.74	1.08	1.13	0.44	0.59	0.78	0.87	0.45
聚乙烯期权	0.91	1.18	0.98	0.66	0.92	1.24	1.19	0.60	0.66	0.81	0.71	0.38
聚氯乙烯期权	1.49	2.01	1.75	0.79	1.35	2.01	2.63	0.72	1.49	2.53	2.89	1.18
棕榈油期权	9.15	10.69	8.10	4.74	4.75	4.47	4.31	3.69	3.38	4.02	3.81	3.23
黄大豆1号期权	—	—	—	—	—	—	—	0.86	1.29	1.22	1.28	1.74
黄大豆2号期权	—	—	—	—	—	—	—	0.28	0.38	0.22	0.38	0.66
豆油期权	—	—	—	—	—	—	—	0.64	2.36	2.79	2.48	1.98
沪深300股指期权	6.32	5.47	5.62	8.52	6.27	5.36	4.97	6.56	4.89	4.79	4.12	4.91
中证1000股指期权	—	—	—	—	—	—	0.63	1.70	1.89	1.82	1.58	2.25
上证50股指期权	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	0.89
工业硅期权	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	0.19

注：月末持仓占比，含自营。

2022年各月份期货品种成交量占比情况(%)

品种	1月	2月	3月	4月	5月	6月	7月	8月	9月	10月	11月	12月
铜	0.78	0.66	0.63	0.57	0.61	0.72	1.03	0.87	0.82	0.78	0.75	0.51
铝	2.16	2.10	1.88	1.71	1.74	1.71	1.54	1.42	1.51	1.33	1.24	0.95
锌	1.25	1.00	0.95	1.24	1.16	1.14	1.14	1.13	1.11	1.16	1.06	0.72
铅	0.46	0.37	0.35	0.32	0.42	0.35	0.28	0.24	0.25	0.28	0.29	0.28
镍	2.35	1.59	0.95	0.54	0.54	0.52	0.58	0.68	0.77	0.57	0.57	0.69
锡	0.62	0.34	0.28	0.18	0.35	0.56	0.48	0.46	0.67	0.52	0.62	0.48
黄金	0.70	0.69	0.81	0.67	0.72	0.62	0.63	0.45	0.49	0.50	0.57	0.58
白银	2.99	2.42	2.76	2.31	2.47	2.36	2.69	2.65	2.81	3.14	3.86	4.66
螺纹钢	6.61	7.56	7.18	8.37	8.62	8.32	8.98	9.49	7.30	8.70	8.76	8.85
线材	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00
热轧卷板	2.07	2.08	2.57	2.54	2.51	2.36	2.48	2.30	2.09	2.13	1.83	1.93
不锈钢	0.75	0.53	0.80	0.44	0.42	0.45	0.46	0.51	0.65	0.66	0.59	0.56
原油	0.79	0.86	1.05	1.00	1.05	1.06	1.04	0.79	0.70	0.55	0.56	0.69
燃料油	1.90	1.92	2.99	3.79	3.07	3.28	3.49	4.01	4.62	3.12	2.71	4.16
低硫燃料油	0.34	0.39	0.46	0.44	0.64	0.75	0.98	0.71	0.72	0.69	0.64	0.75
沥青	2.43	2.16	3.00	2.94	3.37	2.84	2.90	2.58	1.96	2.31	2.13	2.17
天然橡胶	1.43	1.07	1.27	1.32	1.51	1.49	1.39	1.03	1.19	1.06	1.29	1.05
20号胶	0.19	0.21	0.19	0.18	0.21	0.22	0.24	0.19	0.21	0.22	0.24	0.25
纸浆	1.70	1.13	1.15	1.54	1.74	1.67	1.52	1.08	1.19	1.11	0.91	0.88
国际铜	0.07	0.08	0.08	0.08	0.12	0.11	0.12	0.11	0.07	0.08	0.06	0.06
强麦	0.00	0.00	0.01	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00
普麦	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00
棉花	1.18	1.05	1.03	1.14	1.10	1.58	2.64	2.80	2.63	2.87	2.79	2.61
白糖	1.86	1.66	1.66	1.68	1.40	1.24	1.33	1.25	1.24	1.26	1.37	1.51
菜籽油	1.84	1.64	1.22	1.16	0.81	1.02	1.56	1.46	1.54	1.79	2.09	1.65
油菜籽	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00
菜籽粕	3.06	3.84	2.59	2.00	1.12	1.20	1.72	1.91	2.41	2.81	2.99	2.18
粳稻	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00
早籼稻	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00
晚籼稻	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00
棉纱	0.01	0.01	0.01	0.01	0.01	0.01	0.02	0.02	0.02	0.02	0.02	0.01
短纤	0.84	0.71	0.81	0.87	1.13	1.16	1.05	1.20	1.38	1.22	0.91	1.20
苹果	0.94	0.65	0.61	1.37	1.04	0.78	0.63	0.54	0.70	0.86	0.61	0.57
花生	0.58	0.60	0.49	0.31	0.71	0.74	0.40	0.31	0.55	0.65	0.46	0.35
红枣	0.12	0.07	0.06	0.10	0.08	0.08	0.09	0.06	0.05	0.05	0.05	0.08
PTA	7.93	7.14	8.09	8.02	9.50	9.36	8.15	8.48	10.14	8.79	8.30	7.49
甲醇	5.81	4.66	4.75	5.21	7.11	6.93	6.49	6.74	6.95	6.54	7.02	6.16

续表

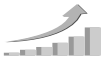
品种	1月	2月	3月	4月	5月	6月	7月	8月	9月	10月	11月	12月
玻璃	2.15	2.71	3.18	4.44	4.22	4.85	3.44	4.04	3.29	2.84	3.24	3.74
动力煤	0.06	0.04	0.01	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00
硅铁	1.27	1.16	1.02	1.42	1.13	0.98	0.81	0.95	1.33	1.14	0.98	1.08
锰硅	0.60	0.51	0.57	0.89	0.73	0.69	0.63	0.74	0.77	0.77	0.68	0.78
尿素	0.35	0.34	0.33	0.42	0.35	0.27	0.31	0.40	0.50	0.55	0.65	0.60
纯碱	4.03	5.53	5.26	5.79	5.75	4.94	4.97	5.00	5.21	4.40	4.89	6.56
玉米	2.57	2.68	2.54	2.70	2.30	2.05	1.75	1.88	1.67	1.93	1.93	1.86
玉米淀粉	0.82	0.96	0.92	0.77	0.77	0.63	0.51	0.60	0.64	0.89	0.67	0.71
黄大豆1号	0.86	0.82	0.55	0.49	0.48	0.49	0.46	0.51	0.52	0.58	0.46	0.53
黄大豆2号	0.22	0.36	0.26	0.19	0.21	0.23	0.26	0.23	0.26	0.43	0.29	0.22
豆粕	5.08	7.98	8.83	5.64	4.07	4.46	4.39	3.57	3.86	5.32	4.60	4.34
豆油	3.32	3.80	3.00	2.61	2.51	2.90	3.27	2.82	2.82	2.98	2.64	2.34
棕榈油	3.47	4.02	4.15	3.70	3.59	3.63	4.23	3.95	3.56	3.86	3.78	3.59
纤维板	0.01	0.01	0.01	0.02	0.01	0.01	0.01	0.01	0.01	0.01	0.00	0.00
胶合板	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00
鸡蛋	0.56	0.40	0.39	0.38	0.33	0.31	0.28	0.45	0.36	0.49	0.42	0.42
生猪	0.12	0.15	0.16	0.17	0.14	0.11	0.17	0.10	0.09	0.12	0.10	0.15
粳米	0.06	0.05	0.05	0.06	0.06	0.05	0.03	0.03	0.03	0.03	0.02	0.02
聚乙烯	2.50	2.49	2.30	2.17	2.33	2.42	2.10	2.05	1.94	1.92	1.88	1.96
聚氯乙烯	4.92	4.43	3.83	3.78	3.46	3.98	4.93	4.74	4.46	4.49	5.11	5.10
聚丙烯	3.14	2.95	3.12	2.99	2.90	2.72	2.47	2.70	2.40	2.42	2.34	2.48
焦炭	0.16	0.16	0.12	0.16	0.15	0.17	0.16	0.17	0.13	0.13	0.12	0.13
焦煤	0.20	0.22	0.21	0.23	0.23	0.26	0.29	0.28	0.24	0.22	0.20	0.25
铁矿石	3.66	3.85	3.40	3.07	3.23	3.30	3.53	3.60	3.13	3.08	3.98	3.78
乙二醇	1.85	1.62	1.79	2.18	2.00	2.01	1.72	1.98	1.89	1.54	1.72	1.92
苯乙烯	1.36	1.02	0.89	1.02	1.13	1.36	1.13	1.38	1.66	1.52	1.36	1.20
液化石油气	1.20	0.99	0.74	0.68	0.76	0.73	0.67	0.60	0.68	0.58	0.52	0.51
工业硅	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	0.03
沪深300股指期货	0.45	0.37	0.49	0.59	0.51	0.51	0.37	0.35	0.34	0.41	0.39	0.34
中证500股指期货	0.40	0.34	0.42	0.59	0.56	0.57	0.38	0.36	0.39	0.43	0.32	0.28
上证50股指期货	0.27	0.21	0.24	0.30	0.26	0.27	0.19	0.20	0.22	0.29	0.26	0.24
中证1000股指期货	—	—	—	—	—	—	0.03	0.17	0.22	0.29	0.21	0.18
2年期国债期货	0.06	0.08	0.06	0.08	0.08	0.09	0.08	0.13	0.15	0.15	0.19	0.17
5年期国债期货	0.16	0.20	0.16	0.15	0.17	0.13	0.12	0.21	0.19	0.20	0.30	0.20
10年期国债期货	0.30	0.38	0.31	0.29	0.32	0.25	0.23	0.34	0.29	0.28	0.48	0.29

注：月度累计成交量占比，含自营。

2022年各月份期权品种成交量占比情况(%)

品种	1月	2月	3月	4月	5月	6月	7月	8月	9月	10月	11月	12月
铜期权	3.39	2.74	2.00	2.61	2.65	2.75	2.57	3.91	4.00	3.07	2.50	2.45
黄金期权	1.15	1.22	0.93	1.06	1.24	1.05	1.07	0.81	1.10	0.67	0.79	0.87
天胶期权	1.10	1.18	1.36	1.75	1.33	1.18	1.51	1.73	1.24	0.93	0.94	1.10
锌期权	1.72	1.40	1.20	2.92	2.12	1.89	1.60	2.52	2.66	2.10	1.86	1.83
铝期权	3.40	2.86	2.11	3.28	3.30	2.94	2.15	3.33	3.15	2.33	2.19	2.22
原油期权	1.02	1.11	1.03	1.22	1.59	1.86	1.46	2.41	1.63	1.12	1.42	2.28
螺纹钢期权	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	0.56
白银期权	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	0.18
白糖期权	4.87	5.21	6.10	5.50	6.20	5.08	5.73	3.89	4.09	3.58	3.91	4.42
棉花期权	2.41	2.50	3.30	3.24	4.58	3.25	4.47	5.09	4.83	4.33	5.19	4.73
甲醇期权	9.90	7.23	7.56	8.22	8.27	7.07	6.64	9.65	10.30	12.64	11.69	12.45
PTA期权	11.81	11.01	9.20	13.03	16.72	17.43	16.28	19.87	20.79	17.01	15.84	20.82
菜籽粕期权	2.10	2.77	2.60	1.67	1.57	1.49	1.33	1.05	1.83	1.45	2.60	1.89
动力煤期权	0.16	0.18	0.11	0.01	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00
花生期权	—	—	—	—	—	—	—	0.12	0.97	1.60	1.61	0.96
菜籽油期权	—	—	—	—	—	—	—	0.08	1.12	0.87	2.38	1.20
豆粕期权	16.40	19.53	17.17	13.45	11.27	13.67	16.72	9.43	11.05	11.80	9.05	6.07
玉米期权	10.38	9.97	11.71	9.43	9.67	9.10	8.18	4.90	3.96	4.14	4.69	3.87
铁矿石期权	6.36	10.37	9.44	10.28	9.40	8.90	11.09	10.64	7.49	9.33	11.70	10.26
液化石油气期权	1.05	1.03	1.14	1.40	1.52	1.65	1.20	1.35	1.36	1.22	1.08	1.45
聚丙烯期权	1.42	1.16	0.86	0.65	1.01	1.63	1.08	0.37	0.31	0.55	0.74	0.38
聚乙烯期权	1.54	1.60	1.16	1.03	1.40	2.58	1.44	0.53	0.58	0.71	0.87	0.47
聚氯乙烯期权	1.27	1.69	1.50	0.89	0.81	1.49	2.12	1.00	0.94	1.40	2.03	1.17
棕榈油期权	7.34	7.31	8.93	6.73	6.60	6.28	7.05	6.35	5.06	4.68	4.89	5.46
黄大豆1号期权	—	—	—	—	—	—	—	0.41	0.70	0.82	0.98	1.41
黄大豆2号期权	—	—	—	—	—	—	—	0.14	0.46	0.45	0.67	1.41
豆油期权	—	—	—	—	—	—	—	0.21	0.95	2.05	2.45	2.14
沪深300股指期权	11.21	7.94	10.59	11.63	8.73	8.69	5.94	6.94	5.64	6.64	5.19	4.75
中证1000股指期权	—	—	—	—	—	—	0.36	3.28	3.79	4.50	2.74	2.69
上证50股指期权	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	0.46
工业硅期权	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	0.04

注：月度累计成交量占比，含自营。



2022年各月份期货品种成交金额分布情况 (%)

品种	1月	2月	3月	4月	5月	6月	7月	8月	9月	10月	11月	12月
铜	3.16	2.70	2.51	2.29	2.40	2.70	3.73	3.33	3.19	3.05	2.99	2.16
铝	2.62	2.75	2.36	2.01	1.96	1.89	1.76	1.63	1.76	1.53	1.41	1.16
锌	1.77	1.45	1.37	1.90	1.67	1.59	1.64	1.73	1.70	1.76	1.51	1.11
铅	0.41	0.33	0.30	0.27	0.35	0.29	0.26	0.23	0.23	0.27	0.27	0.28
镍	4.41	3.18	2.21	1.32	1.23	1.13	1.19	1.45	1.77	1.30	1.36	1.91
锡	2.22	1.31	1.05	0.66	1.08	1.46	1.15	1.11	1.50	1.10	1.32	1.22
黄金	3.00	3.07	3.56	2.93	3.19	2.72	3.01	2.19	2.38	2.45	2.80	3.02
白银	2.47	2.05	2.34	1.93	1.96	1.83	2.14	2.17	2.32	2.65	3.43	4.74
螺纹钢	3.47	4.13	3.86	4.55	4.41	4.11	4.47	4.71	3.46	3.96	3.86	4.49
线材	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00
热轧卷板	1.12	1.18	1.45	1.42	1.32	1.19	1.24	1.13	1.01	0.98	0.83	1.00
不锈钢	0.75	0.56	0.91	0.48	0.43	0.44	0.47	0.49	0.69	0.71	0.60	0.61
原油	4.75	5.73	8.00	7.19	8.15	8.56	8.67	6.74	5.74	4.64	4.29	4.83
燃料油	0.65	0.72	1.28	1.66	1.42	1.45	1.39	1.60	1.65	1.06	0.92	1.39
低硫燃料油	0.15	0.19	0.25	0.24	0.40	0.51	0.65	0.43	0.41	0.41	0.35	0.38
沥青	0.96	0.89	1.27	1.26	1.63	1.45	1.47	1.30	0.92	1.11	0.93	0.99
天然橡胶	2.41	1.76	1.92	1.90	2.18	2.16	2.19	1.60	1.93	1.66	1.98	1.74
20号胶	0.25	0.28	0.24	0.22	0.25	0.28	0.33	0.24	0.26	0.27	0.28	0.31
纸浆	1.20	0.84	0.88	1.18	1.40	1.28	1.27	0.91	1.03	0.94	0.75	0.78
国际铜	0.26	0.28	0.31	0.30	0.42	0.38	0.38	0.36	0.24	0.29	0.23	0.23
强麦	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00
普麦	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00
棉花	1.44	1.29	1.20	1.33	1.28	1.63	2.53	2.57	2.36	2.40	2.23	2.33
白糖	1.23	1.10	1.07	1.09	0.92	0.83	0.96	0.87	0.87	0.88	0.94	1.10
菜籽油	2.52	2.33	1.72	1.68	1.21	1.48	2.13	2.06	2.07	2.48	2.87	2.25
油菜籽	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00
菜籽粕	1.03	1.52	1.07	0.78	0.43	0.44	0.61	0.68	0.93	1.07	1.11	0.86
粳稻	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00
早籼稻	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00
晚籼稻	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00
棉纱	0.02	0.02	0.01	0.01	0.01	0.01	0.03	0.02	0.02	0.02	0.02	0.02
短纤	0.35	0.31	0.35	0.37	0.52	0.55	0.48	0.54	0.64	0.54	0.38	0.54
苹果	0.91	0.68	0.62	1.35	1.06	0.77	0.70	0.60	0.76	0.89	0.61	0.59
花生	0.27	0.28	0.24	0.16	0.40	0.42	0.24	0.18	0.37	0.44	0.30	0.23
红枣	0.09	0.05	0.04	0.06	0.05	0.05	0.06	0.05	0.04	0.04	0.03	0.05
PTA	2.39	2.30	2.70	2.67	3.48	3.63	2.97	2.96	3.58	2.95	2.64	2.53
甲醇	1.79	1.50	1.61	1.62	2.16	2.13	2.00	2.10	2.37	2.17	2.18	2.02

续表

品种	1月	2月	3月	4月	5月	6月	7月	8月	9月	10月	11月	12月
玻璃	1.00	1.32	1.39	1.93	1.68	1.86	1.33	1.52	1.24	1.04	1.10	1.49
动力煤	0.05	0.04	0.01	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00
硅铁	0.64	0.62	0.54	0.82	0.56	0.48	0.40	0.46	0.68	0.58	0.49	0.58
锰硅	0.29	0.24	0.27	0.43	0.34	0.31	0.30	0.33	0.35	0.34	0.30	0.37
尿素	0.20	0.19	0.20	0.26	0.23	0.16	0.17	0.22	0.31	0.32	0.39	0.39
纯碱	2.36	3.66	3.13	3.83	3.68	3.15	3.10	2.94	3.10	2.67	2.95	4.43
玉米	0.80	0.86	0.81	0.87	0.76	0.65	0.59	0.64	0.60	0.69	0.68	0.68
玉米淀粉	0.29	0.36	0.34	0.29	0.29	0.23	0.20	0.23	0.25	0.33	0.25	0.27
黄大豆1号	0.59	0.58	0.37	0.33	0.33	0.33	0.34	0.38	0.39	0.41	0.31	0.36
黄大豆2号	0.11	0.20	0.15	0.11	0.12	0.13	0.15	0.14	0.18	0.29	0.18	0.14
豆粕	1.89	3.48	4.01	2.44	1.82	1.98	2.10	1.69	1.95	2.70	2.30	2.24
豆油	3.49	4.41	3.48	3.10	3.15	3.56	3.80	3.43	3.28	3.50	2.96	2.66
棕榈油	3.64	4.85	5.22	4.53	4.66	4.26	4.31	4.12	3.48	3.83	3.80	3.69
纤维板	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00
胶合板	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00
鸡蛋	0.26	0.20	0.19	0.20	0.17	0.16	0.15	0.23	0.20	0.28	0.22	0.23
生猪	0.32	0.39	0.40	0.49	0.46	0.38	0.75	0.44	0.41	0.53	0.39	0.52
粳米	0.02	0.02	0.02	0.02	0.02	0.02	0.01	0.01	0.01	0.01	0.01	0.01
聚乙烯	1.26	1.28	1.16	1.05	1.12	1.18	1.06	0.99	0.99	0.94	0.90	1.02
聚氯乙烯	2.42	2.25	1.91	1.86	1.63	1.75	2.03	1.92	1.77	1.67	1.83	2.05
聚丙烯	1.51	1.45	1.55	1.42	1.39	1.31	1.25	1.31	1.21	1.16	1.09	1.25
焦炭	0.56	0.59	0.48	0.67	0.55	0.61	0.57	0.59	0.44	0.43	0.38	0.48
焦煤	0.32	0.38	0.41	0.45	0.40	0.44	0.46	0.43	0.36	0.34	0.30	0.37
铁矿石	3.05	3.25	3.04	2.96	2.95	2.97	3.10	3.23	2.79	2.60	3.40	3.93
乙二醇	1.11	0.97	1.05	1.17	1.11	1.10	0.94	1.01	1.03	0.78	0.81	1.01
苯乙烯	0.67	0.53	0.48	0.54	0.63	0.80	0.65	0.71	0.92	0.78	0.65	0.63
液化石油气	1.31	1.22	1.02	0.89	1.02	0.94	0.92	0.80	0.92	0.73	0.64	0.59
工业硅	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	0.03
沪深300股指期货	7.43	5.91	6.84	7.77	6.75	7.21	6.09	5.34	5.07	5.75	5.36	5.20
中证500股指期货	6.45	5.22	5.80	7.46	7.11	7.81	6.02	5.67	6.01	6.34	4.80	4.37
上证50股指期货	3.00	2.25	2.34	2.74	2.32	2.60	2.10	2.06	2.23	2.66	2.42	2.46
中证1000股指期货	—	—	—	—	—	—	0.56	2.89	3.67	4.52	3.42	3.00
2年期国债期货	1.48	1.87	1.42	1.66	1.89	1.92	2.08	3.24	3.78	3.77	4.78	4.29
5年期国债期货	1.88	2.28	1.80	1.70	1.95	1.50	1.52	2.70	2.43	2.50	3.65	2.56
10年期国债期货	3.51	4.34	3.47	3.20	3.55	2.83	2.87	4.31	3.74	3.49	5.83	3.78

注：月度累计成交金额占比，含自营。

2022 年各月份期权品种成交金额分布情况 (%)

品种	1月	2月	3月	4月	5月	6月	7月	8月	9月	10月	11月	12月
铜期权	4.29	4.09	3.26	3.20	4.12	5.20	7.67	6.93	6.67	4.73	5.69	4.13
黄金期权	2.83	3.40	2.66	2.56	2.93	2.13	2.06	1.63	2.10	1.33	1.79	2.17
天胶期权	2.97	2.43	1.83	1.63	1.90	1.60	2.08	1.58	1.60	1.15	1.35	1.31
锌期权	1.45	1.03	0.88	2.08	1.75	1.60	1.50	1.95	1.85	1.50	1.69	1.61
铝期权	2.32	2.02	1.63	1.89	2.13	1.77	1.55	1.93	1.76	1.02	1.40	1.36
原油期权	5.25	7.31	7.97	7.39	10.70	11.87	13.24	13.59	10.00	6.97	8.65	13.69
螺纹钢期权	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	0.40
白银期权	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	0.24
白糖期权	1.65	1.78	1.67	1.95	2.31	1.80	2.01	1.44	1.21	1.10	1.37	1.96
棉花期权	2.25	2.47	1.76	2.35	3.51	4.05	5.82	4.77	3.92	3.10	2.85	3.20
甲醇期权	2.71	2.22	2.23	1.74	1.98	1.73	1.67	1.78	2.28	2.29	2.66	2.57
PTA 期权	2.86	3.41	2.95	2.44	4.46	5.35	5.24	3.48	3.84	2.62	2.94	3.97
菜籽粕期权	0.71	1.72	1.26	0.92	0.75	0.45	0.48	0.44	0.82	0.51	0.68	0.59
动力煤期权	0.37	0.38	0.14	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00
花生期权	—	—	—	—	—	—	—	0.05	0.61	0.71	0.47	0.40
菜籽油期权	—	—	—	—	—	—	—	0.11	0.98	0.58	1.41	0.72
豆粕期权	5.91	11.39	7.24	5.46	4.35	5.03	7.08	3.71	4.96	4.56	3.93	2.89
玉米期权	2.05	1.69	1.60	1.51	1.74	1.52	1.70	1.08	0.86	0.81	0.87	0.90
铁矿石期权	7.87	11.80	8.09	9.35	10.38	9.82	10.42	8.87	5.83	7.04	10.73	9.65
液化石油气期权	0.77	0.77	1.03	0.68	0.76	0.80	0.88	0.74	0.73	0.47	0.50	0.54
聚丙烯期权	0.59	0.50	0.37	0.20	0.32	0.31	0.31	0.10	0.12	0.15	0.16	0.13
聚乙烯期权	0.78	0.74	0.37	0.29	0.50	0.59	0.36	0.19	0.23	0.18	0.17	0.14
聚氯乙烯期权	0.85	0.83	0.41	0.22	0.36	0.58	0.63	0.27	0.36	0.35	0.44	0.42
棕榈油期权	6.87	8.91	9.38	5.71	5.41	5.71	6.48	3.78	3.50	2.60	3.36	3.33
黄大豆1号期权	—	—	—	—	—	—	—	0.15	0.15	0.21	0.24	0.38
黄大豆2号期权	—	—	—	—	—	—	—	0.08	0.16	0.09	0.14	0.27
豆油期权	—	—	—	—	—	—	—	0.35	1.13	1.31	1.39	1.29
沪深300股指期权	44.64	31.11	43.27	48.44	39.65	38.09	25.99	23.38	21.29	27.37	26.42	23.42
中证1000股指期权	—	—	—	—	—	—	2.86	17.63	23.02	27.26	18.71	16.59
上证50股指期权	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	1.54
工业硅期权	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	0.16

注：月度累计成交金额占比，含自营。

附录 5-3 各期货品种合约汇总

2022 年农产品期货合约汇总

交易品种	天然橡胶
交易单位	10 吨/手
报价单位	元（人民币）/吨
最小变动价位	5 元/吨
涨跌停板幅度	上一交易日结算价 $\pm 3\%$
合约月份	1 月、3 月、4 月、5 月、6 月、7 月、8 月、9 月、10 月、11 月
交易时间	上午 9:00—11:30, 下午 1:30—3:00 和交易所规定的其他交易时间
最后交易日	合约月份的 15 日（遇国家法定节假日顺延，春节月份等最后交易日交易所可另行调整并通知）
交割日期	最后交易日后连续 3 个工作日
交割品级	标准品：1. 国产天然橡胶（SCR WF），质量符合国标 GB/T8081-2018 2. 进口 3 号烟胶片（RSS3），质量符合《天然橡胶等级的品质与包装国际标准（绿皮书）》（1979 年版）
交割地点	交易所指定交割仓库
最低交易保证金	合约价值的 5%
交割方式	实物交割
交割单位	10 吨
交易代码	RU
上市交易所	上海期货交易所
交易品种	优质强筋小麦（简称“强麦”）
交易单位	20 吨/手
报价单位	元（人民币）/吨
最小变动价位	1 元/吨
每日价格波动限制	上一个交易日结算价 $\pm 4\%$ 及《郑州商品交易所期货交易风险控制管理办法》相关规定
最低交易保证金	合约价值的 5%
合约交割月份	1 月、3 月、5 月、7 月、9 月、11 月
交易时间	每周一至周五（北京时间 法定节假日除外）上午 9:00—11:30, 下午 1:30—3:00
最后交易日	合约交割月份的第 10 个交易日
最后交割日	合约交割月份的次月 20 日
交割品级	符合《中华人民共和国国家标准 小麦》（GB 1351-2008）的三等及以上小麦，且容重、稳定时间、湿面筋等指标符合《郑州商品交易所优质强筋小麦期货业务细则》规定要求
交割地点	交易所指定交割地点
交割方式	实物交割
交易代码	WH
上市交易所	郑州商品交易所



续表

交易品种	普通小麦（简称“普麦”）
交易单位	50 吨/手
报价单位	元（人民币）/吨
最小变动价位	1 元/吨
每日价格波动限制	上一交易日结算价 $\pm 4\%$ 及《郑州商品交易所期货交易风险控制管理办法》相关规定
最低交易保证金	合约价值的 5%
合约交割月份	1 月、3 月、5 月、7 月、9 月、11 月
交易时间	每周一至周五（北京时间 法定节假日除外） 上午 9:00—11:30，下午 1:30—3:00
最后交易日	合约交割月份的第 10 个交易日
最后交割日	仓单交割：合约交割月份的第 13 个交易日 车（船）板交割：合约交割月份的次月 20 日
交割品级	符合《中华人民共和国国家标准 小麦》（GB1351-2008）的三等及以上小麦，且物理指标等符合《郑州商品交易所普通小麦期货业务细则》规定要求
交割地点	交易所指定交割仓库及指定交割计价点
交割方式	实物交割
交易代码	PM
上市交易所	郑州商品交易所
交易品种	棉花
交易单位	5 吨/手（公定重量）
报价单位	元（人民币）/吨
最小变动价位	5 元/吨
每日价格最大波动限制	上一交易日结算价 $\pm 4\%$ 及《郑州商品交易所期货交易风险控制管理办法》相关规定
最低交易保证金	合约价值的 5%
合约交割月份	1 月、3 月、5 月、7 月、9 月、11 月
交易时间	每周一至周五（北京时间 法定节假日除外） 上午 9:00—11:30，下午 1:30—3:00 及交易所规定的其他交易时间
最后交易日	合约交割月份的第 10 个交易日
最后交割日	合约交割月份的第 13 个交易日
交割品级	基准交割品：符合 GB1103.1-2012《棉花 第 1 部分：锯齿加工细绒棉》规定的 3128B 级，且长度整齐度为 U3 档，断裂比强度为 S3 档，轧工质量为 P2 档的国产棉花。替代品详见交易所棉花期货业务细则。替代品升贴水由交易所另行制定并公告
交割地点	交易所指定棉花交割仓库
交割方式	实物交割
交易代码	CF
上市交易所	郑州商品交易所

续表

交易品种	白砂糖（简称“白糖”）
交易单位	10 吨/手
报价单位	元（人民币）/吨
最小变动价位	1 元/吨
每日价格波动限制	上一交易日结算价 $\pm 4\%$ 及《郑州商品交易所期货交易风险控制管理办法》相关规定
合约交割月份	1 月、3 月、5 月、7 月、9 月、11 月
交易时间	每周一至周五（北京时间 法定节假日除外） 上午 9:00—11:30，下午 1:30—3:00 及交易所规定的其他交易时间
最后交易日	合约交割月份的第 10 个交易日
最后交割日	合约交割月份的第 13 个交易日
交割品级	见《郑州商品交易所白砂糖期货业务细则》
交割地点	交易所指定交割地点
最低交易保证金	合约价值的 5%
交割方式	实物交割
交易代码	SR
上市交易所	郑州商品交易所
交易品种	油菜籽（简称“菜籽”）
交易单位	10 吨/手
报价单位	元（人民币）/吨
最小变动价位	1 元/吨
每日价格波动限制	上一交易日结算价 $\pm 4\%$ 及《郑州商品交易所期货交易风险控制管理办法》相关规定
最低交易保证金	合约价值的 5%
合约交割月份	7 月、8 月、9 月、11 月
交易时间	每周一至周五（北京时间 法定节假日除外） 上午 9:00—11:30，下午 1:30—3:00
最后交易日	合约交割月份的第 10 个交易日
最后交割日	仓单交割：合约交割月份的第 13 个交易日 车（船）板交割：合约交割月份的次月 20 日
交割品级	见《郑州商品交易所油菜籽期货业务细则》
交割地点	交易所指定交割地点
交割方式	实物交割
交易代码	RS
上市交易所	郑州商品交易所

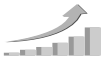


续表

交易品种	菜籽油（简称“菜油”）
交易单位	10 吨/手
报价单位	元（人民币）/吨
最小变动价位	1 元/吨
每日价格波动限制	上一交易日结算价 $\pm 4\%$ 及《郑州商品交易所期货交易风险控制管理办法》相关规定
最低交易保证金	合约价值的 5%
合约交割月份	1 月、3 月、5 月、7 月、9 月、11 月
交易时间	每周一至周五（北京时间 法定节假日除外） 上午 9:00—11:30，下午 1:30—3:00 及交易所规定的其他交易时间
最后交易日	合约交割月份的第 10 个交易日
最后交割日	合约交割月份的第 13 个交易日
交割品级	基准交割品：符合《中华人民共和国国家标准 菜籽油》（GB1536 - 2004）四级质量指标的菜油。替代品及升贴水见《郑州商品交易所菜籽油期货业务细则》
交割地点	交易所指定交割地点
交割方式	实物交割
交易代码	OI
上市交易所	郑州商品交易所
交易品种	菜籽粕（简称“菜粕”）
交易单位	10 吨/手
报价单位	元（人民币）/吨
最小变动价位	1 元/吨
每日价格波动限制	上一交易日结算价 $\pm 4\%$ 及《郑州商品交易所期货交易风险控制管理办法》相关规定
最低交易保证金	合约价值的 5%
合约交割月份	1 月、3 月、5 月、7 月、8 月、9 月、11 月
交易时间	每周一至周五（北京时间 法定节假日除外） 上午 9:00—11:30，下午 1:30—3:00 及交易所规定的其他交易时间
最后交易日	合约交割月份的第 10 个交易日
最后交割日	合约交割月份的第 13 个交易日
交割品级	见《郑州商品交易所菜籽粕期货业务细则》
交割地点	交易所指定交割地点
交割方式	实物交割
交易代码	RM
上市交易所	郑州商品交易所

续表

交易品种	早籼稻
交易单位	20 吨/手
报价单位	元（人民币）/吨
最小变动价位	1 元/吨
每日价格波动限制	上一交易日结算价 $\pm 4\%$ 及《郑州商品交易所期货交易风险控制管理办法》相关规定
最低交易保证金	合约价值的 5%
合约交割月份	1 月、3 月、5 月、7 月、9 月、11 月
交易时间	每周一至周五（北京时间 法定节假日除外） 上午 9:00—11:30，下午 1:30—3:00
最后交易日	合约交割月份的第 10 个交易日
最后交割日	合约交割月份的第 13 个交易日
交割品级	基准交割品：符合《中华人民共和国国家标准 稻谷》（GB1350 - 2009）三等及以上等级质量指标及《郑州商品交易所早籼稻期货交割细则》规定的早籼稻谷。替代品及升贴水见《郑州商品交易所早籼稻期货业务细则》
交割地点	交易所指定交割仓库
交割方式	实物交割
交易代码	RI
上市交易所	郑州商品交易所
交易品种	粳稻谷（简称“粳稻”）
交易单位	20 吨/手
报价单位	元（人民币）/吨
最小变动价位	1 元/吨
每日价格波动限制	上一交易日结算价 $\pm 4\%$ 及《郑州商品交易所期货交易风险控制管理办法》相关规定
最低交易保证金	合约价值的 5%
合约交割月份	1 月、3 月、5 月、7 月、9 月、11 月
交易时间	每周一至周五（北京时间 法定节假日除外） 上午 9:00—11:30，下午 1:30—3:00
最后交易日	合约交割月份的第 10 个交易日
最后交割日	合约交割月份的第 13 个交易日
交割品级	见《郑州商品交易所粳稻谷期货业务细则》
交割地点	交易所指定交割地点
交割方式	实物交割
交易代码	JR
上市交易所	郑州商品交易所



续表

交易品种	晚籼稻
交易单位	20 吨/手
报价单位	元（人民币）/吨
最小变动价位	1 元/吨
每日价格波动限制	上一交易日结算价 $\pm 4\%$ 及《郑州商品交易所期货交易风险控制管理办法》相关规定
最低交易保证金	合约价值的 5%
合约交割月份	1 月、3 月、5 月、7 月、9 月、11 月
交易时间	每周一至周五（北京时间 法定节假日除外） 上午 9:00—11:30，下午 1:30—3:00
最后交易日	合约交割月份的第 10 个交易日
最后交割日	合约交割月份的第 13 个交易日
交割品级	见《郑州商品交易所晚籼稻期货业务细则》
交割地点	交易所指定交割地点
交割方式	实物交割
交易代码	LR
上市交易所	郑州商品交易所
交易品种	棉纱
交易单位	5 吨/手（公定重量）
报价单位	元（人民币）/吨
最小变动价位	5 元/吨
每日价格波动限制	上一交易日结算价 $\pm 4\%$ 及《郑州商品交易所期货交易风险控制管理办法》相关规定
最低交易保证金	合约价值的 5%
合约交割月份	1—12 月
交易时间	每周一至周五（北京时间 法定节假日除外） 上午 9:00—11:30，下午 1:30—3:00 及交易所规定的其他交易时间
最后交易日	合约交割月份的第 10 个交易日
最后交割日	合约交割月份的第 13 个交易日
交割品级	见《郑州商品交易所棉纱期货业务细则》
交割地点	交易所指定交割地点
交割方式	实物交割
交易代码	CY
上市交易所	郑州商品交易所

续表

交易品种	鲜苹果（简称“苹果”）
交易单位	10 吨/手
报价单位	元（人民币）/吨
最小变动价位	1 元/吨
每日价格波动限制	上一交易日结算价 $\pm 5\%$ 及《郑州商品交易所期货交易风险控制管理办法》相关规定
最低交易保证金	合约价值的 7%
合约交割月份	1 月、3 月、4 月、5 月、10 月、11 月、12 月
交易时间	每周一至周五（北京时间 法定节假日除外） 上午 9:00—11:30，下午 1:30—3:00 及交易所规定的其他交易时间
最后交易日	合约交割月份的第 10 个交易日
最后交割日	仓单交割：合约交割月份的第 13 个交易日 车（船）板交割：合约交割月份的次月 10 日
交割品级	见《郑州商品交易所鲜苹果期货业务细则》
交割地点	交易所指定交割地点
交割方式	实物交割
交易代码	AP
上市交易所	郑州商品交易所
交易品种	干制红枣（简称“红枣”）
交易单位	5 吨/手
报价单位	元（人民币）/吨
最小变动价位	5 元/吨
每日价格波动限制	上一交易日结算价 $\pm 5\%$ 及《郑州商品交易所期货交易风险控制管理办法》相关规定
最低交易保证金	合约价值的 7%
合约交割月份	1 月、3 月、5 月、7 月、9 月、12 月
交易时间	每周一至周五（北京时间法定节假日除外） 上午 9:00—11:30，下午 1:30—3:00 及交易所规定的其他交易时间
最后交易日	合约交割月份的第 10 个交易日
最后交割日	合约交割月份的第 13 个交易日
交割品级	见《郑州商品交易所干制红枣期货业务细则》
交割地点	交易所指定交割仓库
交割方式	实物交割
交易代码	CJ
上市交易所	郑州商品交易所



续表

交易品种	花生仁（简称“花生”）
交易单位	5 吨/手
报价单位	元（人民币）/吨
最小变动价位	2 元/吨
每日价格波动限制	上一交易日结算价 $\pm 4\%$ 及《郑州商品交易所期货交易风险控制管理办法》相关规定
最低交易保证金	合约价值的 5%
合约交割月份	1 月、3 月、4 月、10 月、11 月、12 月
交易时间	每周一至周五（北京时间法定节假日除外） 上午 9:00—11:30，下午 1:30—3:00 及交易所规定的其他交易时间
最后交易日	合约交割月份的第 10 个交易日
最后交割日	仓单交割：合约交割月份的第 13 个交易日 车（船）板交割：合约交割月份的次月 10 日
交割品级	见《郑州商品交易所花生仁期货业务细则》
交割地点	交易所指定交割地点
交割方式	实物交割
交易代码	PK
上市交易所	郑州商品交易所
交易品种	黄大豆 1 号
交易单位	10 吨/手
报价单位	元（人民币）/吨
最小变动价位	1 元/吨
涨跌停板幅度	上一交易日结算价的 4%
合约月份	1 月、3 月、5 月、7 月、9 月、11 月
交易时间	每周一至周五上午 9:00—11:30，下午 13:30—15:00，以及交易所规定的其他时间
最后交易日	合约月份第 10 个交易日
最后交割日	最后交易日后第 3 个交易日
交割等级	大连商品交易所黄大豆 1 号交割质量标准（F/DCE A001-2018）
交割地点	大连商品交易所黄大豆 1 号指定交割仓库
最低交易保证金	合约价值的 5%
交割方式	实物交割
交易代码	A
上市交易所	大连商品交易所

续表

交易品种	黄大豆2号
交易单位	10吨/手
报价单位	元(人民币)/吨
最小变动价位	1元/吨
涨跌停板幅度	上一交易日结算价的4%
合约月份	1—12月
交易时间	每周一至周五上午9:00—11:30, 下午13:30—15:00, 以及交易所规定的其他时间
最后交易日	合约月份第10个交易日
最后交割日	最后交易日后第3个交易日
交割等级	大连商品交易所黄大豆2号交割质量标准(F/DCE B003-2017)
交割地点	大连商品交易所黄大豆2号指定交割仓库
最低交易保证金	合约价值的5%
交割方式	实物交割
交易代码	B
上市交易所	大连商品交易所
交易品种	豆粕
交易单位	10吨/手
报价单位	元(人民币)/吨
最小变动价位	1元/吨
涨跌停板幅度	上一交易日结算价的4%
合约月份	1月、3月、5月、7月、8月、9月、11月、12月
交易时间	每周一至周五上午9:00—11:30, 下午13:30—15:00, 以及交易所规定的其他时间
最后交易日	合约月份第10个交易日
最后交割日	最后交易日后第3个交易日
交割等级	大连商品交易所豆粕交割质量标准(F/DCE M004-2020)
交割地点	大连商品交易所豆粕指定交割仓库
最低交易保证金	合约价值的5%
交割方式	实物交割
交易代码	M
上市交易所	大连商品交易所



续表

交易品种	大豆原油
交易单位	10 吨/手
报价单位	元（人民币）/吨
最小变动价位	2 元/吨
涨跌停板幅度	上一交易日结算价的 4%
合约月份	1 月、3 月、5 月、7 月、8 月、9 月、11 月、12 月
交易时间	每周一至周五上午 9:00—11:30, 下午 13:30—15:00, 以及交易所规定的其他时间
最后交易日	合约月份第 10 个交易日
最后交割日	最后交易日后第 3 个交易日
交割等级	大连商品交易所豆油交割质量标准（F/DCE Y002 - 2020）
交割地点	大连商品交易所豆油指定交割仓库
最低交易保证金	合约价值的 5%
交割方式	实物交割
交易代码	Y
上市交易所	大连商品交易所
交易品种	棕榈油
交易单位	10 吨/手
报价单位	元（人民币）/吨
最小变动价位	2 元/吨
涨跌停板幅度	上一交易日结算价的 4%
合约月份	1—12 月
交易时间	每周一至周五上午 9:00—11:30, 下午 13:30—15:00, 以及交易所规定的其他时间
最后交易日	合约月份第 10 个交易日
最后交割日	最后交易日后第 3 个交易日
交割等级	大连商品交易所棕榈油交割质量标准
交割地点	大连商品交易所棕榈油指定交割仓库
最低交易保证金	合约价值的 5%
交割方式	实物交割
交易代码	P
上市交易所	大连商品交易所

续表

交易品种	黄玉米
交易单位	10 吨/手
报价单位	元（人民币）/吨
最小变动价位	1 元/吨
涨跌停板幅度	上一交易日结算价的 4%
合约月份	1 月、3 月、5 月、7 月、9 月、11 月
交易时间	每周一至周五上午 9：00—11：30，下午 13：30—15：00，以及交易所规定的其他时间
最后交易日	合约月份第 10 个交易日
最后交割日	最后交易日后第 3 个交易日
交割等级	大连商品交易所玉米交割质量标准（FC/DCE D001 - 2015）（具体内容见附件）
交割地点	大连商品交易所玉米指定交割仓库
最低交易保证金	合约价值的 5%
交割方式	实物交割
交易代码	C
上市交易所	大连商品交易所
交易品种	玉米淀粉
交易单位	10 吨/手
报价单位	元（人民币）/吨
最小变动价位	1 元/吨
涨跌停板幅度	上一交易日结算价的 4%
合约月份	1 月、3 月、5 月、7 月、9 月、11 月
交易时间	每周一至周五上午 9：00—11：30，下午 13：30—15：00，以及交易所规定的其他时间
最后交易日	合约月份第 10 个交易日
最后交割日	最后交易日后第 3 个交易日
交割等级	大连商品交易所玉米淀粉交割质量标准（F/DCE CS002 - 2018）
交割地点	大连商品交易所玉米淀粉指定交割仓库
最低交易保证金	合约价值的 5%
交割方式	实物交割
交易代码	CS
上市交易所	大连商品交易所

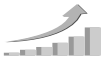


续表

交易品种	鲜鸡蛋
交易单位	5 吨/手
报价单位	元（人民币）/500 千克
最小变动价位	1 元/500 千克
涨跌停板幅度	上一交易日结算价的 4%
合约月份	1—12 月
交易时间	每周一至周五上午 9:00—11:30, 下午 13:30—15:00, 以及交易所规定的其他时间
最后交易日	合约月份倒数第 4 个交易日
最后交割日	最后交易日后第 3 个交易日
交割等级	大连商品交易所鸡蛋交割质量标准（F/DCE JD003 - 2020）
交割地点	大连商品交易所鸡蛋指定交割仓库、指定车板交割场所
最低交易保证金	合约价值的 5%
交割方式	实物交割
交易代码	JD
上市交易所	大连商品交易所
交易品种	粳米
交易单位	10 吨/手
报价单位	元（人民币）/吨
最小变动价位	1 元/吨
涨跌停板幅度	上一交易日结算价的 4%
合约月份	1—12 月
交易时间	每周一至周五上午 9:00—11:30, 下午 13:30—15:00, 以及交易所规定的其他时间
最后交易日	合约月份第 10 个交易日
最后交割日	最后交易日后第 3 个交易日
交割等级	大连商品交易所粳米交割质量标准（F/DCE RR001 - 2019）
交割地点	大连商品交易所粳米指定交割仓库
最低交易保证金	合约价值的 5%
交割方式	实物交割
交易代码	RR
上市交易所	大连商品交易所

续表

交易品种	细木工板
交易单位	500 张/手
报价单位	元（人民币）/张
最小变动价位	0.05 元/张
涨跌停板幅度	上一交易日结算价的 4%
合约月份	1—12 月
交易时间	每周一至周五上午 9:00—11:30, 下午 13:30—15:00, 以及交易所规定的其他时间
最后交易日	合约月份第 10 个交易日
最后交割日	最后交易日后第 3 个交易日
交割等级	大连商品交易所胶合板交割质量标准（F/DCE BB002—2018）
交割地点	大连商品交易所胶合板指定交割仓库
最低交易保证金	合约价值的 5%
交割方式	实物交割
交易代码	BB
上市交易所	大连商品交易所
交易品种	纤维板
交易单位	10 立方米/手
报价单位	元（人民币）/立方米
最小变动价位	0.5 元/立方米
涨跌停板幅度	上一交易日结算价的 4%
合约月份	1—12 月
交易时间	每周一至周五上午 9:00—11:30, 下午 13:30—15:00, 以及交易所规定的其他时间
最后交易日	合约月份第 10 个交易日
最后交割日	最后交易日后第 3 个交易日
交割等级	大连商品交易所纤维板交割质量标准（F/DCE FB001—2019）
交割地点	大连商品交易所纤维板指定交割仓库
最低交易保证金	合约价值的 5%
交割方式	实物交割
交易代码	FB
上市交易所	大连商品交易所



续表

交易品种	生猪
交易单位	16 吨/手
报价单位	元（人民币）/吨
最小变动价位	5 元/吨
涨跌停板幅度	上一交易日结算价的 4%
合约月份	1 月、3 月、5 月、7 月、9 月、11 月
交易时间	每周一至周五上午 9:00—11:30, 下午 13:30—15:00, 以及交易所规定的其他时间
最后交易日	合约月份倒数第 4 个交易日
最后交割日	最后交易日后第 3 个交易日
交割等级	大连商品交易所生猪交割质量标准（F/DCE LH001 - 2021）
交割地点	大连商品交易所生猪指定交割仓库、指定车板交割场所
最低交易保证金	合约价值的 5%
交割方式	实物交割
交易代码	LH
上市交易所	大连商品交易所

2022 年金属产品期货合约汇总

交易品种	阴极铜
交易单位	5 吨/手
报价单位	元（人民币）/吨
最小变动价位	10 元/吨
涨跌停板幅度	上一交易日结算价 $\pm 3\%$
合约月份	1—12 月
交易时间	上午 9:00—11:30, 下午 1:30—3:00, 以及交易所规定的其他交易时间
最后交易日	合约月份的 15 日（遇国家法定节假日顺延, 春节月份等最后交易日交易所可另行调整并通知）
交割日期	最后交易日后连续 3 个工作日
交割品级	标准品: 阴极铜, 符合国标 GB/T467 - 2010 中 1 号标准铜（Cu - CATH - 2）规定, 其中主成份铜加银含量不小于 99.95% 替代品: 阴极铜, 符合国标 GB/T467 - 2010 中 A 级铜（Cu - CATH - 1）规定; 或符合 BS EN 1978: 1998 中 A 级铜（Cu - CATH - 1）规定
交割地点	交易所指定交割仓库
最低交易保证金	合约价值的 5%
交割方式	实物交割
交割单位	25 吨
交易代码	CU
上市交易所	上海期货交易所

续表

交易品种	阴极铜 (BC)
交易单位	5 吨/手
报价单位	元 (人民币) /吨 (交易报价为不含税价格)
最小变动价位	10 元 (人民币) /吨
涨跌停板幅度	上一交易日结算价 $\pm 3\%$
合约月份	1—12 月
交易时间	上午 9:00—11:30, 下午 1:30—3:00, 以及上海国际能源交易中心规定的其他交易时间
最后交易日	交割月份的 15 日 (遇国家法定节假日、休息日顺延; 上海国际能源交易中心可以根据国家法定节假日、休息日调整最后交易日)
交割日期	最后交易日后连续五个交易日
交割品级	阴极铜, 符合国标 GB/T467-2010 中 A 级铜 (Cu-CATH-1) 规定; 或者符合 BS EN 1978:1998 中 A 级铜 (Cu-CATH-1) 规定
交割地点	上海国际能源交易中心指定交割仓库
最低交易保证金	合约价值的 5%
交割方式	实物交割
交易代码	BC
上市机构	上海国际能源交易中心
交易品种	铝
交易单位	5 吨/手
报价单位	元 (人民币) /吨
最小变动价位	5 元/吨
涨跌停板幅度	上一交易日结算价 $\pm 3\%$
合约月份	1—12 月
交易时间	上午 9:00—11:30, 下午 1:30—3:00, 以及交易所规定的其他交易时间
最后交易日	合约月份的 15 日 (遇国家法定节假日顺延, 春节月份等最后交易日交易所可另行调整并通知)
交割日期	最后交易日后连续 3 个工作日
交割品级	标准品: 铝锭, 符合国标 GB/T1196-2017 AL99.70 规定, 其中铝含量不低于 99.70% 替代品: 1. 铝锭, 符合国标 GB/T1196-2017 AL99.80, AL99.85 规定。2. 铝锭, 符合 P1020A 标准
交割地点	交易所指定交割仓库
最低交易保证金	合约价值的 5%
交割方式	实物交割
交割单位	25 吨
交易代码	AL
上市交易所	上海期货交易所



续表

交易品种	锌
交易单位	5 吨/手
报价单位	元（人民币）/吨
最小变动价位	5 元/吨
涨跌停板幅度	上一交易日结算价 $\pm 4\%$
合约月份	1—12 月
交易时间	上午 9:00—11:30, 下午 1:30—3:00, 以及交易所规定的其他交易时间
最后交易日	合约月份的 15 日（遇国家法定节假日顺延, 春节月份等最后交易日交易所可另行调整并通知）
交割日期	最后交易日后连续 3 个工作日
交割品级	标准品：锌锭，符合国标 GB/T470 - 2008 ZN99.995 规定，其中锌含量不小于 99.995% 替代品：锌锭，符合 BS EN 1179: 2003 Z1 规定，其中锌含量不小于 99.995%
交割地点	交易所指定交割仓库
最低交易保证金	合约价值的 5%
交割方式	实物交割
交割单位	25 吨
交易代码	ZN
上市交易所	上海期货交易所
交易品种	铅
交易单位	5 吨/手
报价单位	元（人民币）/吨
最小变动价位	5 元/吨
涨跌停板幅度	上一交易日结算价 $\pm 4\%$
合约月份	1—12 月
交易时间	上午 9:00—11:30, 下午 1:30—3:00, 以及交易所规定的其他交易时间
最后交易日	合约月份的 15 日（遇国家法定节假日顺延, 春节月份等最后交易日交易所可另行调整并通知）
交割日期	最后交易日后连续 3 个工作日
交割品级	标准品：铅锭，符合国标 GB/T 469 - 2013 Pb99.994 规定，其中铅含量不小于 99.994%
交割地点	交易所指定交割仓库
最低交易保证金	合约价值的 5%
交割方式	实物交割
交割单位	25 吨
交易代码	PB
上市交易所	上海期货交易所

续表

交易品种	镍
交易单位	1吨/手
报价单位	元(人民币)/吨
最小变动价位	10元/吨
涨跌停板幅度	上一交易日结算价 $\pm 4\%$
合约月份	1—12月
交易时间	上午9:00—11:30, 下午1:30—3:00, 以及交易所规定的其他交易时间
最后交易日	合约月份的15日(遇国家法定节假日顺延, 春节月份等最后交易日交易所可另行调整并通知)
交割日期	最后交易日后连续3个工作日
交割品级	标准品: 电解镍, 符合国标 GB/T 6516-2010 Ni9996 规定, 其中镍和钴的总含量不小于99.96% 替代品: 电解镍, 符合国标 GB/T 6516-2010 Ni9999 规定, 其中镍和钴的总含量不小于99.99%; 或符合 ASTM B39-79 (2013) 规定, 其中镍的含量不小于99.8%
交割地点	交易所指定交割仓库
最低交易保证金	合约价值的5%
交割方式	实物交割
交割单位	6吨
交易代码	NI
上市交易所	上海期货交易所
交易品种	锡
交易单位	1吨/手
报价单位	元(人民币)/吨
最小变动价位	10元/吨
涨跌停板幅度	上一交易日结算价 $\pm 4\%$
合约月份	1—12月
交易时间	上午9:00—11:30, 下午1:30—3:00, 以及交易所规定的其他交易时间
最后交易日	合约月份的15日(遇国家法定节假日顺延, 春节月份等最后交易日交易所可另行调整并通知)
交割日期	最后交易日后连续3个工作日
交割品级	标准品: 锡锭, 符合国标 GB/T 728-2010 Sn99.90A 牌号规定, 其中锡含量不小于99.90% 替代品: 锡锭, 符合国标 GB/T 728-2010 Sn99.90AA 牌号规定, 其中锡含量不小于99.90%; Sn99.95A、Sn99.95AA 牌号规定, 其中锡含量不小于99.95%; Sn99.99A 牌号规定, 其中锡含量不小于99.99%
交割地点	交易所指定交割仓库
最低交易保证金	合约价值的5%
交割方式	实物交割
交割单位	2吨
交易代码	SN
上市交易所	上海期货交易所



续表

交易品种	黄金
交易单位	1 000 克/手
报价单位	元（人民币）/克
最小变动价位	0.02 元/克
涨跌停板幅度	上一交易日结算价 $\pm 3\%$
合约月份	最近三个连续月份的合约以及最近 13 个月以内的双月合约
交易时间	上午 9:00—11:30，下午 1:30—3:00，以及交易所规定的其他交易时间
最后交易日	合约月份的 15 日（遇国家法定节假日顺延，春节月份等最后交易日交易所可另行调整并通知）
交割日期	最后交易日后第一个工作日
交割品级	金含量不小于 99.95% 的国产金锭及经交易所认可的伦敦金银市场协会（LBMA）认定的合格供货商或精炼厂生产的标准金锭（具体质量规定见附件）
交割地点	交易所指定交割金库
最低交易保证金	合约价值的 4%
交割方式	实物交割
交割单位	3 000 克
交易代码	AU
上市交易所	上海期货交易所
交易品种	白银
交易单位	15 千克/手
报价单位	元（人民币）/千克
最小变动价位	1 元/千克
涨跌停板幅度	上一交易日结算价 $\pm 3\%$
合约月份	1—12 月
交易时间	上午 9:00—11:30，下午 1:30—3:00，以及交易所规定的其他交易时间
最后交易日	合约月份的 15 日（遇国家法定节假日顺延，春节月份等最后交易日交易所可另行调整并通知）
交割日期	最后交易日后连续 3 个工作日
交割品级	标准品：符合国标 GB/T 4135 - 2016 IC - Ag99.99 规定，其中银含量不低于 99.99%
交割地点	交易所指定交割仓库
最低交易保证金	合约价值的 4%
交割方式	实物交割
交割单位	30 千克
交易代码	AG
上市交易所	上海期货交易所

续表

交易品种	螺纹钢
交易单位	10 吨/手
报价单位	元（人民币）/吨
最小变动价位	1 元/吨
涨跌停板幅度	上一交易日结算价 $\pm 3\%$
合约月份	1—12 月
交易时间	上午 9:00—11:30, 下午 1:30—3:00, 以及交易所规定的其他交易时间
最后交易日	合约月份的 15 日（遇国家法定节假日顺延, 春节月份等最后交易日交易所可另行调整并通知）
交割日期	最后交易日后连续 3 个工作日
交割品级	标准品：符合国标 GB/T 1499.2-2018《钢筋混凝土用钢 第 2 部分：热轧带肋钢筋》HRB400E 牌号的 $\Phi 16\text{mm}$ 、 $\Phi 18\text{mm}$ 、 $\Phi 20\text{mm}$ 、 $\Phi 22\text{mm}$ 、 $\Phi 25\text{mm}$ 螺纹钢
交割地点	交易所指定交割仓库
最低交易保证金	合约价值的 5%
交割方式	实物交割
交割单位	300 吨
交易代码	RB
上市交易所	上海期货交易所
交易品种	线材
交易单位	10 吨/手
报价单位	元（人民币）/吨
最小变动价位	1 元/吨
涨跌停板幅度	上一交易日结算价 $\pm 5\%$
合约月份	1—12 月
交易时间	上午 9:00—11:30, 下午 1:30—3:00, 以及交易所规定的其他交易时间
最后交易日	合约月份的 15 日（遇国家法定节假日顺延, 春节月份等最后交易日交易所可另行调整并通知）
交割日期	最后交易日后连续 3 个工作日
交割品级	标准品：符合国标 GB/T 1499.1-2017《钢筋混凝土用钢 第 1 部分：热轧光圆钢筋》HPB300 牌号的 $\phi 8\text{mm}$ 线材 替代品：符合国标 GB/T 1499.1-2017《钢筋混凝土用钢 第 1 部分：热轧光圆钢筋》HPB300 牌号的 $\phi 10\text{mm}$ 线材
交割地点	交易所指定交割仓库
最低交易保证金	合约价值的 7%
交割方式	实物交割
交割单位	300 吨
交易代码	WR
上市交易所	上海期货交易所



续表

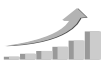
交易品种	热轧卷板
交易单位	10 吨/手
报价单位	元（人民币）/吨
最小变动价位	1 元/吨
涨跌停板幅度	上一交易日结算价 $\pm 3\%$
合约月份	1—12 月
交易时间	上午 9:00—11:30, 下午 1:30—3:00, 以及交易所规定的其他交易时间
最后交易日	合约月份的 15 日（遇国家法定节假日顺延, 春节月份等最后交易日交易所可另行调整并通知）
交割日期	最后交易日后连续 3 个工作日
交割品级	标准品: 符合 GB/T 3274-2017《碳素结构钢和低合金结构钢热轧厚钢板和钢带》的 Q235B 或符合 JIS G 3101-2015《一般结构用轧制钢材》的 SS400, 厚度 5.75mm、宽度 1500mm 热轧卷板 替代品: 符合 GB/T 3274-2017《碳素结构钢和低合金结构钢热轧厚钢板和钢带》的 Q235B 或符合 JIS G 3101-2015《一般结构用轧制钢材》的 SS400, 厚度 9.75mm、9.5mm、7.75mm、7.5mm、5.50mm、4.75mm、4.50mm、3.75mm、3.50mm、宽度 1500mm 热轧卷板
交割地点	交易所指定交割仓库
最低交易保证金	合约价值的 4%
交割方式	实物交割
交割单位	300 吨
交易代码	HC
上市交易所	上海期货交易所
交易品种	不锈钢
交易单位	5 吨/手
报价单位	元（人民币）/吨
最小变动价位	5 元/吨
涨跌停板幅度	上一交易日结算价 $\pm 4\%$
合约月份	1—12 月
交易时间	上午 9:00—11:30, 下午 1:30—3:00, 以及交易所规定的其他交易时间
最后交易日	合约月份的 15 日（遇国家法定节假日顺延, 春节月份等最后交易日交易所可另行调整并通知）
交割日期	最后交易日后连续 3 个工作日
交割品级	标准品为厚度 2.0mm、宽度 1219mm、表面加工类型为 2B、边部状态为切边的 304 奥氏体不锈钢冷轧卷板 质量符合 GB/T 3280-2015《不锈钢冷轧钢板和钢带》要求的 06Cr19Ni10, 或者符合 JIS G 4305:2012《冷轧不锈钢钢板及钢带》的 SUS304 替代交割品厚度可选 0.5 mm、0.6 mm、0.7 mm、0.8 mm、0.9 mm、1.0 mm、1.2 mm、1.5 mm、3.0mm, 宽度可选 1000mm、1500mm, 边部状态可选毛边（厚度升贴水、边部状态升贴水由交易所另行规定并公告）
交割地点	交易所指定交割地点
最低交易保证金	合约价值的 5%
交割方式	实物交割
交割单位	60 吨
交易代码	SS
上市交易所	上海期货交易所

续表

交易品种	工业硅
合约标的	工业硅
交易单位	5 吨/手
报价单位	元（人民币）/吨
最小变动价位	5 元/吨
合约月份	1—12 月
交易时间	每周一至周五（北京时间 法定节假日除外）9：30—11：30，13：00—15：00，及交易所规定的其他时间
最后交易日交易时间	上午：9：30—11：30，下午：13：00—15：00
每日价格最大波动限制	上一个交易日结算价的 $\pm 4\%$
最低交易保证金	合约价值的 5%
最后交易日	合约月份的第 10 个交易日
最后交割日	最后交易日后的第 3 个交易日
交割方式	实物交割
交易代码	SI
上市交易所	广州期货交易所

2022 年能源化工及其他类期货合约汇总

交易品种	燃料油
交易单位	10 吨/手
报价单位	元（人民币）/吨（交易报价为不含税价格）
最小变动价位	1 元/吨
涨跌停板幅度	上一交易日结算价 $\pm 5\%$
合约月份	1—12 月
交易时间	上午 9：00—11：30，下午 1：30—3：00，以及交易所规定的其他交易时间
最后交易日	合约月份前一月份的最后一个交易日；交易所可以根据国家法定节假日调整最后交易日
交割日期	最后交易日后连续 3 个工作日
交割品级	RMC 380 船用燃料油（硫含量为 I 级、II 级）或者质量优于该标准的船用燃料油（具体质量规定见附件）
交割地点	交易所指定交割地点
最低交易保证金	合约价值的 8%
交割方式	实物交割
交割单位	10 吨
交易代码	FU
上市交易所	上海期货交易所



续表

交易品种	低硫燃料油
交易单位	10 吨/手
报价单位	元（人民币）/吨（交易报价为不含税价格）
最小变动价位	1 元（人民币）/吨
涨跌停板幅度	不超过上一交易日结算价 $\pm 5\%$
合约交割月份	1—12 月
交易时间	上午 9:00—11:30, 下午 1:30—3:00, 以及上海国际能源交易中心规定的其他交易时间
最后交易日	交割月份前第一月的最后一个交易日（遇国家法定节假日、休息日顺延；上海国际能源交易中心可以根据国家法定节假日、休息日调整最后交易日）
交割日期	最后交易日后连续五个交易日
交割品质	低硫船用燃料油（具体质量规定见附件）
交割地点	上海国际能源交易中心指定交割仓库
最低交易保证金	合约价值的 8%
交割方式	实物交割
交易代码	LU
上市机构	上海国际能源交易中心
交易品种	石油沥青
交易单位	10 吨/手
报价单位	元（人民币）/吨
最小变动价位	1 元/吨
涨跌停板幅度	上一交易日结算价 $\pm 3\%$
合约月份	最近 1—12 个月为连续月份以及随后四个季月
交易时间	上午 9:00—11:30, 下午 1:30—3:00, 以及交易所规定的其他交易时间
最后交易日	合约月份的 15 日（遇国家法定节假日顺延，春节月份等最后交易日交易所可另行调整并通知）
交割日期	最后交易日后连续 3 个工作日
交割品级	70 号 A 级道路石油沥青，具体内容见《上海期货交易所石油沥青期货交割实施细则（试行）》
交割地点	交易所指定交割地点
最低交易保证金	合约价值的 4%
交割方式	实物交割
交割单位	10 吨
交易代码	BU
上市交易所	上海期货交易所

续表

交易品种	漂白硫酸盐针叶木浆
交易单位	10 吨/手
报价单位	元（人民币）/吨
最小变动价位	2 元/吨
涨跌停板幅度	上一交易日结算价 $\pm 3\%$
合约月份	1—12 月
交易时间	上午 9:00—11:30, 下午 1:30—3:00, 以及交易所规定的其他交易时间
最后交易日	合约月份的 15 日（遇国家法定节假日顺延, 春节月份等最后交易日交易所可另行调整并通知）
交割日期	最后交易日后连续 3 个工作日
交割品级	漂白硫酸盐针叶木浆, 具体质量规定见附件
交割地点	交易所指定交割仓库
最低交易保证金	合约价值的 4%
交割方式	实物交割
交割单位	20 吨
交易代码	SP
上市交易所	上海期货交易所
交易品种	中质含硫原油
交易单位	1 000 桶/手
报价单位	元（人民币）/桶（交易报价为不含税价格）
最小变动价位	0.1 元（人民币）/桶
涨跌停板幅度	不超过上一交易日结算价 $\pm 4\%$
合约交割月份	最近 1—12 个月为连续月份以及随后八个季月
交易时间	上午 9:00—11:30, 下午 1:30—3:00, 以及以及上海国际能源交易中心规定的其他交易时间
最后交易日	交割月份前第一月的最后一个交易日; 上海国际能源交易中心有权根据国家法定节假日调整最后交易日
交割日期	最后交易日后连续五个交易日
交割品质	中质含硫原油, 基准品质为 API 度 32.0, 硫含量 1.5%, 具体可交割油种及升贴水由上海国际能源交易中心另行规定
交割地点	上海国际能源交易中心指定交割仓库
最低交易保证金	合约价值的 5%
交割方式	实物交割
交易代码	SC
上市机构	上海国际能源交易中心



续表

交易品种	20 号胶
交易单位	10 吨/手
报价单位	元（人民币）/吨（交易报价为不含税价格）
最小变动价位	5 元（人民币）/吨
涨跌停板幅度	不超过上一交易日结算价 $\pm 5\%$
合约交割月份	1—12 月
交易时间	上午 9:00—11:30, 下午 1:30—3:00, 以及上海国际能源交易中心规定的其他交易时间
最后交易日	交割月份的 15 日（遇国家法定节假日、休息日顺延；上海国际能源交易中心可以根据国家法定节假日、休息日调整最后交易日）
交割日期	最后交易日后连续五个交易日
交割品质	具体质量规定见附件
交割地点	上海国际能源交易中心指定交割仓库
最低交易保证金	合约价值的 7%
交割方式	实物交割
交易代码	NR
上市机构	上海国际能源交易中心
交易品种	精对苯二甲酸（PTA）
交易单位	5 吨/手
报价单位	元（人民币）/吨
最小变动价位	2 元/吨
每日价格波动限制	上一交易日结算价 $\pm 4\%$ 及《郑州商品交易所期货交易风险控制管理办法》相关规定
最低交易保证金	合约价值的 5%
合约交割月份	1—12 月
交易时间	每周一至周五（北京时间 法定节假日除外） 上午 9:00—11:30, 下午 1:30—3:00, 以及交易所规定的其他交易时间
最后交易日	合约交割月份的第 10 个交易日
最后交割日	合约交割月份的第 13 个交易日
交割品级	见《郑州商品交易所精对苯二甲酸（PTA）期货业务细则》
交割地点	交易所指定交割地点
交割方式	实物交割
交易代码	TA
上市交易所	郑州商品交易所

续表

交易品种	甲醇
交易单位	10 吨/手
报价单位	元（人民币）/吨
最小变动价位	1 元/吨
每日价格波动限制	上一交易日结算价 $\pm 4\%$ 及《郑州商品交易所期货交易风险控制管理办法》相关规定
最低交易保证金	合约价值的 5%
合约交割月份	1—12 月
交易时间	每周一至周五（北京时间 法定节假日除外） 上午 9:00—11:30，下午 1:30—3:00，以及交易所规定的其他交易时间
最后交易日	合约交割月份的第 10 个交易日
最后交割日	合约交割月份的第 13 个交易日
交割品级	见《郑州商品交易所甲醇期货业务细则》
交割地点	交易所指定交割地点
交割方式	实物交割
交易代码	MA
上市交易所	郑州商品交易所
交易品种	平板玻璃（简称“玻璃”）
交易单位	20 吨/手
报价单位	元（人民币）/吨
最小变动价位	1 元/吨
每日价格波动限制	上一交易日结算价 $\pm 4\%$ 及《郑州商品交易所期货交易风险控制管理办法》相关规定
最低交易保证金	合约价值的 5%
合约交割月份	1—12 月
交易时间	每周一至周五（北京时间 法定节假日除外） 上午 9:00—11:30，下午 1:30—3:00，以及交易所规定的其他交易时间
最后交易日	合约交割月份的第 10 个交易日
最后交割日	合约交割月份的第 13 个交易日
交割品级	见《郑州商品交易所平板玻璃期货业务细则》
交割地点	交易所指定交割地点
交割方式	实物交割
交易代码	FG
上市交易所	郑州商品交易所



续表

交易品种	动力煤
交易单位	100 吨/手
报价单位	元（人民币）/吨
最小变动价位	0.2 元/吨
每日价格波动限制	上一交易日结算价 $\pm 4\%$ 及《郑州商品交易所期货交易风险控制管理办法》相关规定
最低交易保证金	合约价值的 5%
合约交割月份	1—12 月
交易时间	每周一至周五（北京时间 法定节假日除外） 上午 9:00—11:30, 下午 1:30—3:00, 以及交易所规定的其他交易时间
最后交易日	合约交割月份的第 5 个交易日
最后交割日	车（船）板交割：合约交割月份的最后 1 个日历日 仓单交割：合约交割月份的第 8 个交易日
交割品级	见《郑州商品交易所动力煤期货业务细则》
交割地点	交易所指定交割地点
交割方式	实物交割
交易代码	ZC
上市交易所	郑州商品交易所
交易品种	硅铁
交易单位	5 吨/手
报价单位	元（人民币）/吨
最小变动价位	2 元/吨
每日价格波动限制	上一交易日结算价 $\pm 4\%$ 及《郑州商品交易所期货交易风险控制管理办法》相关规定
最低交易保证金	合约价值的 5%
合约交割月份	1—12 月
交易时间	每周一至周五（北京时间 法定节假日除外） 上午 9:00—11:30, 下午 1:30—3:00, 以及交易所规定的其他交易时间
最后交易日	合约交割月份的第 10 个交易日
最后交割日	合约交割月份的第 13 个交易日
交割品级	见《郑州商品交易所硅铁期货业务细则》
交割地点	交易所指定交割地点
交割方式	实物交割
交易代码	SF
上市交易所	郑州商品交易所

续表

交易品种	锰硅
交易单位	5 吨/手
报价单位	元（人民币）/吨
最小变动价位	2 元/吨
每日价格波动限制	上一交易日结算价 $\pm 4\%$ 及《郑州商品交易所期货交易风险控制管理办法》相关规定
最低交易保证金	合约价值的 5%
合约交割月份	1—12 月
交易时间	每周一至周五（北京时间 法定节假日除外） 上午 9:00—11:30, 下午 1:30—3:00, 以及交易所规定的其他交易时间
最后交易日	合约交割月份的第 10 个交易日
最后交割日	合约交割月份的第 13 个交易日
交割品级	见《郑州商品交易所锰硅期货业务细则》
交割地点	交易所指定交割地点
交割方式	实物交割
交易代码	SM
上市交易所	郑州商品交易所
交易品种	尿素
交易单位	20 吨/手
报价单位	元（人民币）/吨
最小变动价位	1 元/吨
每日价格波动限制	上一交易日结算价 $\pm 4\%$ 及《郑州商品交易所期货交易风险控制管理办法》相关规定
最低交易保证金	合约价值的 5%
合约交割月份	1—12 月
交易时间	每周一至周五（北京时间 法定节假日除外） 上午 9:00—11:30, 下午 1:30—3:00, 以及交易所规定的其他交易时间
最后交易日	合约交割月份的第 10 个交易日
最后交割日	合约交割月份的第 13 个交易日
交割品级	见《郑州商品交易所尿素期货业务细则》
交割地点	交易所指定交割地点
交割方式	实物交割
交易代码	UR
上市交易所	郑州商品交易所

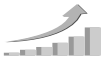


续表

交易品种	纯碱
交易单位	20 吨/手
报价单位	元（人民币）/吨
最小变动价位	1 元/吨
每日价格波动限制	上一交易日结算价 $\pm 4\%$ 及《郑州商品交易所期货交易风险控制管理办法》相关规定
最低交易保证金	合约价值的 5%
合约交割月份	1—12 月
交易时间	每周一至周五（北京时间法定节假日除外） 上午 9:00—11:30，下午 1:30—3:00，以及交易所规定的其他交易时间
最后交易日	合约交割月份的第 10 个交易日
最后交割日	合约交割月份的第 13 个交易日
交割品级	见《郑州商品交易所纯碱期货业务细则》
交割地点	交易所指定交割地点
交割方式	实物交割
交易代码	SA
上市交易所	郑州商品交易所
交易品种	涤纶短纤（简称“短纤”）
交易单位	5 吨/手
报价单位	元（人民币）/吨
最小变动价位	2 元/吨
每日价格波动限制	上一交易日结算价 $\pm 4\%$ 及《郑州商品交易所期货交易风险控制管理办法》相关规定
最低交易保证金	合约价值的 5%
合约交割月份	1—12 月
交易时间	每周一至周五（北京时间，法定节假日除外） 上午 9:00—11:30，下午 1:30—3:00，以及交易所规定的其他交易时间
最后交易日	合约交割月份的第 10 个交易日
最后交割日	合约交割月份的第 13 个交易日
交割品级	见《郑州商品交易所涤纶短纤期货业务细则》
交割地点	交易所指定交割地点
交割方式	实物交割
交易代码	PF
上市交易所	郑州商品交易所

续表

交易品种	线性低密度聚乙烯
交易单位	5 吨/手
报价单位	元（人民币）/吨
最小变动价位	1 元/吨
涨跌停板幅度	上一交易日结算价的 4%
合约月份	1—12 月
交易时间	每周一至周五上午 9:00—11:30, 下午 13:30—15:00, 以及交易所规定的其他时间
最后交易日	合约月份第 10 个交易日
最后交割日	最后交易日后第 3 个交易日
交割等级	大连商品交易所线型低密度聚乙烯交割质量标准
交割地点	大连商品交易所线型低密度聚乙烯指定交割仓库
最低交易保证金	合约价值的 5%
交割方式	实物交割
交易代码	L
上市交易所	大连商品交易所
交易品种	聚丙烯
交易单位	5 吨/手
报价单位	元（人民币）/吨
最小变动价位	1 元/吨
涨跌停板幅度	上一交易日结算价的 4%
合约月份	1—12 月
交易时间	每周一至周五上午 9:00—11:30, 下午 13:30—15:00, 以及交易所规定的其他时间
最后交易日	合约月份第 10 个交易日
最后交割日	最后交易日后第 3 个交易日
交割等级	大连商品交易所聚丙烯交割质量标准
交割地点	大连商品交易所聚丙烯指定交割仓库
最低交易保证金	合约价值的 5%
交割方式	实物交割
交易代码	PP
上市交易所	大连商品交易所



续表

交易品种	聚氯乙烯
交易单位	5 吨/手
报价单位	元（人民币）/吨
最小变动价位	1 元/吨
涨跌停板幅度	上一交易日结算价的 4%
合约月份	1—12 月
交易时间	每周一至周五上午 9:00—11:30, 下午 13:30—15:00, 以及交易所规定的其他时间
最后交易日	合约月份第 10 个交易日
最后交割日	最后交易日后第 3 个交易日
交割等级	质量标准符合《悬浮法通用型聚氯乙烯树脂（GB/T 5761-2018）》规定的 SG5 型一等品和优等品（干流性指标不做要求）
交割地点	大连商品交易所聚氯乙烯指定交割仓库
最低交易保证金	合约价值的 5%
交割方式	实物交割
交易代码	V
上市交易所	大连商品交易所
交易品种	冶金焦炭
交易单位	100 吨/手
报价单位	元（人民币）/吨
最小变动价位	0.5 元/吨
涨跌停板幅度	上一交易日结算价的 4%
合约月份	1—12 月
交易时间	每周一至周五上午 9:00—11:30, 下午 13:30—15:00, 以及交易所规定的其他时间
最后交易日	合约月份第 10 个交易日
最后交割日	最后交易日后第 3 个交易日
交割等级	大连商品交易所焦炭交割质量标准（F/DCE J001-2021）
交割地点	大连商品交易所焦炭指定交割仓库
最低交易保证金	合约价值的 5%
交割方式	实物交割
交易代码	J
上市交易所	大连商品交易所

续表

交易品种	焦煤
交易单位	60 吨/手
报价单位	元（人民币）/吨
最小变动价位	0.5 元/吨
涨跌停板幅度	上一交易日结算价的 4%
合约月份	1—12 月
交易时间	每周一至周五上午 9:00—11:30, 下午 13:30—15:00, 以及交易所规定的其他时间
最后交易日	合约月份第 10 个交易日
最后交割日	最后交易日后第 3 个交易日
交割等级	大连商品交易所焦煤交割质量标准（F/DCE JM001 - 2018）
交割地点	大连商品交易所焦煤指定交割仓库
最低交易保证金	合约价值的 5%
交割方式	实物交割
交易代码	JM
上市交易所	大连商品交易所
交易品种	铁矿石
交易单位	100 吨/手
报价单位	元（人民币）/吨
最小变动单位	0.5 元/吨
涨跌停板幅度	上一交易日结算价的 4%
合约月份	1—12 月
交易时间	每周一至周五上午 9:00—11:30, 下午 13:30—15:00, 以及交易所规定的其他时间
最后交易日	合约月份第 10 个交易日
最后交割日	最后交易日后第 3 个交易日
交割等级	大连商品交易所铁矿石交割质量标准（F/DCE I004 - 2021），可交割品牌和品牌升贴水由大连商品交易所另行规定
交割地点	大连商品交易所铁矿石指定交割仓库及指定交割地点
最低交易保证金	合约价值的 5%
交割方式	实物交割
交易代码	I
上市交易所	大连商品交易所



续表

交易品种	乙二醇
交易单位	10 吨/手
报价单位	元（人民币）/吨
最小变动价位	1 元/吨
涨跌停板幅度	上一交易日结算价的 4%
合约月份	1—12 月
交易时间	每周一至周五上午 9:00—11:30, 下午 13:30—15:00, 以及交易所规定的其他时间
最后交易日	合约月份倒数第 4 个交易日
最后交割日	最后交易日后第 3 个交易日
交割等级	大连商品交易所乙二醇交割质量标准（F/DCE EG001—2018）
交割地点	大连商品交易所乙二醇指定交割仓库
最低交易保证金	合约价值的 5%
交割方式	实物交割
交易代码	EG
上市交易所	大连商品交易所
交易品种	苯乙烯
交易单位	5 吨/手
报价单位	元（人民币）/吨
最小变动价位	1 元/吨
涨跌停板幅度	上一交易日结算价的 4%
合约月份	1—12 月
交易时间	每周一至周五上午 9:00—11:30, 下午 13:30—15:00, 以及交易所规定的其他时间
最后交易日	合约月份倒数第 4 个交易日
最后交割日	最后交易日后第 3 个交易日
交割等级	大连商品交易所苯乙烯交割质量标准（F/DCE EB001—2019）
交割地点	大连商品交易所苯乙烯指定交割仓库
最低交易保证金	合约价值的 5%
交割方式	实物交割
交易代码	EB
上市交易所	大连商品交易所

续表

交易品种	液化石油气
交易单位	20 吨/手
报价单位	元（人民币）/吨
最小变动价位	1 元/吨
涨跌停板幅度	上一交易日结算价的 4%
合约月份	1—12 月
交易时间	每周一至周五上午 9:00—11:30, 下午 13:30—15:00, 以及交易所规定的其他时间
最后交易日	合约月份倒数第 4 个交易日
最后交割日	最后交易日后第 3 个交易日
交割等级	大连商品交易所液化石油气交割质量标准（F/DCE PG001 - 2020）
交割地点	大连商品交易所液化石油气指定交割仓库
最低交易保证金	合约价值的 5%
交割方式	实物交割
交易代码	PG
上市交易所	大连商品交易所

2022 年金融期货合约汇总

合约名称	沪深 300 股票指数期货合约
合约标的	沪深 300 指数
合约乘数	每点 300 元
报价单位	指数点
最小变动价位	0.2 点
合约月份	当月、下月及随后两个季月
交易时间	上午 9:30—11:30, 下午 13:00—15:00
最后交易日交易时间	上午 9:30—11:30, 下午 13:00—15:00
每日价格最大波动限制	上一个交易日结算价的 $\pm 10\%$
最低交易保证金	合约价值的 8%
最后交易日	合约到期月份的第三个周五, 遇国家法定假日顺延
交割日期	同最后交易日
交割方式	现金交割
交易代码	IF
上市交易所	中国金融期货交易所



续表

合约名称	上证 50 股票指数期货合约
合约标的	上证 50 指数
合约乘数	每点 300 元
报价单位	指数点
最小变动价位	0.2 点
合约月份	当月、下月及随后两个季月
交易时间	上午 9:30—11:30, 下午 13:00—15:00
最后交易日交易时间	上午 9:30—11:30, 下午 13:00—15:00
每日价格最大波动限制	上一个交易日结算价的 $\pm 10\%$
最低交易保证金	合约价值的 8%
最后交易日	合约到期月份的第三个周五, 遇国家法定假日顺延
交割日期	同最后交易日
交割方式	现金交割
交易代码	IH
上市交易所	中国金融期货交易所
合约名称	中证 500 股票指数期货合约
合约标的	中证 500 指数
合约乘数	每点 200 元
报价单位	指数点
最小变动价位	0.2 点
合约月份	当月、下月及随后两个季月
交易时间	上午 9:30—11:30, 下午 13:00—15:00
最后交易日交易时间	上午 9:30—11:30, 下午 13:00—15:00
每日价格最大波动限制	上一个交易日结算价的 $\pm 10\%$
最低交易保证金	合约价值的 8%
最后交易日	合约到期月份的第三个周五, 遇国家法定假日顺延
交割日期	同最后交易日
交割方式	现金交割
交易代码	IC
上市交易所	中国金融期货交易所

续表

合约名称	中证 1000 股票指数期货合约
合约标的	中证 1000 指数
合约乘数	每点人民币 200 元
报价单位	指数点
最小变动价位	0.2 点
合约月份	当月、下月及随后两个季月
交易时间	上午 9:30—11:30, 下午 13:00—15:00
每日价格最大波动限制	上一个交易日结算价的 $\pm 10\%$
最低交易保证金	合约价值的 8%
最后交易日	合约到期月份的第三个星期五, 遇国家法定假日顺延
交割日期	同最后交易日
交割方式	现金交割
交易代码	IM
上市交易所	中国金融期货交易所
合约名称	2 年期国债期货合约
合约标的	面值为 200 万元人民币, 票面利率为 3% 的名义中短期国债
可交割国债	发行期限不高于 5 年、合约到期月份首日剩余期限为 1.5 - 2.25 年记账式付息国债
报价方式	百元净价报价
最小变动价位	0.005 元
合约月份	最近的三个季月 (3 月、6 月、9 月、12 月中的最近 3 个月循环)
交易时间	上午 9:30—11:30, 下午 13:00—15:15
最后交易日交易时间	上午 9:30—11:30
每日价格最大波动限制	上一交易日结算价的 $\pm 0.5\%$
最低交易保证金	合约价值的 0.5%
最后交易日	合约到期月份的第二个星期五
最后交割日	最后交易日后的第三个交易日
交割方式	实物交割
合约代码	TS
上市交易所	中国金融期货交易所

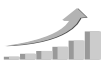


续表

合约名称	5年期国债期货合约
合约标的	面值为100万元人民币，票面利率为3%的名义中期国债
可交割国债	发行期限不高于7年、合约到期月份首日剩余期限为4-5.25年记账式附息国债
报价方式	百元净价报价
最小变动价位	0.005元
合约月份	最近的三个季月（3月、6月、9月、12月中的最近3个月循环）
交易时间	上午9:30—11:30，下午13:00—15:15
最后交易日交易时间	上午9:30—11:30
每日价格最大波动限制	上一交易日结算价的±1.2%
最低交易保证金	合约价值的1%
最后交易日	合约到期月份的第二个星期五
最后交割日	最后交易日后的第三个交易日
交割方式	实物交割
合约代码	TF
上市交易所	中国金融期货交易所
合约名称	10年期国债期货合约
合约标的	面值为100万元人民币，票面利率为3%的名义长期国债
可交割国债	发行期限不高于10年、合约到期月份首日剩余期限不低于6.5年的记账式附息国债
报价方式	百元净价报价
最小变动价位	0.005元
合约月份	最近的三个季月（3月、6月、9月、12月中的最近3个月循环）
交易时间	上午9:30—11:30，下午13:00—15:15
最后交易日交易时间	上午9:30—11:30
每日价格最大波动限制	上一交易日结算价的±2%
最低交易保证金	合约价值的2%
最后交易日	合约到期月份的第二个星期五
最后交割日	最后交易日后的第三个交易日
交割方式	实物交割
合约代码	T
上市交易所	中国金融期货交易所

2022 年期货期权合约汇总

交易品种	阴极铜期货期权
合约标的物	阴极铜期货合约（5 吨）
合约类型	看涨期权，看跌期权
交易单位	1 手阴极铜期货合约
报价单位	元（人民币）/吨
最小变动价位	2 元/吨
涨跌停板幅度	与阴极铜期货合约涨跌停板幅度相同
合约月份	最近两个连续月份合约，其后月份在标的期货合约结算后持仓量达到一定数值之后的第二个交易日挂牌。具体数值交易所另行发布
交易时间	上午 9：00—11：30，下午 13：30—15：00，以及交易所规定的其他时间
最后交易日	标的期货合约交割月前第一月的倒数第五个交易日，交易所可以根据国家法定节假日调整最后交易日
到期日	同最后交易日
行权价格	行权价格覆盖阴极铜期货合约上一交易日结算价上下浮动 1.5 倍当日涨跌停板幅度对应的价格范围。行权价格 ≤40 000 元/吨，行权价格间距为 500 元/吨；40 000 元/吨 < 行权价格 ≤80 000 元/吨，行权价格间距为 1 000 元/吨；行权价格 >80 000 元/吨，行权价格间距为 2 000 元/吨
行权方式	美式。买方可以在到期日前任一交易日的交易时间提交行权申请；买方可以在到期日 15：30 之前提交行权申请、放弃申请
交易代码	看涨期权：CU - 合约月份 - C - 行权价格 看跌期权：CU - 合约月份 - P - 行权价格
上市交易所	上海期货交易所
交易品种	铝期货期权
合约标的物	铝期货合约（5 吨）
合约类型	看涨期权，看跌期权
交易单位	1 手铝期货合约
报价单位	元（人民币）/吨
最小变动价位	1 元/吨
涨跌停板幅度	与标的期货合约涨跌停板幅度相同
合约月份	最近两个连续月份合约，其后月份在标的期货合约结算后持仓量达到一定数值之后的第二个交易日挂牌。具体数值交易所另行发布
交易时间	上午 9：00—11：30，下午 13：30—15：00，以及交易所规定的其他时间
最后交易日	标的期货合约交割月前第一月的倒数第五个交易日，交易所可以根据国家法定节假日等调整最后交易日
到期日	同最后交易日



续表

交易品种	铝期货期权
行权价格	行权价格覆盖标的期货合约上一交易日结算价上下浮动 1.5 倍当日涨跌停板幅度对应的价格范围。行权价格 $\leq 10\,000$ 元/吨, 行权价格间距为 50 元/吨; $10\,000$ 元/吨 $<$ 行权价格 $\leq 20\,000$ 元/吨, 行权价格间距为 100 元/吨; 行权价格 $> 20\,000$ 元/吨, 行权价格间距为 200 元/吨
行权方式	美式。买方可以在到期日前任一交易日的交易时间提交行权申请; 买方可以在到期日 15:30 之前提交行权申请、放弃申请
交易代码	看涨期权: AL - 合约月份 - C - 行权价格 看跌期权: AL - 合约月份 - P - 行权价格
上市交易所	上海期货交易所
交易品种	锌期货期权
合约标的物	锌期货合约 (5 吨)
合约类型	看涨期权, 看跌期权
交易单位	1 手锌期货合约
报价单位	元 (人民币) / 吨
最小变动价位	1 元/吨
涨跌停板幅度	与标的期货合约涨跌停板幅度相同
合约月份	最近两个连续月份合约, 其后月份在标的期货合约结算后持仓量达到一定数值之后的第二个交易日挂牌。具体数值交易所另行发布
交易时间	上午 9:00—11:30, 下午 13:30—15:00, 以及交易所规定的其他时间
最后交易日	标的期货合约交割月前第一月的倒数第五个交易日, 交易所可以根据国家法定节假日等调整最后交易日
到期日	同最后交易日
行权价格	行权价格覆盖标的期货合约上一交易日结算价上下浮动 1.5 倍当日涨跌停板幅度对应的价格范围。行权价格 $\leq 10\,000$ 元/吨, 行权价格间距为 100 元/吨; $10\,000$ 元/吨 $<$ 行权价格 $\leq 25\,000$ 元/吨, 行权价格间距为 200 元/吨; 行权价格 $> 25\,000$ 元/吨, 行权价格间距为 500 元/吨
行权方式	美式。买方可以在到期日前任一交易日的交易时间提交行权申请; 买方可以在到期日 15:30 之前提交行权申请、放弃申请
交易代码	看涨期权: ZN - 合约月份 - C - 行权价格 看跌期权: ZN - 合约月份 - P - 行权价格
上市交易所	上海期货交易所

续表

交易品种	黄金期货期权
合约标的物	黄金期货合约（1 000 克）
合约类型	看涨期权，看跌期权
交易单位	1 手黄金期货合约
报价单位	元（人民币）/克
最小变动价位	0.02 元/克
涨跌停板幅度	与黄金期货合约涨跌停板幅度相同
合约月份	最近两个连续月份合约，其后月份在标的期货合约结算后持仓量达到一定数值之后的第二个交易日挂牌。具体数值交易所另行发布
交易时间	上午 9:00—11:30，下午 13:30—15:00，以及交易所规定的其他时间
最后交易日	标的期货合约交割月前第一月的倒数第五个交易日，交易所可以根据国家法定节假日等调整最后交易日
到期日	同最后交易日
行权价格	行权价格覆盖黄金期货合约上一交易日结算价上下浮动 1.5 倍当日涨跌停板幅度对应的价格范围。行权价格 ≤ 200 元/克，行权价格间距为 2 元/克； 200 元/克 $<$ 行权价格 ≤ 400 元/克，行权价格间距为 4 元/克；行权价格 > 400 元/克，行权价格间距为 8 元/克
行权方式	美式。买方可以在到期日前任一交易日的交易时间提交行权申请；买方可以在到期日 15:30 之前提出行权申请、放弃申请
交易代码	看涨期权：AU - 合约月份 - C - 行权价格 看跌期权：AU - 合约月份 - P - 行权价格
上市交易所	上海期货交易所
交易品种	白银期货期权
合约标的物	白银期货合约（15 千克）
合约类型	看涨期权，看跌期权
交易单位	1 手白银期货合约
报价单位	元（人民币）/千克
最小变动价位	0.5 元/千克
涨跌停板幅度	与标的期货合约涨跌停板幅度相同
合约月份	最近两个连续月份合约，其后月份在标的期货合约结算后持仓量达到一定数值之后的第二个交易日挂牌，具体数值交易所另行发布
交易时间	上午 9:00—11:30，下午 13:30—15:00，以及交易所规定的其他时间
最后交易日	标的期货合约交割月前第一月的倒数第五个交易日，交易所可以根据国家法定节假日等调整最后交易日
到期日	同最后交易日
行权价格	行权价格覆盖标的期货合约上一交易日结算价上下浮动 1.5 倍当日涨跌停板幅度对应的价格范围。行权价格 $\leq 2\,500$ 元/千克，行权价格间距为 20 元/千克； $2\,500$ 元/千克 $<$ 行权价格 $\leq 5\,000$ 元/千克，行权价格间距为 50 元/千克；行权价格 $> 5\,000$ 元/千克，行权价格间距为 100 元/千克
行权方式	美式。买方可在到期日前任一交易日的交易时间提交行权申请；买方可在到期日 15:30 之前提交行权申请、放弃申请
交易代码	看涨期权：AG - 合约月份 - C - 行权价格 看跌期权：AG - 合约月份 - P - 行权价格
上市交易所	上海期货交易所



续表

交易品种	螺纹钢期货期权
合约标的物	螺纹钢期货合约（10吨）
合约类型	看涨期权，看跌期权
交易单位	1手螺纹钢期货合约
报价单位	元（人民币）/吨
最小变动价位	0.5元/吨
涨跌停板幅度	与标的期货合约涨跌停板幅度相同
合约月份	最近两个连续月份合约，其后月份在标的期货合约结算后持仓量达到一定数值之后的第二个交易日挂牌，具体数值交易所另行发布
交易时间	上午9:00—11:30，下午13:30—15:00，以及交易所规定的其他时间
最后交易日	标的期货合约交割月前第一月的倒数第五个交易日，交易所可以根据国家法定节假日等调整最后交易日
到期日	同最后交易日
行权价格	行权价格覆盖标的期货合约上一交易日结算价上下浮动1.5倍当日涨跌停板幅度对应的价格范围。行权价格 ≤ 2500 元/吨，行权价格间距为20元/吨； 2500 元/吨 $<$ 行权价格 ≤ 5000 元/吨，行权价格间距为50元/吨；行权价格 > 5000 元/吨，行权价格间距为100元/吨
行权方式	美式。买方可以在到期日前任一交易日的交易时间提交行权申请；买方可以在到期日15:30之前提交行权申请、放弃申请
交易代码	看涨期权：RB-合约月份-C-行权价格 看跌期权：RB-合约月份-P-行权价格
上市交易所	上海期货交易所
交易品种	天然橡胶期货期权
合约标的物	天然橡胶期货合约（10吨）
合约类型	看涨期权，看跌期权
交易单位	1手天然橡胶期货合约
报价单位	元（人民币）/吨
最小变动价位	1元/吨
涨跌停板幅度	与天然橡胶期货合约涨跌停板幅度相同
合约月份	最近两个连续月份合约，其后月份在标的期货合约结算后持仓量达到一定数值之后的第二个交易日挂牌。具体数值交易所另行发布
交易时间	上午9:00—11:30，下午13:30—15:00，以及交易所规定的其他时间
最后交易日	标的期货合约交割月前一个月的倒数第五个交易日，交易所可以根据国家法定节假日等调整最后交易日
到期日	同最后交易日
行权价格	行权价格覆盖天然橡胶期货合约上一交易日结算价上下浮动1.5倍当日涨跌停板幅度对应的价格范围。行权价格 ≤ 10000 元/吨，行权价格间距为100元/吨； 10000 元/吨 $<$ 行权价格 ≤ 25000 元/吨，行权价格间距为250元/吨；行权价格 > 25000 元/吨，行权价格间距为500元/吨
行权方式	美式。买方可在到期日前任一交易日的交易时间提交行权申请；买方可在到期日15:30之前提交行权申请、放弃申请
交易代码	看涨期权：RU-合约月份-C-行权价格 看跌期权：RU-合约月份-P-行权价格
上市交易所	上海期货交易所

续表

交易品种	原油期货期权
合约标的物	原油期货合约 (1 000 桶)
合约类型	看涨期权, 看跌期权
交易单位	1 手原油期货合约
报价单位	元 (人民币) / 桶
最小变动价位	0.05 元/桶
涨跌停板幅度	与标的期货合约涨跌停板幅度相同
合约月份	最近两个连续月份合约, 其后月份在标的期货合约结算后持仓量达到一定数值之后的第二个交易日挂盘, 具体数值上海国际能源交易中心另行发布
交易时间	上午 9: 00—11: 30, 下午 13: 30—15: 00, 以及上海国际能源交易中心规定的其他时间
最后交易日	标的期货合约交割月前第一月的倒数第 13 个交易日, 上海国际能源交易中心可以根据国家法定节假日等调整最后交易日
到期日	同最后交易日
行权价格	行权价格覆盖标的期货合约上一交易日结算价上下浮动 1.5 倍当日涨跌停板幅度对应的价格范围。行权价格 ≤ 250 元/桶, 行权价格间距为 2 元/桶; 250 元/桶 $<$ 行权价格 ≤ 500 元/桶, 行权价格间距为 5 元/桶; 行权价格 > 500 元/桶, 行权价格间距为 10 元/桶
行权方式	美式。买方可在到期日前任一交易日的交易时间提交行权申请; 买方可在到期日 15: 30 之前提交行权申请、放弃申请
交易代码	看涨期权: SC - 合约月份 - C - 行权价格 看跌期权: SC - 合约月份 - P - 行权价格
上市机构	上海国际能源交易中心 (合约月份小于 SR2401 对应的期权合约适用此版本)
交易品种	白糖期权
合约标的物	白糖期货合约
合约类型	看涨期权、看跌期权
交易单位	1 手 (10 吨) 白糖期货合约
报价单位	元 (人民币) / 吨
最小变动价位	0.5 元/吨
涨跌停板幅度	与白糖期货合约涨跌停板幅度相同
合约月份	标的期货合约中的连续两个近月, 其后月份在标的期货合约结算后持仓量达到 5 000 手 (单边) 之后的第二个交易日挂牌
交易时间	每周一至周五上午 9: 00—11: 30, 下午 13: 30 - 15: 00, 以及交易所规定的其他交易时间
最后交易日	标的期货合约交割月份前一个月的第 3 个交易日, 以及交易所规定的其他日期
到期日	同最后交易日
行权价格	以白糖期货前一交易日结算价为基准, 按行权价格间距挂出 5 个实值期权、1 个平值期权和 5 个虚值期权。行权价格 $\leq 3\ 000$ 元/吨, 行权价格间距为 50 元/吨; $3\ 000$ 元/吨 $<$ 行权价格 $\leq 10\ 000$ 元/吨, 行权价格间距为 100 元/吨; 行权价格 $> 10\ 000$ 元/吨, 行权价格间距为 200 元/吨
行权方式	美式。买方可在到期日前任一交易日的交易时间提交行权申请; 买方可在到期日 15: 30 之前提交行权申请、放弃申请
交易代码	看涨期权: SR—合约月份—C—行权价格 看跌期权: SR—合约月份—P—行权价格
上市交易所	郑州商品交易所 (合约月份大于等于 SR2401 对应的期权合约适用此版本)



续表

交易品种	白糖期权
合约标的物	白糖期货合约
合约类型	看涨期权、看跌期权
交易单位	1手（10吨）白糖期货合约
报价单位	元（人民币）/吨
最小变动价位	0.5元/吨
涨跌停板幅度	与白糖期货合约涨跌停板幅度相同
合约月份	标的期货合约中的连续两个近月，其后月份在标的期货合约结算后持仓量达到5000手（单边）之后的第二个交易日挂牌
交易时间	每周一至周五上午9:00—11:30，下午13:30—15:00，以及交易所规定的其他交易时间
最后交易日	标的期货合约交割月份前一个月第15个日历日之前（含该日）的倒数第3个交易日，以及交易所规定的其他日期
到期日	同最后交易日
行权价格	行权价格覆盖标的期货合约上一交易日结算价上下浮动1.5倍当日涨跌停板幅度对应的价格范围。行权价格 ≤ 3000 元/吨，行权价格间距为50元/吨； 3000 元/吨 $<$ 行权价格 ≤ 10000 元/吨，行权价格间距为100元/吨；行权价格 > 10000 元/吨，行权价格间距为200元/吨
行权方式	美式。买方可在到期日前任一交易日的交易时间提交行权申请；买方可在到期日15:30之前提交行权申请、放弃申请
交易代码	看涨期权：SR—合约月份—C—行权价格 看跌期权：SR—合约月份—P—行权价格
上市交易所	郑州商品交易所 （合约月份小于TA2401对应的期权合约适用此版本）
交易品种	PTA期权
合约标的物	精对苯二甲酸（PTA）期货合约
合约类型	看涨期权、看跌期权
交易单位	1手PTA期货合约
报价单位	元（人民币）/吨
最小变动价位	0.5元/吨
涨跌停板幅度	与PTA期货合约涨跌停板幅度相同
合约月份	标的期货合约中的连续两个近月，其后月份在标的期货合约结算后持仓量达到10000手（单边）之后的第二个交易日挂牌
交易时间	每周一至周五上午9:00—11:30，下午13:30—15:00，以及交易所规定的其他交易时间
最后交易日	标的期货合约交割月份前一个月的第3个交易日，以及交易所规定的其他日期
到期日	同最后交易日
行权价格	以PTA期货前一交易日结算价为基准，按行权价格间距挂出6个实值期权、1个平值期权和6个虚值期权。行权价格 ≤ 5000 元/吨，行权价格间距为50元/吨； 5000 元/吨 $<$ 行权价格 ≤ 10000 元/吨，行权价格间距为100元/吨；行权价格 > 10000 元/吨，行权价格间距为200元/吨
行权方式	美式。买方可在到期日前任一交易日的交易时间提交行权申请；买方可在到期日15:30之前提交行权申请、放弃申请
交易代码	看涨期权：TA—合约月份—C—行权价格 看跌期权：TA—合约月份—P—行权价格
上市交易所	郑州商品交易所 （合约月份大于等于TA2401对应的期权合约适用此版本）

续表

交易品种	PTA 期权
合约标的物	精对苯二甲酸 (PTA) 期货合约
合约类型	看涨期权、看跌期权
交易单位	1 手 PTA 期货合约
报价单位	元 (人民币) / 吨
最小变动价位	0.5 元/吨
涨跌停板幅度	与 PTA 期货合约涨跌停板幅度相同
合约月份	标的期货合约中的连续两个近月, 其后月份在标的期货合约结算后持仓量达到 10 000 手 (单边) 之后的第二个交易日挂牌
交易时间	每周一至周五上午 9: 00—11: 30, 下午 13: 30—15: 00, 以及交易所规定的其他交易时间
最后交易日	标的期货合约交割月份前一个月第 15 个日历日之前 (含该日) 的倒数第 3 个交易日, 以及交易所规定的其他日期
到期日	同最后交易日
行权价格	行权价格覆盖标的期货合约上一交易日结算价上下浮动 1.5 倍当日涨跌停板幅度对应的价格范围。行权价格 $\leq 5\,000$ 元/吨, 行权价格间距为 50 元/吨; $5\,000$ 元/吨 $<$ 行权价格 $\leq 10\,000$ 元/吨, 行权价格间距为 100 元/吨; 行权价格 $> 10\,000$ 元/吨, 行权价格间距为 200 元/吨
行权方式	美式。买方可在到期日前任一交易日的交易时间提交行权申请; 买方可在到期日 15: 30 之前提交行权申请、放弃申请
交易代码	看涨期权: TA - 合约月份 - C - 行权价格 看跌期权: TA - 合约月份 - P - 行权价格
上市交易所	郑州商品交易所 (合约月份小于 MA2401 对应的期权合约适用此版本)
交易品种	甲醇期权
合约标的物	甲醇期货合约
合约类型	看涨期权、看跌期权
交易单位	1 手甲醇期货合约
报价单位	元 (人民币) / 吨
最小变动价位	0.5 元/吨
涨跌停板幅度	与甲醇期货合约涨跌停板幅度相同
合约月份	标的期货合约中的连续两个近月, 其后月份在标的期货合约结算后持仓量达到 10 000 手 (单边) 之后的第二个交易日挂牌
交易时间	每周一至周五上午 9: 00—11: 30, 下午 13: 30—15: 00, 以及交易所规定的其他交易时间
最后交易日	标的期货合约交割月份前一个月的第 3 个交易日, 以及交易所规定的其他日期
到期日	同最后交易日
行权价格	以甲醇期货前一交易日结算价为基准, 按行权价格间距挂出 6 个实值期权、1 个平值期权和 6 个虚值期权。行权价格 $\leq 2\,500$ 元/吨, 行权价格间距为 25 元/吨; $2\,500$ 元/吨 $<$ 行权价格 $\leq 5\,000$ 元/吨, 行权价格间距为 50 元/吨; 行权价格 $> 5\,000$ 元/吨, 行权价格间距为 100 元/吨
行权方式	美式。买方可在到期日前任一交易日的交易时间提交行权申请; 买方可在到期日 15: 30 之前提交行权申请、放弃申请
交易代码	看涨期权: MA - 合约月份 - C - 行权价格 看跌期权: MA - 合约月份 - P - 行权价格
上市交易所	郑州商品交易所 (合约月份大于等于 MA2401 对应的期权合约适用此版本)

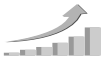


续表

交易品种	甲醇期权
合约标的物	甲醇期货合约
合约类型	看涨期权、看跌期权
交易单位	1手甲醇期货合约
报价单位	元（人民币）/吨
最小变动价位	0.5元/吨
涨跌停板幅度	与甲醇期货合约涨跌停板幅度相同
合约月份	标的期货合约中的连续两个近月，其后月份在标的期货合约结算后持仓量达到10 000手（单边）之后的第二个交易日挂牌
交易时间	每周一至周五上午9：00—11：30，下午13：30—15：00，以及交易所规定的其他交易时间
最后交易日	标的期货合约交割月份前一个月第15个日历日之前（含该日）的倒数第3个交易日，以及交易所规定的其他日期
到期日	同最后交易日
行权价格	行权价格覆盖标的期货合约上一交易日结算价上下浮动1.5倍当日涨跌停板幅度对应的价格范围。行权价格 $\leq 2\,500$ 元/吨，行权价格间距为25元/吨； $2\,500$ 元/吨 $<$ 行权价格 $\leq 5\,000$ 元/吨，行权价格间距为50元/吨；行权价格 $> 5\,000$ 元/吨，行权价格间距为100元/吨
行权方式	美式。买方可在到期日前任一交易日的交易时间提交行权申请；买方可在到期日15：30之前提交行权申请、放弃申请
交易代码	看涨期权：MA-合约月份-C-行权价格 看跌期权：MA-合约月份-P-行权价格
上市交易所	郑州商品交易所 (合约月份小于CF2401对应的期权合约适用此版本)
交易品种	棉花期权
合约标的物	棉花期货合约
合约类型	看涨期权、看跌期权
交易单位	1手棉花期货合约
报价单位	元（人民币）/吨
最小变动价位	1元/吨
涨跌停板幅度	与棉花期货合约涨跌停板幅度相同
合约月份	标的期货合约中的连续两个近月，其后月份在标的期货合约结算后持仓量达到5 000手（单边）之后的第二个交易日挂牌
交易时间	每周一至周五上午9：00—11：30，下午13：30—15：00，以及交易所规定的其他交易时间
最后交易日	标的期货合约交割月份前一个月的第3个交易日，以及交易所规定的其他日期
到期日	同最后交易日
行权价格	以棉花期货前一交易日结算价为基准，按行权价格间距挂出6个实值期权、1个平值期权和6个虚值期权。行权价格 $\leq 10\,000$ 元/吨，行权价格间距为100元/吨； $10\,000$ 元/吨 $<$ 行权价格 $\leq 20\,000$ 元/吨，行权价格间距为200元/吨；行权价格 $> 20\,000$ 元/吨，行权价格间距为400元/吨
行权方式	美式。买方可在到期日前任一交易日的交易时间提交行权申请；买方可在到期日15：30之前提交行权申请、放弃申请
交易代码	看涨期权：CF-合约月份-C-行权价格 看跌期权：CF-合约月份-P-行权价格
上市交易所	郑州商品交易所 (合约月份大于等于CF2401对应的期权合约适用此版本)

续表

交易品种	棉花期权
合约标的物	棉花期货合约
合约类型	看涨期权、看跌期权
交易单位	1手棉花期货合约
报价单位	元(人民币)/吨
最小变动价位	1元/吨
涨跌停板幅度	与棉花期货合约涨跌停板幅度相同
合约月份	标的期货合约中的连续两个近月,其后月份在标的期货合约结算后持仓量达到5000手(单边)之后的第二个交易日挂牌
交易时间	每周一至周五上午9:00—11:30,下午13:30—15:00,以及交易所规定的其他交易时间
最后交易日	标的期货合约交割月份前一个月第15个日历日之前(含该日)的倒数第3个交易日,以及交易所规定的其他日期
到期日	同最后交易日
行权价格	行权价格覆盖标的期货合约上一交易日结算价上下浮动1.5倍当日涨跌停板幅度对应的价格范围。行权价格 $\leq 10\,000$ 元/吨,行权价格间距为100元/吨;10000元/吨 $<$ 行权价格 $\leq 20\,000$ 元/吨,行权价格间距为200元/吨;行权价格 $> 20\,000$ 元/吨,行权价格间距为400元/吨
行权方式	美式。买方可在到期日前任一交易日的交易时间提交行权申请;买方可在到期日15:30之前提交行权申请、放弃申请
交易代码	看涨期权:CF-合约月份-C-行权价格 看跌期权:CF-合约月份-P-行权价格
上市交易所	郑州商品交易所 (合约月份小于RM2401对应的期权合约适用此版本)
交易品种	菜籽粕期权
合约标的物	菜籽粕期货合约
合约类型	看涨期权、看跌期权
交易单位	1手菜籽粕期货合约
报价单位	元(人民币)/吨
最小变动价位	0.5元/吨
涨跌停板幅度	与菜籽粕期货合约涨跌停板幅度相同
合约月份	标的期货合约中的连续两个近月,其后月份在标的期货合约结算后持仓量达到5000手(单边)之后的第二个交易日挂牌
交易时间	每周一至周五上午9:00—11:30,下午13:30—15:00,以及交易所规定的其他交易时间
最后交易日	标的期货合约交割月份前一个月的第3个交易日,以及交易所规定的其他日期
到期日	同最后交易日
行权价格	以菜籽粕期货前一交易日结算价为基准,按行权价格间距挂出6个实值期权、1个平值期权和6个虚值期权。行权价格 $\leq 2\,500$ 元/吨,行权价格间距为25元/吨;2500元/吨 $<$ 行权价格 $\leq 5\,000$ 元/吨,行权价格间距为50元/吨;行权价格 $> 5\,000$ 元/吨,行权价格间距为100元/吨
行权方式	美式。买方可在到期日前任一交易日的交易时间提交行权申请;买方可在到期日15:30之前提交行权申请、放弃申请
交易代码	看涨期权:RM-合约月份-C-行权价格 看跌期权:RM-合约月份-P-行权价格
上市交易所	郑州商品交易所 (合约月份大于等于RM2401对应的期权合约适用此版本)



续表

交易品种	菜籽粕期权
合约标的物	菜籽粕期货合约
合约类型	看涨期权、看跌期权
交易单位	1手菜籽粕期货合约
报价单位	元（人民币）/吨
最小变动价位	0.5元/吨
涨跌停板幅度	与菜籽粕期货合约涨跌停板幅度相同
合约月份	标的期货合约中的连续两个近月，其后月份在标的期货合约结算后持仓量达到5000手（单边）之后的第二个交易日挂牌
交易时间	每周一至周五上午9:00—11:30，下午13:30—15:00，以及交易所规定的其他交易时间
最后交易日	标的期货合约交割月份前一个月第15个日历日之前（含该日）的倒数第3个交易日，以及交易所规定的其他日期
到期日	同最后交易日
行权价格	行权价格覆盖标的期货合约上一交易日结算价上下浮动1.5倍当日涨跌停板幅度对应的价格范围。行权价格 ≤ 2500 元/吨，行权价格间距为25元/吨； 2500 元/吨 $<$ 行权价格 ≤ 5000 元/吨，行权价格间距为50元/吨；行权价格 > 5000 元/吨，行权价格间距为100元/吨
行权方式	美式。买方可在到期日前任一交易日的交易时间提交行权申请；买方可在到期日15:30之前提交行权申请、放弃申请
交易代码	看涨期权：RM-合约月份-C-行权价格 看跌期权：RM-合约月份-P-行权价格
上市交易所	郑州商品交易所 (合约月份小于ZC2401对应的期权合约适用此版本)
交易品种	动力煤期权
合约标的物	动力煤期货合约
合约类型	看涨期权、看跌期权
交易单位	1手动力煤期货合约
报价单位	元（人民币）/吨
最小变动价位	0.1元/吨
涨跌停板幅度	与动力煤期货合约涨跌停板幅度相同
合约月份	标的期货合约中的连续两个近月，其后月份在标的期货合约结算后持仓量达到10000手（单边）之后的第二个交易日挂牌
交易时间	每周一至周五上午9:00—11:30，下午13:30—15:00，以及交易所规定的其他交易时间
最后交易日	标的期货合约交割月份前一个月的第3个交易日，以及交易所规定的其他日期
到期日	同最后交易日
行权价格	以动力煤期货前一交易日结算价为基准，按行权价格间距挂出6个实值期权、1个平值期权和6个虚值期权。行权价格 ≤ 500 元/吨，行权价格间距为5元/吨；行权价格 > 500 元/吨，行权价格间距为10元/吨
行权方式	美式。买方可在到期日前任一交易日的交易时间提交行权申请；买方可在到期日15:30之前提交行权申请、放弃申请
交易代码	看涨期权：ZC-合约月份-C-行权价格 看跌期权：ZC-合约月份-P-行权价格
上市交易所	郑州商品交易所 (合约月份大于等于ZC2401对应的期权合约适用此版本)

续表

交易品种	动力煤期权
合约标的物	动力煤期货合约
合约类型	看涨期权、看跌期权
交易单位	1 手动力煤期货合约
报价单位	元（人民币）/吨
最小变动价位	0.1 元/吨
涨跌停板幅度	与动力煤期货合约涨跌停板幅度相同
合约月份	标的期货合约中的连续两个近月，其后月份在标的期货合约结算后持仓量达到 10 000 手（单边）之后的第二个交易日挂牌
交易时间	每周一至周五上午 9:00—11:30，下午 13:30—15:00，以及交易所规定的其他交易时间
最后交易日	标的期货合约交割月份前一个月第 15 个日历日之前（含该日）的倒数第 3 个交易日，以及交易所规定的其他日期
到期日	同最后交易日
行权价格	行权价格覆盖标的期货合约上一交易日结算价上下浮动 1.5 倍当日涨跌停板幅度对应的价格范围。行权价格 ≤ 500 元/吨，行权价格间距为 5 元/吨；行权价格 > 500 元/吨，行权价格间距为 10 元/吨
行权方式	美式。买方可在到期日前任一交易日的交易时间提交行权申请；买方可在到期日 15:30 之前提交行权申请、放弃申请
交易代码	看涨期权：ZC - 合约月份 - C - 行权价格 看跌期权：ZC - 合约月份 - P - 行权价格
上市交易所	郑州商品交易所 (合约月份小于 OI2401 对应的期权合约适用此版本)
交易品种	菜籽油期权
合约标的物	菜籽油期货合约
合约类型	看涨期权、看跌期权
交易单位	1 手菜籽油期货合约
报价单位	元（人民币）/吨
最小变动价位	0.5 元/吨
涨跌停板幅度	与菜籽油期货合约涨跌停板幅度相同
合约月份	标的期货合约中的连续两个近月，其后月份在标的期货合约结算后持仓量达到 5 000 手（单边）之后的第二个交易日挂牌
交易时间	每周一至周五上午 9:00—11:30，下午 13:30—15:00，以及交易所规定的其他交易时间
最后交易日	标的期货合约交割月份前一个月的第 3 个交易日，以及交易所规定的其他日期
到期日	同最后交易日
行权价格	以菜籽油期货前一交易日结算价为基准，按行权价格间距挂出 9 个实值期权、1 个平值期权和 9 个虚值期权。行权价格 ≤ 5 000 元/吨，行权价格间距为 50 元/吨；5 000 元/吨 < 行权价格 ≤ 10 000 元/吨，行权价格间距为 100 元/吨；行权价格 > 10 000 元/吨，行权价格间距为 200 元/吨
行权方式	美式。买方可在到期日前任一交易日的交易时间提交行权申请；买方可在到期日 15:30 之前提交行权申请、放弃申请
交易代码	看涨期权：OI - 合约月份 - C - 行权价格 看跌期权：OI - 合约月份 - P - 行权价格
上市交易所	郑州商品交易所 (合约月份大于等于 OI2401 对应的期权合约适用此版本)



续表

交易品种	菜籽油期权
合约标的物	菜籽油期货合约
合约类型	看涨期权、看跌期权
交易单位	1手菜籽油期货合约
报价单位	元（人民币）/吨
最小变动价位	0.5元/吨
涨跌停板幅度	与菜籽油期货合约涨跌停板幅度相同
合约月份	标的期货合约中的连续两个近月，其后月份在标的期货合约结算后持仓量达到5000手（单边）之后的第二个交易日挂牌
交易时间	每周一至周五上午9:00—11:30，下午13:30—15:00，以及交易所规定的其他交易时间
最后交易日	标的期货合约交割月份前一个月第15个日历日之前（含该日）的倒数第3个交易日，以及交易所规定的其他日期
到期日	同最后交易日
行权价格	行权价格覆盖标的期货合约上一交易日结算价上下浮动1.5倍当日涨跌停板幅度对应的价格范围。行权价格 ≤ 5000 元/吨，行权价格间距为50元/吨； 5000 元/吨 $<$ 行权价格 ≤ 10000 元/吨，行权价格间距为100元/吨；行权价格 > 10000 元/吨，行权价格间距为200元/吨
行权方式	美式。买方可在到期日前任一交易日的交易时间提交行权申请；买方可在到期日15:30之前提交行权申请、放弃申请
交易代码	看涨期权：OI-合约月份-C-行权价格 看跌期权：OI-合约月份-P-行权价格
上市交易所	郑州商品交易所 (合约月份小于PK2401对应的期权合约适用此版本)
交易品种	花生期权
合约标的物	花生期货合约
合约类型	看涨期权、看跌期权
交易单位	1手花生期货合约
报价单位	元（人民币）/吨
最小变动价位	0.5元/吨
涨跌停板幅度	与花生期货合约涨跌停板幅度相同
合约月份	标的期货合约中的连续两个近月，其后月份在标的期货合约结算后持仓量达到5000手（单边）之后的第二个交易日挂牌
交易时间	每周一至周五上午9:00—11:30、下午13:30—15:00，以及交易所规定的其他交易时间
最后交易日	标的期货合约交割月份前一个月的第3个交易日，以及交易所规定的其他日期
到期日	同最后交易日
行权价格	以花生期货前一交易日结算价为基准，按行权价格间距挂出9个实值期权、1个平值期权和9个虚值期权。行权价格 ≤ 5000 元/吨，行权价格间距为50元/吨； 5000 元/吨 $<$ 行权价格 ≤ 10000 元/吨，行权价格间距为100元/吨；行权价格 > 10000 元/吨，行权价格间距为200元/吨
行权方式	美式。买方可在到期日前任一交易日的交易时间提交行权申请；买方可在到期日15:30之前提交行权申请、放弃申请
交易代码	看涨期权：PK-合约月份-C-行权价格 看跌期权：PK-合约月份-P-行权价格
上市交易所	郑州商品交易所 (合约月份大于等于PK2401对应的期权合约适用此版本)

续表

交易品种	花生期权
合约标的物	花生期货合约
合约类型	看涨期权、看跌期权
交易单位	1 手花生期货合约
报价单位	元（人民币）/吨
最小变动价位	0.5 元/吨
涨跌停板幅度	与花生期货合约涨跌停板幅度相同
合约月份	标的期货合约中的连续两个近月，其后月份在标的期货合约结算后持仓量达到 5 000 手（单边）之后的第二个交易日挂牌
交易时间	每周一至周五上午 9：00—11：30，下午 13：30—15：00，以及交易所规定的其他交易时间
最后交易日	标的期货合约交割月份前一个月第 15 个日历日之前（含该日）的倒数第 3 个交易日，以及交易所规定的其他日期
到期日	同最后交易日
行权价格	行权价格覆盖标的期货合约上一交易日结算价上下浮动 1.5 倍当日涨跌停板幅度对应的价格范围。行权价格 $\leq 5\,000$ 元/吨，行权价格间距为 50 元/吨； $5\,000$ 元/吨 $<$ 行权价格 $\leq 10\,000$ 元/吨，行权价格间距为 100 元/吨；行权价格 $> 10\,000$ 元/吨，行权价格间距为 200 元/吨
行权方式	美式。买方可在到期日前任一交易日的交易时间提交行权申请；买方可在到期日 15：30 之前提交行权申请、放弃申请
交易代码	看涨期权：PK - 合约月份 - C - 行权价格 看跌期权：PK - 合约月份 - P - 行权价格
上市交易所	郑州商品交易所
交易品种	豆粕期权
合约标的物	豆粕期货合约
合约类型	看涨期权、看跌期权
交易单位	1 手（10 吨）豆粕期货合约
报价单位	元（人民币）/吨
最小变动价位	0.5 元/吨
涨跌停板幅度	与豆粕期货合约涨跌停板幅度相同
合约月份	1 月、3 月、5 月、7 月、8 月、9 月、11 月、12 月
交易时间	每周一至周五上午 9：00—11：30，下午 13：30—15：00，以及交易所规定的其他时间
最后交易日	标的期货合约交割月份前一个月的第 5 个交易日
到期日	同最后交易日
行权价格	行权价格范围覆盖豆粕期货合约上一交易日结算价上下浮动 1.5 倍当日涨跌停板幅度对应的价格范围。行权价格 $\leq 2\,000$ 元/吨，行权价格间距为 25 元/吨； $2\,000$ 元/吨 $<$ 行权价格 $\leq 5\,000$ 元/吨，行权价格间距为 50 元/吨；行权价格 $> 5\,000$ 元/吨，行权价格间距为 100 元/吨
行权方式	美式。买方可以在到期日之前任一交易日的交易时间，以及到期日 15：30 之前提出行权申请
交易代码	看涨期权：M - 合约月份 - C - 行权价格 看跌期权：M - 合约月份 - P - 行权价格
上市交易所	大连商品交易所



续表

交易品种	玉米期权
合约标的物	玉米期货合约
合约类型	看涨期权、看跌期权
交易单位	1手（10吨）玉米期货合约
报价单位	元（人民币）/吨
最小变动价位	0.5元/吨
涨跌停板幅度	与玉米期货合约涨跌停板幅度相同
合约月份	1月、3月、5月、7月、9月、11月
交易时间	每周一至周五上午9:00—11:30, 下午13:30—15:00, 以及交易所规定的其他时间
最后交易日	标的期货合约交割月份前一个月的第5个交易日
到期日	同最后交易日
行权价格	行权价格范围覆盖玉米期货合约上一交易日结算价上下浮动1.5倍当日涨跌停板幅度对应的价格范围。行权价格 ≤ 1000 元/吨, 行权价格间距为10元/吨; 1000 元/吨 $<$ 行权价格 ≤ 3000 元/吨, 行权价格间距为20元/吨; 行权价格 > 3000 元/吨, 行权价格间距为40元/吨
行权方式	美式。买方可以在到期日之前任一交易日的交易时间, 以及到期日15:30之前提出行权申请
交易代码	看涨期权: C-合约月份-C-行权价格 看跌期权: C-合约月份-P-行权价格
上市交易所	大连商品交易所
交易品种	棕榈油期权
合约标的物	棕榈油期货合约
合约类型	看涨期权、看跌期权
交易单位	1手（10吨）棕榈油期货合约
报价单位	元（人民币）/吨
最小变动价位	0.5元/吨
涨跌停板幅度	与棕榈油期货合约涨跌停板幅度相同
合约月份	1—12月
交易时间	每周一至周五上午9:00—11:30, 下午13:30—15:00, 以及交易所规定的其他时间
最后交易日	标的期货合约交割月份前一个月的第5个交易日
到期日	同最后交易日
行权价格	行权价格覆盖棕榈油期货合约上一交易日结算价上下浮动1.5倍当日涨跌停板幅度对应的价格范围。行权价格 ≤ 5000 元/吨, 行权价格间距为50元/吨; 5000 元/吨 $<$ 行权价格 ≤ 10000 元/吨, 行权价格间距为100元/吨; 行权价格 > 10000 元/吨, 行权价格间距为200元/吨
行权方式	美式。买方可以在到期日之前任一交易日的交易时间, 以及到期日15:30之前提出行权申请
交易代码	看涨期权: P-合约月份-C-行权价格 看跌期权: P-合约月份-P-行权价格
上市交易所	大连商品交易所

续表

交易品种	线型低密度聚乙烯期权
合约标的物	线型低密度聚乙烯期货合约
合约类型	看涨期权、看跌期权
交易单位	1手(5吨)线型低密度聚乙烯期货合约
报价单位	元(人民币)/吨
最小变动价位	0.5元/吨
涨跌停板幅度	与线型低密度聚乙烯期货合约涨跌停板幅度相同
合约月份	1—12月
交易时间	每周一至周五上午9:00—11:30, 下午13:30—15:00, 以及交易所规定的其他时间
最后交易日	标的期货合约交割月份前一个月的第5个交易日
到期日	同最后交易日
行权价格	行权价格覆盖线型低密度聚乙烯期货合约上一交易日结算价上下浮动1.5倍当日涨跌停板幅度对应的价格范围。行权价格 ≤ 5000 元/吨, 行权价格间距为50元/吨; 5000 元/吨 $<$ 行权价格 ≤ 10000 元/吨, 行权价格间距为100元/吨; 行权价格 > 10000 元/吨, 行权价格间距为200元/吨
行权方式	美式。买方可以在到期日之前任一交易日的交易时间, 以及到期日15:30之前提出行权申请
交易代码	看涨期权: L-合约月份-C-行权价格 看跌期权: L-合约月份-P-行权价格
上市交易所	大连商品交易所
交易品种	聚丙烯期权
合约标的物	聚丙烯期货合约
合约类型	看涨期权、看跌期权
交易单位	1手(5吨)聚丙烯期货合约
报价单位	元(人民币)/吨
最小变动价位	0.5元/吨
涨跌停板幅度	与聚丙烯期货合约涨跌停板幅度相同
合约月份	1—12月
交易时间	每周一至周五上午9:00—11:30, 下午13:30—15:00, 以及交易所规定的其他时间
最后交易日	标的期货合约交割月份前一个月的第5个交易日
到期日	同最后交易日
行权价格	行权价格覆盖聚丙烯期货合约上一交易日结算价上下浮动1.5倍当日涨跌停板幅度对应的价格范围。行权价格 ≤ 5000 元/吨, 行权价格间距为50元/吨; 5000 元/吨 $<$ 行权价格 ≤ 10000 元/吨, 行权价格间距为100元/吨; 行权价格 > 10000 元/吨, 行权价格间距为200元/吨
行权方式	美式。买方可以在到期日之前任一交易日的交易时间, 以及到期日15:30之前提出行权申请
交易代码	看涨期权: PP-合约月份-C-行权价格 看跌期权: PP-合约月份-P-行权价格
上市交易所	大连商品交易所

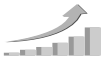


续表

交易品种	聚氯乙烯期权
合约标的物	聚氯乙烯期货合约
合约类型	看涨期权、看跌期权
交易单位	1手（5吨）聚氯乙烯期货合约
报价单位	元（人民币）/吨
最小变动价位	0.5元/吨
涨跌停板幅度	与聚氯乙烯期货合约涨跌停板幅度相同
合约月份	1—12月
交易时间	每周一至周五上午9:00—11:30, 下午13:30—15:00, 以及交易所规定的其他时间
最后交易日	标的期货合约交割月份前一个月的第5个交易日
到期日	同最后交易日
行权价格	行权价格覆盖聚氯乙烯期货合约上一交易日结算价上下浮动1.5倍当日涨跌停板幅度对应的价格范围。行权价格 ≤ 5000 元/吨, 行权价格间距为50元/吨; 5000 元/吨 $<$ 行权价格 ≤ 10000 元/吨, 行权价格间距为100元/吨; 行权价格 > 10000 元/吨, 行权价格间距为200元/吨
行权方式	美式。买方可以在到期日之前任一交易日的交易时间, 以及到期日15:30之前提出行权申请
交易代码	看涨期权: V-合约月份-C-行权价格 看跌期权: V-合约月份-P-行权价格
上市交易所	大连商品交易所
交易品种	铁矿石期权
合约标的物	铁矿石期货合约
合约类型	看涨期权、看跌期权
交易单位	1手（100吨）铁矿石期货合约
报价单位	元（人民币）/吨
最小变动价位	0.1元/吨
涨跌停板幅度	与铁矿石期货合约涨跌停板幅度相同
合约月份	1—12月
交易时间	每周一至周五上午9:00—11:30, 下午13:30—15:00, 以及交易所规定的其他时间
最后交易日	标的期货合约交割月份前一个月的第5个交易日
到期日	同最后交易日
行权价格	行权价格覆盖铁矿石期货合约上一交易日结算价上下浮动1.5倍当日涨跌停板幅度对应的价格范围。行权价格 ≤ 300 元/吨, 行权价格间距为5元/吨; 300 元/吨 $<$ 行权价格 ≤ 1000 元/吨, 行权价格间距为10元/吨; 行权价格 > 1000 元/吨, 行权价格间距为20元/吨
行权方式	美式。买方可以在到期日之前任一交易日的交易时间, 以及到期日15:30之前提出行权申请
交易代码	看涨期权: I-合约月份-C-行权价格 看跌期权: I-合约月份-P-行权价格
上市交易所	大连商品交易所

续表

交易品种	液化石油气期权
合约标的物	液化石油气期货合约
合约类型	看涨期权、看跌期权
交易单位	1手(20吨)液化石油气期货合约
报价单位	元(人民币)/吨
最小变动价位	0.2元/吨
涨跌停板幅度	与液化石油气期货合约涨跌停板幅度相同
合约月份	1—12月
交易时间	每周一至周五上午9:00—11:30,下午13:30—15:00,以及交易所规定的其他时间
最后交易日	标的期货合约交割月份前一个月的第5个交易日
到期日	同最后交易日
行权价格	行权价格覆盖液化石油气期货合约上一交易日结算价上下浮动1.5倍当日涨跌停板幅度对应的价格范围。行权价格 \leq 2000元/吨,行权价格间距为25元/吨;2000元/吨 $<$ 行权价格 \leq 6000元/吨,行权价格间距为50元/吨;行权价格 $>$ 6000元/吨,行权价格间距为100元/吨
行权方式	美式。买方可以在到期日之前任一交易日的交易时间,以及到期日15:30之前提出行权申请
交易代码	看涨期权:PG-合约月份-C-行权价格 看跌期权:PG-合约月份-P-行权价格
上市交易所	大连商品交易所
交易品种	黄大豆1号期权
合约标的物	黄大豆1号期货合约
合约类型	看涨期权、看跌期权
交易单位	1手(10吨)黄大豆1号期货合约
报价单位	元(人民币)/吨
最小变动价位	0.5元/吨
涨跌停板幅度	与黄大豆1号期货合约涨跌停板幅度相同
合约月份	1月、3月、5月、7月、9月、11月
交易时间	每周一至周五上午9:00—11:30,下午13:30—15:00,以及交易所规定的其他时间
最后交易日	标的期货合约交割月份前一个月的第5个交易日
到期日	同最后交易日
行权价格	行权价格覆盖黄大豆1号期货合约上一交易日结算价上下浮动1.5倍当日涨跌停板幅度对应的价格范围。行权价格 \leq 2500元/吨,行权价格间距为25元/吨;2500元/吨 $<$ 行权价格 \leq 5000元/吨,行权价格间距为50元/吨;行权价格 $>$ 5000元/吨,行权价格间距为100元/吨
行权方式	美式。买方可以在到期日之前任一交易日的交易时间,以及到期日15:30之前提出行权申请
交易代码	看涨期权:A-合约月份-C-行权价格 看跌期权:A-合约月份-P-行权价格
上市交易所	大连商品交易所



续表

交易品种	黄大豆2号期权
合约标的物	黄大豆2号期货合约
合约类型	看涨期权、看跌期权
交易单位	1手（10吨）黄大豆2号期货合约
报价单位	元（人民币）/吨
最小变动价位	0.5元/吨
涨跌停板幅度	与黄大豆2号期货合约涨跌停板幅度相同
合约月份	1—12月
交易时间	每周一至周五上午9:00—11:30, 下午13:30—15:00, 以及交易所规定的其他时间
最后交易日	标的期货合约交割月份前一个月的第5个交易日
到期日	同最后交易日
行权价格	行权价格覆盖黄大豆2号期货合约上一交易日结算价上下浮动1.5倍当日涨跌停板幅度对应的价格范围。行权价格 \leq 2500元/吨, 行权价格间距为25元/吨; 2500元/吨 $<$ 行权价格 \leq 5000元/吨, 行权价格间距为50元/吨; 行权价格 $>$ 5000元/吨, 行权价格间距为100元/吨
行权方式	美式。买方可以在到期日之前任一交易日的交易时间, 以及到期日15:30之前提出行权申请
交易代码	看涨期权: B-合约月份-C-行权价格 看跌期权: B-合约月份-P-行权价格
上市交易所	大连商品交易所
交易品种	豆油期权
合约标的物	豆油期货合约
合约类型	看涨期权、看跌期权
交易单位	1手（10吨）豆油期货合约
报价单位	元（人民币）/吨
最小变动价位	0.5元/吨
涨跌停板幅度	与豆油期货合约涨跌停板幅度相同
合约月份	1月、3月、5月、7月、8月、9月、11月、12月
交易时间	每周一至周五上午9:00—11:30, 下午13:30—15:00, 以及交易所规定的其他时间
最后交易日	标的期货合约交割月份前一个月的第5个交易日
到期日	同最后交易日
行权价格	行权价格覆盖豆油期货合约上一交易日结算价上下浮动1.5倍当日涨跌停板幅度对应的价格范围。行权价格 \leq 5000元/吨, 行权价格间距为50元/吨; 5000元/吨 $<$ 行权价格 \leq 10000元/吨, 行权价格间距为100元/吨; 行权价格 $>$ 10000元/吨, 行权价格间距为200元/吨
行权方式	美式。买方可以在到期日之前任一交易日的交易时间, 以及到期日15:30之前提出行权申请
交易代码	看涨期权: Y-合约月份-C-行权价格 看跌期权: Y-合约月份-P-行权价格
上市交易所	大连商品交易所

续表

合约名称	沪深 300 股票指数期权合约
合约标的物	沪深 300 指数
合约乘数	每点人民币 100 元
合约类型	看涨期权、看跌期权
报价单位	指数点
最小变动价位	0.2 点
每日价格最大波动限制	上一交易日沪深 300 指数收盘价的 $\pm 10\%$
合约月份	当月、下 2 个月及随后 3 个季月
行权价格	行权价格覆盖沪深 300 指数上一交易日收盘价上下浮动 10% 对应的价格范围 对当月与下 2 个月合约：行权价格 ≤ 2500 点时，行权价格间距为 25 点； $2500 < \text{行权价格} \leq 5000$ 点时，行权价格间距为 50 点； $5000 < \text{行权价格} \leq 10000$ 点时，行权价格间距为 100 点；行权价格 > 10000 点时，行权价格间距为 200 点 对随后 3 个季月合约：行权价格 ≤ 2500 点时，行权价格间距为 50 点； $2500 < \text{行权价格} \leq 5000$ 点时，行权价格间距为 100 点； $5000 < \text{行权价格} \leq 10000$ 点时，行权价格间距为 200 点；行权价格 > 10000 点时，行权价格间距为 400 点
行权方式	欧式
交易时间	上午 9:30—11:30，下午 13:00—15:00
最后交易日	合约到期月份的第三个星期五，遇国家法定假日顺延
到期日	同最后交易日
交割方式	现金交割
交易代码	看涨期权：IO 合约月份 - C - 行权价格 看跌期权：IO 合约月份 - P - 行权价格
上市交易所	中国金融期货交易所
合约名称	中证 1000 股票指数期权合约
合约标的物	中证 1000 指数
合约乘数	每点人民币 100 元
合约类型	看涨期权、看跌期权
报价单位	指数点
最小变动价位	0.2 点
每日价格最大波动限制	上一交易日中证 1000 指数收盘价的 $\pm 10\%$
合约月份	当月、下 2 个月及随后 3 个季月
行权价格	行权价格覆盖中证 1000 指数上一交易日收盘价上下浮动 10% 对应的价格范围 对当月与下 2 个月合约：行权价格 ≤ 2500 点时，行权价格间距为 25 点； $2500 < \text{行权价格} \leq 5000$ 点时，行权价格间距为 50 点； $5000 < \text{行权价格} \leq 10000$ 点时，行权价格间距为 100 点；行权价格 > 10000 点时，行权价格间距为 200 点 对随后 3 个季月合约：行权价格 ≤ 2500 点时，行权价格间距为 50 点； $2500 < \text{行权价格} \leq 5000$ 点时，行权价格间距为 100 点； $5000 < \text{行权价格} \leq 10000$ 点时，行权价格间距为 200 点；行权价格 > 10000 点时，行权价格间距为 400 点



续表

合约名称	中证1000 股票指数期权合约
行权方式	欧式
交易时间	上午9:30—11:30, 下午13:00—15:00
最后交易日	合约到期月份的第三个星期五, 遇国家法定假日顺延
到期日	同最后交易日
交割方式	现金交割
交易代码	看涨期权: MO 合约月份 - C - 行权价格 看跌期权: MO 合约月份 - P - 行权价格
上市交易所	中国金融期货交易所
合约名称	上证50 股票指数期权合约
合约标的物	上证50 指数
合约乘数	每点人民币100元
合约类型	看涨期权、看跌期权
报价单位	指数点
最小变动价位	0.2点
每日价格最大波动限制	上一交易日上证50 指数收盘价的±10%
合约月份	当月、下2个月及随后3个季月
行权价格	行权价格覆盖上证50 指数上一交易日收盘价上下浮动10%对应的价格范围 对当月与下2个月合约: 行权价格≤2500点时, 行权价格间距为25点; 2500点<行权价格≤5000点时, 行权价格间距为50点; 5000点<行权价格≤10000点时, 行权价格间距为100点; 行权价格>10000点时, 行权价格间距为200点 对随后3个季月合约: 行权价格≤2500点时, 行权价格间距为50点; 2500点<行权价格≤5000点时, 行权价格间距为100点; 5000点<行权价格≤10000点时, 行权价格间距为200点; 行权价格>10000点时, 行权价格间距为400点
行权方式	欧式
交易时间	上午9:30—11:30, 下午13:00—15:00
最后交易日	合约到期月份的第三个星期五, 遇国家法定假日顺延
到期日	同最后交易日
交割方式	现金交割
交易代码	看涨期权: HO 合约月份 - C - 行权价格 看跌期权: HO 合约月份 - P - 行权价格
上市交易所	中国金融期货交易所

续表

交易品种	工业硅期权
合约标的物	工业硅期货合约
交易单位	1手(5吨)工业硅期货合约
合约类型	看涨期权、看跌期权
报价单位	元(人民币)/吨
最小变动价位	1元/吨
每日价格最大波动限制	与工业硅期货合约涨跌停板幅度相同
合约月份	1—12月
行权价格	行权价格覆盖工业硅期货合约上一交易日结算价上下浮动1.5倍当日涨跌停板幅度对应的价格范围。行权价格 $\leq 10\,000$ 元/吨,行权价格间距为100元/吨; 10 000元/吨 $<$ 行权价格 $\leq 30\,000$ 元/吨,行权价格间距为200元/吨;行权价格 $>$ 30 000元/吨,行权价格间距为400元/吨
行权方式	美式
交易时间	上午9:00—11:30,下午13:30—15:00
最后交易日	标的期货合约交割月份前1个月第5个交易日
到期日	同最后交易日
交易代码	看涨期权:SI—合约月份—C—行权价格 看跌期权:SI—合约月份—P—行权价格
上市交易所	广州期货交易所

附录 5-4 各期货品种交割仓库明细

2022 年各期货品种交割仓（厂）库明细

品种	交易所	交割仓库	库容	地址	电话
铜	上期所	南储仓储管理集团有限公司	2 万吨	广东省佛山市禅城区佛罗公路 166 号	18588033336
		上海国储天威仓储有限公司	12 万吨	上海市嘉定区黄渡工业园区星塔路 1289 号	15317578691
		上海国储天威仓储有限公司 (外高桥仓库)	2 万吨	上海市浦东新区外高桥保税区荷丹路 68 号	13918171231
		中储发展股份有限公司上海吴淞分公司	14.46 万吨	上海市宝山区宝杨路 2069 号/铁山路 495 号	13331955737
		中储发展股份有限公司无锡物流中心	2 万吨	江苏省无锡市城南路 32-1 号	0510-85361369
		上港物流金属仓储（上海）有限公司	21 万吨	上海市宝山区安达路 240 号	15821008607
		上海裕强供应链管理有限公司	1.5 万吨	上海市宝山区共和新路 3501 号	13671575566
		上海裕强供应链管理有限公司闵行仓库	6 万吨	上海市闵行区剑川路 2222 号	13917631328
		中储发展股份有限公司上海大场分公司	13.6 万吨	上海市宝山区南大路 257 号、310 号、137 号	13331955737
		上港物流金属仓储（上海）有限公司（苏州库）	15 万吨	江苏省苏州市高新区钢成路 8 号	15821008607
		上海洋山保税港区世天威物流有限公司	1 万吨	上海市浦东新区洋山保税港区海旺路 288 号	15821987825
		中储发展股份有限公司上海沪闵分公司	6 万吨	上海市闵行区剑川路 2280 号	64300825
		无锡市国联物流有限公司	2 万吨	江苏省无锡市钱皋路 168 号	13771149693
		国家粮食和物资储备局浙江局八三七处	1 万吨	浙江省宁波市镇海区大通路 331 号	13429322352
		宁波港九龙仓仓储有限公司	1 万吨	浙江省宁波市镇海区平海路 299 号	13757477277
浙江南湖国际物流有限公司	2 万吨	浙江省嘉兴市秀洲区怀安路 186 号	18966375995		

续表

品种	交易所	交割仓库	库容	地址	电话
铜	上期所	国家粮食和物资储备局广东局八三〇处（黄埔库）	3 万吨	广东省广州市萝岗区开发大道1330 号	13168881080
		国家粮食和物资储备局广东局八三〇处（增城库）	2 万吨	广东省广州市增城区永宁街创强路123 号	13168881080
		中国外运华东有限公司（张华浜仓库）	2 万吨	上海市宝山区逸仙路4088 号	13501724955
		江西国储物流有限公司	3 000 吨	江西省鹰潭市高新技术产业开发区金田路10 号仓库	15979190273
		上海添马行物流有限公司	2 万吨	江苏省无锡市宜兴经济技术开发区杏里路17 号	13901785660
		常州融达现代物流有限公司	2 万吨	江苏省常州市钟楼区新闻镇运河路298 号	18151721003
		中远海运物流有限公司（宝山库）	2 万吨	上海市宝山区宝杨路2249 号	18681352659
		广东炬申仓储有限公司	2 万吨	广东省佛山市南海区丹灶镇丹灶物流中心金泰路1 号	15015835397
		上海中储临港物流有限公司（洋山保税库）	3 万吨	上海市浦东新区洋山保税港区双惠路195	021 - 68280480 68280479
		世天威物流（上海外高桥保税物流园区）有限公司	1 万吨	上海市浦东新区外高桥保税物流园区申亚路89 号	13817283912
铝	上期所	国家粮食和物资储备局广东局八三〇处	1.8 万吨	广东省佛山市南海区盐步镇三眼桥货场西侧	13690748800
		广东中储晟世照邦物流有限公司	2 万吨	广东省佛山市南海区小塘西货场侧晟世物流小塘仓	18927759921
		南储仓储管理集团有限公司	3 万吨	广东省佛山市禅城区佛罗公路166 号	18588033336
		上海国储天威仓储有限公司	4 万吨	上海市嘉定区黄渡工业园区星塔路1289 号	15317578691
		上海国储天威仓储有限公司（外高桥仓库）	6 600 吨	上海市浦东新区外高桥保税区荷丹路68 号	13918171231
		中储发展股份有限公司上海吴淞分公司	4.82 万吨	上海市宝山区宝杨路2069 号/铁山路495 号	13331955737
		中储发展股份有限公司无锡物流中心	8 万吨	江苏省无锡市城南路32 - 1 号	0510 - 85361369
上港物流金属仓储（上海）有限公司	7 万吨	上海市宝山区安达路240 号	15821008607		



续表

品种	交易所	交割仓库	库容	地址	电话
铝	上期所	上海裕强供应链管理有限公司	5 000 吨	上海市宝山区共和新路 3501 号	13671575566
		上海裕强供应链管理有限公司闵行仓库	2 万吨	上海市闵行区剑川路 2222 号	13917631328
		中储发展股份有限公司上海大场分公司	4.53 万吨	上海市宝山区南大路 257 号、310 号、137 号	13331955737
		天津中储陆通物流有限公司	1.5 万吨	天津市北辰区陆路港物流装备产业园陆港四经支路 1 号	18920287007
		天津全程物流配送有限公司	1.5 万吨	天津市东丽区天津市东丽区华粮道 2298 号	13752257108
		上港物流金属仓储(上海)有限公司(苏州库)	5 万吨	江苏省苏州市高新区钢成路 8 号	15821008607
		山东高通物流有限公司(泰安仓库)	1 万吨	山东省泰安市高新区长城路 699 号	18560169066
		甘肃国通大宗商品供应链管理股份有限公司	1 万吨	甘肃省兰州市兰州新区山丹河街 968 号	18993099136
		无锡市国联物流有限公司	4 万吨	江苏省无锡市钱皋路 168 号	13771149693
		国家粮食和物资储备局浙江局八三七处	1 万吨	浙江省宁波市宁波市镇海区大通路 331 号	13429322352
		宁波港九龙仓仓储有限公司	2.5 万吨	浙江省宁波市镇海区平海路 299 号	13757477277
		浙江南湖国际物流有限公司	2 万吨	浙江省嘉兴市秀洲区怀安路 186 号	18966375995
		河南国储物流股份有限公司(巩义四三一处)	1.5 万吨	河南省郑州市巩义市孝义路 2 号	13838040968
		中国外运华东有限公司(张华浜仓库)	4 万吨	上海市宝山区逸仙路 4088 号	13501724955
		上海添马行物流有限公司(松江库)	2 万吨	上海市松江区车新公路 518-1 号	18101877928
		上海添马行物流有限公司	1 万吨	江苏省无锡市宜兴经济技术开发区杏里路 17 号	13901785660
		上海全胜物流股份有限公司	1 万吨	上海市嘉定区沪华东路 289 号	13761972065
		江苏百金汇物流有限公司	3 万吨	江苏省南通市海安县晓星大道 105 号(铁路一号线南侧)	18112280078
常州融达现代物流有限公司	5 万吨	江苏省常州市钟楼区新闸镇运河路 298 号	18151721003		

续表

品种	交易所	交割仓库	库容	地址	电话
铝	上期所	五矿无锡物流园有限公司	7万吨	江苏省无锡市惠山区天港路1号	15852513305
		上海国能物流有限公司(常州奔牛库)	4万吨	江苏省常州市奔牛镇奔牛港劲港路28号	13584536626
		浙江长兴田川物流有限公司	5万吨	浙江省湖州市长兴县画溪街道雉洲大道108号	13967251888
		河南国储物流股份有限公司(巩义三三九处)	4万吨	河南省郑州市巩义市光明路12号	13939052796
		河南国储物流股份有限公司(洛阳四三三处)	1.5万吨	河南省洛阳市西工区汉宫路58号	13613797939
		中储发展股份有限公司洛阳分公司	1万吨	河南省洛阳市西工区道南路41号	13938849703
		重庆中集物流有限公司	2万吨	重庆市沙坪坝区月台路14号A幢	18623022012
		山东恒欣仓储有限公司	2万吨	山东省临沂市清河南路与通达路交汇西200米	15106690379
		山东高通物流有限公司(临沂仓库)	2万吨	山东省临沂市山东临沂市河东区凤仪街东段临沂北火车站货场	18560169066
		中铝物流集团中部国际陆港有限公司	5万吨	河南省郑州市上街区新安西路18号	13838282386
		广东炬申仓储有限公司	3万吨	广东省佛山市南海区丹灶镇丹灶物流中心金泰路1号	15015835397
上海中储临港物流有限公司(洋山保税库)	1万吨	上海市浦东新区洋山保税港区双惠路195	021-68280480 68280479		
锌	上期所	广东中储晟世照邦物流有限公司	2万吨	广东省佛山市南海区小塘西货场侧晟世物流小塘仓	18927759921
		南储仓储管理集团有限公司	7万吨	广东省佛山市禅城区佛罗公路166号	18588033336
		上海国储天威仓储有限公司	5.5万吨	上海市嘉定区黄渡工业园区星塔路1289号	15317578691
		中储发展股份有限公司上海吴淞分公司	1.5万吨	上海市宝山区宝杨路2069号/铁山路495号	13331955737
		中储发展股份有限公司无锡物流中心	1万吨	江苏省无锡市城南路32-1号	0510-85361369
		上港物流金属仓储(上海)有限公司	6万吨	上海市宝山区安达路240号	15821008607



续表

品种	交易所	交割仓库	库容	地址	电话
锌	上期所	上海裕强供应链管理有限公司	2万吨	上海市宝山区共和新路3501号	13671575566
		上海裕强供应链管理有限公司闵行仓库	2万吨	上海市闵行区剑川路2222号	13917631328
		中储发展股份有限公司上海大场分公司	4万吨	上海市宝山区南大路257号、310号、137号	13331955737
		上港物流金属仓储(上海)有限公司(苏州库)	1.5万吨	江苏省苏州市高新区钢成路8号	15821008607
		中储发展股份有限公司上海沪闵分公司	2万吨	上海市闵行区剑川路2280号	64300825
		无锡市国联物流有限公司	2万吨	江苏省无锡市钱皋路168号	13771149693
		国家粮食和物资储备局浙江局八三七处	5000吨	浙江省宁波市宁波镇海区大通路331号	13429322352
		宁波港九龙仓仓储有限公司	1万吨	浙江省宁波市镇海区平海路299号	13757477277
		中远海运物流有限公司(天津库)	2万吨	天津市塘沽区滨海高新区塘沽海洋科技园塘汉路10号	13820412356
		上海全胜物流股份有限公司(天津库)	1万吨	天津市东丽区津塘公路5号	13761972065
		天津市新兴伟业集装箱装卸服务有限公司	5000吨	天津市东丽区新立街新兴村合兴路688号	13902138329
		中国外运华东有限公司(张华浜仓库)	2万吨	上海市宝山区逸仙路4088号	13501724955
		上海全胜物流股份有限公司	2.5万吨	上海市嘉定区沪华东路289号	13761972065
		江苏百金汇物流有限公司	1万吨	江苏省南通市海安县晓星大道105号(铁路一号线南侧)	18112280078
		中远海运物流有限公司(宝山库)	1万吨	上海市宝山区宝杨路2249号	18681352659
		上海国能物流有限公司(常州奔牛库)	1万吨	江苏省常州市奔牛镇奔牛港劲港路28号	13584536626
		浙江长兴田川物流有限公司	1万吨	浙江省湖州市长兴县画溪街道雒洲大道108号	13967251888
		广东炬申仓储有限公司	2万吨	广东省佛山市南海区丹灶镇丹灶物流中心金泰路1号	15015835397
		上海全胜物流股份有限公司曹安仓库	2万吨	上海市嘉定区曹安公路3645号	13761972065
		国家粮食和物资储备局广东局八三〇处(三水西仓库)	2万吨	广东省佛山市三水区广海路321国道三水西铁路货场	13690748800

续表

品种	交易所	交割仓库	库容	地址	电话
铅	上期所	广东中储晟世照邦物流有限公司	1.5万吨	广东省佛山市南海区小塘西货场侧晟世物流小塘仓	18927759921
		南储仓储管理集团有限公司	2万吨	广东省佛山市禅城区佛罗公路166号	18588033336
		上海国储天威仓储有限公司	1万吨	上海市嘉定区黄渡工业园区星塔路1289号	15317578691
		中储发展股份有限公司上海吴淞分公司	2万吨	上海市宝山区宝杨路2069号/铁山路495号	13331955737
		中储发展股份有限公司无锡物流中心	4.5万吨	江苏省无锡市城南路32-1号	0510-85361369
		中储发展股份有限公司上海大场分公司	2.5万吨	上海市宝山区南大路257号、310号、137号	13331955737
		天津中储陆通物流有限公司	4万吨	天津市北辰区陆路港物流装备产业园陆港四经支路1号	18920287007
		天津全程物流配送有限公司	1.5万吨	天津市东丽区天津市东丽区华粮道2298号	13752257108
		中储发展股份有限公司上海沪闵分公司	1万吨	上海市闵行区剑川路2280号	64300825
		上海国储天威仓储有限公司(临港库)	1万吨	上海市浦东新区同顺大道1111号	18049920420
		国家粮食和物资储备局广东局八三〇处(黄埔库)	2万吨	广东省广州市萝岗区开发大道1330号	13168881080
		五矿无锡物流园有限公司	2万吨	江苏省无锡市惠山区天港路1号	15852513305
浙江长兴田川物流有限公司	5万吨	浙江省湖州市长兴县画溪街道雉洲大道108号	13967251888		
上海全胜物流股份有限公司曹安仓库	1万吨	上海市嘉定区曹安公路3645号	13761972065		
镍	上期所	上海国储天威仓储有限公司	3万吨	上海市嘉定区黄渡工业园区星塔路1289号	15317578691
		中储发展股份有限公司无锡物流中心	1万吨	江苏省无锡市城南路32-1号	0510-85361369
		上港物流金属仓储(上海)有限公司	2万吨	上海市宝山区安达路240号	15821008607
		国家粮食和物资储备局山东局八三二处	2000吨	山东省青岛市城阳区文阳路988号	15963207169



续表

品种	交易所	交割仓库	库容	地址	电话
镍	上期所	中储发展股份有限公司上海大场分公司	2 万吨	上海市宝山区南大路 257 号、310 号、137 号	13331955737
		中国农业生产资料集团公司(中农吴泾仓库)	1 万吨	上海市闵行区吴泾通海路 275 号	13901831155
		国家粮食和物资储备局浙江局八三七处	2 000 吨	浙江省宁波市宁波市镇海区大通路 331 号	13429322352
		宁波港九龙仓储有限公司	5 000 吨	浙江省宁波市镇海区平海路 299 号	13757477277
		中国外运华东有限公司(张华浜仓库)	1 万吨	上海市宝山区逸仙路 4088 号	13501724955
		常州融达现代物流有限公司	5 000 吨	江苏省常州市钟楼区新闻镇运河路 298 号	18151721003
		中远海运物流有限公司(宝山库)	1 万吨	上海市宝山区宝杨路 2249 号	18681352659
		中远海运物流有限公司(临港库)	3 万吨	上海市浦东新区临港自营物流园区捷畅路 156 号	13564151550
		宁波保税区高新货柜有限公司	5 000 吨	浙江省宁波市保税西区创业六路六号	18906693001
		上海鑫依物流有限公司	7 000 吨	上海市浦东新区洋山特殊综合保税区汇港路 255 号	13761163028
锡	上期所	南储仓储管理集团有限公司	3 000 吨	广东省佛山市禅城区佛罗公路 166 号	18588033336
		上海国储天威仓储有限公司	3 000 吨	上海市嘉定区黄渡工业园区星塔路 1289 号	15317578691
		中储发展股份有限公司无锡物流中心	2 000 吨	江苏省无锡市城南路 32-1 号	0510-85361369
		中储发展股份有限公司上海大场分公司	3 000 吨	上海市宝山区南大路 257 号、310 号、137 号	13331955737
		上港物流金属仓储(上海)有限公司(苏州库)	2 000 吨	江苏省苏州市高新区钢成路 8 号	15821008607
		国家粮食和物资储备局广东局八三〇处(黄埔库)	3 000 吨	广东省广州市萝岗区开发大道 1330 号	13168881080
		广东炬申仓储有限公司	2 000 吨	广东省佛山市南海区丹灶镇丹灶物流中心金泰路 1 号	15015835397
		上海全胜物流股份有限公司曹安仓库	1 000 吨	上海市嘉定区曹安公路 3645 号	13761972065

续表

品种	交易所	交割仓库	库容	地址	电话
螺纹钢	上期所	中储发展股份有限公司无锡物流中心	6 万吨	江苏省无锡市城南路 32 - 1 号	0510 - 85361369
		天津中储陆通物流有限公司	6 万吨	天津市北辰区陆路港物流装备产业园陆港四经支路 1 号	18920287007
		镇江惠龙长江港务有限公司	45 万吨	江苏省镇江市金桥大道 88 号	15105293553
		上海上港保税仓储管理有限公司（共青库）	1.5 万吨	上海市杨浦区军工路 2400 号	13501604628
		广东广物物流有限公司	9 万吨	广东省广州市白云区石井镇龙湖乡唐阁村西街 4 号	13560312100
		中储发展股份有限公司（南京滨江物流中心）	5 万吨	江苏省南京市江宁区滨江经济开发区丽水大街 1186 号	13601409234
		中储发展股份有限公司天津塘沽分公司	4.8 万吨	天津市塘沽区滨海新区塘沽于庄子路 2579 号	13920586081
		鞍钢股份有限公司	3 万吨	辽宁省鞍山市铁西区	13998005911
		江苏沙钢集团有限公司	3 万吨	江苏省苏州市张家港市锦丰镇	18962219275
		江苏省鑫鑫钢铁集团有限公司	3 万吨	江苏省连云港市赣榆区柘汪镇临港产业区	15722536789
		河钢集团有限公司（承钢）	3 万吨	河北省承德市双滦区滦河镇承钢厂	010 - 85898082
河钢集团有限公司（邯钢）	3 万吨	河北省邯郸市复兴区复兴路邯钢厂	010 - 85898082		
线材	上期所	中储发展股份有限公司无锡物流中心	2 万吨	江苏省无锡市城南路 32 - 1 号	0510 - 85361369
		天津中储陆通物流有限公司	1.8 万吨	天津市北辰区陆路港物流装备产业园陆港四经支路 1 号	18920287007
		镇江惠龙长江港务有限公司	15 万吨	江苏省镇江市金桥大道 88 号	15105293553
		中储发展股份有限公司天津塘沽分公司	1.5 万吨	天津市塘沽区滨海新区塘沽于庄子路 2579 号	13920586081
热轧卷板	上期所	中储发展股份有限公司无锡物流中心	6 万吨	江苏省无锡市城南路 32 - 1 号	0510 - 85361369
		天津中储陆通物流有限公司	6 万吨	天津市北辰区陆路港物流装备产业园陆港四经支路 1 号	18920287007
		镇江惠龙长江港务有限公司	18 万吨	江苏省镇江市金桥大道 88 号	15105293553
		上海上港保税仓储管理有限公司（共青库）	1.5 万吨	上海市杨浦区军工路 2400 号	13501604628



续表

品种	交易所	交割仓库	库容	地址	电话
热轧卷板	上期所	广东广物物流有限公司	9万吨	广东省广州市白云区石井镇龙湖乡唐阁村西街4号	13560312100
		中国外运华东有限公司(苏州库)	4.5万吨	江苏省苏州市高新区长江路748号	021-56441555
		中储发展股份有限公司(南京滨江物流中心)	4.5万吨	江苏省南京市江宁区滨江经济开发区丽水大街1186号	13601409234
		中储发展股份有限公司汉口分公司	1.2万吨	湖北省武汉市汉口区解放大道2020号	13986139332
		上海兴晟钢材加工有限公司	3万吨	上海市宝山区杨南路609号	13901933045
		无锡市国联物流有限公司	4.5万吨	江苏省无锡市钱皋路168号	13771149693
		宁波港九龙仓仓储有限公司	6万吨	浙江省宁波市镇海区平海路299号	13757477277
		中国外运华东有限公司(张华浜仓库)	4.5万吨	上海市宝山区逸仙路4088号	13501724955
		玖隆钢铁物流有限公司	24万吨	江苏省苏州市张家港市锦丰镇锦绣路181号	15895595421
不锈钢	上期所	中储发展股份有限公司无锡物流中心	10万吨	江苏省无锡市城南路32-1号	0510-85361369
		五矿无锡物流园有限公司	7万吨	江苏省无锡市惠山区天港路1号	15852513305
		广东炬申仓储有限公司	3.6万吨	广东省佛山市南海区丹灶镇丹灶物流中心金泰路1号	15015835397
		玖隆钢铁物流有限公司	6万吨	江苏省苏州市张家港市锦丰镇锦绣路181号	15895595421
黄金	上期所	工商银行北京分行营业部	—	北京市西城区复兴门南大街2号天银大厦B座	010-66411132
		工商银行上海分行营业部出纳科	—	上海市黄浦区中山东一路24号	021-63215820
		工商银行深圳分行清算中心	—	广东省深圳市深南东路金融中心北座1610室	0755-82246264
		工商银行贵溪市支行	—	江西省鹰潭市贵溪市雄石大道38号	0701-3773031
		工商银行三门峡分行营业部中心库	—	河南省三门峡市崤山路40号	0398-2836884
		工商银行三门峡分行灵宝支行	—	河南省三门峡市灵宝市函谷路中段	0398-8861995

续表

品种	交易所	交割仓库	库容	地址	电话
黄金	上期所	工商银行龙岩市分行	—	福建省龙岩市新罗区九一南路47号	0597-2224619
		工商银行龙岩市分行上杭支行	—	福建省龙岩市上杭县北环路东段	0597-3843087
		工商银行招远分行	—	山东省烟台市山东省招远市魁星路95号	0535-8224694
		工商银行莱州分行	—	山东省烟台市莱州市鼓城街88号	0535-2213413
		工商银行洛阳分行	—	河南省洛阳市高新技术开发区河洛路5号(三山路008号)	13937975796
		建设银行北京市分行西客站金库	—	北京市丰台区莲花池东路114号	010-51996686
		建设银行上海分行	—	上海市浦东新区陆家嘴环路900号	021-68490508
		建设银行深圳市分行	—	广东省深圳市红岭南路金融中心东座	0755-82488309
		建设银行安徽省铜陵市分行	—	安徽省铜陵市长江西路41号	13335621886
		建设银行河南省三门峡市分行	—	河南省三门峡市崤山路52号	0398-2985206
		建设银行河南省灵宝支行金库	—	河南省三门峡市灵宝市金城大道西段7号	0398-8869166
		建设银行山东省烟台市分行	—	山东省烟台市南大街9号	0535-6603378
		建设银行福建省分行龙岩分行	—	福建省龙岩市九一北路111号	0597-2239529
		建设银行福建省分行上杭支行	—	福建省龙岩市上杭县临江镇北环路261号	0597-3998730
		建设银行贵州省分行	—	贵州省贵阳市云岩区中华北路148号	13885066702
		交通银行北京分行	—	北京市西城区金融大街33号	010-66101163
		交通银行上海分行	—	上海市静安区万荣一路20号	021-63111000-4564
交通银行深圳分行	—	广东省深圳市福田区红荔西路3002号交行大厦	13682387916		
交通银行昆明分行	—	云南省昆明市盘龙区白塔路397号交银大厦	0871-66034125		

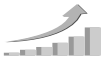


续表

品种	交易所	交割仓库	库容	地址	电话
黄金	上期所	交通银行广西壮族自治区分行	—	广西壮族自治区南宁市人民东路228号通银大厦15楼	13878160085
		交通银行湖北省分行	—	湖北省武汉市江岸区建设大道847号A座18楼	027-85487301
		交通银行陕西省分行	—	陕西省西安市西新街88号	029-87653294
		中国银行股份有限公司上海市分行	—	上海市黄浦区中山东一路23号	021-63291968
		中国银行股份有限公司深圳市分行	—	广东省深圳市和平路1195号中怡大厦	0755-22332190
		中国银行股份有限公司莱州支行	—	山东省烟台市莱州市莱州北路733号	13791224567
		中国银行股份有限公司招远支行	—	山东省烟台市招远市府前路78号	0535-8240070
		中国银行股份有限公司福建省分行	—	福建省福州市福州市五四路136号	0591-87090054/ 13860666121
		中国银行股份有限公司三门峡分行	—	河南省三门峡市崆山东路15号	0398-2982424
		中国银行股份有限公司灵宝支行	—	河南省三门峡市灵宝市金城大道10号	0398-2982822
		中国银行股份有限公司陕西省分行	—	陕西省西安市莲湖区唐延路北段18号	029-89592575 18192168877
		上海浦东发展银行股份有限公司宁波分行	—	浙江省宁波市海曙区江夏街21号	1380584141
		上海浦东发展银行股份有限公司大连分行	—	辽宁省大连市沙河口区会展路45号	0411-66866744
		中国农业银行股份有限公司	—	广东省深圳市罗湖区深南东路5008号农业银行大厦	0755-25591030
		深圳市威豹金融押运股份有限公司	—	广东省深圳市福田区广夏路8号	18038032090
白银	上期所	中储发展股份有限公司上海吴淞分公司	1 800 吨	上海市宝山区宝杨路2069号/铁山路495号	13331955737
		中国外运华东有限公司(虹井库)	2 000 吨	上海市宝山区上海市虹井路865号	021-63221003
		深圳市威豹金融押运股份有限公司	700 吨	广东省深圳市福田区广夏路8号	18038032090
		中工美(北京)供应链物流管理有限责任公司	1 000 吨	上海市青浦区重固镇崧华路1579号	021-63574771

续表

品种	交易所	交割仓库	库容	地址	电话
燃料油	上期所	中化兴中石油转运（舟山）有限公司	30万吨	浙江省舟山市定海区临城岙山岛	0580-2061786
		洋山申港国际石油储运有限公司	30万吨	上海市浦东新区洋山深水港沈家湾	021-68405123
		浙江海洋石油仓储有限公司	5.7万吨	浙江省舟山市定海区岑港街道烟墩工业区22号	0580-8710877
		大鼎油储有限公司	25万吨	浙江省舟山市定海区临城街道岙山东路496号	0580-8171134
沥青	上期所	金海宏业（镇江）沥青有限公司（仓库）	5.05万吨	江苏省镇江市丹徒经济开发区二重大道222号	15050857203
		江苏恒泰沥青有限公司	4.086万吨	江苏省镇江市大港新区临江东路6号（恒泰沥青库）	13655285528
		江苏新越沥青有限公司	4万吨	江苏省镇江市大港新区临江东路18号	13862446877
		宁波爱思开宝盈沥青仓储有限公司	3.358万吨	浙江省宁波市镇海区威远路111号	18757169680
		盘锦北方沥青股份有限公司	4万吨	辽宁省盘锦市兴隆台区新工街	18504276665
		辽宁华路特种沥青有限公司	3万吨	辽宁省盘锦市辽东湾新区长春路西	15658181818
		营口特茂石油化工有限公司	1.6374万吨	辽宁省营口市老边区兴达街32号	19984181111
		山东高速华瑞道路材料技术有限公司	2.32万吨	山东省淄博市高新区桓台新区石化路7号	15153115615
		中基宁波集团股份有限公司（江苏）	2万吨	江苏省镇江市丹徒经济开发区二重大道222号	18668566166
		中基宁波集团股份有限公司（辽宁）	5000吨	辽宁省营口市老边区兴达街32号	18668566166
		浙江四邦实业有限公司（江苏）	8000吨	江苏省南京市栖霞区燕子矶街道太新路81号	15168220915
		浙江四邦实业有限公司（安徽）	3000吨	安徽省池州市经济技术开发区临港工业园	15168220915
浙江四邦实业有限公司（辽宁）	5000吨	辽宁省营口市老边区兴达街32号	15168220915		
浙江永安资本管理有限公司（江苏）	1.65万吨	江苏省镇江市大港新区临江东路18号	18153525883		



续表

品种	交易所	交割仓库	库容	地址	电话
沥青	上期所	浙江永安资本管理有限公司 (辽宁)	5 000 吨	辽宁省营口市老边区兴达街 32 号	18153525883
		中海油气(泰州)石化有限公司	1 万吨	江苏省泰州市经济开发区滨江大道 6 号(高港油库)	18912192666
		中海沥青股份有限公司	2 万吨	山东省滨州市滨城区黄河七路 817 号	13371337766
		中化弘润石油化工有限公司 (厂库)	13 万吨	山东省潍坊市青州市开发区东京 路 687 号	15953665703
		佛山高富中石油燃料沥青有 限责任公司	5 万吨	广东省佛山市高明区富湾工业开 发区	13928505026
		南京蓝途沥青有限公司	8 460 吨	江苏省南京市栖霞区燕子矶街道 太新路 81 号	13770564197
		安徽环宇公路沥青材料有限 责任公司	1.16 万吨	安徽省芜湖市开发区四褐路 23 号	18130351081
		池州华远新材料有限公司	9 966 吨	安徽省池州市经济技术开发区临 港工业园	18963733533
		泰普克沥青(新会)有限 公司	7 850 吨	广东省江门市新会区今古洲经济 开发区银海大道南 31 号	18688396192
		山东高速物资储运有限公司	5.238 万吨	山东省淄博市临淄区乙烯路 319 号 山东高速物资储运公司(临淄油库)	18653322335
		江苏阿尔法船舶燃料贸易有 限公司	2.46 万吨	江苏省无锡市江阴市璜土镇石庄 春江路 16 号	13961706971
		江苏天诺道路材料有限公司	1.805 万吨	江苏省镇江市大港新区韩桥路	15152906900
		山东东明石化集团有限公司	3 万吨	山东省菏泽市东明县菜园集工业 园区	13953075887
		山东京博石油化工有限公司	30 万吨	山东省滨州市博兴县经济开发区 京博工业园	15066988903
中化弘润石油化工有限公司 (仓库)	4.04 万吨	山东省潍坊市青州市经济开发区 东京路 687 号	15953665703		
橡胶	上期所	中储发展股份有限公司上海 吴淞分公司	2 万吨	上海市宝山区宝杨路 2069 号/铁 山路 495 号	13331955737
		山东省奥润特贸易有限公司	4 万吨	山东省青岛市李沧区长顺路 15 号	15318869321
		国家粮食和物资储备局山东 局八三二处	3.7 万吨	山东省青岛市城阳区文阳路 988 号	15963207169

续表

品种	交易所	交割仓库	库容	地址	电话
橡胶	上期所	云南天然橡胶储运中心有限公司	3 万吨	云南省昆明市经济开发区洛羊街道办事处王家营贮木场	13388803019
		海南新思科电子商务有限公司（永桂仓库）	2 万吨	海南省海口市长流金盘永桂开发区永桂路9号	13907645415
		中储发展股份有限公司上海大场分公司	2.5 万吨	上海市宝山区南大路 257 号、310 号、137 号	13331955737
		天津中储陆通物流有限公司	3 万吨	天津市北辰区陆路港物流装备产业园陆港四经支路1号	18920287007
		中储发展股份有限公司上海临港分公司	6.5 万吨	上海市奉贤区平宇路 585 号、418 号	13331955737
		天津全程物流配送有限公司	2.3 万吨	天津市东丽区天津市东丽区华粮道 2298 号	13752257108
		中远海运物流有限公司	5.5 万吨	山东省青岛市高新技术产业开发区宝源路 789 号	13969710212
		山东省港口集团有限公司（青岛国际物流）	5 万吨	山东省青岛市青岛港前湾港区内经八路 2 号仓库	13468287229
		海南港航物流集团有限公司	2.6 万吨	海南省澄迈县老城经济开发区南一环路 69 号海口综合保税区	13389822888
		上海远盛仓储有限公司	1.5 万吨	上海市宝山区蕴川路 2508 号	13671698424
		中远海运物流有限公司（黄岛库）	2 万吨	山东省青岛市黄岛区同江路 556 号	13969710212
		中国外运华东有限公司（海港库）	3 万吨	上海市奉贤区新杨公路 778 号	13661814000
		中国外运华东有限公司（解放岛）	2 万吨	上海市闵行区解放岛路 988 号	13501724955
		中国外运华中有限公司	1.5 万吨	山东省青岛市四方区傍海南路 1 号仓库	13964877211
		中国外运华中有限公司（黄岛库）	2 万吨	山东省青岛市保税区吉隆坡路 6 号仓库	13964877211
		中国外运华中有限公司（胶州库）	3 万吨	山东省青岛市胶州经济技术开发区物流大道 1 号	13964877211
		中国农业生产资料集团公司（中农吴泾仓库）	1.5 万吨	上海市闵行区吴泾通海路 275 号	13901831155
		上海中储临港物流有限公司	1 万吨	上海市浦东新区双惠路 195 号	13564496979
山东省港口集团有限公司（青岛国际物流胶州库）	2 万吨	山东省青岛市胶州广东路 2 号甲	18669844878		



续表

品种	交易所	交割仓库	库容	地址	电话
橡胶	上期所	中国外运华东有限公司 (张华浜仓库)	1.5 万吨	上海市宝山区逸仙路 4088 号	13501724955
		上海上港保税仓储管理有限公司 (新港集装箱仓库)	5 000 吨	上海市浦东新区茂祥路 258 号	13817137097
		青岛宏桥市场经营有限公司	4.5 万吨	山东省青岛市保税区北京路 58 号 (B)	13953288112
		国家粮食和物资储备局云南局五三〇处	1 万吨	云南省昆明市官渡区大板桥镇沙沟乡	13888803019
纸浆	上期所	中储发展股份有限公司上海吴淞分公司	1 万吨	上海市宝山区宝杨路 2069 号/铁山路 495 号	13331955737
		山东省奥润特贸易有限公司	3 万吨	山东省青岛市李沧区长顺路 15 号	15318869321
		天津中储陆通物流有限公司	5 万吨	天津市北辰区陆路港物流装备产业园陆港四经支路 1 号	18920287007
		中储发展股份有限公司上海临港分公司	5 万吨	上海市奉贤区平宇路 585 号、418 号	13331955737
		山东省港口集团有限公司 (青岛国际物流)	13 万吨	山东省青岛市青岛港前湾港区内经八路 2 号仓库	13468287229
		上海远盛仓储有限公司	1.5 万吨	上海市宝山区蕴川路 2508 号	13671698424
		中远海运物流有限公司 (青岛库)	3.5 万吨	山东省青岛市黄岛区同江路 556 号	13969710212
		中国外运华中有限公司 (胶州库)	13 万吨	山东省青岛市胶州经济技术开发区物流大道 1 号	13964877211
		青岛宏桥市场经营有限公司	3 万吨	山东省青岛市保税区北京路 58 号 (B)	13953288112
		中国供销集团南通供销产业发展有限公司	3 万吨	江苏省南通市高新技术产业开发区希望大道 008 号	18362402520
		青岛市青银仓储物流有限公司	2 万吨	山东省青岛市黄岛区淮河东路 36 号	13608987099
		建发物流集团有限公司 (平湖库)	3 万吨	浙江省嘉兴市平湖市独山港镇引港路 333 号	18760575887
		建发物流集团有限公司 (青岛库)	5 万吨	山东省青岛市黄岛区七星河路 363 号	18760575887
常熟威特隆仓储有限公司	3 万吨	江苏省苏州市常熟经济技术开发区兴华港区 1 路	13601550609		

续表

品种	交易所	交割仓库	库容	地址	电话
纸浆	上期所	厦门象屿速传供应链发展股份有限公司（上海库）	1 万吨	上海市宝山区长建路 505 号	13524560575
		厦门象屿速传供应链发展股份有限公司（青岛库）	2.5 万吨	山东省青岛市黄岛区骊山路 179 号	13524560575
		厦门建发纸业有限公司	1 万吨	山东省青岛市黄岛区七星河路 363 号	18650808643
		浙江永安资本管理有限公司	3 万吨	山东省青岛市青岛港前湾港区内经八路 1 号	18258206861
		金翌贸易（上海）有限公司	1 万吨	江苏省苏州市常熟经济技术开发区兴华港区 1 路	18516788059
		浙江景诚实业有限公司	2 万吨	山东省青岛市黄岛区淮河东路北侧（淮河东路千山北路交叉口）	17706406966
20 号胶	上期能源	上海洋山保税港区世天威物流有限公司	3 万吨	上海市浦东新区洋山保税港区海旺路 288 号	15821987825
		上海中储临港物流有限公司（洋山保税库）	5 万吨	上海市浦东新区洋山保税港区双惠路 195	021 - 68280480, 68280479
		山东中储国际物流有限公司	1 万吨	山东省青岛市保税港区北京路 45 号	13954207760
		世天威物流（上海外高桥保税物流园区）有限公司	2 万吨	上海市浦东新区外高桥保税物流园区申亚路 89 号	13817283912
		青岛中外运供应链管理有限公司	4 万吨	山东省青岛前湾保税港区月湾路 8 号	15153205257
		青岛涿亨物流有限公司	1.5 万吨	山东省青岛市保税港区北京路 39 号（A）	18669836338
		山东省港口集团有限公司（青岛国际物流）	8 万吨	山东省青岛市保税港区纬四路 18 号（A）	13468287229
		招商局国际码头（青岛）有限公司	3.5 万吨	山东省青岛市经济技术开发区前湾港路 68 号 3 号库	13854239920
		济钢国际物流有限公司	1 万吨	山东省青岛市保税港区莫斯科路 43 号（A）	18561788878
		海南农垦现代物流集团有限公司	1 万吨	海南省澄迈县老城经济开发区南一环路 69 号海口综合保税区保税仓 A1 仓库	13098909257
山东省港口集团有限公司（龙口海纳）	5 000 吨	山东省烟台市龙口经济开发区沟头路南仓库	18653518881		

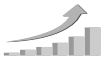


续表

品种	交易所	交割仓库	库容	地址	电话
原油	上期能源	中国石化集团石油商业储备有限公司日照分公司	520 万桶	山东省日照市岚山北港区	0633 - 7898809
		中国石化集团石油商业储备有限公司舟山分公司	350 万桶	浙江省舟山市册子岛	0580 - 8772789
		中石油燃料油有限责任公司湛江仓储分公司	311 万桶	广东省湛江市霞山区友谊路 1 号港务局二区	15889832944
		中化兴中石油转运 (舟山) 有限公司	210.1 万桶	浙江省舟山市定海区临城岙山岛	13906807550
		国家粮食和物资储备局广东局八三〇处	829.5 万桶	广东省佛山市南海区盐步镇三眼桥货场西侧	13690748800
		山东省港口集团有限公司 (青岛实华)	239.2 万桶	青岛市董家口一期库区	0532 - 82988686
		广东中储晟世照邦物流有限公司	126 万桶	广东省佛山市南海区小塘西货场侧晟世物流小塘仓	18927759921
		中国石化集团石油商业储备有限公司海南分公司	300 万桶	海南省洋浦经济开发区滨海大道 83 号	18117766005
		国投 (洋浦) 油气储运有限公司	124.5 万桶	海南省洋浦经济开发区化学工业园区园一路北侧	17702736890
		大鼎油储有限公司	130 万桶	浙江省舟山市定海区临城街道岙山东路 496 号	0580 - 8171134
		大连中石油国际储运有限公司大连国际储备库	1 080 万桶	辽宁省大连市保税区新港大连中石油国际储备库	0411 - 87596138
		大连北方油品储运有限公司	54 万桶	大连市保税区新港大连港新港沙坨子原油库	0411 - 87596759
		中化弘润石油储运 (潍坊) 有限公司	1 800 万桶	潍坊滨海经济开发区先进制造产业园海丰路以西渤海大街以北	0536 - 2095126
		中国石化集团石油商业储备有限公司湛江分公司	208 万桶	广东省湛江市临港工业园兴港大道湛江商储分公司	0759 - 3483018
		中国石化集团石油商业储备有限公司曹妃甸分公司	200 万桶	河北省唐山市曹妃甸工业区曹妃甸商储分公司	022 - 66335663
		大连中石油国际储运有限公司广西国际储备库	120 万桶	广西壮族自治区钦州市钦州保税港区的广西中石油国际储备库	0411 - 87596138
山东省港口集团有限公司 (海业摩科瑞)	239.2 万桶	山东省青岛市黄岛区董家口港区港润大道 88 号	13468287604		

续表

品种	交易所	交割仓库	库容	地址	电话
低硫 燃料 油	上期 能源	中化兴中石油转运（舟山）有限公司	15 万吨	浙江省舟山市定海区临城岙山岛	13906807550
		山东省港口集团有限公司（青岛实华）	4 万吨	青岛市董家口一期库区	0532 - 82988686
		广东中储晟世照邦物流有限公司	15 万吨	广东省佛山市南海区小塘西货场侧晟世物流小塘仓	18927759921
		浙江海洋石油仓储有限公司	2 万吨	浙江省舟山市定海区岑港街道烟墩工业区 22 号	0580 - 8710877
		大鼎油储有限公司	10 万吨	浙江省舟山市定海区临城街道岙山东路 496 号	0580 - 8171134
		浙江自贸区中石油国际事业有限公司	4 万吨	浙江省舟山市定海区临城岙山岛	13795356663
		中石化浙江舟山石油有限公司	4 万吨	浙江舟山市普陀区东港街道海洲路 727 号	18058071136
国际 铜	上期 能源	上海洋山保税港区世天威物流有限公司	4 万吨	上海市浦东新区洋山保税港区海旺路 288 号	15821987825
		上海鑫依物流有限公司	5 000 吨	上海市浦东新区洋山特殊综合保税区汇港路 255 号	13761163028
		上海中储临港物流有限公司（洋山保税库）	3 万吨	上海市浦东新区洋山保税港区双惠路 195	021 - 68280480 , 68280479
		世天威物流（上海外高桥保税物流园区）有限公司	4 万吨	上海市浦东新区外高桥保税物流园区申亚路 89 号	13817283912
		上海上港保税仓储管理有限公司	6 万吨	上海市浦东新区临港新片区洋山特殊综合保税区顺运路 389 号	13817860605
		中远海运物流有限公司（上海中汽仓储有限公司）	5 000 吨	上海市浦东新区外高桥保税区日京路 150 号 101	13501773037
		亨睿保税仓储（上海）有限公司	3 万吨	上海市浦东新区洋山特殊综合保税区汇港路 269 号	13818401463
		上海国储仓储有限公司	1 万吨	上海市浦东新区外高桥保税区荷丹路 68 号	13761450411
菜粕	郑商所	中粮粮油工业（黄冈）有限公司（仓库）	2 万吨	湖北省黄冈市黄州工业园高新技术产业区唐渡四路（中粮大道）	0713 - 8399232
		益海嘉里（安徽）粮油工业有限公司（仓库）	2 万吨	安徽省芜湖市鸠江区二坝镇鸠江经济开发区二坝园区合裕路 1 号	0553 - 2539966



续表

品种	交易所	交割仓库	库容	地址	电话
菜粕	郑商所	中粮祥瑞粮油工业(荆门)有限公司(仓库)	2万吨	湖北省荆门市钟祥经济开发区西环路1号	0724-6900626
		中国华粮物流集团南通粮油接运有限责任公司(仓库)	2万吨	江苏省南通市崇川区任港路62号	0513-83508460
		中粮粮油工业(荆州)有限公司(仓库)	2万吨	湖北省荆州市公安县青吉工业园	13997631138
		中粮粮油工业(巢湖)有限公司(仓库)	2万吨	安徽省合肥市巢湖市居巢经济开发区旗山路1号	0551-82350380
		中纺粮油(福建)有限公司(仓库和厂库)	仓库2万吨+ 厂库0.9万吨	福建省漳州市漳州开发区招商大道129号	13799043633
		中粮油脂(钦州)有限公司(厂库)	0.9万吨	广西钦州市钦州港经济技术开发区建港路39号	18577701271
		东莞市富之源饲料蛋白开发有限公司(厂库)	0.9万吨	广东省东莞市洪梅镇樱花台盈工业区	15889630185
		大海粮油工业(防城港)有限公司(厂库)	0.9万吨	广西防城港市港口区出海大道1号	13877088327
		防城港枫叶粮油有限公司(厂库)	0.9万吨	广西防城港市港口区东湾大道东侧	18777081175
		厦门中禾实业有限公司(厂库)	2万吨	福建省厦门市同安区城南工业区金富路97号	18006009977
		邦基(东莞)粮油有限公司(厂库)	0.9万吨	广东省东莞市麻涌镇漳澎村作业区中路1号	13356337655
		防城港澳加粮油工业有限公司(厂库)	1万吨	广西防城港市港口区东吹填区港区1号路西侧	13557002500
		厦门建发物产有限公司(厂库)	6万吨	厦门市湖里区环岛东路1699号25楼	15956560066
厦门市明穗粮油贸易有限公司(厂库)	6万吨	厦门市湖里区象屿路88号保税市场大厦3楼	13806033174		
菜油	郑商所	陕西西瑞粮食储备库有限公司(仓库)	2万吨	陕西省咸阳市西吴镇兴平食品工业园区	38412031
		中粮东海粮油工业(张家港)有限公司(厂库)	2万吨	江苏省张家港市金港镇	0512-58388228
		泰州市过船港务有限公司(仓库)	2万吨	江苏省泰兴经济开发区沿江路2号	0523-89718055

续表

品种	交易所	交割仓库	库容	地址	电话
菜油	郑商所	中央储备粮四川新津直属库有限公司(仓库)	2万吨	四川省成都市新津县普兴镇	028-67716108
		中储粮镇江粮油有限公司(仓库)	2万吨	镇江市京口区谏壁镇粮山村	13861350613
		南京铁心桥国家粮食储备库有限公司(仓库)	2万吨	石埠桥河西里1号	52890799
		益海嘉里(武汉)粮油工业有限公司(仓库)	2万吨	武汉市东西湖区慈惠工业园	2783899687
		益海(广汉)粮油饲料有限公司(仓库)	2万吨	四川省德阳市广汉市经济开发区湘潭路一段80号	0838-5303973
		中粮祥瑞粮油工业(荆门)有限公司(仓库)	2万吨	湖北省钟祥经济开发区	0724-4285729
		四川粮油批发中心直属储备库(仓库)	2万吨	四川省成都市新都区桂湖西路148号	028-83931711
		江苏省江海粮油集团有限公司(仓库)	2万吨	江苏省张家港市金港镇宝岛路1号	0512-58388066
		凯欣粮油有限公司(仓库)	2万吨	重庆市九龙坡区铜罐驿镇砖瓦村167号	18581020110
		道道全重庆粮油有限责任公司(厂库)	2万吨	重庆市涪陵区鹤滨路26号	18107303663
		益海(泰州)粮油工业有限公司(厂库)	2万吨	江苏省泰州市高港区永安洲镇疏港北路1号	15817320321
		新实力食品科技(南京)有限公司(厂库)	1万吨	江苏省南京市栖霞区疏港路1号龙潭物流基地内	13813852027
		南通凯晟粮油有限公司(厂库)	2万吨	江苏南通市经济技术开发区营船港西路2号	15062765332
		嘉吉粮油(南通)有限公司(厂库)	2万吨	江苏省南通市经济开发区同兴路1号	15962968657
		东莞市富之源饲料蛋白开发有限公司	2万吨	广东省东莞市洪梅镇樱花台盈工业区	15889630185
邦基(东莞)粮油有限公司	2万吨	广东省东莞市麻涌镇漳澎村作业区中路1号	13356337655		
中粮油脂(钦州)有限公司(厂库)	2万吨	广西壮族自治区防城港市港口区东湾大道东侧	18577701271		

附录G
统计数据



续表

品种	交易所	交割仓库	库容	地址	电话
菜油	郑商所	大海粮油工业(防城港)有限公司(厂库)	2万吨	广西省防城港市港口区出海大道一号	13877088327
		防城港枫叶粮油工业有限公司	2万吨	广西壮族自治区防城港市港口区东湾大道东侧	18777081175
		防城港澳加粮油工业有限公司	2万吨	防城港市港口区东吹填区港区一号路西侧	13557002500
		厦门中禾实业有限公司(厂库)	2万吨	福建省厦门市同安区城南工业区金富路97号	18006009977
		中纺粮油(福建)有限公司	2万吨	福建省漳州市漳州开发区招商大道129号	13799043633
		仪征益江粮油工业有限公司(仓库)	2万吨	江苏省仪征市油港路1号	18724093168
菜籽	郑商所	中国华粮物流集团南通粮油接运有限责任公司(仓库)	2万吨	南通市崇川区任港路62号	0513-83508460
		中粮粮油工业(巢湖)有限公司(仓库)	2万吨	安徽省合肥市巢湖市居巢经济开发区旗山路	0551-82350275
		中粮粮油工业(荆州)有限公司(仓库)	2万吨	湖北省荆州市公安县青吉工业园	18627298606
		中粮祥瑞粮油工业(荆门)有限公司(仓库)	2万吨	湖北省荆门市钟祥经济开发区西环路1号	0724-4285729
		益海嘉里(安徽)粮油工业有限公司(仓库)	2万吨	安徽省芜湖市鸠江区二坝镇鸠江经济开发区二坝园区合裕路1号	0553-2539366
		中粮粮油工业(黄冈)有限公司(仓库)	2万吨	湖北省黄冈市黄州工业园高新技术产业区唐渡四路(中粮大道)	0713-8399232
苹果	郑商所	中国供销集团延长果业有限责任公司(仓库)	2万吨	陕西省延安市延长县七里村	15962868000
		陕西华圣企业(集团)股份有限公司(厂库)	1000吨	陕西省西安市未央湖旅游开发区	029-86674830 13363975955
		白水盛隆果业有限责任公司(厂库)	800吨	陕西省渭南市白水县北井头乡李家卓村	18691318818
		延安中果生态农业科技股份有限公司(厂库)	800吨	陕西省延安市延长县七里村镇白家川工业园区	0911-8964699 13359113053
		栖霞德丰食品有限公司(厂库)	800吨	山东省栖霞市德丰路一号	0535-3371789 13370927501

续表

品种	交易所	交割仓库	库容	地址	电话
苹果	郑商所	莱州天赐宝物产有限公司(厂库)	800 吨	山东省莱州市程郭镇西程村	0535 - 2418968 15854537456
		三门峡二仙坡绿色果业有限公司(厂库)	600 吨	河南省三门峡市陕州区禹王路中段	13703814168
		宝鸡海升现代农业有限公司(厂库)	800 吨	陕西省宝鸡市千阳县南寨镇	18691080612
		甘肃德美地缘现代农业集团有限公司(厂库)	800 吨	甘肃省平凉市静宁县城川镇红旗村农产品冷链物流产业园	15293309929
		天水花牛苹果(集团)有限责任公司(厂库)	800 吨	甘肃省天水市麦积区甘里铺工业园区	18893989100
		烟台联盛果蔬有限公司(厂库)	1 000 吨	山东省烟台市经济技术开发区潮水镇衙前村	13806389919
		秦安雪原果品有限责任公司(厂库)	800 吨	甘肃省天水市秦安县安伏工业园区	18093808400
		威海市翠虹果业股份有限公司(厂库)	800 吨	山东省荣成市城西街道办事处东岭后村	18463166134
		陕西粮农洛川果业有限公司(厂库)	800 吨	陕西省延安市洛川县苹果产业园区 17 号	13324636939
		中国供销集团延长果业有限责任公司(厂库)	1 000 吨	陕西省延安市延长县七里村	15962868000
		蓬莱昊林果蔬有限公司(厂库)	800 吨	山东省烟台市蓬莱区大辛店镇	13562583333
		渭南天顺农产品商贸有限公司(厂库)	800 吨	陕西省渭南市白水县	18329361935
		陕西果业铜川集团有限公司(厂库)	800 吨	陕西省铜川市新材料产业园区	13201587905
		陕西子午实业发展有限公司(厂库)	800 吨	陕西省延安市富县吉子现乡	17868814777
		陕西华圣企业(集团)股份有限公司(车船板交割服务机构)	—	陕西省西安市未央湖旅游开发区	029 - 86674830 13363975955
		白水县盛隆果业有限责任公司(车船板交割服务机构)	—	陕西省渭南市白水县北井头乡李家卓村	18691318818
延安中果生态农业科技股份有限公司(车船板交割服务机构)	—	陕西省延安市延长县七里村镇白家川工业园区	0911 - 8964699 13359113053		

附录 G
统计数据



续表

品种	交易所	交割仓库	库容	地址	电话
苹果	郑商所	栖霞德丰食品有限公司 (车船板交割服务机构)	—	山东省栖霞市德丰路一号	0535 - 3371789 13370927501
		莱州天赐宝物产有限公司 (车船板交割服务机构)	—	山东省莱州市程郭镇西程村	0535 - 2418968 15854537456
		甘肃德美地缘现代农业集团有限公司 (车船板交割服务机构)	—	甘肃省平凉市静宁县城川镇红旗村农产品冷链物流产业园	15293309929
		天水花牛苹果 (集团) 有限责任公司 (车船板交割服务机构)	—	甘肃省天水市麦积区甘里铺工业园区	18893989100
		秦安雪原果品有限责任公司 (车船板交割服务机构)	—	甘肃省天水市秦安县安伏工业园区	18093808400
		威海市翠虹果品股份有限公司 (车船板交割服务机构)	—	山东省荣成市城西街道办事处东岭后村	18463166134
		烟台联盛果蔬有限公司 (车船板交割服务机构)	—	山东省烟台市经济技术开发区潮水镇衙前村	13806389919
		栖霞市沃尔德果蔬冷藏有限公司 (车船板交割服务机构)	—	山东省烟台市栖霞市观里镇古村	13808927777
		陕西粮农洛川果业有限公司 (车船板交割服务机构)	—	陕西省延安市洛川县苹果产业园区17号	13324636939
		中国供销集团延长果业有限责任公司 (车船板交割服务机构)	—	陕西省延安市延长县七里村	15962868000
		蓬莱昊林果蔬有限公司 (车船板交割服务机构)	—	山东省烟台市蓬莱区大辛店镇	13562583333
		渭南天顺农产品商贸有限公司 (车船板交割服务机构)	—	陕西省渭南市白水县	18329361935
		陕西果业铜川集团有限公司 (车船板交割服务机构)	—	陕西省铜川市新材料产业园区	13201587905
陕西子午实业发展有限公司 (车船板交割服务机构)	—	陕西省延安市富县吉子现乡	17868814777		
白糖	郑商所	广西弘信供应链管理有限公司 (仓库)	2万吨	广西扶绥县新宁镇空港大道与华阳路交汇处	0771 - 2539399
		中糖世纪股份有限公司江苏分公司 (仓库)	2万吨	江苏省南通市跃龙南路179号	0513 - 85519936
		广东北部湾农产品批发中心有限公司 (仓库)	2万吨	广东省湛江市麻章区金川路32号	13828243808

续表

品种	交易所	交割仓库	库容	地址	电话
白糖	郑商所	河北永安国家粮食储备库有限公司(仓库)	2万吨	石家庄市藁城区永安路18号	13473782071
		中粮糖业(唐山)仓储物流有限公司(仓库)	2万吨	河北省唐山市曹妃甸工业区二港池西岸	13820560727
		北京中糖物流有限公司(仓库)	2万吨	北京市大兴区魏善庄镇东枣林村东200米	010-89205810
		陕西省储备粮咸阳直属库(仓库)	2万吨	陕西省咸阳市渭城区东风路16号	029-33774152
		秦皇岛冀盛物流有限公司(仓库)	2万吨	河北省秦皇岛市海港区东港北路45号	13933553743
		云南陆航物流服务有限公司(仓库)	2万吨	昆明市呈贡区洛羊街道办事处洛羊物流片区03-01号	0871-67412872
		南宁云鸥物流股份有限公司(仓库)	2万吨	南宁市邕宁区蒲庙镇橙山路9号	0771-4919926
		广西融桂物流集团有限公司钦州仓储分公司(仓库)	2万吨	广西钦州市钦州港经济开发区勒沟作业区	0777-3888538
		云南广大铁路物资储运有限公司(仓库)	2万吨	云南省楚雄市彝人古镇五期怡星园E6幢	0878-3399195
		广西北部湾弘信供应链管理有限公司(仓库)	2万吨	广西南宁市高新区丰达路8号	0771-2539399
		日照市凌云海糖业集团有限公司(厂库)	1万吨	日照市秦皇岛路59号	0633-3601359
		广西贵港桂糖储备有限公司(仓库)	2万吨	广西贵港市覃塘区石卡镇贵港产业园石卡园	0775-4906568
		营口北方糖业有限公司(仓库)	2万吨	辽宁省营口市熊岳大铁工业园	0417-6881888
		广西柳州桂糖有限责任公司(仓库)	2万吨	广西柳州市航生路9号	0772-3213992
		营口港务集团有限公司(仓库)	2万吨	辽宁省营口市鲅鱼圈区营港路1号	0417-6268751
中糖世纪股份有限公司湖北分公司(仓库)	2万吨	武汉市黄陂区滢口糖库	027-61862237		
中储发展股份有限公司郑州南阳寨分公司(仓库)	2万吨	郑州市兴隆铺路9号中储仓库	0371-63731373		



续表

品种	交易所	交割仓库	库容	地址	电话
白糖	郑商所	平湖华瑞仓储有限公司 (仓库)	2 万吨	浙江省平湖市独山港镇海涛路88号	0573 - 85656923
		广西融桂怡亚通供应链有限公司 (仓库)	2 万吨	广西来宾市盘古大道	13878255430
		广西荣桂国际智慧物流有限公司 (仓库)	2 万吨	广西崇左市扶绥县新宁镇航空港大道东46号	18277194455
		中粮糖业控股股份有限公司 (厂库)	5 万吨	北京市朝阳区朝阳门南大街8号 中粮福临门大厦902	13241823192
		山东星光糖业有限公司 (厂库)	5 万吨	经济技术开发区星光工业园	0546 - 6298863
		中粮屯河伊犁新宁糖业有限公司 (厂库)	0.5 万吨	新疆伊犁州伊宁县玉其温乡	18699422611
		云南英茂糖业 (集团) 有限公司 (厂库)	2 万吨	云南省昆明市西山区滇池路739号	15911627336
		广西糖业集团柳兴制糖有限公司	2 万吨	广西壮族自治区柳州市柳石路迎宾路口	0772 - 3829492
棉花	郑商所	国家粮食和物资储备局河南局四三二处 (仓库)	2 万吨	河南省新乡市获嘉县史庄村南	15083133099
		河南豫棉物流有限公司 (仓库)	2 万吨	河南省郑州市管城区南曹乡小李庄火车站	13223079634
		衡水市棉麻总公司储备库 (仓库)	2 万吨	河北省衡水市人民西路西段98号	13833869506
		菏泽市棉麻公司巨野棉麻站 (仓库)	2 万吨	山东省菏泽市牡丹区八一路太原路交叉口文化城B3栋13楼1310室	13853001858
		菏泽市棉麻公司菏泽转运站 (仓库)	2 万吨	山东省菏泽市牡丹区八一路太原路交叉口文化城B3栋13楼1310室	13853001858
		滨州中纺银泰实业有限公司 (仓库)	2 万吨	山东省滨州市滨城区小营办事处虎跃三路14号	13905430020
		江阴市协丰棉麻有限公司 (仓库)	2 万吨	江苏省江阴市华西村华西商贸城150号	15961633918
		湖北储备物资管理局三三八处 (仓库)	2 万吨	湖北省孝感市孝昌县卫店镇三三八处	13797179803
		中棉集团山东物流园有限公司 (仓库)	2.5 万吨	山东省潍坊市滨海经济技术开发区汉江西街000666号	15666266301

续表

品种	交易所	交割仓库	库容	地址	电话
棉花	郑商所	江苏银海农佳乐仓储有限公司(仓库)	2万吨	江苏省盐城市建湖县上冈镇人民南路666号	18036286719
		库尔勒银星物流有限责任公司(仓库)	15万吨	新疆省库尔勒市上户镇	18009968722
		中国供销集团南通供销产业发展有限公司(仓库)	2万吨	江苏省南通市通州高新区锦绣路888号	13962803671
		中储棉漯河有限公司(仓库)	2万吨	河南省漯河市孟南工业区纬三路	13781741159
		新疆中新建现代物流股份有限公司(仓库)	35万吨	喀什地区巴楚县火车站(巴莎公路以西)	15276951999
		江苏银隆仓储物流有限公司(仓库)	2万吨	江苏省海安市城东镇银联路3号	15599767777
		新疆农资(集团)有限责任公司(仓库)	40万吨	新疆奎屯市阿独公路南229号	13677520022
		新疆银棉储运有限公司(仓库)	6万吨	新疆伊犁州奎屯市胡杨园2号	18892975168
		中储棉库尔勒有限责任公司(仓库)	10万吨	新疆巴州库尔勒市火车站	13909962698
		新疆汇锦物流有限公司(仓库)	40万吨	新疆库尔勒市上库综合产业园区	15099451726
		新疆伊犁州陆德棉麻有限责任公司(仓库)	15万吨	新疆伊犁州奎屯市南环路翠竹园	13899540566
		中储棉菏泽有限责任公司(仓库)	1万吨	山东省菏泽市黄河西路5666号	15865162527
		中储棉武汉有限公司(仓库)	1万吨	湖北省武汉市江夏区大桥新区三合街	13986049680
		新疆中锦胡杨河仓储物流有限公司(仓库)	6万吨	新疆第七师130团太行山路(东)187号	13609919608
		新疆兵棉宏泰物流有限公司(仓库)	40万吨	新疆第八师石河子市143团10连	15199003397
阿拉尔市鹏宇棉花仓储物流有限责任公司(仓库)	10万吨	新疆维吾尔自治区阿拉尔市经济技术开发区2号工业园绿园路以北	18999661690		
张家港保税区外商投资服务有限公司(仓库)	2万吨	江苏省张家港市台湾路2号	15862621558		

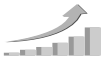


续表

品种	交易所	交割仓库	库容	地址	电话
棉花	郑商所	阿克苏益康仓储物流有限公司 (仓库)	10 万吨	新疆阿克苏地区新和县北工业园区	13565121678
棉纱	郑商所	项城市纺织有限公司 (厂库)	0.24 万吨	河南省项城市东方大道 158 号	18135756786
		尉氏纺织有限公司 (厂库)	0.24 万吨	河南省尉氏县人民东路 168 号	13937899826
		河南新野纺织股份有限公司 (厂库)	1.2 万吨	河南省新野县书院路 15 号	13903778786
		临清三和纺织集团有限公司 (厂库)	0.48 万吨	山东省临清市大桥街 1050 号	13666388138
		徐州天虹时代纺织有限公司 (厂库)	0.36 万吨	江苏省徐州市睢宁县景湖工业区	13852052369
		江苏大生集团有限公司 (厂库)	0.48 万吨	江苏省南通市唐闸南市街 14 号	13813606011
		浙江华孚色纺有限公司 (厂库)	0.24 万吨	浙江省绍兴市上虞区人民西路 1088 号	13858530581
		武汉裕大华纺织服装集团有限公司 (厂库)	0.12 万吨	武汉市新洲区阳逻经济开发区工业园特 1 号	18627880315
		河北宏润新型面料有限公司 (厂库)	0.18 万吨	河北高阳县西外环西侧	15933957555
		远纺工业 (无锡) 有限公司 (厂库)	0.07 万吨	江苏省无锡市新吴区新洲路 20 号	13806185260
		河南豫棉物流有限公司 (仓库)	1 万吨	河南省郑州市管城区南曹乡小李庄火车站	13223079634
		国家粮食和物资储备局河南局四三二处 (仓库)	1 万吨	郑州市东明路北 177 号	13803838080
		中棉集团山东物流园有限公司 (仓库)	2 万吨	山东省潍坊市滨海经济开发区汉江西街 00666 号中棉集团	15726550678
		菏泽市棉麻公司 (仓库)	2 万吨	山东省菏泽市中华路 466 号	13853001858
		青州中储物流有限公司 (仓库)	1 万吨	山东省青州市玲珑山北路 638 号	13563679116
		江阴市协丰棉麻有限公司 (仓库)	0.5 万吨	江苏省江阴市华士镇华西商贸城 150 号	13801522007
中国供销集团南通供销产业发展有限公司 (仓库)	1 万吨	南通高新区锦绣路 888 号	18921602649		

续表

品种	交易所	交割仓库	库容	地址	电话
棉纱	郑商所	杭州临港物流有限公司（仓库）	1万吨	浙江省杭州市萧山区瓜沥镇临港工业园区瓜港西路309号	13867568730
		浙江尖峰国际贸易有限公司（仓库）	0.5万吨	浙江省金华市金义都市新区常春西路88号	15605793277
红枣	郑商所	新疆叶河源果业股份有限公司（仓库）	0.2万吨	新疆图木舒克市昆神街6号	17881031686
		新疆阿拉尔聚天红果业有限责任公司（仓库）	0.2万吨	新疆阿拉尔市阿塔公路113公里北侧	18999665616
		新疆羌都枣业股份有限公司（仓库）	0.2万吨	新疆若羌县胜利区胜利路	13779300296
		若羌靖祥新丝路物流有限公司（仓库）	0.2万吨	办公地址：新疆维吾尔自治区巴音郭楞蒙古自治州若羌县团结路6区11号楼1-5号 仓库地址：新疆维吾尔自治区巴音郭楞蒙古自治州若羌县楼兰大道新丝路1号（315国道1588公里处）	18146144500
		和田昆仑山枣业股份有限公司（仓库）	0.2万吨	新疆昆玉市皮墨北京工业园区和兴街137号	15209030117
		阿克苏西域惠农电子商务供应链有限公司（仓库）	0.2万吨	新疆阿克苏地区阿克苏市商贸物流园区	18160503673
		新疆昆仑土地扶贫开发股份有限公司（仓库）	0.2万吨	喀什地区疏附县商贸园区	13909985658
		叶城西域果叔电商供应链有限公司（仓库）	0.2万吨	新疆维吾尔自治区喀什地区叶城县恰尔巴格镇9村6组5号	15001468006
		新疆和田果业有限公司（仓库）	0.2万吨	新疆维吾尔自治区和田地区和田县工业经济园区（昆仑工业园区）金唱路6号	15026285866
		喀什新鑫果业有限公司	0.2万吨	新疆喀什地区岳普湖县泰岳工业园区新粤路5号	13579550517
		新疆中麦开发实业有限公司	0.2万吨	新疆喀什地区麦盖提县创业路一号城西工业园区2号门面房	13579300568
新疆乐优食品有限公司	0.2万吨	新疆阿克苏地区阿克苏纺织工业城开发区上海路6号	15031891609		

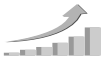


续表

品种	交易所	交割仓库	库容	地址	电话
红枣	郑商所	好想你健康食品股份有限公司 (仓库)	0.2 万吨	河南省新郑市薛店镇	13607673647
		沧州好想你枣业有限公司 (仓库)	0.2 万吨	河北省沧县崔尔庄红枣工业园区 1 号	15832739066
		沧州盛源食品有限公司 (仓库)	0.2 万吨	河北省沧县大官厅乡白贾村	13930798568
花生	郑商所	中粮山萃花生制品 (威海) 有限公司 (厂库和车船板服务机构)	0.45 万吨	山东省威海市文登经济开发区文昌路 66 号	15098100107
		费县中粮油脂工业有限公司 (厂库和车船板服务机构)	0.45 万吨	山东省临沂市费县城站北路 1 号	0539 - 5016068
		青岛嘉里花生油有限公司 (厂库和车船板服务机构)	0.45 万吨	青岛市开发区前湾港路 99 号	0532 - 86827195
		益海嘉里 (兖州) 粮油工业有限公司 (厂库和车船板服务机构)	0.45 万吨	山东省济宁市兖州区益海路 1 号	13518658000
		中粮油脂 (菏泽) 有限公司 (厂库)	0.45 万吨	山东省菏泽市开发区长江东路 7058 号	15698195925
		青岛天祥食品集团有限公司 (厂库)	0.45 万吨	山东省青岛市平度市南村镇郭庄三城路 86 - 1 号	0532 - 82328889
		山东玉皇粮油食品有限公司 (厂库)	0.3 万吨	山东省莒南县南环路中段	13589663375
		河南正康粮油有限公司 (厂库)	0.3 万吨	河南省驻马店市遂平县工业集聚区	18203960618
		开封龙大植物油有限公司 (厂库)	0.3 万吨	开封经济开发区黄龙园区纬七路 17 号	13353837887
		益海 (石家庄) 粮油工业有限公司 (厂库)	0.3 万吨	河北省石家庄良村经济技术开发区扬子路东段	18031368080
		河南丰盛农业开发有限公司 (厂库和车船板服务机构)	0.3 万吨	河南省鹤壁市浚县产业集聚区永济大道西段路北 1 号	15139254468
		山东金胜粮油食品有限公司 (厂库)	0.45 万吨	山东省莒南县城南环路西段	15969723286
		浙江杭实善成实业有限公司 (厂库)	0.3 万吨	杭州市上城区基金小镇二期甘水巷 17 号	1377888979
菏泽市粮油中转储备库 (车船板服务机构)	—	山东省菏泽市长江东路 7118 号 国家粮食储备库	13805309290		

续表

品种	交易所	交割仓库	库容	地址	电话
花生	郑商所	乳山市金果食品股份有限公司（车船板服务机构）	—	山东省乳山市市区惠州路66号	13863018011
		正阳新地食品工业有限公司（车船板服务机构）	—	正阳县新地春天13-A05	18623975529
		开封粮食产业集团有限公司（车船板服务机构）	—	开封市城乡一体化示范区杏花营乡杏花营村	0371-25996025
		濮阳皇甫国家粮食储备库有限公司（车船板服务机构）	—	河南省濮阳市黄河路西段	13839390880
		河北永安国家粮食储备库有限公司（车船板服务机构）	—	石家庄市藁城区永安路18号	0311-88199837
		河南镇平国家粮食储备库（车船板服务机构）	—	河南省南阳市镇平县工业园区航天北路39号	15637701800
		济宁市第一粮库有限公司（车船板交割服务机构）	—	山东省济宁市任城区车站西路83号	13515378939
		青岛中储物流有限公司（车船板服务机构）	—	山东省青岛市胶州市胶北办事处北关物流工业园中储路97号	13553013975
		益海嘉里（盘锦）食品工业有限公司（车船板服务机构）	—	辽宁省盘锦市辽滨沿海经济区滨海大道（一号路）北侧	18642735999
		辽宁正业花生产业发展有限公司（车船板服务机构）	—	辽宁省葫芦岛市兴城市红崖子镇汤屯村500号	13470209656
		阜新市农牧产业（集团）有限公司（车船板服务机构）	—	辽宁省阜新市细河区四合镇四合路155号	18740180702
营口锦豪农贸有限公司（车船板服务机构）	—	辽宁省营口市老边区青花大街东139号	13906990889		
普麦	郑商所	河北开源粮油储备库有限公司（仓库）	2万吨	河北省元氏县北环东路街道44号	18831177717
		济宁市第一粮库有限公司（仓库）	2万吨	济宁市任城区车站西路67号	0537-2250416
		南京铁心桥国家粮食储备库有限公司（仓库）	2万吨	南京市栖霞区石埠桥河西里1号	13851421688
		徐州国家粮食储备库（仓库）	2万吨	徐州市鼓楼区下淀路174号	0516-83643209
		河南安阳安林国家粮食储备库（仓库）	2万吨	河南省安阳市安阳县柏庄镇青春村北	13569038233



续表

品种	交易所	交割仓库	库容	地址	电话
普麦	郑商所	陕西西瑞粮食储备库有限公司（仓库）	2万吨	陕西省兴平市食品工业园咸兴大道东	029-38412031
		衡水和平国储粮库有限责任公司（仓库）	3万吨	衡水市桃城区和平东路道岔街66号	0318-2057012
		菏泽市粮油中转储备库（仓库）	2万吨	菏泽市长江东路7118号	0530-5967760
		河南郑州兴隆国家粮食储备库（仓库）	2万吨	郑州市惠济区粮仓路1号	0371-63757525
		河南省粮油对外贸易有限公司鄆城粮食储备库（仓库）	2万吨	河南省漯河市鄆城区孟庙镇太行山路北段	13838275236
强麦	郑商所	济宁市第一粮库有限公司（车船板交割服务机构）	—	山东省济宁市任城区车站西路67号	13515378939
		菏泽市粮油中转储备库（车船板交割服务机构）	—	山东省菏泽市长江东路7118号	13805309290 18653098369
		河南郑州兴隆国家粮食储备库（车船板交割服务机构）	—	河南省郑州市惠济区粮仓路1号	13703715751
		河南安阳安林国家粮食储备库（车船板交割服务机构）	—	河南省安阳市北关区柏庄镇青春村北	13569038233
		河南濮阳皇甫国家粮食储备库有限公司（车船板交割服务机构）	—	河南省濮阳市黄河路西段	13839390880
		豫粮集团延津小麦产业有限公司（车船板交割服务机构）	—	延津县产业集聚区	13525548505
		豫粮集团濮阳粮食产业园有限公司（车船板交割服务机构）	—	河南省濮阳市皇石路与太行路交叉口西北角	13461657685
		河南世通谷物有限公司夏邑直属库（车船板交割服务机构）	—	河南省商丘市夏邑县淮海工业区6号	13603712102
		益海嘉里（郑州）食品工业有限公司（车船板交割服务机构）	—	河南省郑州市经济技术开发区经北四路155号	18638117177
		益海（周口）小麦工业有限公司（车船板交割服务机构）	—	河南省周口市南环路东段路南益海工业园	18638117177

续表

品种	交易所	交割仓库	库容	地址	电话
强麦	郑商所	益海嘉里（安阳）食品工业有限公司（车船板交割服务机构）	—	河南省汤阴县食品工业园区工纵二路	18638117177
		中粮（郑州）粮油工业有限公司（车船板交割服务机构）	—	郑州经济技术开发区航海东路1746号	15937128282
		衡水和平国储粮库有限责任公司（车船板交割服务机构）	—	河北省衡水市桃城区和平东路道岔街66号	13932859618
		河北永安国家粮食储备库有限公司（车船板交割服务机构）	—	河北省石家庄市藁城区永安路18号	13831155700
		河北开源粮油储备库有限公司（车船板交割服务机构）	—	河北省石家庄市元氏县北环东路街道44号	18831177717
		益海（石家庄）粮油工业有限公司（车船板交割服务机构）	—	河北省石家庄市良村经济技术开发区扬子路55号	18031368007
		陕西西瑞粮食储备库有限公司（车船板交割服务机构）	—	陕西省兴平市食品工业园区咸兴大道东	18829802015
		陕西粮农杨凌储备库有限公司（车船板交割服务机构）	—	陕西省杨凌示范区康乐东路城东物流园	13891037568
		陕西粮农华州储备库有限公司（车船板交割服务机构）	—	陕西省渭南市华州区杏林厂区	13759888188
早籼	郑商所	湖南永州下河国家粮食储备库（仓库）	1万吨	湖南永州冷水滩区零陵北路411号	0746-8466942
		九江市粮油总公司储备仓库（仓库）	1万吨	九江市滨江路577号	0792-8138902
		湖南衡阳三塘国家粮食储备库（仓库）	1万吨	湖南省衡南县三塘镇环城南路65号	0734-8722197
		湖南金霞粮食产业有限公司（仓库）	1万吨	湖南省长沙市开福区芙蓉北路1119号	0731-89780539
		湖南天下洞庭粮油实业有限公司（仓库）	1万吨	湖南省沅江市沅南路8号	13607373282
		江西省粮油集团新干购销公司（仓库）	1万吨	江西新干金川北大道123号	0796-2687080



续表

品种	交易所	交割仓库	库容	地址	电话
早籼	郑商所	江西樟树国家粮食储备库(仓库)	1万吨	江西省樟树市药都北大道15号	0795-7119868
		江西省温圳粮库(仓库)	1万吨	江西省进贤县温圳镇城北大道169号	0791-5540393
		金健粮食有限公司(仓库)	1万吨	湖南常德市经济开发区	0736-2588349
晚籼	郑商所	江西樟树国家粮食储备库(仓库)	1万吨	江西省樟树市药都北大道15号	0795-7119868
		湖南永州下河国家粮食储备库(仓库)	1万吨	湖南永州冷水滩区零陵北路411号	0746-8466942
		湖南天下洞庭粮油实业有限公司(仓库)	2万吨	湖南省沅江市沅南路8号	13607373282
		湖北康宏粮油食品有限公司(仓库)	3万吨	湖北黄梅濯港十里关山工业园	0713-3165996
		江西省粮油集团新干购销公司(仓库)	1万吨	江西新干金川北大道123号	0796-2687080
		益海嘉里(南昌)粮油食品有限公司(仓库)	2万吨	江西省南昌市南昌县南新乡益海大道99号	0791-85882575
粳稻	郑商所	营口港务集团有限公司(仓库)	5万吨	辽宁省营口市鲅鱼圈区营港路1号	0417-6268751
		益海嘉里(哈尔滨)粮油食品工业有限公司(仓库和厂库)	仓库2万吨+ 厂库2万吨	哈尔滨市平房开发区哈平东路10号	0451-86786305
		沈阳第四粮食收储有限公司(仓库)	3万吨	辽宁省沈阳市浑南新区沈营路52号	024-23780672
		北京古船米业有限公司(仓库)	2万吨	吉林省榆树市榆陶公路3.5公里路南	43181996601
		中粮米业(绥化)有限公司(仓库和厂库)	仓库2万吨+ 厂库2万吨	黑龙江省绥化市经济开发区食品工业园区	0455-8713054
		中央储备粮哈尔滨直属库有限公司(仓库)	5万吨	哈尔滨市香坊区哈平路新发屯7.5公里处	0451-87066679
甲醇	郑商所	连云港荣泰化工仓储有限公司(仓库)	2万吨	江苏省连云港市徐圩新区岗前大道仓储办公楼	18795586658
		张家港保税区长江国际港务有限公司(仓库)	2万吨	张家港保税物流园区西区南京路	0512-58387580

续表

品种	交易所	交割仓库	库容	地址	电话
甲醇	郑商所	南通千红石化港储有限公司(仓库)	2万吨	南通经济技术开发区江海港区(通盛南路6号)	0513-85991146
		兖矿煤化供销有限公司(厂库)	2万吨	山东邹城矿建东路1089号院内	15153705737
		广州发展碧辟油品有限公司(仓库)	2万吨	广东省广州市南沙区环市大道北19号	13928830100
		定州天鹭新能源有限公司(厂库)	2万吨	河北省定州市定曲路北侧	18831900511
		内蒙古博源联合化工有限公司(厂库)	2万吨	内蒙古鄂尔多斯市东胜区大桥路西19号(博源物流院内)	18647171616
		新能源有限公司(厂库)	2万吨	内蒙古鄂尔多斯市达拉特旗新新能源有限公司	13930680303
		南通阳鸿石化有限公司(仓库)	2万吨	江苏省如皋市长江镇堤顶路65号	0513-87688067
		江苏海企化工仓储股份有限公司(仓库)	2万吨	江苏省泰州高港区永安洲工业园	13952618356
		河南省中原大化集团有限责任公司(厂库)	2万吨	河南省濮阳市人民路西段	13939368999
		新能凤凰(滕州)能源有限公司(厂库)	2万吨	山东省滕州市木石镇驻地	13589612016
		东莞市百安石化仓储有限公司(仓库)	2万吨	广东省东莞市沙田镇立沙岛石化基地	0769-89985678
		江苏长江石油化工有限公司(仓库)	2万吨	江苏省太仓市上海东路5号华侨大厦16楼	0512-53719630
		张家港保税区长江国际扬州石化仓储有限公司(仓库)	2万吨	江苏省仪征市扬州化学工业园区中化路3号	0514-83211611
		京唐港液体化工码头有限公司(仓库)	2万吨	河北省唐山市海港经济开发区	15373565156
		江苏德桥仓储有限公司(仓库)	7万吨	江苏省靖江市新港园区敦土路南首	13626237585
扬州恒基达鑫国际化工仓储有限公司(仓库)	3万吨	江苏省仪征市大连路8-8号	18012335863		
东莞市九丰能源有限公司(仓库)	3万吨	广东省东莞市沙田镇立沙岛立沙大道	13713495801		

附录
统计数据



续表

品种	交易所	交割仓库	库容	地址	电话
甲醇	郑商所	江苏丽天石化码头有限公司 (仓库)	3 万吨	江苏省江阴市临港街道润华路 9 号	15152605578
		上期资本管理有限公司 (厂库)	3 万吨	上海市浦东新区世纪大道 826 号 T3-21	021-60876309 15853700207
		浙江杭实化工有限公司 (厂库)	3 万吨	杭州市江干区香樟街 2 号泛海国际 A 座 31 楼	0571-8260062 13185004108
		海油富岛 (上海) 化学有限公司 (厂库)	3 万吨	北京市朝阳区安贞西里三区 15 号凯康海油大厦	010-84527336 18611791199 传真: 010-84527341
		南京诚志清洁能源有限公司 (厂库)	3 万吨	北京市海淀区清华科技园创新大厦 A 座 207	010-62565770 18600818429 传真: 010-62565770
		江阴市金桥化工有限公司 (厂库)	3 万吨	江阴市澄江中路 118 号海澜国贸大厦 10 楼	0510-86409620 15950136826 传真: 0510-86409618
		浙江永安资本管理有限公司 (厂库)	3 万吨	杭州市江干区新业路 200 号华峰国际 32 层	15867185274
		中基石化有限公司 (厂库)	3 万吨	浙江省宁波市鄞州区和源路 318 号中银大厦 29 楼	0574-88366101 13805880557
		盛虹科技 (上海) 有限公司 (厂库)	3 万吨	上海市长宁区延安西路 728 号华敏翰尊国际大厦 12 楼 B/C 座	021-5268599-8025 15968052605
		厦门国贸石化有限公司	3 万吨	福建省厦门市湖里区仙岳路 4688 号国贸中心 1 栋 20 层	0592-5821023 18659801519
		浙江南华资本管理有限公司 (厂库)	3 万吨	杭州市上城区西湖大道 193 号定安名都 B 座 313 房	0571-89727453 17321163513
		上海新湖瑞丰金融服务有限公司 (厂库)	3 万吨	上海市浦东新区向城路 288 号国华人寿金融大厦 607-608 室	021-50767055 15305399987
		浙江浙期实业有限公司 (厂库)	3 万吨	浙江省杭州市西湖区求是路 8 号公元大厦南楼 1103 室	0571-87396437 18329137099
建滔 (常州) 石化码头有限公司 (仓库)	2 万吨	常州市新北区滨江工业园区新化路 88 号	0519-81697815		

续表

品种	交易所	交割仓库	库容	地址	电话
动力煤	郑商所	中国中煤能源股份有限公司(厂库)	—	北京市朝阳区黄寺大街1号中煤大厦	18618228712
		陕西煤业化工集团有限责任公司(厂库)	—	陕西省西安市高新区锦业路1号	18629562979
		神华销售集团有限公司(厂库)	—	北京市东城区安德路16号神华大厦C座	18810098948
		晋能控股煤业集团有限公司(厂库)	—	山西省大同市矿区新平旺	13994350912
		江苏晋和电力燃料有限公司(厂库)	—	江苏省泰州市高港区永安镇堂圩七组	18637101718
		内蒙古伊泰煤炭股份有限公司(厂库)	—	内蒙古鄂尔多斯市东胜区天骄北路伊泰大厦	18947773948
		秦皇岛港股份有限公司(车船板服务机构)	—	河北省秦皇岛市海滨路35号	0335-3091076 13933603767
		国能黄骅港务有限责任公司(车船板服务机构)	—	河北省沧州市黄骅港开发区	15690295122
		国投曹妃甸港口有限公司(车船板服务机构)	—	河北省唐山市曹妃甸工业区六加国投码头	15176676103
		国投中煤同煤京唐港口有限公司(车船板服务机构)	—	河北省唐山市海港开发区国投京唐港大厦	15933252464
		天津港交易市场有限责任公司(车船板服务机构)	—	天津港散货物流中心金岸二道481号	18920123126
		唐山港京唐港区进出口保税储运有限公司(车船板服务机构)	—	河北省唐山市海港开发区唐山港集团2号门保税物流中心	0315-2916385 15232515656
		防城港北部湾港务有限公司(车船板服务机构)	—	广西壮族自治区防城港市港口区友谊大道18号	18577011778
		福建可门港物流有限公司(车船板服务机构)	—	福建省福州市连江县下宫乡港区大道	0591-26163660 13358285679
		广州港股份有限公司(车船板服务机构)	—	广东省广州市越秀区沿江东路406号	020-83050938 13822194892
唐山曹妃甸煤炭港务有限公司(车船板服务机构)	—	河北省唐山市曹妃甸工业区	0315-8827180 18531580168		
华能曹妃甸港口有限公司(车船板服务机构)	—	河北省唐山市曹妃甸工业区	18716061761		



续表

品种	交易所	交割仓库	库容	地址	电话
动力煤	郑商所	河北华电曹妃甸储运有限公司（车船板服务机构）	—	河北省唐山市曹妃甸工业区	18231533999
		华能太仓港务有限责任公司（车船板服务机构）	—	江苏省太仓市港区滨江大道	13616225998
		浙江浙能港口运营管理有限公司（车船板服务机构）	—	浙江省舟山市普陀区六横镇兴港路1号	0580-6182888 13906695148
纯碱	郑商所	河北中储物流有限公司（仓库）	2万吨	河北省石家庄市鹿泉经济开发区石获北路30号	13754517598
		上海中远海运物流国际储运有限公司（仓库）	2万吨	河北省石家庄市高邑县高邑镇工业路冀中南智能港	13969710212 13953265477
		上海中远海运物流国际储运有限公司（仓库）	2万吨	河北省邯郸市武安市南环东路1366号	16631068899
		国家粮食和物资储备局河北局一三四处（仓库）	2万吨	湖北省孝感市孝昌县卫店镇	13733496388
		国家粮食和物资储备局湖北局三三八处（仓库）	2万吨	河北省石家庄市鹿泉区龙泉路56号	13503205091
		国家粮食和物资储备局湖北局七三六处（仓库）	2万吨	湖北省武汉市江夏区星光大道16号	18602713315
		国家粮食和物资储备局河北局一三三处（仓库）	5万吨	河北省石家庄市藁城区永安路18号	13473782071
		国家粮食和物资储备局湖北局三三七处（仓库）	4万吨	湖北省宜昌市当阳市庙前镇桐树垭村烟远路特1号	13545832288
		河北永安国家粮食储备库有限公司（仓库）	2万吨	河南省安阳市汤阴县产业集聚区阳光大道与汤伏路交叉口	13783570172
		河南万庄安阳物流园有限公司（仓库）	5万吨	湖北省仙桃市彭场镇仙彭公路东侧	15926094411
		武汉新港汉江集装箱股份有限公司（仓库）	4万吨	湖北省襄阳市襄州区钻石大道232号	13797564275
		国家粮食和物资储备局湖北局五三八处（仓库）	2万吨	河南省漯河市舞阳县南环路中段	15515805055
		河南金大地化工有限责任公司（厂库）	3万吨	河南省漯河市舞阳县南环路中段	15515805055
唐山三友化工股份有限公司（厂库）	3万吨	河北省唐山市曹妃甸区发展道407号	15512001001		

续表

品种	交易所	交割仓库	库容	地址	电话
纯碱	郑商所	河南中源化学股份有限公司(厂库)	3万吨	河南省南阳市桐柏县安棚镇中心卫生院南侧	13598221794
		山东海天生物化工有限公司(厂库)	3万吨	山东省潍坊市昌邑市下营镇金晶大道1号	15169592511
		武汉众恒创景新型材料有限公司(厂库)	2万吨	湖北省应城市四里棚工业园区应城市新都化工有限责任公司。双方另有约定的除外	18018658798
		沙玻玻璃物流沙河有限公司(厂库)	1万吨	河北省邢台市沙河市纬三路南侧河北正玻玻璃科技园区A0、C2库房。双方另有约定的除外	18334305585
		成都云图控股股份有限公司(厂库)	5万吨	河北省邢台市沙河市纬三路南侧河北正玻玻璃科技园区A1库房。双方另有约定的除外	15998229696
		浙江永安资本管理有限公司(厂库)	2万吨	河北省邢台市沙河市纬二路9号。双方另有约定的除外	15075975651
		浙江杭实善成实业有限公司(厂库)	2万吨	河北省邢台市沙河市正玻科技园区A5-2西区	15902778656
		河北正大玻璃有限公司(厂库)	2万吨	河南省郑州市金水区未来路未来大厦2009c	18737190655
		豫新投资管理(上海)有限公司(厂库)	2万吨	浙江省杭州市滨江区科技馆街626号寰宇商务中心B座1106室	13523717861
		浙江景诚实业有限公司(厂库)	2万吨	上海市虹口区东长治路359号一方大厦16楼	13601996589
		银河德睿资本管理有限公司(厂库)	2万吨	上海市浦东新区樱花路868号建工大唐国际广场A座1803室	13701883591
尿素	郑商所	东海资本管理有限公司(厂库)	2万吨	安徽省芜湖市鸠江区凤鸣湖北路信义玻璃1号门	13811400158
		信义节能玻璃(芜湖)有限公司(厂库)	4万吨	河北省邢台市沙河市经济开发区纬二路61号	13932952555
		菏泽市粮油中转储备库(仓库)	2万吨	菏泽市长江东路7118号	0530-5967760
尿素	郑商所	青州中储物流有限公司(仓库)	2万吨	玲珑山北路638号	0536-3292571
		河南心连心化学工业集团股份有限公司(厂库)	5万吨	新乡县经济开发区青龙路东段	0373-5592888



续表

品种	交易所	交割仓库	库容	地址	电话
尿素	郑商所	河南晋开化工投资控股集团 有限责任公司(厂库)	5万吨	沁阳市北工业集聚区	0371-22210236 15937836655
		河南晋控天庆煤化工有限责 任公司(厂库)	4万吨	沁阳市北工业集聚区	0391-5038777 18739186769
		河北省东光化工有限责任公 司(厂库)	4万吨	河北省沧州市东光县城东工业 区	13932779557 0317-7819517
		河北正元氢能科技有限公司 (厂库)	2万吨	沧州临港经济技术开发区东区 化工一路北侧	0311-66609909 13931896293
		山东晋煤明水化工集团有限 公司(厂库)	2万吨	刁镇工业园	0531-61322988 13969029557
		河南豫棉物流有限公司(仓 库)	2万吨	河南省郑州市管城区南曹乡 小李庄火车站	13051172650
		安徽昊源化工集团有限公司 (厂库)	4万吨	阜阳市阜康路1号	15605582929 0558-2368818
		国家粮食和物资储备局河南 局四三二处(仓库)	2万吨	新乡获嘉县史庄镇	0530-5965936
		国投山东临沂路桥发展有限 责任公司(仓库)	2万吨	临沂市河东区华阳路中段国 投华阳物流园区	0539-8095189
		中农云仓物流(宜昌)有限 公司(仓库)	2万吨	湖北省宜昌市高新区白洋沙 湾曹岗路9号	0717-8998052
		史丹利化肥宁陵有限公司 (仓库)	2万吨	产业集聚区史丹利化肥宁陵 有限公司	0370-7757777 15539772772
		安徽晋煤中能化工股份有限 公司(厂库)	4万吨	临泉县临化路2号	0558-6582032 13965576143
		中化化肥有限公司(厂库)	5万吨	经济技术开发区翔宇路61号	010-59569724 18911999724
		衡水市棉麻总公司(仓库)	2万吨	衡水市人民西路西段98号	0318-2398258

续表

品种	交易所	交割仓库	库容	地址	电话
尿素	郑商所	安徽辉隆集团农资连锁有限责任公司(仓库)	2万吨	宿州市埇桥区夹沟镇南206国道东侧	0551-62667337
		成都云图控股股份有限公司(厂库)	3万吨	四川省成都市新都区蜀龙大道969号汇景大厦414室	028-83961236
		山东晋煤明升达化工有限公司(厂库)	4万吨	山东省泰安市宁阳县经济开发区灵山大道以西、堡头大街以北	13561765966
		四川农资化肥有限责任公司(厂库)	1.6万吨	四川省成都市青羊区太升北路12号	13982222231
		河南省中原大化集团有限责任公司(厂库)	2万吨	河南省濮阳市人民路西段	13939368999
		国家粮食和物资储备局湖北局七三六处(仓库)	2万吨	湖北省当阳市庙前镇桐树垭村烟远路特1号	13545832288
		江阴市协丰棉麻有限公司(仓库)	2万吨	江苏省江阴市华士镇华西商贸城150号	13801522007
		湖北三宁化工股份有限公司(厂库)	3万吨	湖北省宜昌市枝江市姚家港沿江路9号	15717883551
		江苏农垦农业服务有限公司(厂库)	1万吨	江苏泽州农资有限公司(江苏省盐城市阜宁县益林镇站前路2号)	13851222111
		浙江永安资本管理有限公司(厂库)	1万吨	浙江省杭州市上城区新业路200号华峰国际32层	15384063520
		浙江景诚实业有限公司(厂库)	1万吨	浙江省杭州市滨江区科技馆街626号寰宇商务中心B座1106室	18626891122
硅铁	郑商所	天津全程物流配送有限公司(仓库)	2万吨	天津市东丽区华粮道2298号	022-84828818-300
		邯郸市东之桦物流有限公司(仓库)	1万吨	河北省邯郸市曲周县南工业区晨光路东段路南	18931016688
		江苏奔牛港务集团有限公司(仓库)	1万吨	江苏省常州市新北区奔牛镇奔牛港	13701508500
		国家粮食和物资储备局河北局一三四处(仓库)	1万吨	河北省武安市南环东路1366号	16631068899
		国家粮食和物资储备局湖北局三三八处(仓库)	1万吨	湖北省孝昌县卫店镇三三八处	13733496388
		国家粮食和物资储备局湖北局三三七处(仓库)	2万吨	湖北省武汉市江夏区大桥星光大道20号	15377578786



续表

品种	交易所	交割仓库	库容	地址	电话
硅铁	郑商所	中储发展股份有限公司天津塘沽分公司 (仓库)	1 万吨	天津市滨海新区于庄子路 2579 号	13821193332
		玖隆钢铁物流有限公司 (仓库)	1 万吨	江苏省张家港市锦丰镇锦绣路 181 号	15895595421
		江苏诚通物流有限公司 (仓库)	2 万吨	江苏省常州市新北区罗溪镇通达路 2 号	0519 - 68000621
		中储发展股份有限公司天津新港分公司 (仓库)	1 万吨	天津市滨海新区塘沽新港四号路 791 号	13920425007
		天津中储陆通物流有限公司 (仓库)	1 万吨	天津市北辰区陆路港物流装备产业园区陆港四经支路 1 号	18920287007
		河南万庄安阳物流园有限公司 (仓库)	1 万吨	安阳市汤阴县产业集聚区阳光大道与汤伏路交叉口	13783570172
		中储南京物流有限公司 (仓库)	1 万吨	南京市江宁滨江经济开发区丽水大街 1186 号	15905145629
		腾达西北铁合金有限责任公司 (厂库)	1.5 万吨	甘肃省兰州市永登县连城镇	13993153517
		青海福鑫硅业有限公司 (厂库)	0.4 万吨	青海省西宁经济技术开发区甘河工业园区	18097239888
		豫新投资管理 (上海) 有限公司 (厂库)	1 万吨	河南省郑州市金水区未来路 69 号未来大厦 2009C	13525661732
		浙江永安资本管理有限公司 (厂库)	0.4 万吨	杭州市江干区新业路 200 号华锋国际 32 层	15801732007
		银河德睿资本管理有限公司 (厂库)	2 万吨	上海市虹口区东长治路 359 号一方大厦 16 楼	13601996589
中信寰球商贸有限公司 (厂库)	1 万吨	上海市浦东新区杨高南路 799 号陆家嘴世纪金融广场 3 号楼 22 层	13801639433		
锰硅	郑商所	邯郸市东之桦物流有限公司 (仓库)	1 万吨	河北省邯郸市曲周县南工业区晨光路东段路南	18931016688
		天津全程物流配送有限公司 (仓库)	2 万吨	天津市东丽区华粮道 2298 号	022 - 84828818 - 300
		江苏奔牛港务集团有限公司 (仓库)	1 万吨	江苏省常州市新北区奔牛镇奔牛港	13701508500
		国家粮食和物资储备局湖北局三三八处 (仓库)	1 万吨	湖北省孝昌县卫店镇三三八处	13733496388

续表

品种	交易所	交割仓库	库容	地址	电话
锰硅	郑商所	中储发展股份有限公司天津塘沽分公司(仓库)	1万吨	天津市滨海新区于庄子路2579号	13821193332
		玖隆钢铁物流有限公司(仓库)	1万吨	江苏省张家港市锦丰镇锦绣路181号	15895595421
		江苏诚通物流有限公司(仓库)	2万吨	江苏省常州市新北区通达路2号	18861123645
		中储发展股份有限公司天津新港分公司(仓库)	1万吨	天津市滨海新区塘沽新港四号路791号	13920425007
		天津中储陆通物流有限公司(仓库)	1万吨	天津市北辰区陆路港物流装备产业园区陆港四经支路1号	18920287007
		河南万庄安阳物流园有限公司(仓库)	1万吨	安阳市汤阴县产业集聚区阳光大道与汤伏路交叉口	13783570172
		中储南京物流有限公司(仓库)	1万吨	南京市江宁滨江经济开发区丽水大街1186号	15905145629
		国家粮食和物资储备局河北局一三四处(仓库)	1万吨	河北省武安市南环东路1366号	16631068899
		国家粮食和物资储备局湖北局三三七处(仓库)	2万吨	湖北省武汉市江夏区大桥星光大道20号	15377578786
		宁夏晟晏实业集团有限公司(厂库)	1.5万吨	宁夏平罗太沙工业园区翰泉路8号	15081528787
		中国矿产有限责任公司(厂库)	0.5万吨	内蒙古乌兰察布市化德县北辰北路	18601318776
		内蒙古普源铁合金有限责任公司(厂库)	1.4万吨	内蒙古乌兰察布市丰镇市氟化学园区西区	13994313599
		内蒙古瑞濠新材料科技有限公司(厂库)	1.3万吨	内蒙古丰镇市氟化工业园区西园区	15247465226
		豫新投资管理(上海)有限公司(厂库)	1万吨	河南省郑州市金水区未来路69号未来大厦2009C	13525661732
		中信寰球商贸(上海)有限公司(厂库)	1万吨	上海市浦东新区杨高南路799号陆家嘴世纪金融广场3号楼22层	13801639433
浙江永安资本管理有限公司(厂库)	0.4万吨	杭州市江干区新业路200号华锋国际32层	15801732007		
银河德睿资本管理有限公司(厂库)	5万吨	上海市虹口区东长治路359号一方大厦16楼	13601996589		

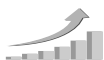


续表

品种	交易所	交割仓库	库容	地址	电话
PTA	郑商所	嘉兴石化有限公司 (仓库)	2 万吨	嘉兴市乍浦镇中山西路 388 号	0573 - 85539165
		嘉兴市海陆物流有限公司 (仓库)	2 万吨	嘉兴市乍浦经济开发区东方大道 133 号	0573 - 85826601
		恒力石化 (大连) 有限公司 (厂库)	10 万吨	辽宁省大连市长兴岛经济区长松路 299 号	15754088946
		荣盛石化股份有限公司 (仓库)	2 万吨	杭州市萧山区益农镇红阳路 98 号	0571 - 82526113
		逸盛大化石化有限公司 (厂库)	8 万吨	大连开发区海滨旅游路 262 号	0411 - 62777878
		江苏国望高科纤维有限公司 (仓库)	2 万吨	江苏省苏州市吴江区平望镇梅堰工业集中区	18101553100
		平湖华瑞仓储有限公司 (仓库)	2 万吨	浙江省平湖市独山港镇海涛路 88 号	0573 - 85656923
		张家港保税区外商投资服务有限公司 (仓库)	2 万吨	张家港保税区台湾路/物流园区东区	0512 - 58320352
		浙江逸盛石化有限公司 (厂库)	8 万吨	浙江省宁波市北仑区小港镇港口路 8 号	0574 - 86189180
		江苏海伦石化有限公司 (仓库)	2 万吨	江苏省江阴市临港新城利港镇润华路 20 号	0510 - 86093556
		江苏恒科新材料有限公司 (仓库)	2 万吨	江苏省南通市通州区五接镇恒力纺织产业园	0513 - 68655895
		张家港保税港区港务有限公司 (仓库)	2 万吨	江苏省张家港保税物流园区 (西区) 南京路 55 号	0512 - 58323199
		建发物流集团有限公司 (仓库)	2 万吨	浙江省平湖市独山港镇引港路 333 号	15859268576
		浙江嘉兴港物流有限公司 (仓库)	2 万吨	浙江平湖独山港镇海涛路 111 号	0573 - 85656898
		福建金纶高纤股份有限公司 (仓库)	2 万吨	福建省长乐市滨海工业区	0591 - 28518896
福建海裕石化有限公司 (厂库)	4 万吨	福建省漳州市古雷港经济开发区世纪金源 23 区商业 3 号楼	17689381954		
太仓新港物流管理中心有限公司 (仓库)	2 万吨	江苏省太仓市浮桥镇北环路 9 号	0512 - 53710805		

续表

品种	交易所	交割仓库	库容	地址	电话
PTA	郑商所	张家港保税区华瑞物流有限公司（仓库）	2万吨	张家港保税区福建南路	0512-56308901
		杭州临港物流有限公司（仓库）	2万吨	杭州市萧山区瓜沥镇临港工业园区	0571-83531810
		宁波保税区高新货柜有限公司（仓库）	2万吨	宁波保税西区创业6路6号	0574-87270612
		江阴市协丰棉麻有限公司（仓库）	2万吨	江阴市华西村华西商贸城（沿江高速华西出口处）	0510-86068600
		华润化学材料科技股份有限公司（仓库）	2万吨	春江镇圩塘新宇东路1号	0519-85177777
		厦门国贸物流有限公司（仓库）	2万吨	厦门市湖里区国贸中心南塔22楼	13906012532
		苏州港口张家港保税区现代物流有限公司（仓库）	2万吨	江苏省张家港保税区上海路18号/港城大道与沿江公路东50米	0512-58322391
玻璃	郑商所	山东巨润建材有限公司（厂库）	5.6万吨	山东省菏泽市巨野县巨野路1号	0530-8025867
		河北德金玻璃有限公司（厂库）	4万吨	河北省沙河市经济开发区纬三路26号	0319-8848168
		沙河市长城玻璃有限公司（厂库）	5万吨	河北省邢台市沙河市沙河经济开发区安全路6号	0319-8998111
		中玻新材料科技有限公司（厂库）	0万吨	山东省临沂市罗庄区付庄办事处驻地	010-69781066
		河北正大玻璃有限公司（厂库）	2万吨	河北省沙河市经济开发区纬二路9号	0319-8781001
		山东金晶科技股份有限公司（厂库）	3.6万吨	山东省淄博市高新区金晶大道204号	18653376729
		沙河市安全实业有限公司（厂库）	6万吨	河北省沙河市经济开发区安全路1号	0319-8840379
		湖北三峡新型建材股份有限公司（厂库）	4万吨	湖北省当阳市高新技术开发区车站路1号	15872504445
		武汉众恒创景新型材料有限公司（厂库）	3万吨	公司地址：武汉市汉阳区人信汇时代中心 提货地点1：沙河市正大玻璃工业园区A5-2西区 提货地点2：湖北省荆州市沙市区锣场镇达雅路10号，双方另有约定的除外	027-84703336

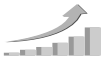


续表

品种	交易所	交割仓库	库容	地址	电话
玻璃	郑商所	浙江永安资本管理有限公司 (厂库)	3 万吨	公司地址: 浙江省杭州市江干区新业路 200 号 32 层 提货地点 1: 沙河市正大玻璃工业园区 A 车间 提货地点 2: 湖北省当阳市玉阳办事处和平村	0571 - 86871577
		滕州金晶玻璃有限公司 (厂库)	2.4 万吨	山东省滕州市鲍沟镇南沙河东站西厂区	18653376729
		沙洋弘润建材有限公司 (厂库)	4 万吨	湖北省荆门市沙洋县经济开发区洪岭大道 33 号	13908694163
		浙江杭实善成实业有限公司 (厂库)	2 万吨	浙江省杭州市上城区基金小镇二期甘水巷 15 号	15998229696
		河北金宏阳太阳能科技股份有限公司 (厂库)	2 万吨	河北省沙河市 S329 省道 116 号	15350857811
		武汉长利玻璃 (汉南) 有限公司 (厂库)	4 万吨	湖北省武汉市汉南经济开发区长利玻璃工业园	027 - 84738120
		石家庄玉晶玻璃有限公司 (厂库)	4 万吨	河北省石家庄市行唐县工业园区	15350857811
短纤	郑商所	江阴新伦化纤有限公司 (厂库)	2 万吨	江苏省江阴市周庄镇运伦路 18 号	18352580883
		江阴宏凯化纤有限公司 (厂库)	2 万吨	江苏省江阴市周庄镇澄鹿路 1108 号	13626237030 0510 - 86230078
		江苏华西村股份有限公司 (厂库)	2 万吨	江苏江阴华西村工业园泾浜路 88 号	15852590222 13915318945
		宿迁逸达新材料有限公司 (厂库)	2 万吨	江苏省宿迁市宿豫区京杭大道 1 号	18936926818
		浙江恒逸高新材料有限公司 (厂库)	1 万吨	浙江省杭州市钱塘新区临江高新技术产业园区恒捷路 169 号	18758860126
		福建省金纶高纤股份有限公司 (厂库)	2 万吨	福建省福州市长乐区滨海工业区	0591 - 28518896
		福建经纬新纤科技实业有限公司 (厂库)	1 万吨	福建省福州市福清市城头镇梁厝村 485 号	18666535122
		厦门同歆贸易有限公司 (厂库)	3 万吨	福建省厦门市湖里区仙岳路 4688 号国贸中心 A 塔	15260221773

续表

品种	交易所	交割仓库	库容	地址	电话
短纤	郑商所	中国石化仪征化纤有限责任公司(厂库)	2万吨	江苏省仪征市长江西路1号	13511721508
		苏州市相城区江南化纤集团有限公司(厂库)	1万吨	苏州市相城区黄埭镇春秋路8号江南大厦	13862580718
		福建逸锦化纤有限公司(厂库)	1万吨	福建省泉州市晋江市英林镇锦兴工业园(原加排盐场)	13967186686
		江苏德赛化纤有限公司(厂库)	1万吨	江苏省东台市站前路8号	18901411299
		青岛华亿诚物资有限公司(厂库)	1万吨	山东省青岛市市北区兴隆路7号丙	15806425473
		浙江永安资本管理有限公司(厂库)	3万吨	杭州市江干区新业路200号华峰国际商务大厦32层	13777869200
		浙江敦和实业有限公司(厂库)	1万吨	浙江省杭州市江干区新业路200号华峰国际30楼	15088689046
		浙江四邦实业有限公司(厂库)	1万吨	浙江省杭州市江干区钱江新城香樟街2号泛海国际A座32楼	15088617966
		厦门象屿物流集团有限责任公司(厂库)	1万吨	厦门市湖里区国际航运中心E座9楼	13860192991
		厦门建发轻工有限公司(厂库)	2万吨	福建省厦门市思明区环岛东路1699号建发国际大厦17楼	13806075106
		远大能源化工有限公司(厂库)	1万吨	宁波市鄞州区惊驾路555号泰富广场A座1308室	13586589746
		中基宁波集团股份有限公司(厂库)	1万吨	浙江省宁波市鄞州区天童南路666号中基大厦2405室	18668566166
		浙江杭实善成实业有限公司(厂库)	1万吨	浙江省杭州市上城区基金小镇2期甘水巷17号	18069863913
		豫新投资管理(上海)有限公司(厂库)	0.5万吨	河南省郑州市金水区未来路69号未来大厦20楼2009C室	18937157583
东海资本管理有限公司(厂库)	0.5万吨	上海市浦东新区樱花路868号建工大唐国际广场A座1803室	18701917642		
黄大豆1号	大商所	中央储备粮哈尔滨直属库有限公司	10万吨	黑龙江省哈尔滨市香坊区哈平路7.5公里处	0451-85865522 17603605655
		益海嘉里(哈尔滨)粮油食品工业有限公司	10万吨	黑龙江省哈尔滨市平房开发区哈平东路10号	15663819060



续表

品种	交易所	交割仓库	库容	地址	电话
黄大豆1号	大商所	中央储备粮绥棱直属库有限公司	5万吨	黑龙江省绥化市绥棱县绥棱镇繁华大街364号	0455-4658012 15114503520
		维维东北食品饮料有限公司	5万吨	黑龙江省绥化市经济开发区	0455-7860029 15505163366 13845511532
		海伦阔海粮油有限公司	5万吨	黑龙江省海伦市北环路十八道线原燃料公司院内	0455-5755335 13845557665
		黑龙江龙田仓储加工有限公司	5万吨	黑龙江省绥棱县工业园区(龙田路)	13194119119
		桦南县宏安粮油贸易有限公司	5万吨	黑龙江省佳木斯市桦南县双果路中段	0454-6639666 13845492555
		讷河象屿农产有限公司	5万吨	黑龙江省讷河工业园区	15350909099
		中粮华粮物流集团讷河国家粮食储备库有限公司	5万吨	黑龙江省讷河市大兴路路北	13845280333
		齐齐哈尔军粮储备库有限公司	5万吨	黑龙江省齐齐哈尔市梅里斯达斡尔族区齐富路军粮储备库(伊利对面)	18704526866
		黑龙江省北安农垦九三粮食收储有限公司	5万吨	黑龙江省哈尔滨市长江路386号九三大厦1401室	0451-55559265 19969936580
		北安象屿金谷农产有限责任公司	5万吨	黑龙江省北安市北安健康产业园	18520870265
		黑龙江省华贺农业科技发展有限公司	5万吨	黑龙江省北安市东环路绿色产业园	18745557288
		绥滨县盛中农业发展有限公司	5万吨	黑龙江省鹤岗市绥滨县绥滨镇松滨街东段北侧(11委)	15998615305
		九三集团嫩江九三粮食收储有限公司	5万吨	黑龙江省嫩江市九三局直23委	13694577645
		中央储备粮大杨树直属库有限公司	5万吨	内蒙古自治区呼伦贝尔市鄂伦春自治旗大杨树镇综合物流园	0470-5716691 18604707695
		黑龙江省大兴安岭地区行署粮食局大杨树粮库	5万吨	内蒙古自治区鄂伦春自治旗大杨树镇大杨树粮库	0470-5710095 13191307779
		黑龙江源发粮食物流有限公司	5万吨	黑龙江省绥化市青冈县	13845591177
中央储备粮敦化直属库有限公司	5万吨	吉林省敦化市渤海街自由路2号	0433-6256605 18626969901		

续表

品种	交易所	交割仓库	库容	地址	电话
黄大豆1号	大商所	大连良运集团储运有限公司	5万吨	辽宁省大连市甘井子区新水泥路2号	0411-88101455 13387871220
		辽宁港口股份有限公司	5万吨	辽宁省大连市开发区海洋路1号	0411-87598516 18698737136 15542507019
		中国船舶工业物资大连有限公司	5万吨	辽宁省大连市中山区长江路48号	15941179917
		中国华粮物流集团北良有限公司	10万吨	辽宁省大连开发区海青岛柳柴沟	0411-39898625 13352267392
		中央储备粮大连直属库有限公司	10万吨	辽宁省大连市甘井子区华北路286号	0411-86537018 15542419366
黄大豆2号	大商所	辽宁港口股份有限公司	5万吨	辽宁省大连市开发区海洋路1号	0411-87598516 18698737136 15542507019
		中国华粮物流集团北良有限公司	5万吨	辽宁省大连开发区海青岛柳柴沟	0411-39898855
		中国华粮物流集团南通粮油接运有限责任公司	5万吨	江苏南通市任港路62号	0513-83508460
		青岛港国际股份有限公司(大港库区)	10万吨	山东青岛市港青路6号	0532-82982898
		青岛港国际股份有限公司(董家口港区)		山东省青岛市黄岛区董家口港区港润大道88号	0532-82985376
		江苏省江海粮油集团有限公司	5万吨	张家港市金港镇宝岛路1号	025-84799546 13505148861
		上海良友新港储运有限公司	3万吨	上海市浦东新区东靖路5755号	021-50188376
		九三集团大连大豆科技有限公司	2.2万吨	辽宁省大连保税区北良港内	13766878810
		秦皇岛金海粮油工业有限公司	3.7万吨	河北省秦皇岛市海港区海滨路35号	0335-3097174
		中储粮镇江粮油有限公司	4.5万吨	江苏省镇江市京口区谏壁镇粮山村	13861350613
		嘉吉粮油(南通)有限公司	4.5万吨	江苏省南通市经济技术开发区同兴路1号	021-33327845
		中粮(东莞)粮油工业有限公司		广东省东莞市麻涌镇新沙公园路11号	0769-8976999-8130 13928922223



续表

品种	交易所	交割仓库	库容	地址	电话
黄大豆2号	大商所	莞路易达孚饲料蛋白有限公司	4.5万吨	广东省东莞市麻涌镇新沙港科技工业园区	0769-82922441 0769-88280667(F) 13501500286
		江苏省江海粮油集团有限公司	1万吨	江苏张家港市金港镇宝岛路1号	025-84798952 025-84799258(F) 13814005151
豆粕	大商所	中国华粮物流集团南通粮油接运有限责任公司	1万吨	江苏南通市任港路62号	0513-85159255 13951411759
		南京铁心桥国家粮食储备库有限公司	1万吨	江苏省南京市栖霞区石埠桥河西里1号	025-52350799 13851421688
		中粮东海粮油工业（张家港）有限公司	6万吨	江苏省张家港市金港镇东海路1号	0512-58389121 0512-58388235(F) 15250388220
		江苏汇福蛋白科技有限公司	4.5万吨	江苏省泰州市高港区永安洲镇疏港北路西侧	18358580993 15295210819
		嘉吉粮油（南通）有限公司	3.75万吨	江苏省南通市经济技术开发区同兴路	0513-85966028 0513-85966001(F) 15996649791
		益海（泰州）粮油工业有限公司	3万吨	江苏省泰州市高港区永安洲镇疏港北路	15817320321
		张家港江海粮油工业有限公司	2.7万吨	江苏张家港市金港镇宝岛路1号	025-84798952 025-84799258(F) 13814005151
		中储粮镇江粮油有限公司	1.8万吨	江苏省镇江市谏壁镇粮山村	0511-81996632/ 81996644 0511-81996630(F) 15051116866/ 13861350613
		中粮（东莞）粮油工业有限公司	2.88万吨	广东省东莞市麻涌镇新沙公园路11号	0769-8976999 -8130 13928922223
		东莞市富之源饲料蛋白开发有限公司	2.25万吨	广东省东莞市洪梅镇疏港大道1号	0769-88436102 15889630185

续表

品种	交易所	交割仓库	库容	地址	电话
豆粕	大商所	东莞路易达孚饲料蛋白有限公司	2.25 万吨	广东省东莞市麻涌镇新沙港科技工业园区	0769 - 82922441 0769 - 88280667(F) 13501500286
		中纺粮油(湛江)工业有限公司	2.25 万吨	广东省湛江市霞山区湖光路5号	13828296856
		中粮新沙粮油工业(东莞)有限公司	2 万吨	广东省东莞市麻涌镇新沙港	0769 - 8976999 - 8130 0769 - 89768671(F) 13928922223
		中储粮油脂工业东莞有限公司	1.8 万吨	广东省东莞市麻涌镇新沙港后工业区	0769 - 88236688 - 8708 0769 - 88230288(F) 13829107932
		嘉吉粮油(阳江)有限公司	1.8 万吨	广东省阳江市阳江港沿港大道3-6号	0769 - 88239723 82661733 0769 - 88239556(F) 13826169279 13068864504
		东莞嘉吉粮油有限公司	1.5 万吨	广东省东莞市麻涌镇新沙工业园区	0769 - 88239723 82661733 0769 - 88239556(F) 13826169279 13068864504
		东莞嘉吉饲料蛋白科技有限公司	1.2 万吨	广东省东莞市麻涌镇新沙港科技工业园区	0769 - 88239723 82661733 0769 - 88239556(F) 13826169279 13068864504
		益海(连云港)粮油工业有限公司	4.8 万吨	江苏省连云港市墟沟大港路	0518 - 82387266 0518 - 82387206(F) 13971088817
		中粮黄海粮油工业(山东)有限公司	3 万吨	山东省日照市岚山港北	0633 - 2639066 0633 - 2639065(F) 15863352882

附录G
统计数据

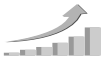


续表

品种	交易所	交割仓库	库容	地址	电话
豆粕	大商所	中纺粮油(日照)有限公司	2.025万吨	山东省日照市海滨五路157号	0633-2166057 0633-2166277(F) 13082792588
		邦基三维油脂有限公司	1.5万吨	山东省日照市经济开发区海滨五路	0633-3988280 0633-3988810(F) 13506336735
		九三集团天津大豆科技有限公司	4.5万吨	天津市天津港保税区新港大道266号	022-66271999 19969938648
		邦基正大(天津)粮油有限公司	3万吨	天津经济技术开发区洞庭路149号	022-66889712 15122183887
		京粮(天津)粮油工业有限公司	2.025万吨	天津滨海新区临港经济区渤海四十路1306号	022-25618318 022-25618380(F) 18512212718
		中粮佳悦(天津)有限公司	2.025万吨	天津市滨海新区临港经济区渤海40路510号	022-60271081 022-60271028(F) 13602031376
		路易达孚(天津)食品科技有限责任公司	2.025万吨	天津市滨海新区临港经济区渤海四十路2068号	022-59855777 022-59855711(F) 010-59655127
		中粮油脂(钦州)有限公司	6万吨	广西壮族自治区钦州市钦州港建港路39号	13828296856
		大海粮油工业(防城港)有限公司	4.5万吨	广西壮族自治区防城港市港口区出海大道一号	0770-6130719 13907700504
		广西惠禹粮油工业有限公司	4.5万吨	广西壮族自治区防城港市粮油食品产业园	13766878810
豆油	大商所	泰州市过船港务有限公司(本库区)	4万吨	江苏省泰兴市经济开发区疏港路二号	0523-87918055 13327793535
		泰州市过船港务有限公司(中苏储库区)		江苏省泰兴市经济开发区长江中路8号	
		中储粮镇江粮油有限公司	3万吨	江苏省镇江市谏壁镇粮山村	0511-81996632 81996644 0511-81996630(F) 15051116866 13861350613

续表

品种	交易所	交割仓库	库容	地址	电话
豆油	大商所	江苏省江海粮油集团有限公司	3万吨	江苏省张家港市金港镇宝岛路1号	025-84798952 025-84799258(F) 13814005151
		益海(泰州)粮油工业有限公司	3万吨	江苏省泰州市高港区永安洲镇疏港北路	15817320321
		南京铁心桥国家粮食储备库有限公司	2万吨	江苏省南京市栖霞区石埠桥河西里1号	025-52350799 025-52890972(F) 13851421688
		中国华粮物流集团南通粮油接运有限责任公司	2万吨	江苏南通市任港路62号	0513-85159255 0513-85159255(F) 13951411759
		仪征益江粮油工业有限公司	2万吨	江苏省扬州化学工业园区油港路1号	0514-83299316 0514-83296139(F) 18724093168
		中央储备粮天津保税区直属库有限公司	3万吨	天津自贸试验区(天津港保税区)海滨六路29号	022-66275025 022-66275001(F) 13516139177
		中粮佳悦(天津)有限公司	3万吨	天津市滨海新区临港经济区渤海40路510号	022-60271081 022-60271028(F) 13602031376
		京粮(天津)粮油工业有限公司	2万吨	天津滨海新区临港经济区渤海四十路1306号	022-25618319 25618378 022-2561830(F) 18512212721 18202202963
		秦皇岛金海粮油工业有限公司	2万吨	河北省秦皇岛市海港区滨海路35号丙码头	0335-3097174 0335-3094342(F) 15903354582
		中央储备粮日照仓储有限公司	4万吨	山东省日照市海滨五路139号	0633-3699219 0633-3699226(F) 13356337661
中粮东海粮油工业(张家港)有限公司	4.5万吨	江苏省张家港市金港镇东海路1号	0512-58389121 0512-58388235(F) 15250388220		



续表

品种	交易所	交割仓库	库容	地址	电话
豆油	大商所	嘉吉粮油(南通)有限公司	1.5万吨	江苏省南通市经济技术开发区同兴路	0513-85966028(O) 0513-85966001(F) 15996649791
		金光食品(宁波)有限公司	1.5万吨	浙江省宁波市北仑区黄河北路1号	0574-86888188-6800 0574-86886931(F) 15957458120
		嘉里粮油(天津)有限公司	3万吨	天津港保税区津滨大道95号	15122436809
		路易达孚(天津)食品科技有限责任公司	2.25万吨	天津滨海新区临港经济区渤海四十路2068号	15102245018
		九三集团天津大豆科技有限公司	1.5万吨	天津港保税区新港大道266号	022-66271999 19969938648
		邦基正大(天津)粮油有限公司	1.5万吨	天津经济技术开发区洞庭路149号	022-66889712 15122183887
		河北嘉好粮油有限公司	1.5万吨	河北省沧州市渤海新区黄骅港综合大港一号港池	18902141069 13516119706
		益海(连云港)粮油工业有限公司	3万吨	江苏省连云港市墟沟大港路	0518-82388336 13605133363
		中纺粮油(日照)有限公司	1.5万吨	山东省日照市海滨五路157号	0633-2166057 0633-2166277(F) 13082792588
		中粮黄海粮油工业(山东)有限公司	1.2万吨	山东省日照市岚山港北	0633-2639066 0633-2639065(F) 15863352882
		中粮油脂(龙口)有限公司	1.2万吨	山东省龙口市开发区新港路39号	0535-8857927 0535-8857325(F) 15318223655
		邦基三维油脂有限公司	0.9万吨	山东省日照市经济开发区海滨五路	0633-3988280 0633-3988810(F) 13506336735
		中储粮油工业东莞有限公司	1.5万吨	广东省东莞市麻涌镇新沙港工业园	0769-88236688-8708 0769-88230288(F) 13829107932

续表

品种	交易所	交割仓库	库容	地址	电话
豆油	大商所	中粮（东莞）粮油工业有限公司	1.5 万吨	广东省东莞市麻涌镇新沙公园路11号	0769-8976999 -8130 0769-89768671(F) 13928922223
		益海（广州）粮油工业有限公司	1.5 万吨	广东省广州经济技术开发区东江大道2号	020-66252580 13725350607
		东莞路易达孚饲料蛋白有限公司	1.35 万吨	广东省东莞市麻涌镇漳澎村新沙工业园区港中路	0769-82922438 0769-88280667(F) 13790569984
		东莞嘉吉粮油有限公司	1.2 万吨	广东省东莞市麻涌镇新沙工业区	0769-81296177 0769-88239703(F) 18928787426
		中粮油脂（钦州）有限公司	3 万吨	广西壮族自治区钦州市钦州港建港路39号	13828296856
		大海粮油工业（防城港）有限公司	3 万吨	广西壮族自治区防城港市港口区出海大道一号	0770-6130719 13907700504
		广西惠禹粮油工业有限公司	3 万吨	广西壮族自治区防城港市粮油食品产业园	13766878810
玉米	大商所	中国华粮物流集团北良有限公司	10 万吨	大连经济技术开发区海青岛柳柴沟	13352267392 13591323025
		辽宁港口股份有限公司	5 万吨	辽宁省大连市开发区海洋路1号	15542507019 18698737136
		中国船舶工业物资大连有限公司	5 万吨	大连市中山区长江路48号	13841177052 15941179917
		中央储备粮大连直属库有限公司	10 万吨	大连市甘井子区华北路286号	13940870679 15604112692
		锦州港股份有限公司	5 万吨	锦州经济技术开发区锦港大街一段1号	13604166961 18841604000
		辽宁锦州锦阳粮食储备有限公司	5 万吨	锦州经济技术开发区兴海路西段	13840661236 18841605533
		大连良运集团储运有限公司	5 万吨	大连市甘井子区新水泥路2号	15541177083 13387871220
		中储粮（辽宁）储运有限公司	5 万吨	营口市鲅鱼圈区钱塘江路西段（新港大厦）	13940706883 13147936099



续表

品种	交易所	交割仓库	库容	地址	电话
玉米	大商所	营口中远海运百丰泰物流有限公司	5万吨	营口市鲅鱼圈区运河北路	13842602986 18004113330
		辽宁粮食物流有限公司	5万吨	辽宁省营口市鲅鱼圈区芦屯镇四台子工业园	15940773757 15698714442
		路易达孚(上海)有限公司	9万吨	中国(上海)自由贸易试验区西里路55号6层605室	13840853673 15940952925
		浙江杭实能源服务有限公司	9万吨	浙江省杭州市江干区香樟路2号泛海国际A座31楼	18273401827 13989878090
		中粮贸易有限公司	9万吨	北京市东城区建国门内大街8号中粮广场A座12层	13795183022 18811405290
		大连象屿农产有限公司	9万吨	大连市中山区港兴路6号富力中心	13354283081 13604251026
		中粮贸易有限公司-中粮松原库区	5万吨	吉林松原市西郭尔罗斯大路578号	13904343822 13604380985
		中粮贸易有限公司-中粮榆树库区	5万吨	吉林长春五棵树经济开发区东风大街1号	13120205555 13901256625
		中粮贸易有限公司-中粮江阴库区	3万吨	江苏省江阴市萧山路5号	15161655068 13795183022
		中粮贸易有限公司-潍坊中粮库区	3万吨	山东省潍坊市滨海区森达美物流园内	13789875605 13795183022
		维维食品饮料股份有限公司-维维东北公司库区	5万吨	黑龙江省绥化市经济开发区	15505163366 13845511532
		维维食品饮料股份有限公司-维维产业园粮食库区	3万吨	江苏省徐州市铜山区张集镇维维产业园粮库	18745557288 15152147808
		浙江省农村发展集团有限公司-辽北库区	5万吨	辽宁省开原市兴开街偏坡台村	13591093244 13958151919
		浙江省农村发展集团有限公司-浙江镇海库区	3万吨	镇海区招宝山街道后海塘(平海路888号)	18888968886 18857975554
		嘉吉投资(中国)有限公司	5万吨	吉林省松原市江南工业开发区	13512140931 13894998966
吉林云天化农业发展有限公司	5万吨	吉林省松原市长岭县太平川镇五区二段	19997046118 18604453266		
厦门象屿股份有限公司-绥化象屿库区	10万吨	黑龙江省绥化市张维镇	13936251758 18714756077		

续表

品种	交易所	交割仓库	库容	地址	电话
玉米	大商所	厦门象屿股份有限公司 - 青岛速传库区	2.1 万吨	山东省青岛市黄岛区七星河路363号	18906397857 13791956181
		陕西粮农集团有限责任公司 - 陕粮农开鲁库区	5 万吨	内蒙古通辽市开鲁县义和塔拉镇核心村	13363910986 13659197966
		陕西粮农集团有限责任公司 - 陕粮杨凌库区	1.5 万吨	陕西省咸阳市杨陵区康乐东路	18220680893 17792293572
		河北省粮食产业集团有限公司 - 公主岭禾丰库区	5 万吨	吉林省公主岭市公伊路98号	13803117865 15144422229
		河北省粮食产业集团有限公司 - 冀粮永安库区	3 万吨	河北省石家庄市藁城区永安路18号	13630826092 15332123837
		北京京粮粮油贸易集团有限公司	5 万吨	黑龙江省绥化市青冈县	18645589711 13845591177
玉米 淀粉	大商所	中粮生化能源(榆树)有限公司	3 万吨	吉林省长春五棵树开发区东风大街1号	13120205555 18844008811
		中粮生化能源(公主岭)有限公司	3 万吨	吉林省公主岭市河南大街2887号	13694499977 13120205555
		嘉吉生化有限公司	2 万吨	吉林省松原市经济技术开发区江南工业园区裕丰街2888号	14743828004 13512140931
		辽宁益海嘉里地尔乐斯淀粉科技有限公司	2.5 万吨	辽宁省铁岭市开原市北环路19号	15941031775 15041006309
		保龄宝生物股份有限公司	2 万吨	山东省禹城市高新开发区东外环路1号	13305342372 15805442688
		山东中谷淀粉糖有限公司	2 万吨	山东省乐陵市经济技术开发区星光工业园	15065444001 15266964303
		山东福洋生物科技股份有限公司	3 万吨	山东省平原县经济技术开发区东区	13905447706 18753481115
		诸城兴贸玉米开发有限公司	3.6 万吨	山东省诸城市东环路385号	15964596167 13515364034
		山东福宽生物工程有限公司	0.9 万吨	山东省肥城市高新技术产业开发区工业三路	13375487117 18801129769
		临清德能金玉米生物有限公司	4.05 万吨	山东省临清市南环路东首	13884820636 13562665199
中粮生化能源(龙江)有限公司	1.5 万吨	黑龙江省龙江县白山工业园区内	13359731989 13120205555		



续表

品种	交易所	交割仓库	库容	地址	电话
玉米 淀粉	大商所	玉锋实业集团有限公司	1.5 万吨	河北省宁晋县西城工业区	15227664625 13931905277
		潍坊盛泰药业有限公司	0.75 万吨	山东省昌乐开发区方山路 1202 号	13940916511 13792654395
		黑龙江龙凤玉米开发有限公司	6 万吨	黑龙江省绥化市青冈县青安公路 2.5 公里处	15964596167 15265612777
		北安象屿金谷生化科技有限公司	3 万吨	黑龙江省黑河市北安健康产业园	15245085198 13945141264
		富锦象屿金谷生化科技有限公司	2.1 万吨	黑龙江富锦经济开发区锦城路 一号	17790050677 15765431817
		黑龙江昊天玉米开发有限公司	1.8 万吨	黑龙江绥化市经济技术开发区天 山路 1 号	18045515555 13351356677
		益海嘉里(富裕)生物科技有限公司	2.5 万吨	黑龙江省齐齐哈尔市富裕县经济 开发区塔哈综合产业园区	15214458345 13895961442
		京粮龙江生物工程有限公司	3.3 万吨	黑龙江省绥化市青冈县中央大街 西段消防大队对过	13370652535 15764559995
		青岛港国际股份有限公司	5 万吨	山东省青岛市港青路 6 号	0532 - 82982898
		营口中远海运百丰泰物流有限公司	5 万吨	营口市鲅鱼圈区运河北路	13842602986 18004113330
棕榈油	大商所	中储粮油脂工业东莞有限公司	4 万吨	广东省东莞市麻涌镇新沙港后工 业区	0769 - 88236688 - 8708 13829107932
		中粮新沙粮油工业(东莞)有限公司	3 万吨	广东省东莞市麻涌镇新沙港	0769 - 8976999 - 8130 13928922223
		益海(广州)粮油工业有限公司	3 万吨	广州经济技术开发区东江大道 2 号	020 - 66252580 13826117915
		东莞嘉吉粮油有限公司	2 万吨	广东省东莞市麻涌镇新沙港工 业区	0769 - 81296177 18928787426
		远大油脂(东莞)有限公司	2 万吨	广东省东莞市麻涌镇文武涌路 5 号	021 - 61806028 13535200818
		益海(泰州)粮油工业有限公司	3 万吨	江苏省泰州市高港区永安洲镇疏 港北路	15817320321

续表

品种	交易所	交割仓库	库容	地址	电话
棕榈油	大商所	江苏省江海粮油集团有限公司	2 万吨	江苏省张家港市金港镇宝岛路 1 号	025 - 84798952 13814005151
		中储粮镇江粮油有限公司	2 万吨	江苏省镇江市谏壁镇粮山村	0511 - 81996632 13861350613
		嘉吉粮油（南通）有限公司	2 万吨	江苏省南通市经济技术开发区同兴路 1 号	0513 - 89101810 (O) 15962968657
		仪征益江粮油工业有限公司	1 万吨	江苏省扬州化学工业园区油港路 1 号	0514 - 83299316 18724093168
		泰州市过船港务有限公司	1 万吨	江苏省泰兴市经济开发区疏港路 二号	0523 - 87918055 13327793535
		中粮佳悦（天津）有限公司	3 万吨	天津市滨海新区临港经济区渤海 40 路 510 号	022 - 60271081 13602031376
		中央储备粮天津保税区直属库有限公司	2 万吨	天津自贸试验区（天津港保税区）海滨六路 29 号	022 - 66275025 13516139177
		嘉里粮油（天津）有限公司	1 万吨	天津港保税区津滨大道 95 号	15122436809
		路易达孚（天津）食品科技有限责任公司	1 万吨	天津市滨海新区临港经济区渤海 四十路 2068 号	022 - 59855777 010 - 59655127
		广州植之元油脂实业有限公司	1.5 万吨	广州市南沙区万顷沙镇万环西路 新安工业园	020 - 87520888 13928981444
		中粮东海粮油工业（张家港）有限公司	2.4 万吨	江苏省张家港市金港镇东海路 1 号	0512 - 58389121 15250388220
		新实力食品科技（南京）有限公司	1.5 万吨	江苏省南京市栖霞取疏港路 1 号 龙潭物流基地内	18651909711
		仪征方顺粮油工业有限公司	1.2 万吨	江苏省仪征市油港路 3 号	0514 - 83299628 13773360371
春金（天津）油脂有限公司	1.5 万吨	天津市滨海新区临港经济区洛河 道 288 号	022 - 66336598 18522743656		
鸡蛋	大商所	大连韩伟养鸡有限公司	1 050 吨	辽宁省大连市旅顺口区三涧堡镇 东泥河村	13840844621
		德州和膳生态农业有限公司	300 吨	山东省德州市宁津县宁津镇注赵 村南	13361021557
		湖北神丹健康食品有限公司	1 050 吨	湖北省孝感市安陆解放大道东 3 号	027 - 87399611 13607155272



续表

品种	交易所	交割仓库	库容	地址	电话
鸡蛋	大商所	苏州欧福蛋业股份有限公司	150 吨	江苏省苏州吴江区金家坝社区金贤路 386 号	0512 - 63206111 18621612023
		铜川春蕾绿色禽业有限公司	450 吨	陕西省铜川市印台区周陵农业科技示范区	0919 - 7681315 15667966009
		丰城圣迪乐村生态食品有限公司	375 吨	江西省丰城市梅林镇低山村	0795 - 6281306 15179509922
		山西晋龙养殖股份有限公司	750 吨	山西省稷山县化峪镇吴疰村村东	0359 - 5521114 18903595851
		四川圣迪乐村生态食品股份有限公司	150 吨	河北省沧州市泊头市经济开发区 (四川圣迪乐村生态食品股份有限公司沧州分公司)	15130792337
		山西平遥国青禽业股份有限公司	150 吨	山西省平遥县岳壁乡梁村	13453416646
		湖北鑫盛农牧股份有限公司	150 吨	湖北省石首市东方大道徐家铺	13407133298
		赵县昌晟源蛋鸡养殖专业合作社	150 吨	河北省石家庄市赵县大郝庄	13832190635
		德州壹号食品有限公司	750 吨	山东省德州市临邑县德平镇南 2 公里	18605341250
		四川省绿科禽业有限公司	375 吨	四川省南充市顺庆区	18121931603
		吉林金翼蛋品有限公司	750 吨	吉林省辽源市安恕镇曲家村一组	15044079430
		宁夏顺宝现代农业股份有限公司	375 吨	宁夏吴忠市青铜峡市邵刚镇甘城子村	13895475490
四川省乐山市明仕农业发展有限公司	375 吨	四川省乐山市沙湾区太平镇沫江村 1 组	13880378962		
四川厚全生态农业有限公司	750 吨	四川省夹江县吴场镇百茶村周冲三组 (原三洞镇周冲三组)	15520712856		
新绛县首山惠农蛋鸡养殖有限公司	375 吨	山西省运城市新绛县北张镇北董村	18935086071		
胶合板	大商所	天津全程物流配送有限公司	3 000 平方米	天津市西青经济开发区兴华十支路 7 号	022 - 60805914
		镇江惠龙长江港务有限公司	3 000 平方米	江苏省镇江市金桥大道 88 号	0511 - 85938558
		江苏奔牛港务集团有限公司	3 000 平方米	江苏省常州市新北区奔牛镇奔牛港	0519 - 68850505
		浙江省国际贸易集团物流有限公司	3 000 平方米	浙江省嘉兴市塘汇镇铁路站内	0571 - 85778718

续表

品种	交易所	交割仓库	库容	地址	电话
胶合板	大商所	浙江尖峰国际贸易有限公司	5 000 平方米	浙江省金华市金东经济开发区 B 区	0579 - 82382768
		平湖华瑞仓储有限公司	5 000 平方米	浙江省平湖市独山港镇海涛路 88 号	0571 - 83786752
纤维板	大商所	广西高峰五洲人造板有限公司	6 000 立方米	广西南宁市兴宁区五塘镇六塘	18078719986
		广西得力木业开发有限公司	7 500 立方米	广西隆安县那桐镇华侨管理区富侨大道 23 号	13768448978
		封开县威利邦木业有限公司	7 500 立方米	广东省肇庆市封开县长岗镇旺村管理区	13827512030
		绿洲森工(淮南)有限公司	4 500 立方米	安徽省淮南市寿县正阳关镇南堤村	13817861686
		江苏奔牛港务集团有限公司	3 000 立方米	江苏省常州市新北区奔牛镇奔牛港	0519 - 68850505
		镇江惠龙长江港务有限公司	3 000 立方米	江苏省镇江市金桥大道 88 号	0511 - 85938558
粳米	大商所	益海(佳木斯)粮油工业有限公司	0.9 万吨	黑龙江省佳木斯市东风区松兴路	15946682898 13836659992
		维维汤旺河生态农业有限公司	0.9 万吨	黑龙江省佳木斯市汤原县香兰镇	13805215666 18305217999
		黑龙江瓮福人和米业有限公司	0.9 万吨	黑龙江省鹤岗市萝北县宝泉岭经济开发区南外环路 3 号	15645849555 15545929888
		黑龙江六水香生态农业有限公司	0.9 万吨	黑龙江省齐齐哈尔市泰来县工业园区	0452 - 8897999 - 8004 13114668399
		黑龙江清龙米业有限公司	0.9 万吨	黑龙江省齐齐哈尔市依安县依明公路西侧 47#	13766086999 13946246051
		黑龙江雪那红米业有限公司	0.9 万吨	黑龙江省佳木斯市同江市建三江前进农场场直	15331966888 13512690916
		黑龙江益华米业有限公司	0.9 万吨	黑龙江省佳木斯市富锦市建三江分局七星分公司第二管理区 11 生产区	13945493083 13329558656
		中粮米业(大连)有限公司	0.9 万吨	辽宁省大连市保税区海洋路 6 号	13904087819 18641107978



续表

品种	交易所	交割仓库	库容	地址	电话
粳米	大商所	中国华粮物流集团北良有限公司	3 万吨	大连经济技术开发区海青岛柳柴沟	0411 - 39898625
		锦州港股份有限公司	3 万吨	锦州经济技术开发区锦港大街一段1号	0416 - 3586990 18841604000
		黑龙江省富油嘉宝农业科技有限公司	0.9 万吨	黑龙江省佳木斯市富锦市建三江分局创业农场工业园区	13394577890
LLDPE (线型 低密度 聚乙烯)	大商所	中储发展股份有限公司(浦东分公司)	2 万吨	上海市奉贤区平宇路 585 路	021 - 57543295 021 - 37123030
		上海远盛仓储有限公司	3 万吨	上海市虹口区曲阳路 900 号 3 号楼 225 室	021 - 61806028 021 - 61806025
		上港集团物流有限公司	2.5 万吨	上海市宝山区安达路 240 号	021 - 56445090 021 - 56440120
		上海象屿速传供应链有限公司	2 万吨	上海市黄浦区南苏州路 999 号象屿大厦 8 楼	021 - 56010175 021 - 56010110
		中国外运华东有限公司	3 万吨	上海市宝山区逸仙路 4188 号	021 - 63221003 021 - 56445300
		国家粮食和物资储备局浙江局八三七处	2 万吨	浙江省宁波市镇海区大通路 331 号	0574 - 86370854
		浙江省国际贸易集团物流有限公司	3.5 万吨	杭州市体育场路 229 号	0571 - 85779792 0571 - 85778718
		杭州临港物流有限公司	7 万吨	杭州萧山区瓜沥镇临港工业园区瓜港西路 309 号	0571 - 83786752 0571 - 83531810
		浙江尖峰国际贸易有限公司	4 万吨	浙江省金华市金义都市新区常春西路 88 号	0579 - 82382768 0579 - 82977115
		浙江铁道畅兴物流有限公司	2 万吨	浙江省湖州市长兴县综合物流园区铁路南货场	0571 - 56129118 0571 - 56129118
		台州传化洲镗公路港物流有限公司	2 万吨	浙江省台州市黄岩区院桥镇兴华路西段 166 号	0576 - 84506666 0576 - 89199091
		平湖华瑞仓储有限公司	5 万吨	浙江省平湖市独山港镇海涛路 88 号	0571 - 83786752 0573 - 85656921
		江苏奔牛港务集团有限公司	7.5 万吨	江苏省常州市新北区奔牛镇奔牛港行政办公楼	0519 - 83133012
江苏燕进联运有限公司	2 万吨	江苏省常州市新北区罗溪镇塑化路 25 - 1 号	0519 - 83519583		

续表

品种	交易所	交割仓库	库容	地址	电话
LLDPE (线型 低密 度聚 乙烯)	大商所	中国物资储运广州有限公司	3 万吨	广州市黄埔区黄埔东路 268 号怡港大厦 A 座 905-910 室	020-82299020 020-82285893
		广州市川金路物流有限公司	3 万吨	广东省广州市萝岗区开发大道 1330 号综合楼 101-102 房	020-32289663 020-32289962
		江苏正盛仓储物流有限公司	3 万吨	江苏省南通市海安经济开发区晓星大道 105 号	0513-80688188
		青州中储物流有限公司	8 万吨	山东省青州市玲珑山北路 638 号	0536-3288768 0536-3309571
		国投山东临沂路桥发展有限责任公司	1 万吨	山东省临沂市河东区华阳路中段	0539-8097506
		青岛中外运供应链管理有限公司	2 万吨	山东省青岛市保税港区莫斯科路 46 号	0532-86760715
		临沂中储供应链有限公司	2 万吨	临沂市河东经济开发区凤仪街 700 号	0539-7703909
		青岛中远海运物流供应链有限公司	2 万吨	青岛市高新区宝源路 789 号	0532-82850296 0411-82513517
		中储发展股份有限公司(大场分公司)	3.5 万吨	上海市宝山区南大路 257	021-56681101 021-36520019
		宁波保税区高新货柜有限公司	5 万吨	宁波保税西区创业 6 路 6 号	0574-86818951 0574-86818951
		镇江中远海运仓储发展有限公司	2 万吨	镇江市新区大港通港路 130 号	0511-88803902 0411-82513517
		金发科技股份有限公司	2.5 万吨	广州市高新技术产业开发区科学城科丰路 33 号	020-66221551 020-66221450
		广东柏亚供应链股份有限公司	2 万吨	汕头市南澳路 283 号柏亚日化工业园	0754-86708898 0754-86708835
		中国石油天然气股份有限公司(重庆仓储中心)	1.5 万吨	重庆市沙坪坝区土主镇土主中路 199 号附 1-443	023-65761203
		南储仓储管理集团有限公司	2 万吨	佛山市禅城区佛罗公路 166 号	0757-88015030 0757-8801512071
北京迅邦润泽物流有限公司	1 万吨	北京市房山区燕山东流水工业区 7 号	010-81361679 010-81361662		
天津全程物流配送有限公司	4.5 万吨	天津市东丽区华粮道 2298 号	022-60805914		



续表

品种	交易所	交割仓库	库容	地址	电话
LLDPE (线型 低密 度聚 乙烯)	大商所	天津开发区泰达公共保税仓 有限公司	1.5 万吨	天津经济技术开发区渤海路 39 号	022-59858176 022-59856558- 8002
		天津中储陆通物流有限公司	2 万吨	天津市北辰区陆路港物流装备产 业园四经支路 1 号	022-58986670 022-58986805
		四联创业集团股份有限公司	1.8 万吨	北京市房山区燕山东流水工业区 7 号	0571-81992979
		浙江文德进出口有限公司	0.45 万吨	浙江省杭州市滨江区滨盛路双城 国际 1 号楼 26 楼	0571-870249
		浙江明日控股集团股份有限 公司	0.69 万吨	浙江省杭州滨江泰安路 199 号农 资大厦 1703	0571-87661418
		物产中大化工集团有限公司	0.75 万吨	浙江省杭州市下城区中山北路中 大广场 A 座 2905 室	0571-88278637
		浙江杭实善成实业有限公司	0.9 万吨	浙江省杭州市上城区甘水巷 15 号	0571-85301632
		厦门象屿物流集团有限责任公司	0.9 万吨	福建省厦门现代物流园区象屿路 99 号厦门国际航运中心 E 栋 9 层 02 单元	0592-2639953
		浙江前程石化股份有限公司	0.54 万吨	浙江省宁波市鄞州区和源路 510 号宁兴国贸大厦 18 楼	0574-87780904
		浙江四邦实业有限公司	0.225 万吨	杭州市上城区香樟街 2 号泛海国 际 A 座 33 楼	0571-87662657
		道恩集团有限公司	2.175 万吨	山东省龙口市经济开发区东首	0535-8867752
PP (聚丙 烯)	大商所	中储发展股份有限公司(浦 东分公司)	2 万吨	上海市奉贤区平宇路 585 路	021-57543295 021-37123030
		上海远盛仓储有限公司	3 万吨	上海市虹口区曲阳路 900 号 3 号 楼 225 室	021-61806028 021-61806025
		上港集团物流有限公司	2.5 万吨	上海市宝山区安达路 240 号	021-56445090 021-56440120
		上海象屿速传供应链有限 公司	2 万吨	上海市黄浦区南苏州路 999 号象 屿大厦 8 楼	021-56010175 021-56010110
		中国外运华东有限公司	3 万吨	上海市宝山区逸仙路 4188 号	021-63221003 021-56445300
		国家粮食和物资储备局浙江 局八三七处	2 万吨	浙江省宁波市镇海区大通路 331 号	0574-86370854

续表

品种	交易所	交割仓库	库容	地址	电话
PP (聚丙烯)	大商所	浙江省国际贸易集团物流有限公司	3.5万吨	杭州市体育场路229号	0571-85779792 0571-85778718
		杭州临港物流有限公司	7万吨	杭州萧山区瓜沥镇临港工业园区瓜港西路309号	0571-83786752 0571-83531810
		浙江尖峰国际贸易有限公司	4万吨	浙江省金华市金义都市新区常春西路88号	0579-82382768 0579-82977115
		浙江铁道物兴物流有限公司	2万吨	浙江省湖州市长兴县综合物流园区铁路南货场	0571-56129118 0571-56129118
		台州传化洲隍公路港物流有限公司	2万吨	浙江省台州市黄岩区院桥镇兴华路西段166号	0576-84506666 0576-89199091
		平湖华瑞仓储有限公司	5万吨	浙江省平湖市独山港镇海涛路88号	0571-83786752 0573-85656921
		江苏奔牛港务集团有限公司	7.5万吨	江苏省常州市新北区奔牛镇奔牛港行政办公楼	0519-83133012
		江苏燕进联运有限公司	2万吨	江苏省常州市新北区罗溪镇塑化路25-1号	0519-83519583
		中国物资储运广州有限公司	3万吨	广州市黄埔区黄埔东路268号怡港大厦A座905-910室	020-82299020 020-82285893
		广州市川金路物流有限公司	3万吨	广东省广州市萝岗区开发大道1330号综合楼101-102房	020-32289663 020-32289962
		江苏正盛仓储物流有限公司	3万吨	江苏省南通市海安经济开发区晓星大道105号	0513-80688188
		青州中储物流有限公司	8万吨	山东省青州市玲珑山北路638号	0536-3288768 0536-3309571
		国投山东临沂路桥发展有限责任公司	1万吨	山东省临沂市河东区华阳路中段	0539-8097506
		青岛中外运供应链管理有限公司	2万吨	山东省青岛市保税港区莫斯科路46号	0532-86760715
		临沂中储供应链有限公司	2万吨	临沂市河东经济开发区凤仪街700号	0539-7703909
		青岛中远海运物流供应链有限公司	2万吨	青岛市高新区宝源路789号	0532-82850296 0411-82513517
中储发展股份有限公司(大场分公司)	3.5万吨	上海市宝山区南大路257	021-56681101 021-36520019		



续表

品种	交易所	交割仓库	库容	地址	电话
PP (聚丙烯)	大商所	宁波保税区高新货柜有限公司	5 万吨	宁波保税西区创业 6 路 6 号	0574 - 86818951 0574 - 86818951
		镇江中远海运仓储发展有限公司	2 万吨	镇江市新区大港通港路 130 号	0511 - 88803902 0411 - 82513517
		金发科技股份有限公司	2.5 万吨	广州市高新技术产业开发区科学城科丰路 33 号	020 - 66221551 020 - 66221450
		广东柏亚供应链股份有限公司	2 万吨	汕头市南澳路 283 号柏亚日化工业园	0754 - 86708898 0754 - 86708835
		中国石油天然气股份有限公司(重庆仓储中心)	1.5 万吨	重庆市沙坪坝区土主镇土主中路 199 号附 1 - 443	023 - 65761203
		东华能源(宁波)新材料有限公司	1.8 万吨	浙江省宁波市大榭开发区东港北路 6 号	025 - 86771277
		东华能源(张家港)新材料有限公司	0.9 万吨	江苏省张家港市保税区出口加工区东华路 668 号	0512 - 35027805
		四联创业集团股份有限公司	0.9 万吨	北京市房山区燕山东流水工业区 7 号	0571 - 81992979
		浙江永安资本管理有限公司	1.05 万吨	浙江省杭州市江干区兴业路 200 号华峰国际 32 楼	0571 - 88370927
		浙江明日控股集团股份有限公司	1.14 万吨	浙江省杭州滨江泰安路 199 号农资大厦 1703	0571 - 87661418
		浙江杭实善成实业有限公司	0.9 万吨	浙江省杭州市上城区甘水巷 15 号	0571 - 85301632
		厦门象屿物流集团有限责任公司	0.975 万吨	福建省厦门现代物流园区象屿路 99 号厦门国际航运中心 E 栋 9 层 02 单元	0592 - 2639953
		浙江前程石化股份有限公司	0.54 万吨	浙江省宁波市鄞州区和源路 510 号宁兴国贸大厦 18 楼	0574 - 87780904
		浙江四邦实业有限公司	0.225 万吨	杭州市上城区香樟街 2 号泛海国际 A 座 33 楼	0571 - 87662657
		道恩集团有限公司	1.05 万吨	山东省龙口市经济开发区东首	0535 - 8867752
中化石化销售有限公司	3.95 万吨	上海市长宁区虹桥路 1438 号古北财富中心二期 20 楼	021 - 62781706		
福建中景石化有限公司	4 万吨	福建省福州市福清市江阴镇工业区福建中景石化有限公司办公楼 3 层	0591 - 83229002		

续表

品种	交易所	交割仓库	库容	地址	电话
PVC (聚氯乙烯)	大商所	中储发展股份有限公司(浦东分公司)	2万吨	上海市奉贤区平宇路585路	021-57543295 021-37123030
		上海远盛仓储有限公司	3万吨	上海市虹口区曲阳路900号3号楼225室	021-61806028 021-61806025
		上港集团物流有限公司	5万吨	上海市宝山区安达路240号	021-56445090 021-56440120
		上海象屿速传供应链有限公司	2万吨	上海市黄浦区南苏州路999号象屿大厦8楼	021-56010175 021-56010110
		上海中外运张华浜储运有限公司	1万吨	上海市宝山区逸仙路4188号	021-66783019
		国家粮食和物资储备局浙江局八三七处	2万吨	浙江省宁波市镇海区大通路331号	0574-86256059
		浙江省国际贸易集团物流有限公司	5万吨	杭州市体育场路229号	0571-85779792 0571-85778718
		杭州临港物流有限公司	7万吨	杭州萧山区瓜沥镇临港工业园区瓜港西路309号	0571-83786752 0571-83531810
		浙江尖峰国际贸易有限公司	4万吨	浙江省金华市金义都市新区常春西路88号	0579-82382768 0579-82977115
		浙江铁道畅兴物流有限公司	2万吨	浙江省湖州市长兴县综合物流园区铁路南货场	0571-56129118 0571-56129118
		台州传化洲隍公路港物流有限公司	2万吨	浙江省台州市黄岩区院桥镇兴华路西段166号	0576-84506666 0576-89199091
		平湖华瑞仓储有限公司	5万吨	浙江省平湖市独山港镇海涛路88号	0571-83786752 0573-85656921
		江阴市协丰棉麻有限公司	5万吨	江苏省江阴市华西村商贸城物流园	0510-86068518 0510-86060500
		江苏奔牛港务集团有限公司	5万吨	江苏省常州市新北区奔牛镇奔牛港行政办公楼	0519-83133012
		江苏燕进联运有限公司	2万吨	江苏省常州市新北区罗溪镇塑化路25-1号	0519-83519583
江苏正盛仓储物流有限公司	3万吨	江苏省南通市海安经济开发区晓星大道105号	0513-80688188		
中国物资储运广州有限公司	3万吨	广州市黄埔区黄埔东路268号怡港大厦A座905-910室	020-82299020		

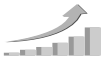


续表

品种	交易所	交割仓库	库容	地址	电话
PVC (聚氯乙烯)	大商所	广州市川金路物流有限公司	3 万吨	广东省广州市萝岗区开发大道 1330 号综合楼 101 - 102 房	020 - 32289663 020 - 32289962
		南储仓储管理集团有限公司	2 万吨	佛山市禅城区佛罗公路 166 号	0757 - 88015030 0757 - 88015120
		上海中泰多经国际贸易有限责任公司	2.1 万吨	上海市长宁区江苏路华敏翰尊国际 长宁区延安西路 726 号	021 - 52217295
		浙江永安资本管理有限公司	1.05 万吨	浙江省杭州市江干区兴业路 200 号华峰国际 32 楼	0571 - 88398250
		浙江明日控股集团股份有限公司	0.69 万吨	浙江省杭州滨江泰安路 199 号农 资大厦 1703	0571 - 87663035
		物产中大化工集团有限公司	0.75 万吨	浙江省杭州市下城区中山北路中 大广场 A 座 2905 室	0571 - 88278633
		浙江特产石化有限公司	2.1 万吨	浙江省杭州市萧山区三益线万丰 大厦	0571 - 87827082
		厦门象屿物流集团有限责任公司	0.6 万吨	福建省厦门现代物流园象屿路 99 号厦门国际航运中心 E 栋 9 层 02 单元	0592 - 5603777
		内蒙古鄂尔多斯电力冶金集团 股份有限公司	0.3 万吨	内蒙古鄂尔多斯市鄂托克旗棋盘 井镇电冶大厦	0477 - 2286144
		张家港保税区天泰国际贸易 有限责任公司	0.6 万吨	张家港市石化交易大厦 804 室	0831 - 5980847
苯乙烯	大商所	南通阳鸿石化储运有限公司	2 万吨	如皋市长江镇堤顶路 65 号	0513 - 87688067
		江阴华西化工码头有限公司	2 万吨	江阴市临港新城石庄办事处诚信 路 1 号	0510 - 86668562
		常州宏川石化仓储有限公司	5 万吨	常州市新北化工园区龙江北路 1585 号	0519 - 81697028
		南通千红石化港储有限公司	3 万吨	南通市经济技术开发区通盛南路 6 号	0512 - 52192368
		江苏利士德化工有限公司	2 万吨	江阴市利港镇双良路 28 号	0510 - 86630287
		东莞市百安石化仓储有限 公司	2 万吨	东莞市沙田镇立沙岛石化基地	0769 - 89985678 - 761
		东莞三江港口储罐有限公司	2 万吨	东莞市虎门港立沙大道 15 号	0769 - 82914516
		常熟千红石化港储有限公司	2 万吨	常熟经济技术开发区滨江路 8 号	0512 - 52192368
		江苏丽天石化码头有限公司	5 万吨	江苏省无锡市江阴市利港镇润华 路 9 号	0510 - 86092189

续表

品种	交易所	交割仓库	库容	地址	电话
苯乙烯	大商所	中海壳牌石油化工有限公司	0.9 万吨	广东省惠州市大亚湾石化园区	18219596777
		新阳科技集团有限公司	3 万吨	常州市新北区春江镇龙江北路1569号	15861865556
		江阴市金桥化工有限公司	1.8 万吨	江苏省江阴市澄江中路118号国贸大厦10楼	0510-86409651
		宁波镇海炼化利安德化学有限公司	1.2 万吨	浙江省宁波市镇海区蛟川街道镇浦路2188号	13586795429
		远大能源化工有限公司	2.7 万吨	浙江省宁波市惊驾路555号泰富广场A座13楼	13566632188
		宁波中哲物产有限公司	1.8 万吨	浙江省宁波市南部商务区泰星巷9号合和国际大厦南楼6楼	13757446706
		中基宁波集团股份有限公司	0.9 万吨	浙江省宁波市天童南路666号中基大厦	18668566166
		浙江四邦实业有限公司	1.8 万吨	浙江省杭州市香樟街2号泛海国际A座33楼	15868457119
		浙江浙期实业有限公司	0.9 万吨	浙江省杭州市西湖区天目山路198号财通双冠大厦东楼9层	17302195783
		浙江敦和实业有限公司	1.5 万吨	浙江省杭州市上城区新业路200号华峰国际30楼	0571-88336767
		浙江杭实善成实业有限公司	1.5 万吨	浙江省杭州市上城区甘水巷15号	13806676820
		厦门国贸石化有限公司	1.8 万吨	厦门市湖里区仙岳路4688号国贸中心A栋	13482474768
		恒力能源(苏州)有限公司	3 万吨	江苏省苏州工业园区苏州中心广场88幢2301	13385309773
宁波杉杉能化有限公司	0.9 万吨	浙江省宁波市鄞州区南部商务区杉杉大厦6楼	15258119721		
中化石化销售有限公司	5.7 万吨	上海市长宁区虹桥路1438号古北财富中心二期20楼	18916080519		
焦煤	大商所	天津港交易市场有限责任公司	40 万吨	天津自贸试验区(东疆保税港区)海铁三路199号	022-25703089 13323399839
		江苏连云港港口股份有限公司	20 万吨	连云港市连云区鑫港大厦2212室	0518-82389267 13605132219



续表

品种	交易所	交割仓库	库容	地址	电话
焦煤	大商所	日照港股份有限公司	70 万吨	山东省日照市日照港国贸大厦 1905 室	0633 - 8382589 13656338817
		青岛港国际股份有限公司	100 万吨	青岛市港寰路 58 号业务与信息化部	0532 - 82982050 13805428892
		唐山港京唐港区进出口保税储运有限公司	50 万吨	唐山海港开发区港兴大街 (7 号路) 以南、海平路 (10 号路) 以西 (保税物流中心办公楼三层)	0315 - 2916385 13931521582
		曹妃甸港集团有限公司	50 万吨	河北省唐山市曹妃甸工业区弘毅码头 815 室	0315 - 8853422 13932553335
		天津物产进出口贸易有限公司	5 万吨	天津市南开区华苑智慧山东塔 19 层	13622000614
		中铝内蒙古国贸有限公司	6 万吨	内蒙古巴彦淖尔市临河区五一街百替文博大厦 A 座 10 层	021 - 68903930
		山西美锦煤焦化有限公司	9.6 万吨	山西省太原市杏花岭区府西街 92 号天隆仓大厦 13 层	13663516797
		河钢集团北京国际贸易有限公司	6 万吨	北京市朝阳区建国路甲 92 号世茂大厦	15033936170
焦炭	大商所	天津港交易市场有限责任公司	100 万吨	天津自贸试验区 (东疆保税港区) 海铁三路 199 号	022 - 25703089 13323399839
		江苏连云港港口股份有限公司	8 万吨	连云港市连云区鑫港大厦 2212 室	0518 - 82389267 13605132219
		日照港股份有限公司	60 万吨	山东省日照市上海路东段日照港国贸中心 3 楼	0633 - 8389023 18806339218
		中钢国际货运有限公司	8 万吨	天津开发区第三大街 51 号滨海金融街西区 W5 - C1 - 5	010 - 62688285 13901382998
		青岛港国际股份有限公司	60 万吨	青岛市港寰路 58 号业务与信息化部	0532 - 82982050 13805428892
		唐山港京唐港区进出口保税储运有限公司	50 万吨	唐山海港开发区港兴大街 (7 号路) 以南、海平路 (10 号路) 以西 (保税物流中心办公楼三层)	0315 - 2925650 15930525518
		曹妃甸港集团有限公司	50 万吨	河北省唐山市曹妃甸工业区弘毅码头 815 室	0315 - 8853429 15127509006

续表

品种	交易所	交割仓库	库容	地址	电话
焦炭	大商所	天津物产进出口贸易有限公司	5 万吨	天津市南开区华苑智慧山东塔 19 层	13622000614
		中铝内蒙古国贸有限公司	6 万吨	内蒙古巴彦淖尔市临河区五一街百替文博大厦 A 座 10 层	021 - 68903930
		河北旭阳能源有限公司	9 万吨	河北省定州市定曲路	13661397215
		山西美锦煤焦化有限公司	6.6 万吨	山西省太原市杏花岭区府西街 92 号天隆仓大厦 13 层	15903467668
		山西宏安焦化科技有限公司	2.4 万吨	山西省太原市平阳路 126 号安泰大厦 20 层	18636083421
		迁安市宏奥工贸有限公司	4.5 万吨	河北省迁安市太平庄乡崇家峪村南	0315 - 7026698 15931532110
		山西阳光焦化集团股份有限公司	4.5 万吨	山西省河津经济技术开发区西区 1 号	0359 - 5770516 18435985999
		徐州伟天化工有限公司	3 万吨	铜山区利国镇马元村	0516 - 61888286 13775889906
		唐钢美锦（唐山）煤化工有限公司	3 万吨	滦县司家营循环经济园区	0315 - 5035006 18713865831
		河北华丰能源科技发展有限公司	4.5 万吨	河北省武安市磁山镇二街	0310 - 5898985 19931008826
		山东兖矿国际焦化有限公司	3 万吨	山东省济宁市兖州区国际大道 1 号	18053701566
		山西亚鑫能源集团有限公司	3 万吨	山西省太原市长治路阳光国际 A 座 22 层	0351 - 5256112 18536665599
		孝义市鹏飞实业有限公司	4.5 万吨	山西省吕梁孝义市振兴街与中和路交叉口鹏飞总部	13920289878
		河北中煤旭阳能源有限公司	3 万吨	河北省邢台市襄都区晏家屯镇石相村西	13661397215
		山西华鑫煤焦化实业集团有限公司	3 万吨	吕梁市交城县奈林村西口	021 - 65390055 18335819823
迁安市九江煤炭储运有限公司	3 万吨	迁安市上射雁庄乡平青大公路西侧	13703370951 0315 - 7957651		
铁矿石	大商所	天津港交易市场有限责任公司	100 万吨	天津自贸试验区（东疆保税港区）海铁三路 199 号	022 - 25703089 13323399839
		江苏连云港港口股份有限公司	20 万吨	连云港市连云区鑫港大厦 2212 室	0518 - 82389267 13605132219



续表

品种	交易所	交割仓库	库容	地址	电话
铁矿石	大商所	日照港股份有限公司	90 万吨	山东省日照市日照港国贸大厦 1905 室	0633 - 8382589 13656338817
		青岛港国际股份有限公司	300 万吨	青岛市港寰路 58 号业务与信息化部	0532 - 82982050 13805428892
		唐山港京唐港区进出口保税储运有限公司	50 万吨	唐山海港开发区港兴大街 (7 号路) 以南、海平路 (10 号路) 以西 (保税物流中心办公楼三层)	0315 - 2916471 15081925688
		曹妃甸港集团有限公司	100 万吨	河北省唐山市曹妃甸工业区弘毅码头 815 室	0315 - 8853429 15127509006
		唐山曹妃甸实业港务有限公司	50 万吨	唐山曹妃甸工业区唐山曹妃甸实业港务有限公司	0315 - 8821176 18633131983
		山东岚桥港有限公司	30 万吨	日照市岚山区滨海路 66 号	0633 - 2660308 13963309198
		河北钢铁集团矿业有限公司	20 万吨	河北唐山建设北路 81 号	0315 - 2793187 15081656960
		江苏沙钢国际贸易有限公司	60 万吨	江苏省张家港市锦丰镇沙钢大厦 605	021 - 68599779 - 688 15951186618
		瑞钢联集团有限公司	70 万吨	北京市东城区朝阳门北大街 1 号新保利大厦 23 层	010 - 84193799 13911201973
		中钢德远矿产品有限公司	20 万吨	北京市海淀区海淀大街 8 号 32 层	010 - 62686693 13693546961
		杭州热联集团股份有限公司	35 万吨	杭州市江干区富春路丹桂街 8 号汉嘉国际 35 楼	0571 - 88388196 13588473296
		山东华信工贸有限公司	15 万吨	山东省日照市东港区山海路 99 号	0633 - 8367880 18863376363
		鞍钢股份有限公司	20 万吨	辽宁省鞍山市铁东区团结街 42 号	0412 - 6304143 13322119492
		嘉吉迈拓金属贸易 (上海) 有限公司	60 万吨	上海市徐汇区淮海中路 999 号上海环贸广场一期 10 楼	021 - 33327131 13818925388
		河钢集团北京国际贸易有限公司	60 万吨	北京市朝阳区建国路甲 92 号世茂大厦	010 - 85898607 17600107507
天津物产能源资源发展有限公司	45 万吨	天津市河北区王串场街金东里 43 门二层	022 - 58896031 13920110996		

续表

品种	交易所	交割仓库	库容	地址	电话
铁矿石	大商所	中信金属股份有限公司	60 万吨	北京市朝阳区新源南路 6 号京城大厦 1903 室	010 - 59661967 13581819435
		敬业钢铁有限公司	15 万吨	河北省平山县南甸镇	0311 - 82870539
		沧州中铁装备制造材料有限公司	15 万吨	河北省沧州市黄骅港开发区	010 - 63705151 - 8333 15120013363
		浙江物产金属集团有限公司	15 万吨	杭州市凤起路 78 号	0571 - 85271258 15700084115
		厦门国贸集团股份有限公司	55 万吨	福建省厦门市湖里区仙岳路 4688 号国贸中心 2801 单元	0592 - 5863224 13959257161
		浙江永安资本管理有限公司	15 万吨	浙江省杭州市江干区新业路 200 号华峰国际 32 楼	0571 - 87150538 18958042842
		善成资源有限公司	15 万吨	宁波保税区兴农大厦 206 室	0571 - 86060922 18258185870
		宝矿国际贸易有限公司	10 万吨	上海市裕通路 100 号宝矿洲际商务中心 55 - 56 楼	021 - 32529920 13816677801
		天津建龙钢铁实业有限公司	40 万吨	北京市南四环西路 188 号总部基地 15 区 2 号楼	010 - 83941558 15801386268
		河北东海特钢集团有限公司	40 万吨	中国河北省唐山市滦州市茨榆坨工业园区	0315 - 7560909 15931519348
		湖南华菱资源贸易有限公司	20 万吨	湖南省长沙市天心区湘府西路 222 号华菱嘉园写字楼 4 楼	17708464899
		本钢板材股份有限公司	20 万吨	辽宁省本溪市平山区人民路 16 号	024 - 42224508 18841498101
		宝钢资源控股(上海)有限公司	60 万吨	上海市浦东新区世博大道 1859 号宝武大厦 1 号楼 12 楼	021 - 35880276 18101886795
		河北津西钢铁集团股份有限公司	40 万吨	河北省唐山市迁西县三屯营镇东	18131599928
		大连港散货物流中心有限公司	55 万吨	大连经济技术开发区新港大连港矿石码头公司	0411 - 87595577 13604250299
青岛港国际股份有限公司	20 万吨	青岛市港寰路 58 号业务与信息化部	0532 - 82982050 13805428892		
乙二醇	大商所	张家港保税区长江国际港务有限公司	70 万吨	张家港保税物流园西区南京路	0512 - 58387580
		太仓阳鸿石化有限公司	3 万吨	江苏省苏州市太仓市浮桥镇浏家港镇石化路 1 号	0512 - 53370193



续表

品种	交易所	交割仓库	库容	地址	电话
乙二醇	大商所	南通阳鸿石化储运有限公司	2万吨	如皋市长江镇堤顶路65号	0513-87688019
		南通千红石化港储有限公司	4万吨	南通经济技术开发区通盛南路6号	0513-85991146
		洋山中港国际石油储运有限公司	6万吨	洋山深水港东港区	021-20939056
		江阴恒阳化工储运有限公司	3万吨	江苏省江阴市石庄镇恒阳路1号	0510-86668811
		常州宏川石化仓储有限公司	8万吨	常州新北工业园龙江北路1585号	0519-81697028
		常熟宏川石化仓储有限公司	4万吨	常熟经济开发区沿江工业园建业路2号	0512-52654831
		常熟千红石化港储有限公司	5万吨	常熟经济技术开发区滨江路8号	0512-52192368
		常熟市东联仓储有限公司	3万吨	江苏省常熟经济技术开发区建业路4号	0512-52654283
		宁波宁兴液化储运有限公司	8万吨	宁波市镇海区威远路111号	0574-27695504
		东莞三江港口储罐有限公司	2万吨	东莞市虎门港立沙大道15号	0769-82914516
		张家港保税区长江国际扬州石化仓储有限公司	3万吨	江苏扬州仪征化学工业园区中化路3号	0514-83211602
		东莞市百安石化仓储有限公司	2万吨	广东东莞市沙田镇立沙岛	0769-89985678-761
		江苏长江石油化工有限公司	3万吨	江苏省太仓市太仓港港口开发区滨江南路8号	0512-53719630
		江苏恒科新材料有限公司	3万吨	江苏省南通市通州滨江新区(五接镇)恒力纺织新材料产业园	0513-68655846
		中海壳牌石油化工有限公司	2万吨	广东省惠州市大亚湾石化园区	020-22398901
		中基宁波集团股份有限公司	4.5万吨	浙江省宁波市天童南路666号中基大厦	18668566166
		远大能源化工有限公司	6万吨	宁波市鄞州区惊驾路555号泰富广场A座1308室	13805849702
		浙江永安资本管理有限公司	6万吨	浙江省杭州市上城区新业路200号华峰国际32层	13777869200
		连云港石化有限公司	3万吨	连云港市徐圩新区复堆河路西150米	13705736122
		浙江前程石化股份有限公司	4.5万吨	浙江省宁波市鄞州区和源路510号宁兴国贸大厦18-19楼	0574-87780904
物产中大化工集团有限公司	1.5万吨	浙江省杭州市拱墅区中山北路中大广场A座2912室	13588180968		

续表

品种	交易所	交割仓库	库容	地址	电话
乙二醇	大商所	浙江恒逸国际贸易有限公司	6 万吨	杭州市萧山区市心北路 260 号南岸明珠办公楼	13588180968
		厦门国贸石化有限公司	6 万吨	厦门市湖里区仙岳路 4688 号国贸中心 A 栋 20 楼	17816895589
		福建百宏聚纤科技实业有限公司	2 万吨	福建省晋江市龙湖镇枫林工业区	13959297590
		浙江三江化工新材料有限公司	1.5 万吨	浙江省嘉兴市海盐经济开发区滨海大道 1 号 3 幢 301 室	13306998233
		中化石化销售有限公司	4.5 万吨	上海市长宁区虹桥路 1438 号古北财富中心二期 20 楼	18916080519
LPG (液化石油气)	大商所	海洋石油阳江实业有限公司	1.6 万吨	阳江市江城区平冈镇大魁管理区墩波至咀头地段	0662 - 3828364
		东莞市九丰能源有限公司	6 万吨	广东省东莞市沙田镇立沙岛作业区立沙大道 16 号	13925892021
		广州华凯石油燃气有限公司	2 万吨	广东省广州市南沙区环市大道北 1 号广州华凯石油燃气有限公司	020 - 28650599
		江门市新江煤气有限公司	0.5 万吨	江门市新会区古井镇的官冲乡牛牯岭	13760620711
		广东中石油昆仑液化气有限公司	2.4 万吨	汕头市濠江区塔头库区	13502755058
		潮州市欧华能源有限公司	5.6 万吨	广东省潮州市饶平县所城镇龙湾村红螺山东侧	0768 - 2863931
		物产中大化工集团有限公司	5 万吨	浙江省嘉兴市平湖市独山港镇白沙路 333 号	0571 - 88278637
		万华化学(烟台)石化有限公司	6 万吨	山东省烟台市开发区大季家镇包头路万华化学工业园	18953568967
		广西中油能源有限公司	2 万吨	广西防城港市港口区东部吹填区	0770 - 2805010
		福建华星石化有限公司	2.4 万吨	福建省泉州市泉港区上西村	13116110976
		福州中民新能源有限公司	6 万吨	福建省福州市福清市江阴镇工业区福建中景石化科技园	13338415050
		宁波百地年液化石油气有限公司	6 万吨	浙江省宁波市大榭开发区关外路 1 号	13776569198
		广西天盛港务有限公司	6 万吨	钦州港经济开发区果鹰大道鹰岭作业区	15366151577
浙江卫星能源有限公司	2.4 万吨	浙江嘉兴平湖兴港路 1 号	13511368761		

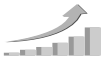


续表

品种	交易所	交割仓库	库容	地址	电话
LPG (液化石油气)	大商所	东华能源股份有限公司	6 万吨	张家港保税区出口加工区东华路668 号	15366151502
		山东京博石油化工有限公司	4.8 万吨	山东省滨州市博兴经济开发区	15066988903
		山东神驰石化有限公司	4.2 万吨	山东省东营市东营港经济开发区港北三路南, 港西二路西	15254619195
		青岛运达石油化工有限公司	4.8 万吨	龙口市环海路 24 号	18553300111
		浙江中燃华电能源有限公司	3.2 万吨	浙江省温州市洞头区	0577 - 56610010
		福化工贸(漳州)有限公司	3.4 万吨	福建省漳州市古雷港经济开发区古雷镇下林路 17 号	17689381954
		宁波中金石化有限公司	1.2 万吨	浙江省宁波市镇海区宁波石化经济技术开发区荣盛路 1 号	0574 - 86688806
		江阴市金桥化工有限公司	3 万吨	江苏省靖江市新港园区敦土路南首	0510 - 86409601
		宁波齐鲁新化能源科技有限公司	2.4 万吨	山东省青岛市黄岛区青岛港董家口港区	18017342538
		东营联合石化有限责任公司	5 万吨	东营市东营港经济开发区港西二路以东, 港北二路以北	13561096056
		中化弘润石油化工有限公司	6 万吨	山东省青州市开发区弘润工业园弘润厂区内	15953665703
		上海煜驰进出口有限公司	4.2 万吨	浙江省宁波市北仑区戚家山街道宏源路 168 号	13051177206
		江苏斯尔邦石化有限公司	6 万吨	江苏省连云港市徐圩新区港前大道 398 号	13701785351
		金能化学(青岛)有限公司	5.4 万吨	山东省青岛市西海岸新区董家口化工园区双星北路与钢厂西路交叉口	18660409693
浙江麦堆科技股份有限公司	2.4 万吨	浙江省嘉兴市乍浦镇雅山西路 988 号	0573 - 85587663		
中化石油(海南)有限公司	3.36 万吨	海南省洋浦经济开发区新英湾区洋浦保税区陆侨国际海产品产业园 1 号楼第 8 层 802 室	18965551719		
生猪	大商所	牧原食品股份有限公司	2 400 吨	河南省南阳市卧龙区龙升工业园区 G312 牧原集团	15214544737
		湖北钟祥牧原养殖有限公司	3600 吨	湖北省钟祥市旧口镇大王庙村	17739507756
		安徽颍上牧原农牧有限公司	2 400 吨	安徽省阜阳市颍上县经开区高速出口南 200 米	19156528850

续表

品种	交易所	交割仓库	库容	地址	电话
生猪	大商所	正阳牧原农牧有限公司	2 400 吨	河南省驻马店市正阳县西三环路	18623776773
		安乡牧原农牧有限公司	1 200 吨	湖南省常德市安乡县深柳镇华南新村 6 组	19971332070
		四川牧原农牧有限公司	720 吨	四川省成都市金堂县桔园路 214 号	18081066379
		邛崃牧原养殖有限公司	720 吨	四川省成都市邛崃市高埂街道火星村冷河湾	18292487515
		南昌牧原农牧有限公司	720 吨	江西省南昌市南昌县晶科广场 13 楼	18679658690
		湖北石首牧原农牧有限公司	720 吨	湖北省荆州市石首市横沟市镇 220 省道石首牧原项目部	19171658262
		亳州温氏畜牧有限公司	1 200 吨	安徽省亳州市涡阳县楚店镇李楼行政村	13655671766
		三台新希望农牧科技有限公司	1 200 吨	四川省绵阳市三台县芦溪镇学府街 47 号	15010355992 18989279918
		夏津新希望六和农牧有限公司	1 200 吨	山东省德州市夏津县西外环电子商务产业园	15010355992 18253468362
		南京新牧农牧有限公司	720 吨	南京市高淳区经济开发区汶溪路 127 号南京洲城科技园 5 栋 2 楼	15010355992 15092918316
		邳州正大食品有限公司	720 吨	江苏省徐州市邳州市炮车镇滨湖大道南太湖大道西	13615129799
		泗阳双胞胎畜牧有限公司	1 200 吨	江苏省宿迁市泗阳县南刘集乡花井村	18911243126 18170800334
		灵璧双胞胎泰峰畜牧有限公司	720 吨	安徽省宿州市灵璧县虞姬乡灵璧双胞胎泰峰畜牧有限公司	18911243126 18170800334
		中粮家佳康（江苏）有限公司	1 200 吨	江苏省盐城市东台市弶港镇	13756099995 18751437911
		中粮家佳康（河南）有限公司	1 200 吨	河南省商丘市永城市图书馆六楼	13756099995 13598390963
		中粮家佳康（盐城）有限公司	1 200 吨	江苏省盐城市响水县大有镇	13756099995 18751437911
		武汉中粮肉食品有限公司	720 吨	湖北省武汉市江夏区山坡街新生村	13377876073
中粮家佳康（张北）有限公司	2 400 吨	河北省张家口市张北县经济开发区燕北路 10 号	17792813894 13051093475		

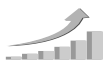


续表

品种	交易所	交割仓库	库容	地址	电话
生猪	大商所	中粮家佳康(赤峰)有限公司	2400吨	内蒙古自治区赤峰市翁牛特旗乌丹镇民禾加气站西北角	15655238661 18747179942
		江安德康生猪养殖有限公司	1200吨	四川省宜宾市江安县江安镇308省道鸿国现代物流园4-1-22号	13402800235 18628123338
		常熟德康农牧有限公司	1200吨	苏州市常熟市海虞镇海阳路31号	13402800235 18015626678
		泸州德康农牧科技有限公司	1200吨	叙永县叙永镇和平社区绕城大道801号川滇黔商贸城B区15单元4层4号	13402800235 17683001777
		渠县德康生猪养殖有限公司	1200吨	四川省达州市渠县平翔汽贸3楼	13402800235 15340505770
		泗洪德康农牧科技有限公司	2400吨	江苏省宿迁市泗洪县沙家浜路2号	13402800235 15252864667
		湖北三匹畜牧科技有限公司	1200吨	湖北省安陆市巡店镇傲农集团安陆养猪运营中心	13886534699
		宿迁市立华牧业有限公司	1200吨	江苏省宿迁市沭阳县李恒镇汤涧现代农业产业园	13806113287 15956707016
		湖南龙华农牧发展有限公司	1680吨	湖南省株洲市茶陵县金星村16组	15096316262 18073336669
		南乐美神养殖有限公司	1200吨	河南省濮阳市南乐县千口镇南仇庄村北350米	18072252359 13393957660
		丰镇市大红门农牧科技有限公司	1200吨	内蒙古乌兰察布市丰镇市巨宝庄镇西十八台村	15511978686 15640909827
		赤城县大红门科技牧业有限公司	1200吨	河北省张家口市赤城县雕鄂镇黎家堡村	15640909827 15033671597
		河南万东牧业有限公司	1200吨	漯河市城乡一体化示范区姬石镇韩庄	18839520055 18839538060
		叶县双汇牧业有限公司	1200吨	叶县夏李乡国营畜牧场院内	18839562791 18839538060
		武汉市江夏区金龙畜禽有限责任公司	1200吨	湖北省武汉市江夏区大桥新区侨亚国际大厦24层	15972966026
		汝南天康宏展农牧科技有限公司	1200吨	河南省郑州市郑东新区商务外环路29号国泰财富中心	15515794888 18749775977
正康(义乌)猪业有限公司	720吨	浙江省义乌市义亭镇绿发农业开发有限公司(正康猪业办公室)	15650513936 15857949741		

续表

品种	交易所	交割仓库	库容	地址	电话
工业硅	广期所	中储发展股份有限公司（仓库）	1 万吨	上海市宝山区宝杨路 2069 号	18916601995 15900771013
			1 万吨	上海市宝山区南大路 137 号	15021007591 13512161593
			5 000 吨	上海市宝山区南大路 310 号	15021007591 13512161593
		中远海运物流有限公司（仓库）	5 000 吨	上海市宝山区宝杨路 2249 号	15928043608 18681352659
		厦门象屿速传供应链发展股份有限公司（仓库）	1 万吨	上海市宝山区长建路 505 号	15021224863 17717238817
		上海远盛仓储有限公司（仓库）	1 万吨	上海市宝山区蕙川路 2508 号	13901816119 13671698424
		中储发展股份有限公司（仓库）	1 万吨	江苏省无锡市新吴区城南路 32 - 1 号	18921287700 18362331065
		中国物流股份有限公司（仓库）	1 万吨	江苏省常州市新北区罗溪镇通达路 2 号	13921033322 18861123645
		浙江尖峰供应链有限公司（仓库）	5 000 吨	浙江省金华市金东区浙江金东经济开发区常春西路 88 号	13806789598 13626898993
		广州港物流有限公司（仓库）	5 000 吨	广州市南沙区龙穴街启航路 5 号	13580473027 13560347325
		广东国储供应链股份有限公司（仓库）	1 万吨	广州市黄埔区开发大道 1330 号	13928901955 13318831758
		建发物流集团有限公司（仓库）	1 万吨	广东省东莞市麻涌镇创业西路 37 号	13850096508 13661308736
		广东炬申仓储有限公司（仓库）	1 万吨	广东省佛山市南海区丹灶镇丹灶物流中心金泰路 1 号	15015835397 15915220011
		中储发展股份有限公司（仓库）	1 万吨	四川省成都市金牛区天回镇明月路 59 号	18908080308 13683411698
		中国物流股份有限公司（仓库）	5 000 吨	四川省成都市青白江区城厢镇香岛大道 599 号	15828004353 18628368772
		中国外运华中有限公司（仓库）	1 万吨	四川省成都市新都区物流大道 399 号	13964877211 15192580461
			1 万吨	四川省成都市龙泉驿区柏合街道经开区南四路 321 号	13964877211 15192580461



续表

品种	交易所	交割仓库	库容	地址	电话
工业硅	广期所	中国物流股份有限公司（仓库）	2万吨	新疆乌鲁木齐新市区友谊路69号	13808374737 15099174048
		广东国储供应链股份有限公司（仓库）	1万吨	新疆乌鲁木齐市新市区乌昌辅道757号	13928901955 13318831758
		中疆物流有限责任公司（仓库）	1万吨	新疆昌吉州昌吉市 X131 中疆 3 号中疆昌吉物流园区	18199255500 13150308273

注：郑商所的仓库库容均为最低保障库容，厂库库容为最大库容。

附录 6

机构名录^①

附录 6-1 中国期货业协会会员名录

普通会员——期货公司

序号	机构全称	通信地址
1	方正中期期货有限公司	北京市朝阳区东三环北路 38 号院 1 号楼泰康金融大厦 22 层 (100026)
2	金鹏期货经纪有限公司	北京市西城区金融大街 27 号投资广场 B 座九层
3	国都期货有限公司	北京市东城区东直门南大街 3 号国华投资大厦 8 层、10 层
4	中粮期货有限公司	北京市东城区东直门南大街 5 号中青旅大厦 15 层
5	北京首创期货有限责任公司	北京市西城区宣武门外大街甲 1 号 3 层 301、302、314 房间
6	一德期货有限公司	天津市和平区解放北路 188 号信达大厦 16 层
7	宏源期货有限公司	北京市海淀区西直门北大街甲 43 号金运大厦 B 座 6 层
8	第一创业期货有限责任公司	北京市西城区新街口北大街 3 号星街坊购物中心 6 层 603、604 室
9	冠通期货股份有限公司	北京市朝阳区朝外大街甲 6 号万通中心 D 座 20 层
10	国元期货有限公司	北京市东城区东直门外大街 46 号 1 号楼 19 层 1901、9 层 906、908B
11	首创京都期货有限公司	北京市朝阳区安定门外大街 1 号 1 幢 10 层 1018 室
12	中衍期货有限公司	北京市朝阳区东四环中路 82 号金长安大厦 B 座 7 层
13	中钢期货有限公司	北京市海淀区海淀大街 8 号 19 层
14	华金期货有限公司	天津市和平区五大道街南京路 183 号世纪都会商厦办公楼 22 层 2203 - 2207 室

① 截至 2022 年 12 月 31 日。



续表

序号	机构全称	通信地址
15	财达期货有限公司	天津市和平区南京路君隆广场 C 座 9 层
16	国泰君安期货有限公司	上海市静安区新闻路 669 号 29 层、30 层
17	山金期货有限公司	天津市南开区长江道与三马路交口融汇广场 B 座 21 层
18	和融期货有限责任公司	天津市和平区郑州道 18 号港澳大厦 103, 201 - 1, 201 - 2, 302 - 1, 302 - 2
19	恒银期货有限公司	石家庄市槐安东路 90 号国富大厦三层
20	山西三立期货经纪有限公司	山西省太原市府西街 69 号国贸 A 座 18 层
21	民生期货有限公司	北京市东城区建国门内大街 28 号民生金融中心 A 座 19 层
22	和合期货有限公司	山西省太原市菜园东街 2 号和合期货
23	鑫鼎盛期货有限公司	福建省福州市台江区曙光支路 128 号福州农商银行总部大楼地上 15 层 01、02 半单元
24	先锋期货股份有限公司	深圳市罗湖区桂园街道老围社区深南东路 5016 号蔡屋围京基一百大厦 A 座 5401 - 01、11、12 单元
25	九州期货有限公司	北京市海淀区西直门北大街甲 43 号金运大厦 B 座 1418 室
26	江海汇鑫期货有限公司	济南市历下区经十路 17703 号华特广场五层 C 区 C500、502 室
27	国盛期货有限责任公司	中国（上海）自由贸易试验区世纪大道 1501 号 501、502、503、505、506、507、508、509 室
28	天富期货有限公司	吉林省长春市人民大街 10606 号东北亚国际金融中心 5 层
29	中融汇信期货有限公司	上海市浦东新区东育路 255 弄 5 号 29 层
30	恒力期货有限公司	辽宁省大连市沙河口区会展路 129 号大连国际金融中心 A 座 - 大连期货大厦 33、34 层 3302、3305、3401、3410 室
31	兴证期货有限公司	福州市鼓楼区温泉街道湖东路 268 号 6 层（兴业证券大厦）
32	晟鑫期货经纪有限公司	山西省阳泉市德胜东街 23 号
33	天鸿期货经纪有限公司	上海市虹口区东大名路 501 号 32 层 01、07、08 单元
34	大通期货经纪有限公司	黑龙江哈尔滨南岗区西大直街 118 号 1 号楼 6 楼
35	中金财富期货有限公司	深圳市福田区莲花街道福新社区益田路 6001 号太平金融大厦 4203 - 4205 单元
36	银河期货有限公司	北京市朝阳区建国门外大街 8 号楼 31 层 2702 单元 31012 室、33 层 2902 单元 33010 室
37	紫金天风期货股份有限公司	上海市虹口区黄浦路 99 号上海滩国际大厦 508 室
38	中国国际期货股份有限公司	北京市朝阳区建国门外光华路 14 号中国中期大厦 A 座 6 层
39	渤海期货股份有限公司	中国（上海）自由贸易试验区新金桥路 28 号 1201、1202、1203、1205 室
40	国富期货有限公司	上海市浦东新区杨高南路 799 号 25 层 01、04
41	海通期货股份有限公司	中国（上海）自由贸易试验区世纪大道 1589 号 17 楼、6 楼 01 - 04 单元、25 楼、2 楼 05、03 单元

续表

序号	机构全称	通信地址
42	华鑫期货有限公司	上海市黄浦区福州路666号21、22楼
43	光大期货有限公司	中国（上海）自由贸易试验区杨高南路729号陆家嘴世纪金融广场1号楼6楼
44	铜冠金源期货有限公司	上海市浦东新区源深路273号（1、2、3楼）
45	恒泰期货股份有限公司	上海市浦东新区峨山路91弄120号2层201单元
46	国投安信期货有限公司	北京市西城区广安门外南滨河路1号高新大厦9层
47	建信期货有限责任公司	上海市浦东新区银城路99号502、503室
48	上海东亚期货有限公司	上海市虹口区东大名路1089号26层2601-2608单元
49	上海东方期货经纪有限责任公司	上海市浦东新区松林路300号1603室
50	上海大陆期货有限公司	上海市徐汇区凯旋路3131号明申中心大厦25楼
51	东航期货有限责任公司	上海市吴中路686弄3号D幢16楼201103
52	中财期货有限公司	上海市浦东新区陆家嘴环路958号23楼
53	上海浙石期货经纪有限公司	上海市浦东新区浦电路438号双鸽大厦10-G室
54	瑞银期货有限责任公司	中国（上海）自由贸易试验区花园石桥路33号3808室
55	通惠期货有限公司	上海市浦东新区陆家嘴西路99号7楼
56	上海东证期货有限公司	上海市黄浦区中山南路318号2号楼11、21、35、39层，2201、2204、3101-3104室
57	海证期货有限公司	上海市临平北路19号3楼
58	上海中期期货股份有限公司	上海市浦东新区世纪大道1701号1301单元
59	上海东方财富期货有限公司	中国（上海）自由贸易试验区世纪大道1500号12楼北座、902A室、802A室、802B室、802D-3室、802D-5室、802D-6室、802D-7室
60	江苏东华期货有限公司	江苏省南京市王府大街63号5层
61	国联期货股份有限公司	江苏省无锡市金融一街8号6楼
62	创元期货股份有限公司	苏州市工业园区苏州大道东265号现代传媒广场25楼
63	东海期货有限责任公司	上海市浦东新区东方路1928号东海证券大厦8楼
64	新纪元期货股份有限公司	徐州市鼓楼区民主北路2号黎明大厦1号楼8-9楼
65	弘业期货股份有限公司	南京市中华路50号弘业大厦9楼
66	前海期货有限公司	深圳市前海深港合作区梦海大道5033号卓越前海壹号A栋26楼08单元
67	锦泰期货有限公司	南京市玄武区中央路258-28号锦盈大厦
68	物产中大期货有限公司	浙江省杭州市中山北路310号3层、11层西、12层东、18层
69	浙江新世纪期货有限公司	浙江省杭州市体育场路335号
70	宝城期货有限责任公司	杭州市西湖区求是路8号公元大厦南裙楼5层
71	大地期货有限公司	浙江省杭州市江干区四季青街道香樟街39号24、25层



续表

序号	机构全称	通信地址
72	浙商期货有限公司	浙江省杭州市下城区环城北路305号耀江发展中心20层
73	大越期货股份有限公司	浙江省绍兴市解放北路186号7楼
74	信达期货有限公司	浙江省杭州市萧山区宁围街道利一路188号天人大厦19-20层
75	新湖期货股份有限公司	上海市静安区裕通路100号36层、38层3801-5室
76	南华期货股份有限公司	杭州市上城区横店大厦301室、401室、501室、701室、901室、1001室、1101室、1201室
77	国海良时期货有限公司	杭州市河东路91号
78	永安期货股份有限公司	浙江省杭州市上城区新业路200号华峰国际商务大厦10层、1101室、1102室、1104室、16-17层
79	兴业期货有限公司	上海市浦东新区银城路167号兴业银行大厦11层
80	中泰期货股份有限公司	济南市市中区经七路86号15、16层
81	山东齐盛期货有限公司	山东省淄博市张店区柳泉路45号甲3号5层
82	中州期货有限公司	山东省烟台市芝罘区西关南街2号万达金融中心（A3）座20楼
83	英大期货有限公司	注册地：北京市朝阳区呼家楼京广中心6层605室 办公地：北京市东城区建国门内大街乙18号院英大国际大厦2层
84	徽商期货有限责任公司	安徽省合肥市芜湖路258号3号楼6-7层、6号楼1-2层
85	华安期货有限责任公司	安徽省合肥市蜀山区潜山路190号华邦世贸中心超高层写字楼40、41层
86	安粮期货股份有限公司	安徽省合肥市包河区花园大道986号安粮中心23-24层
87	格林大华期货有限公司	北京市朝阳区建国门外大街8号楼北京国际财源中心A座21层2101单元
88	华融融达期货股份有限公司	郑州市郑东新区商务内环路27号楼万达期货大厦3层
89	国信期货有限责任公司	上海市虹口区东大名路358号2001、2002、2003、2005、2006、2007、2008、2009、2010、2013、2015、2016、2017室
90	中原期货股份有限公司	河南省郑州市郑东新区商务外环路10号中原广发金融大厦四楼
91	福能期货股份有限公司	福建省福州市鼓楼区五四路75号海西商务大厦31层
92	金信期货有限公司	湖南省芙蓉区长沙市车站北路459号证券大厦五楼
93	美尔雅期货有限公司	湖北省武汉市江汉区青年路169号ICC武汉环贸中心A塔16层
94	云财富期货有限公司	新疆乌鲁木齐市天山区西河坝后街137号瑞达国际大厦七楼
95	华闻期货有限公司	上海市黄浦区北京东路666号H区（东座）31楼、28楼A1、B2、C、D室
96	长江期货股份有限公司	湖北省武汉市武昌区中北路9号长城汇T2号写字楼第27层
97	宁证期货有限责任公司	南京市建邺区白龙江东街9号2幢二单元1901室
98	华联期货有限公司	广东省东莞市城区可园南路1号金源中心17层
99	华龙期货股份有限公司	甘肃省兰州市城关区静宁路308号信托大厦4楼

续表

序号	机构全称	通信地址
100	广发期货有限公司	广州市天河区天河北路183-187号大都会广场38楼3801-3819, 41楼4101-4120, 42楼和43楼
101	混沌天成期货股份有限公司	深圳市福田区福华三路与金田路交汇处卓越世纪中心3号楼2306、2608-10、2701-2710室
102	佛山金控期货有限公司	广东省佛山市南海区桂城街道永胜西路22号新凯广场2座39层
103	长城期货股份有限公司	广东省广州市天河区珠江新城珠江西路17号广晟国际大厦1501-B
104	摩根大通期货有限公司	中国(上海)自由贸易试验区银城中路501号4605室
105	华泰期货有限公司	广州市南沙区横沥镇明珠三街1号10层1001-1004、1011-1016房 增加经营场所:广州市天河区临江大道1号之一2101-2106单元
106	金石期货有限公司	新疆乌鲁木齐市天山区解放北路177号徕远广场B座29楼
107	中天期货有限责任公司	北京市丰台区方庄芳古园一区29号楼3层
108	国贸期货有限公司	福建省厦门市湖里区仙岳路4688号国贸中心A栋16层
109	中航期货有限公司	深圳市福田区华富路1006号航都大厦25层
110	中信期货有限公司	深圳福田中心三路8号卓越时代广场二期14层
111	五矿期货有限公司	深圳市南山区粤海街道海珠社区滨海大道3165号五矿金融大厦1301、1401、1501、1601
112	招商期货有限公司	深圳市福田区福田街道福安社区福华一路111号招商证券大厦16楼、17楼1703室
113	深圳市中金岭南期货有限公司	深圳市罗湖区桂园街道老围社区深南东路5016号蔡屋围京基一百大厦A座6601
114	乾坤期货有限公司	广东省深圳市福田区中心四路1号嘉里建设广场第一座第十六层02B、03A2室
115	海航期货股份有限公司	深圳市罗湖区桂园街道老围社区蔡屋围京基一百大厦A座4301-02单元
116	神华期货有限公司	深圳市福田区深南大道1006号深圳国际创新中心A栋27层东半层A
117	金瑞期货股份有限公司	深圳市福田区福田街道岗厦社区深南大道1003号东方新天地广场A3101、A3102、A3103、A3104、A3105、A3106
118	平安期货有限公司	深圳市福田区金田路4036号荣超大厦15层1501、1503单元
119	金元期货股份有限公司	海南省海口市南宝路36号证券大厦1楼
120	国新国证期货有限责任公司	海南省海口市龙昆北路53-1号
121	道通期货经纪有限公司	江苏省南京市鼓楼区广州路188号苏宁环球大厦5层02座
122	申银万国期货有限公司	中国(上海)自由贸易试验区东方路800号7楼、8楼、10楼、3401室
123	华西期货有限责任公司	成都市青羊区通惠门路3号

续表

序号	机构全称	通信地址
124	瑞达期货股份有限公司	厦门市思明区塔埔东路169号13层
125	国金期货有限责任公司	成都市锦江区东大街芷泉段229号1栋2单元28层
126	倍特期货有限公司	成都市高新区锦城大道539号盈创动力大厦A座4楼406室
127	西南期货有限公司	重庆市江北区金沙门路32号23层(不含2310、2311室)
128	中信建投期货有限公司	重庆市渝中区中山三路131号希尔顿商务中心27楼、30楼
129	中电投先融期货股份有限公司	重庆市江北区江北城聚贤岩9号国华金融中心A塔23F
130	红塔期货有限责任公司	云南省昆明市春城路168号
131	西部期货有限公司	陕西省西安市新城区东新街319号(人民大厦)8幢10000室9层、10层
132	长安期货有限公司	陕西省西安市浐灞生态区浐灞大道1号浐灞外事大厦9层
133	东兴期货有限责任公司	上海市虹口区杨树浦路248号22楼
134	江西瑞奇期货有限公司	江西省南昌市红谷滩区雅苑路196号金控大厦17楼
135	迈科期货股份有限公司	陕西省西安市高新区锦业路12号迈科中心43层
136	永商期货有限公司	黑龙江省哈尔滨市南岗区中山路260号9层901室
137	中辉期货有限公司	上海市浦东新区新金桥路27号10号楼5层A区
138	大有期货有限公司	湖南省长沙市天心区芙蓉南路二段128号现代广场三、四楼
139	华创期货有限责任公司	重庆市渝中区中山三路131号希尔顿商务楼13楼
140	云晨期货有限责任公司	云南省昆明市盘龙区华云路1号
141	东吴期货有限公司	上海市西藏南路1208号6楼、19楼
142	广州金控期货有限公司	广东省广州市天河区体育西路191号中石化大厦B塔25楼
143	盛达期货有限公司	浙江省杭州市萧山区宁围街道平澜路259号国金中心2单元2201室
144	广州期货股份有限公司	广州市天河区临江大道1号寺右万科中心南塔6层
145	津投期货经纪有限公司	天津市河西区马场道59号国贸中心大厦A座9层
146	中金期货有限公司	北京市朝阳区建外大街1号国贸写字楼2座7层
147	东方汇金期货有限公司	吉林省长春市朝阳区西安大路2128号绿地·蓝海5A第20层
148	财信期货有限公司	湖南省长沙市岳麓区茶子山东路112号滨江金融中心T2栋(B座)18层
149	中银国际期货有限责任公司	中国(上海)自由贸易试验区世纪大道1589号903-909室
150	山东港信期货有限公司	山东省青岛市市南区香港西路48号海天中心T2写字楼10楼

普通会员——证券公司

序号	机构全称	通信地址
1	平安证券股份有限公司	深圳市福田区益田路5023号平安金融中心南塔第22-25层
2	中国银河证券股份有限公司	北京市丰台区西营街8号院1号楼青海金融大厦

续表

序号	机构全称	通信地址
3	中泰证券股份有限公司	济南市市中区经七路86号21层
4	华泰证券股份有限公司	江苏省南京市建邺区江东中路228号华泰证券广场1号楼
5	东海证券股份有限公司	上海市浦东新区东方路1928号东海证券大厦7楼
6	光大证券股份有限公司	上海市静安区新闻路1508号静安国际广场
7	兴业证券股份有限公司	福州市湖东路268号
8	海通证券股份有限公司	上海市黄浦区广东路689号海通证券大厦
9	申万宏源证券有限公司	上海市长乐路989号世纪商贸广场40楼
10	长江证券股份有限公司	湖北省武汉市江汉区新华路特8号
11	广发证券股份有限公司	广州市天河区马场路26号广发证券大厦
12	国都证券股份有限公司	中国北京市东城区东直门南大街3号国华投资大厦九层
13	长城证券股份有限公司	深圳市福田区金田路2026号能源大厦南塔楼18层
14	中信证券股份有限公司	广东省深圳市福田区中心三路8号中信证券大厦
15	国信证券股份有限公司	广东省深圳市罗湖区红岭中路1012号国信证券大厦16-26楼
16	中信证券（山东）有限责任公司	山东省青岛市崂山区深圳路222号1号楼2001
17	华福证券有限责任公司	福建省福州市鼓楼区鼓屏路27号1#楼3层、4层、5层；福州市台江区江滨中大道380号宝地广场18-19层
18	国泰君安证券股份有限公司	上海市银城中路168号上海银行大厦29楼
19	华安证券股份有限公司	合肥市政务文化新区天鹅湖路198号
20	山西证券股份有限公司	山西省太原市府西街69号山西国际贸易中心东塔
21	东方证券股份有限公司	上海市黄浦区外马路118号东方证券大厦
22	中信建投证券股份有限公司	北京市东城区朝内大街188号
23	渤海证券股份有限公司	天津市南开区滨水西道8号
24	安信证券股份有限公司	深圳市福田区金田路4018号安联大厦35层
25	东莞证券股份有限公司	广东省东莞市莞城区可园南路1号金源中心30楼
26	信达证券股份有限公司	北京市西城区闹市口大街9号楼1号楼
27	国联证券股份有限公司	无锡市金融一街8号国联金融大厦8楼
28	西部证券股份有限公司	陕西省西安市新城区东新街319号8幢10000室
29	南京证券股份有限公司	南京市建邺区江东中路389号南京证券办公室
30	东吴证券股份有限公司	江苏省苏州工业园区星阳街5号
31	中银国际证券有限责任公司	上海市浦东新区银城中路200号中银大厦40层
32	中原证券股份有限公司	河南省郑州市郑东新区商务外环路10号
33	中国国际金融股份有限公司	北京市朝阳区建国门外大街1号国贸大厦2座28层
34	浙商证券股份有限公司	浙江省杭州市江干区五星路201号浙商大楼8F衍生品经纪业务总部
35	财通证券股份有限公司	杭州市杭大路15号嘉华国际商务中心1722室

续表

序号	机构全称	通信地址
36	大通证券股份有限公司	大连市沙河口区会展路129号大连期货大厦39层
37	金元证券股份有限公司	深圳市深南大道4001号时代金融中心大厦17楼
38	申万宏源西部证券有限公司	新疆乌鲁木齐市高新区(新市区)北京南路358号大成国际大厦20楼2005室
39	方正证券股份有限公司	长沙市芙蓉中路二段华侨国际大厦22-24层
40	华西证券股份有限公司	成都市高新区天府二街198号
41	第一创业证券股份有限公司	深圳市福田区福华一路115号投行大厦20楼
42	国元证券股份有限公司	安徽省合肥市梅山路18号
43	湘财证券股份有限公司	长沙市天心区湘府中路198号新南城商务中心A栋11楼
44	民生证券股份有限公司	北京市东城区建国门内大街28号民生金融中心A座18层
45	国海证券股份有限公司	广西南宁市滨湖路46号国海大厦
46	中山证券有限责任公司	深圳市南山区粤海街道蔚蓝海岸社区创业路1777号海信南方大厦21层、22层
47	华创证券有限责任公司	贵州省贵阳市云岩区中华北路216号华创大厦
48	中航证券有限公司	江西省南昌市红谷滩新区红谷中大道1619号国际金融中心A座41层
49	万联证券有限责任公司	广州市天河珠江东路11号19楼
50	江海证券有限公司	哈尔滨市香坊区赣水路56号
51	东兴证券股份有限公司	北京市西城区金融大街5号新盛大厦12-15层
52	恒泰证券股份有限公司	内蒙古自治区呼和浩特市新城区海拉尔东街满世尚都办公商业综合楼
53	红塔证券股份有限公司	云南省昆明市北京路155号附1号红塔大厦9楼
54	国盛证券有限责任公司	江西省南昌市新建区子实路1589号
55	华融证券股份有限公司	北京市朝阳区朝阳门北大街18号
56	德邦证券股份有限公司	上海市福山路500号城建国际中心29楼
57	华龙证券股份有限公司	兰州市城关区东岗西路638号兰州财富中心21楼
58	中天证券股份有限公司	辽宁省沈阳市和平区南5马路121号4楼
59	财达证券股份有限公司	河北省石家庄市自强路35号庄家金融大厦24层
60	上海证券有限责任公司	上海市黄浦区四中路213号久事商务大厦7楼
61	东北证券股份有限公司	长春市自由大路1138号
62	开源证券股份有限公司	陕西省西安市锦业路1号都市之门B座5层
63	天风证券股份有限公司	湖北省武汉市武昌区中南路99号保利广场A座37楼
64	国金证券股份有限公司	四川省成都市青羊区东城根上街95号成证大厦16层
65	中信证券华南股份有限公司	广州市天河区珠江西路5号广州国际金融中心5层
66	方正证券承销保荐有限责任公司	北京市朝阳区北四环中路27号盘古大观A座40-43层

续表

序号	机构全称	通信地址
67	诚通证券股份有限公司	北京市海淀区北三环西路99号院西海国际中心1号楼15层1501
68	西南证券股份有限公司	重庆市江北区桥北苑8号西南证券大厦
69	万和证券股份有限公司	深圳市福田区深南大道7028号时代科技大厦西厅20层
70	首创证券股份有限公司	北京市西城区德胜门外大街115号德胜尚城E座
71	华宝证券股份有限公司	中国（上海）自由贸易试验区浦电路370号2、3、4层
72	五矿证券有限公司	深圳市福田区金田路4028号荣超经贸中心办公楼47层01单元
73	太平洋证券股份有限公司	云南省昆明市青年路389号志远大厦18层
74	华林证券股份有限公司	广东省深圳市福田区民田路178号华融大厦六楼
75	联储证券有限责任公司	青岛市崂山区苗岭路15号金融中心大厦15层
76	世纪证券有限责任公司	深圳市福田区深南大道7088号招商银行大厦40-42层
77	粤开证券股份有限公司	广州市经济技术开发区科学大道60号开发区控股中心21、22、23层
78	大同证券有限责任公司	山西省大同市平城区迎宾街15号桐城中央21层
79	长城国瑞证券有限公司	福建省厦门市思明区深田路46号深田国际大厦20楼
80	东方财富证券股份有限公司	西藏自治区拉萨市柳梧新区国际总部城10栋楼
81	宏信证券有限责任公司	四川省成都市人民南路二段18号川信大厦10楼
82	银泰证券有限责任公司	深圳市福田区竹子林四路紫竹七道光太银行大厦18楼
83	九州证券股份有限公司	北京市朝阳区安立路30号仰山公园东一门2号楼
84	华金证券股份有限公司	上海市静安区天目西路128号19层1902室
85	英大证券有限责任公司	深圳市福田区深南中路华能大厦30、31层

普通会员——资产管理公司

序号	机构全称	通信地址
1	华期梧桐成都资产管理有限公司	成都青羊区通惠门路3号
2	深圳天风天成资产管理有限公司	湖北省武汉市武昌区中北路知音广场15楼天风天成
3	深圳中金岭南金汇资本管理有限公司	广东省深圳市福田区深南大道6025号英龙大厦911室
4	四川倍特资产管理有限公司	四川省成都市高新区锦城大道539号盈创动力大厦4楼405室
5	混沌天成资产管理（上海）有限公司	上海市浦东新区世纪大道826号904室
6	上海杰询资产管理有限公司	上海市徐汇区凯旋路3131号名申中心大厦26楼
7	盈蒨（上海）资产管理有限公司	中国（上海）自由贸易试验区杨高南路799号23层04单元
8	厦门国贸资产管理有限公司	上海市闵行区申虹路928弄虹桥嘉汇2号楼1层



续表

序号	机构全称	通信地址
9	中电投先融（上海）资产管理有限公司	上海市黄浦区中山南路268号新源广场1号楼17层
10	和合资产管理（上海）有限公司	上海市浦东新区银城中路501号3002室

普通会员——风险管理公司

序号	机构全称	通信地址
1	浙江永安资本管理有限公司	杭州市江干区新业路200号华峰国际商务大厦32层
2	浙江浙期实业有限公司	浙江省杭州市西湖区天目山路198号财通双冠大厦东楼9层
3	上海融致实业有限公司	地址1：河南省郑州市郑东新区商务内环28号中储粮大厦8层 地址2：上海市浦东新区樱花路100号富荟广场901
4	广发商貿有限公司	上海市浦东新区东方路1217号陆家嘴金融服务广场11楼E座
5	中泰汇融资本投资有限公司	山东省济南市市中区经七路86号证券大厦16楼
6	浙江济海贸易发展有限公司	浙江杭州香樟街39号浙江国贸金融总部大楼24层
7	上海新湖瑞丰金融服务有限公司	上海市浦东新区浦电路500号1801B
8	浙江南华资本管理有限公司	浙江省杭州市西湖大道193号定安名都B座313室
9	江苏锦盈资本管理有限公司	江苏省南京市玄武区中央路258号-28号（锦盈大厦6808）
10	上海际丰投资管理有限责任公司	地址1：北京市朝阳区东三环北路38号院泰康金融大厦22层 地址2：上海市浦东新区福山路450号新天国际大厦24楼
11	弘业资本管理有限公司	南京市秦淮区中华路50号弘业大厦六楼6028室
12	中信中证资本管理有限公司	深圳市福田区中心三路8号卓越时代广场二期13楼
13	宏源恒利（上海）实业有限公司	上海市浦东新区世纪大道1589号1501单元
14	中粮祈德丰投资服务有限公司	上海市浦东新区福山路500号507室
15	金瑞前海资本管理（深圳）有限公司	深圳市福田区彩田路东方新天地广场A座4C
16	上海海通资源管理有限公司	上海市浦东新区世纪大道1568号中建大厦1602室
17	瑞达新控资本管理有限公司	福建省厦门市思明区观音山南投路11号荣鑫盛营运中心6楼E单元
18	申银万国智富投资有限公司	上海市浦东新区东方路800号宝安大厦27楼2702B
19	华泰长城资本管理有限公司	地址1：上海市浦东新区1788, 1800号T1第29层01B单元 地址2：深圳市福田区莲花街道益田路5999号基金大厦7层D单元
20	银河德睿资本管理有限公司	北京市西城区月坛西街6号院9-10号楼银河商务楼3层
21	光大光子投资管理有限公司	中国（上海）自由贸易试验区福山路458号303室

续表

序号	机构全称	通信地址
22	格林大华资本管理有限公司	上海市浦东新区源深路 1088 号平安财富大厦 7 楼
23	中期国际风险管理有限公司	北京市朝阳区光华路 16 号中期大厦 A 座 6 层
24	长江产业金融服务（武汉）有限公司	武汉市武昌区楚汉路湖北银行大厦附三楼
25	国投安信（上海）投资有限公司	北京办公地址：北京市西城区广安门外南滨河路 1 号高新大厦 8 层 上海办公地址：上海市虹口区东大名路 638 号 502 - 503 室
26	五矿产业金融服务（深圳）有限公司	深圳市南山区滨海大道 3165 号五矿金融大厦 1501
27	东证润和资本管理有限公司	上海市黄浦区中山南路 268 号 1 号楼 25 楼
28	睦盛投资管理（上海）有限公司	上海市浦东新区张杨路 620 号中融恒瑞国际大厦 1202 单元
29	迈科资源管理（上海）有限公司	上海市浦东新区世纪大道 1568 号 中建大厦 1907 室
30	国贸启润资本管理有限公司	上海市浦东新区张杨路 620 号中融恒瑞国际大厦东楼 1801
31	上期资本管理有限公司	上海市浦东新区银城中路 488 号太平金融大厦 1104A
32	国海良时资本管理有限公司	浙江省杭州市下城区河东路 91 号国海良时期货 230 室
33	东海资本管理有限公司	上海市浦东新区花木街道兰花路 333 号 333 世纪大厦 801 - 804
34	平安商贸有限公司	深圳市福田区益田路 5023 号平安金融中心 B 座 2310 室
35	国泰君安风险管理有限公司	上海市新闻路 669 号博华广场 30 层
36	上海伴兴实业发展有限公司	上海市虹口区杨树浦路 248 号 2408 - 2410 室
37	中金财富资本（深圳）有限公司	广东省深圳市福田区深南大道 4009 号投资大厦 13 楼 E1 - E2 区
38	上海东吴玖盈投资管理有限公司	上海市黄浦区西藏南路 1208 号 10 楼 B、C、D、F、G 座 苏州市工业园区星阳街 5 号东吴证券大厦 7 楼 705 室
39	汇信融植资本管理有限公司	上海市虹口区四川北路 1350 号利通广场 903 室
40	上海华闻金融信息服务有限公司	上海市黄浦区北京东路 668 号上海科技京城西楼 31 楼
41	方顿物产（重庆）有限公司	地址 1：上海浦东新区世纪大道 1777 号东方希望大厦 3 层 F1 室 地址 2：重庆渝中区两路口皇冠大厦 9 层
42	华期创一成都投资有限公司	四川省成都市青羊区通惠门路 3 号（华西期货）
43	国联汇富资本管理有限公司	无锡市金融一街 8 号 600 室及 601 室
44	中衍期（天津）企业管理咨询有限公司	天津市武清开发区福源道北侧金融商务楼 2 号楼 1004 室
45	国元投资管理（上海）有限公司	北京市东城区东直门外大街 46 号天恒大厦 A906
46	混沌天成资本管理有限公司	上海市浦东新区杨高南路 759 号陆家嘴世纪金融广场 2 号楼 702 - 703 室

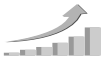


续表

序号	机构全称	通信地址
47	中粮祈德丰（北京）商贸有限公司	北京市东城区东滨河路甲一号大象投资大厦5层
48	渤海融盛资本管理有限公司	中国（上海）自由贸易试验区新金桥路28号13层1301室
49	上海安粮资本有限公司	上海市浦东新区世纪大道1568号中建大厦706、07A
50	豫新投资管理（上海）有限公司	河南省郑州市郑东新区商务外环路10号中原广发金融大厦四层402、403、405室
51	和合资源管理（上海）有限公司	上海市浦东新区银城中路8号中融碧玉蓝天大厦36层
52	上海夯石商贸有限公司	上海市浦东新区银城路99号建行大厦5楼
53	物产中大资本管理（浙江）有限公司	深圳市罗湖区桂园街道深南东路5016号京基一百大厦A座5301
54	华能宝城物华有限公司	上海浦东新区世博馆路200号华能上海大厦621
55	广期资本管理（上海）有限公司	广州市珠江新城珠江西路5号广州国际金融中心10楼
56	中金岭南经贸（深圳）有限公司	杭州市拱墅区金华南路355号远洋国际中心B座10楼1005室
57	华龙新瑞资本管理有限公司	上海市浦东新区世纪大道1568号中建大厦7楼704
58	财达投资（天津）有限公司	兰州市兰州新区地铁商务中心4楼
59	招证资本投资有限公司	天津市自贸试验区中心大道汇津广场2号楼502室
60	建信商贸有限责任公司	深圳市福田区民田路178号华融大厦5楼505
61	中电投先融（天津）风险管理 有限公司	中国（上海）自由贸易试验区长清北路53号中铝大厦南楼906室
62	融鲲（上海）企业管理有限 公司	天津市滨海新区中心商务区金融大厦17层
63	上海滇晟商贸有限公司	上海市浦东新区浦东大道1868号东方城市大厦14F
64	重庆鼎富瑞泽风险管理有限公司	重庆市江北区金沙门路32号西南证券总部大楼23层（2310、2311室）
65	安徽华安资本管理有限责任公司	安徽省合肥市高新区创新大道2800号创新产业园二期E1楼基金大厦七楼B座
66	江西瑞奇资本管理有限公司	江西省南昌市红谷滩新区红谷中大道788号江信国际花园18号楼203室
67	华泰长城投资管理有限公司	上海市浦东新区世纪大道1788号陆家嘴金控广场T1栋2903单元
68	紫金天示（上海）企业管理有 限公司	上海市浦东新区源深路1088号平安财富大厦1604室；广东省深圳市福田区深南大道金地中心13楼1301
69	兴业银期商品贸易有限公司	上海市浦东新区银城路167号兴业银行大厦11楼

续表

序号	机构全称	通信地址
70	上海福能商创贸易有限责任公司	福建省福州市鼓楼区外贸大厦31层
71	上海华发盈期实业有限公司	上海市浦东新区杨高南路759号陆家嘴世纪金融广场2号楼2304室
72	徽丰实业(上海)有限公司	上海市浦东新区东方路738号裕安大厦2205室
73	东航物网风险管理有限公司	上海市闵行区吴中路686弄3号D座2楼
74	兴证风险管理有限公司	上海市浦东新区长柳路36号兴业证券大厦7楼712室
75	上海西部永唐投资管理有限公司	中国(上海)自由贸易试验区耀体路276号802室
76	国信金阳资本管理有限公司	上海市虹口区东大名路358号20楼2011、2012室 深圳市罗湖区红岭中路1010号国际信托大厦1601、1602室
77	苏州创元和赢资本管理有限公司	江苏省苏州市工业园区苏州大道东265号现代传媒广场25楼C座
78	广州金控物产有限公司	广州市天河区体育西路191号B塔4010-13
79	鑫纪元资本管理有限公司	上海市浦东区双鸽大厦16E
80	上海红塔众鑫企业管理有限公司	上海市虹口区黄浦路99号上海滩国际大厦1206、1208B室
81	南京道通资本管理有限公司	江苏省南京市广州路188号苏宁环球大厦20楼2007室
82	上海中财资本管理有限公司	上海市徐汇区襄阳南路365号B座一层
83	上海茂川资本管理有限公司	上海市浦东新区松林路357号24楼2410室
84	华期资本管理(广州)有限公司	广东省广州市天河区华夏路16号(富力盈凯)1507房A
85	上海美尔雅实业有限公司	上海市浦东区松林路333弄16栋1102室
86	民生博海资本管理有限公司	上海浦东新区福山路458号同盛大厦1802
87	中石化朝阳风险管理有限公司	浙江省杭州市拱墅区密渡桥路1号时代大厦B座3楼
88	国富裕宸(上海)商贸有限公司	上海市浦东区杨高南路799号陆家嘴世纪金融广场3号楼25楼
89	中信寰球商贸有限公司	上海市浦东区杨高南路799号陆家嘴世纪金融广场3号楼22层
90	长开经贸(上海)有限公司	陕西省西安市灞桥区浐灞大道1号浐灞商务中心二期四层
91	上海海证风险管理有限公司	上海虹口区东大名路501号505A室
92	上海山金实业发展有限公司	上海市浦东新区陆家嘴东路161号招商局大厦36楼
93	国网英大风险管理(深圳)有限公司	深圳市福田区深南中路华能大厦三十层
94	财信风险管理有限公司	长沙市五一西路2号第一大道10楼
95	新期(上海)实业有限公司	上海市虹口区欧阳路196号1号楼2层37室
96	恒力恒新工贸(上海)有限公司	中国(上海)自由贸易试验区罗山路1502弄14号
97	上海云期鸿升实业有限公司	上海市浦东新区杨高南路729号2102室



续表

序号	机构全称	通信地址
98	渤证和融风险管理（天津）有限责任公司	天津市河西区南京路66号凯旋门大厦B22A
99	南京宁证资本管理有限公司	南京市建邺区白龙江东街9号金鱼嘴基金街区B区2栋1单元1001、1002室
100	天津一德信融风险管理有限公司	天津市和平区小白楼街大沽北路与徐州道交口天津万通中心7层710-712室

普通会员——私募基金管理人

序号	机构全称	通信地址
1	深圳市凯丰投资管理有限公司	广东省深圳市福田区益田路6001号太平金融大厦26楼
2	白石资产管理（上海）有限公司	上海市浦东新区东方路18号保利广场E座603室
3	华风投资咨询有限公司	杭州市余杭区文一西路1001号衢州海创园A座401室
4	敦和资产管理有限公司	杭州市上城区浦玉路57号

特别会员

序号	机构全称	通信地址
1	大连商品交易所	大连市会展路129号
2	郑州商品交易所	郑州市郑东新区商务外环路30号期货大厦2505
3	上海期货交易所	上海市浦东新区浦电路500号
4	中国金融期货交易所	上海市浦东世纪大道1600号陆家嘴商务广场6楼
5	中国期货市场监控中心有限责任公司	北京市西城区金融街5号新盛大厦B座17层
6	广州期货交易所股份有限公司	广州市天河区珠江东路广州银行大厦25楼
7	中证商品指数有限责任公司	北京市西城区锦什坊街26号恒奥中心C座3层

联系会员——地方协会

序号	机构全称	通信地址
1	北京期货商会	北京市海淀区紫竹园路31号华澳中心嘉慧苑1216室
2	天津市期货协会	天津市徐州道与大沽北路交口天津万通中心7层709
3	黑龙江省期货业协会	哈尔滨市南岗区花园街235号东方大厦603
4	上海市期货同业公会	上海市浦东新区松林路300号1602室

续表

序号	机构全称	通信地址
5	江苏省期货业协会	江苏省南京市中山东路90号华泰证券大厦2418
6	深圳市期货业协会	深圳市福田区中心三路8号卓越时代广场二期1306室
7	河北省证券期货业协会	河北省石家庄市新华路296号盛安大厦3层
8	大连市期货业协会	辽宁省大连市中山区中山路136号希望大厦1804D
9	辽宁省期货业协会	辽宁省沈阳市和平区十一纬路12号银基发展中心1002室
10	浙江期货行业协会	杭州市余杭塘路515号矩阵国际中心5号楼602、604（丰潭路与余杭塘路交叉口）
11	宁波市证券期货业协会	宁波市中兴路775号天润商座C座12层1203室
12	安徽省证券期货业协会	安徽省合肥市蒙城路109号地税大厦17楼
13	山东省期货业协会	山东省济南市市中区经七路86号11楼1103室
14	河南省证券期货基金业协会	郑州市农业路与中州大道交叉口苏荷中心六楼636室
15	江西省证券期货业协会	南昌市东湖区紫金城证券街1号紫金大厦四层
16	广东证券期货业协会	广州市天河区临江大道3号发展中心21楼B1单元
17	广西证券期货基金业协会	广西南宁市金湖路52-1号东方曼哈顿大厦20层2011室
18	福建省证券期货业协会	福州市铜盘路软件大道89号福州软件园10号楼华兴创业中心201室
19	厦门证券期货基金业协会	厦门市思明区湖滨南路388号国贸大厦8楼D1单元
20	四川省证券期货业协会	四川省成都市洗面桥街39号银谷基业10楼
21	重庆市证券期货业协会	重庆市渝中区临江支路2号合景大厦25楼
22	甘肃证券期货业协会	甘肃省兰州市张掖路延寿巷8号基隆大厦A座9001室
23	新疆维吾尔自治区证券期货业协会	新疆乌鲁木齐金银路53号金融大厦1806室
24	海南证券期货业协会	海南省海口市大英山西三路9号（3A）海南迎宾馆北区2-3夹层
25	云南省证券业协会	云南省昆明市北京路579号泓瑞花园1单元503室
26	陕西证券期货业协会	陕西省西安市浐灞生态区浐灞大道1号商务中心二期2层
27	青岛证券期货业协会	青岛市市南区东海西路28号龙翔广场一号楼一楼
28	吉林省证券业协会	吉林省长春市生态大街2099号伟峰东第11号楼2703室
29	宁夏证券期货基金业协会	宁夏银川市兴庆区民族北街15号南京证券宁夏分公司四楼
30	贵州证券业协会	贵州省贵阳市云岩区北京路9号京玖大厦8楼B座（贵州医科大学旁）
31	湖南省期货业协会	长沙市车站北路459号证券大厦12楼
32	湖北省证券期货业协会	湖北省武汉市武昌区中北路86号鄂旅投大厦28层
33	内蒙古证券期货业协会	内蒙古呼和浩特市赛罕区敕勒川大街东方君座D座14楼1412
34	山西省期货业协会	山西省太原市平阳路101号国瑞大厦16层
35	西藏自治区证券业协会	西藏拉萨柳梧国际总部城3栋一单元3-5室
36	青海证券业协会	青海省西宁市城中区南大街75号



联系会员——保证金存管银行

序号	机构全称	通信地址
1	兴业银行股份有限公司	上海市浦东新区银城路167号18楼
2	中国光大银行股份有限公司	北京市西城区太平桥大街25号中国光大中心B座909
3	上海浦东发展银行股份有限公司	上海市北京东路689号东银大厦
4	交通银行股份有限公司	上海市浦东新区银城中路188号23层
5	中国银行股份有限公司	北京市复兴门内大街1号中国银行总行金融机构部
6	招商银行股份有限公司	上海市浦东新区陆家嘴环路1088号招商银行上海大厦28楼同业部
7	中国民生银行股份有限公司	北京市西城区复兴门内大街2号
8	中国工商银行股份有限公司	北京市西城区复兴门内大街55号
9	汇丰银行（中国）有限公司	上海浦东新区世纪大道8号上海国金中心（汇丰银行大楼）33楼 证券服务部
10	平安银行股份有限公司	广东省深圳市深南东路5047号22楼
11	中信银行股份有限公司	北京市东城区朝阳门北大街9号
12	广发银行股份有限公司	北京市西城区菜市口大街1号院2号楼

联系会员——技术三商机构

序号	机构全称	通信地址
1	上海期货信息技术有限公司	上海市浦东新区浦电路500号上海期货大厦13楼
2	郑州易盛信息技术有限公司	郑州市郑东新区龙湖外环东路31号技术中心
3	大连飞创信息技术有限公司	辽宁省大连市沙河口区会展路129号期货大厦46F
4	上海金融期货信息技术有限公司	上海市浦东新区世纪大道1600号17楼
5	恒生电子股份有限公司	杭州市滨江区江南大道3588号
6	上海文华财经资讯股份有限公司	上海市浦东新区浦电路500号期货大厦1901B
7	上海金仕达软件科技有限公司	上海市浦东新区张江高科技园区亮景路210号
8	福建顶点软件股份有限公司	福州市软件大道89号福州软件园顶点软件中心
9	上海富远软件技术有限公司	上海市闵行区沪闵路7940号510B
10	上海信易信息科技股份有限公司	上海市张江高科技园区郭守敬路498号12幢21311-31313室
11	上海数讯信息技术有限公司	上海市张江高科技园区郭守敬路498号4幢2楼
12	北京普华路通科技发展有限公司	北京市海淀区中关村东路甲331号怡升园商务公寓六单元9层
13	上海彭博财经资讯有限公司	上海市浦东软件园陆家嘴分园峨山路91弄101号501室
14	深圳开拓者科技有限公司	深圳市南山区粤海街道科技园北区松坪山路1号源兴科技大厦北座401
15	上海科视数码频道制作有限公司	中国上海市徐汇区肇家浜路333号亚太企业大楼703-706

续表

序号	机构全称	通信地址
16	上海览逸信息科技有限公司	上海市零陵路585号18G
17	盛立金融软件开发(杭州)有限公司	杭州市滨江区南环路3766号4楼403室
18	艾扬软件(上海)有限公司	上海市浦东新区北张家浜路88号C312室
19	上海融航信息技术股份有限公司	上海市浦东新区福山路388号1506室
20	上海飞鼠软件科技有限公司	中国(上海)自由贸易试验区世纪大道1500号东方大厦1602A室、1602B室
21	武汉宏源寰球科技有限公司	武汉东湖新技术开发区关山大道1号软件产业园4.1期E3 1103
22	上海量投网络科技有限公司	上海市浦东新区杨高南路799号25层

联系会员——证监相关服务机构

序号	机构全称	通信地址
1	中证信息技术服务有限责任公司	北京市西城区金融大街4号金益大厦3层
2	证通股份有限公司	上海浦东新区锦康路308号陆家嘴世纪金融广场6号楼

联系会员——其他期货服务机构

序号	机构全称	通信地址
1	万得信息技术股份有限公司	上海市浦明路1500号万得大厦7楼
2	和讯信息科技有限公司	朝阳门外大街22号泛利大厦10层

附录6-2 期货公司分类评价及业务资格

序号	公司名称	注册资本 (亿元)	2022年分 类评级	是否具有以下业务资格		
				金融期货	投资咨询	资产管理
1	中信期货有限公司	76.00	AA	是	是	是
2	国泰君安期货有限公司	50.00	AA	是	是	是
3	银河期货有限公司	45.00	AA	是	是	是
4	上海东证期货有限公司	38.00	AA	是	是	是
5	招商期货有限公司	35.98	AA	是	是	是
6	华泰期货有限公司	29.39	AA	是	是	是
7	五矿期货有限公司	27.15	A	是	是	是
8	国信期货有限责任公司	20.00	A	是	是	是
9	广发期货有限公司	19.00	AA	是	是	是
10	国投安信期货有限公司	18.86	AA	是	是	是
11	华融融达期货股份有限公司	18.30	A	是	是	是
12	广州期货股份有限公司	16.50	A	是	是	是
13	兴证期货有限公司	16.00	A	是	否	是
14	光大期货有限公司	15.00	AA	是	是	是
15	永安期货股份有限公司	14.56	AA	是	是	是
16	申银万国期货有限公司	14.42	AA	是	是	是
17	中信建投期货有限公司	14.00	AA	是	是	是
18	浙商期货有限公司	13.71	AA	是	是	是
19	海通期货股份有限公司	13.02	AA	是	是	是
20	上海中期期货股份有限公司	12.00	B	是	是	是
21	东吴期货有限公司	10.32	A	是	是	是
22	中电投先融期货股份有限公司	10.10	BBB	是	是	是
23	弘业期货股份有限公司	10.08	A	是	是	是
24	方正中期期货有限公司	10.05	A	是	是	是
25	中泰期货股份有限公司	10.02	AA	是	是	是
26	格林大华期货有限公司	10.00	A	是	是	是
27	宏源期货有限公司	10.00	A	是	是	是
28	海证期货有限公司	10.00	BBB	是	是	是
29	华金期货有限公司	10.00	BB	是	是	是
30	红塔期货有限责任公司	10.00	BBB	是	是	是
31	中国国际期货股份有限公司	10.00	BBB	是	是	是
32	山东港信期货有限公司	10.00	BBB	否	否	否

续表

序号	公司名称	注册资本 (亿元)	2022 年分 类评级	是否具有以下业务资格		
				金融期货	投资咨询	资产管理
33	大地期货有限公司	9.98	A	是	是	是
34	建信期货有限责任公司	9.36	A	是	是	是
35	金瑞期货股份有限公司	9.33	A	是	是	是
36	创元期货股份有限公司	9.00	A	是	是	是
37	西南期货有限公司	8.50	BBB	是	是	是
38	中粮期货有限公司	8.46	AA	是	是	是
39	混沌天成期货股份有限公司	8.10	BBB	是	是	是
40	广州金控期货有限公司	8.00	BBB	是	是	是
41	西部期货有限公司	8.00	BBB	是	是	是
42	摩根大通期货有限公司	7.75	BBB	是	否	否
43	财信期货有限公司	7.50	BBB	是	是	是
44	平安期货有限公司	7.22	A	是	是	是
45	中金财富期货有限公司	7.00	A	是	是	是
46	上海浙石期货经纪有限公司	7.00	BB	是	否	是
47	东海期货有限责任公司	6.67	A	是	是	是
48	英大期货有限公司	6.58	BB	是	是	是
49	南华期货股份有限公司	6.10	AA	是	是	是
50	国元期货有限公司	6.10	A	是	是	是
51	华安期货有限责任公司	6.00	A	是	是	是
52	华西期货有限责任公司	6.00	BBB	是	是	是
53	恒力期货有限公司	6.00	BBB	是	是	是
54	江西瑞奇期货有限公司	6.00	BBB	是	否	否
55	山金期货有限公司	6.00	BBB	是	是	是
56	宝城期货有限责任公司	6.00	A	是	是	是
57	信达期货有限公司	6.00	A	是	是	是
58	国海良时期货有限公司	6.00	A	是	是	是
59	物产中大期货有限公司	6.00	A	是	是	是
60	首创京都期货有限公司	6.00	BBB	是	否	是
61	长江期货股份有限公司	5.88	A	是	是	是
62	大有期货有限公司	5.80	BBB	是	是	是
63	深圳市中金岭南期货有限公司	5.60	BB	是	否	是
64	国贸期货有限公司	5.30	A	是	是	是
65	紫金天风期货股份有限公司	5.24	A	是	是	是
66	东兴期货有限责任公司	5.18	BBB	是	是	是

续表

序号	公司名称	注册资本 (亿元)	2022 年分 类评级	是否具有以下业务资格		
				金融期货	投资咨询	资产管理
67	锦泰期货有限公司	5.07	BBB	是	是	是
68	渤海期货股份有限公司	5.00	A	是	是	是
69	海航期货股份有限公司	5.00	CCC	是	是	是
70	华龙期货股份有限公司	5.00	CCC	是	是	是
71	安粮期货股份有限公司	5.00	BBB	是	是	是
72	和融期货有限责任公司	5.00	BB	是	否	否
73	宁证期货有限责任公司	5.00	BBB	是	是	是
74	财达期货有限公司	5.00	BB	是	是	是
75	兴业期货有限公司	5.00	A	是	是	是
76	中融汇信期货有限公司	5.00	BBB	是	是	是
77	长安期货有限公司	4.93	BBB	是	是	是
78	东航期货有限责任公司	4.50	A	是	是	是
79	国联期货股份有限公司	4.50	A	是	是	是
80	云财富期货有限公司	4.50	BB	是	是	否
81	瑞达期货股份有限公司	4.45	A	是	是	是
82	华闻期货有限公司	4.20	BB	是	是	是
83	瑞银期货有限责任公司	4.20	BBB	是	否	否
84	徽商期货有限责任公司	4.10	A	是	是	是
85	一德期货有限公司	4.00	A	是	是	是
86	和合期货有限公司	3.90	BB	是	是	是
87	九州期货有限公司	3.76	CCC	是	是	是
88	华联期货有限公司	3.76	BBB	是	是	是
89	新纪元期货股份有限公司	3.75	D	是	是	是
90	国富期货有限公司	3.65	A	是	是	是
91	民生期货有限公司	3.61	BBB	是	是	是
92	上海东方财富期货有限公司	3.60	A	是	否	否
93	新湖期货股份有限公司	3.60	AA	是	是	是
94	中金期货有限公司	3.50	A	是	否	是
95	中银国际期货有限责任公司	3.50	BBB	是	是	是
96	中原期货股份有限公司	3.30	BB	是	是	是
97	迈科期货股份有限公司	3.28	CCC	是	是	是
98	倍特期货有限公司	3.20	BBB	是	是	是
99	国新国证期货有限责任公司	3.20	BB	是	否	是
100	道通期货经纪有限公司	3.00	BB	是	是	是

续表

序号	公司名称	注册资本 (亿元)	2022 年分 类评级	是否具有以下业务资格		
				金融期货	投资咨询	资产管理
101	美尔雅期货有限公司	3.00	BBB	是	是	是
102	福能期货股份有限公司	3.00	BB	是	是	是
103	铜冠金源期货有限公司	3.00	BB	是	是	是
104	神华期货有限公司	3.00	BB	是	是	否
105	国金期货有限责任公司	3.00	BBB	是	是	是
106	云晨期货有限责任公司	3.00	BB	是	否	否
107	盛达期货有限公司	3.00	CCC	是	否	是
108	华鑫期货有限公司	2.90	BB	是	是	是
109	中州期货有限公司	2.90	C	是	是	是
110	江海汇鑫期货有限公司	2.80	BB	是	是	是
111	中钢期货有限公司	2.80	BBB	是	是	是
112	中航期货有限公司	2.80	BB	是	是	是
113	中衍期货有限公司	2.50	BB	是	是	是
114	浙江新世纪期货有限公司	2.50	BBB	是	是	是
115	恒银期货有限公司	2.47	C	是	是	否
116	金石期货有限公司	2.40	BB	是	是	是
117	国盛期货有限责任公司	2.23	B	是	否	否
118	乾坤期货有限公司	2.11	BBB	是	否	否
119	津投期货经纪有限公司	2.00	CCC	是	是	否
120	北京首创期货有限责任公司	2.00	BB	是	是	是
121	国都期货有限公司	2.00	B	是	是	是
122	冠通期货股份有限公司	1.90	BBB	是	是	是
123	中财期货有限公司	1.90	BBB	是	是	是
124	中天期货有限责任公司	1.86	BB	是	是	否
125	金信期货有限公司	1.80	CCC	是	是	是
126	鑫鼎盛期货有限公司	1.80	BB	是	否	是
127	天鸿期货经纪有限公司	1.75	CCC	是	否	否
128	第一创业期货有限责任公司	1.70	BB	是	是	是
129	东方汇金期货有限公司	1.53	CCC	是	否	是
130	前海期货有限公司	1.50	D	是	是	否
131	金元期货股份有限公司	1.50	BB	是	是	是
132	上海大陆期货有限公司	1.50	CCC	是	是	是
133	先锋期货股份有限公司	1.50	B	是	是	是
134	天富期货有限公司	1.50	CCC	是	是	是

续表

序号	公司名称	注册资本 (亿元)	2022 年分 类评级	是否具有以下业务资格		
				金融期货	投资咨询	资产管理
135	长城期货股份有限公司	1.47	BB	是	否	否
136	中辉期货有限公司	1.43	CCC	是	是	是
137	晟鑫期货经纪有限公司	1.42	BB	是	否	否
138	上海东亚期货有限公司	1.40	BB	是	是	是
139	通惠期货有限公司	1.25	B	是	是	是
140	恒泰期货股份有限公司	1.25	BB	是	是	是
141	佛山金控期货有限公司	1.20	B	是	是	是
142	大越期货股份有限公司	1.20	BBB	是	是	是
143	大通期货经纪有限公司	1.12	C	是	否	是
144	山东齐盛期货有限公司	1.05	BB	是	是	是
145	金鹏期货经纪有限公司	1.01	BBB	是	是	是
146	山西三立期货经纪有限公司	1.00	CCC	是	否	否
147	华创期货有限责任公司	1.00	BB	是	是	是
148	永商期货有限公司	0.70	CCC	是	否	否
149	江苏东华期货有限公司	0.50	B	是	否	是
150	上海东方期货经纪有限责任公司	0.45	D	否	否	否

后 记

《中国期货市场年鉴（2022年）》编撰工作由中国证监会、中国期货业协会联合组织，中国期货业协会具体组织实施。编撰工作得到了中国证监会领导的关心和指导，得到了中国证监会内外相关单位的大力支持和配合，具体是：中国证监会期货监管部、上海期货交易所、郑州商品交易所、大连商品交易所、中国金融期货交易所、广州期货交易所、中国期货市场监控中心、中证商品指数有限责任公司、中国期货业协会，以及中国证监会国际部、投资者保护局等。中国财政经济出版社在编辑、出版及发行过程中给予了大力支持。在此，我们对上述领导和单位表示衷心的感谢！

参与本次年鉴编撰工作的人员有：

杨光	程莘	焦增军	巫伟斐	郑冰梅	吴亚军
李铭	鲁纳雯	许鑫	张宜生	贾燕	贾昆鹏
赵欣	祁国中	张惠岩	刘传君	康乐	于翔
海洋	谢亚	聂智洋	于延超	常鑫鑫	付迟
杨阳	于德阳	马晓旭	李团团	官雨	潘赛赛
刘丹	张润琪				

中国证券监督管理委员会
中国期货业协会
2023年6月