

2006 · 09
总第17期

月度市场报告

 郑州商品交易所

ZCE MONTHLY REPORT

目 录

一、小麦、棉花、白糖价格走势图.....	2
二、郑州商品交易所 9 月份交易统计.....	6
三、郑州商品交易所 9 月行情表.....	7
四、郑州商品交易所 9 月分品种每日结算价统计表.....	8
五、公告.....	10
六、市场综述.....	13
七、动态摘要.....	14

一、小麦、棉花、白糖价格走势图

图1 郑州小麦期货价与现货价走势图

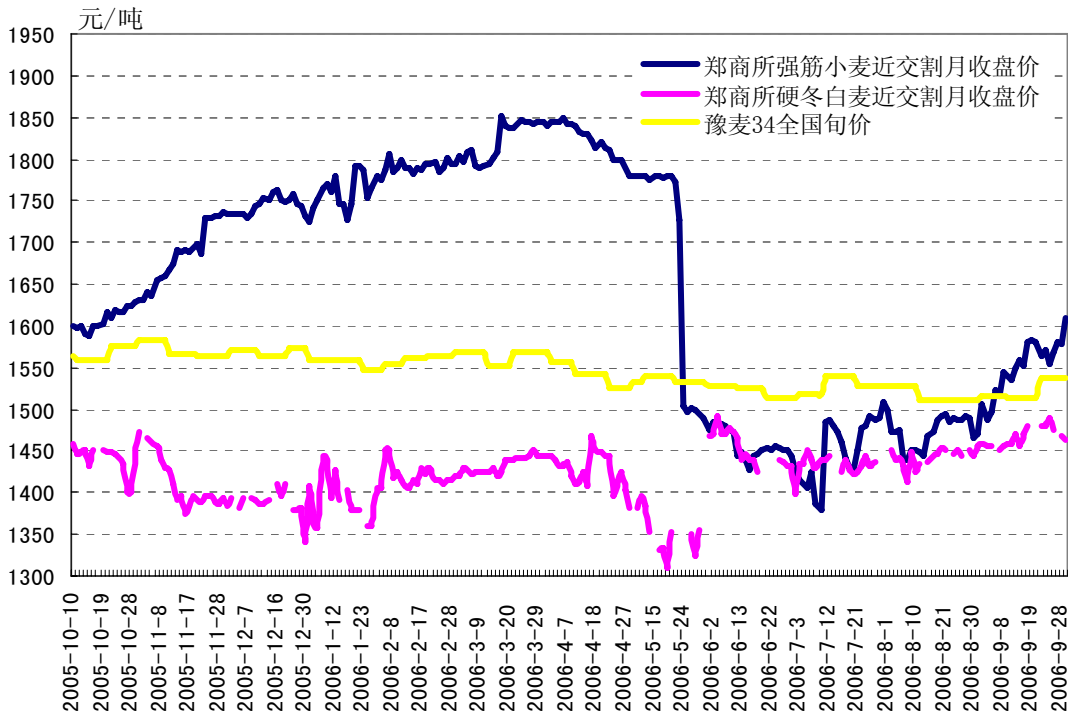


图2 郑州小麦期货价与CBOT小麦期货价走势图

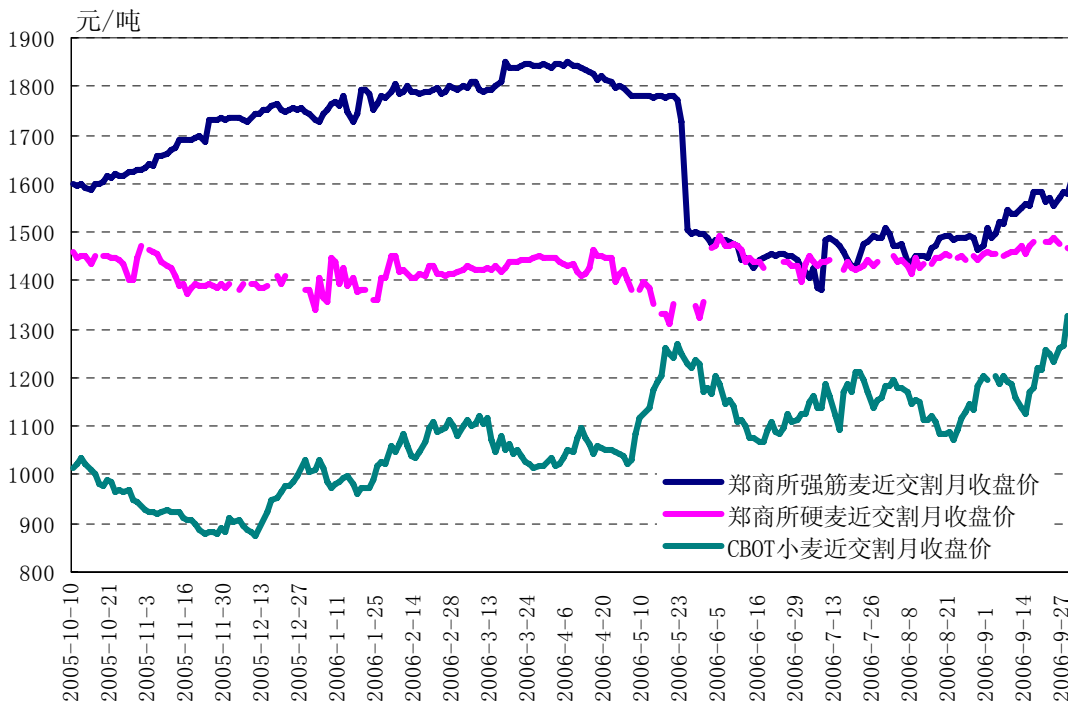


图3 郑州强筋小麦价与进口硬质小麦到岸价对比图

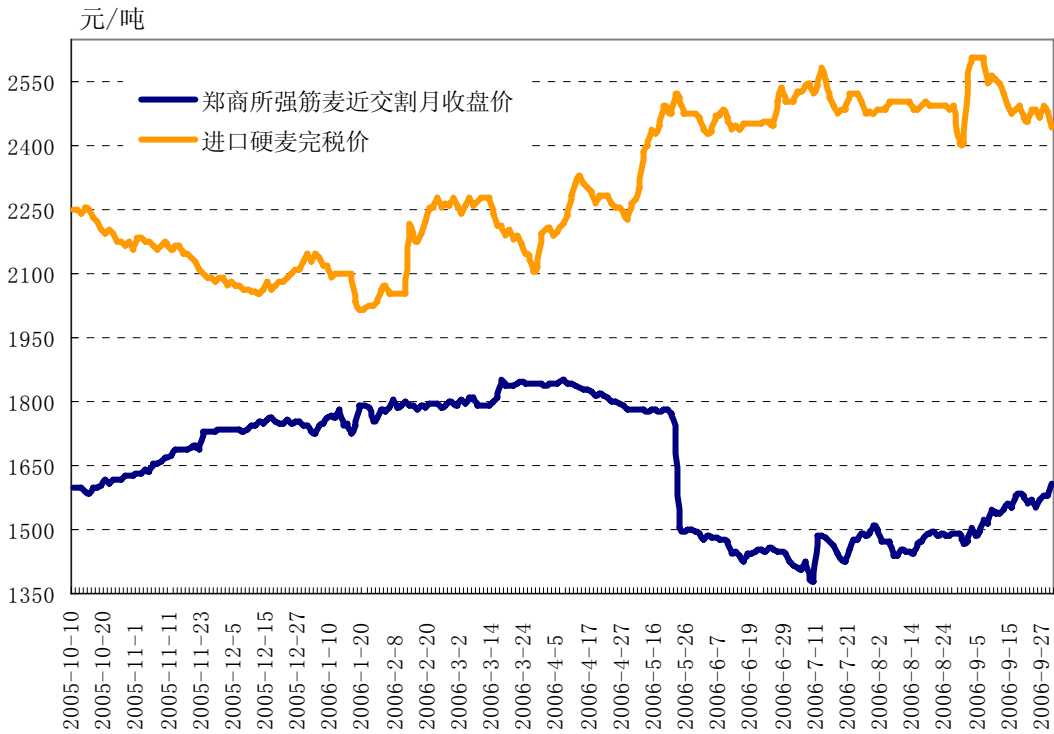


图4 郑州棉花期货价格与中国棉花价格指数对比图

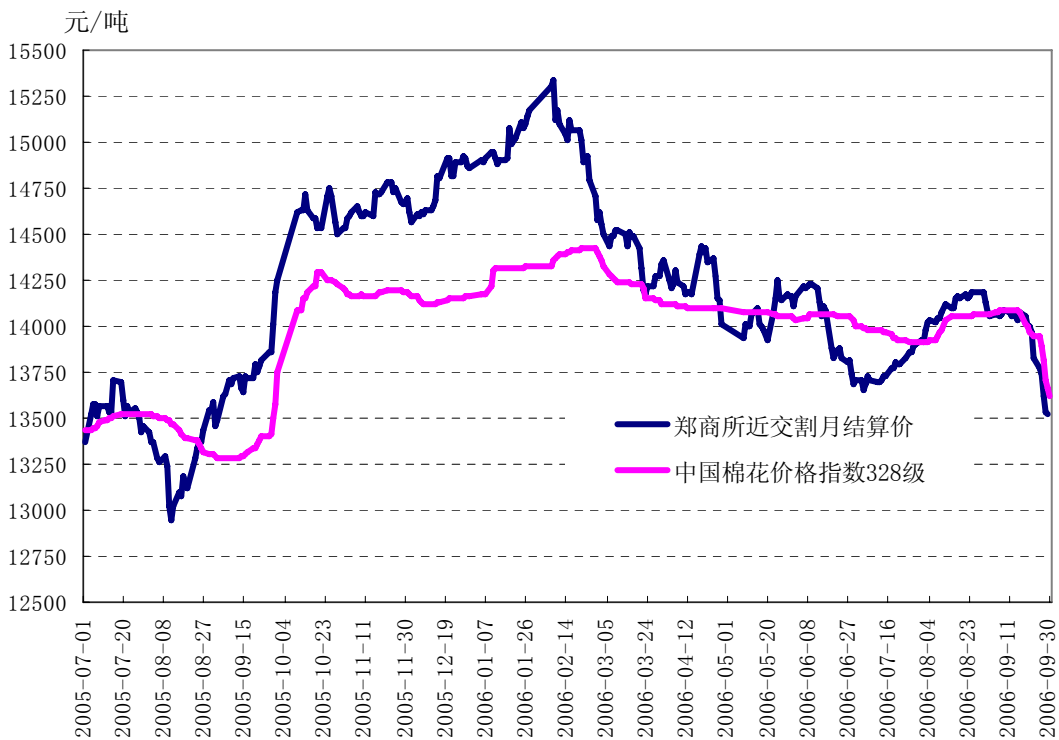


图5 郑州棉花期货与纽约棉花期货价格走势对比图

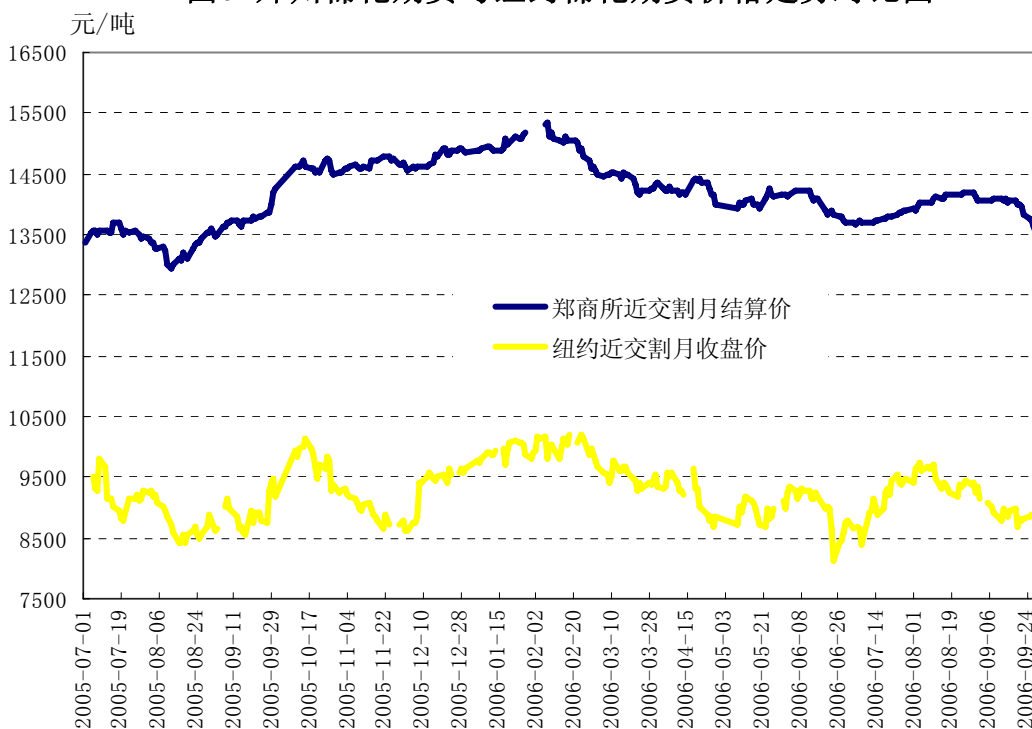


图6 郑州棉花期货价格与进口棉花价格指数对比图

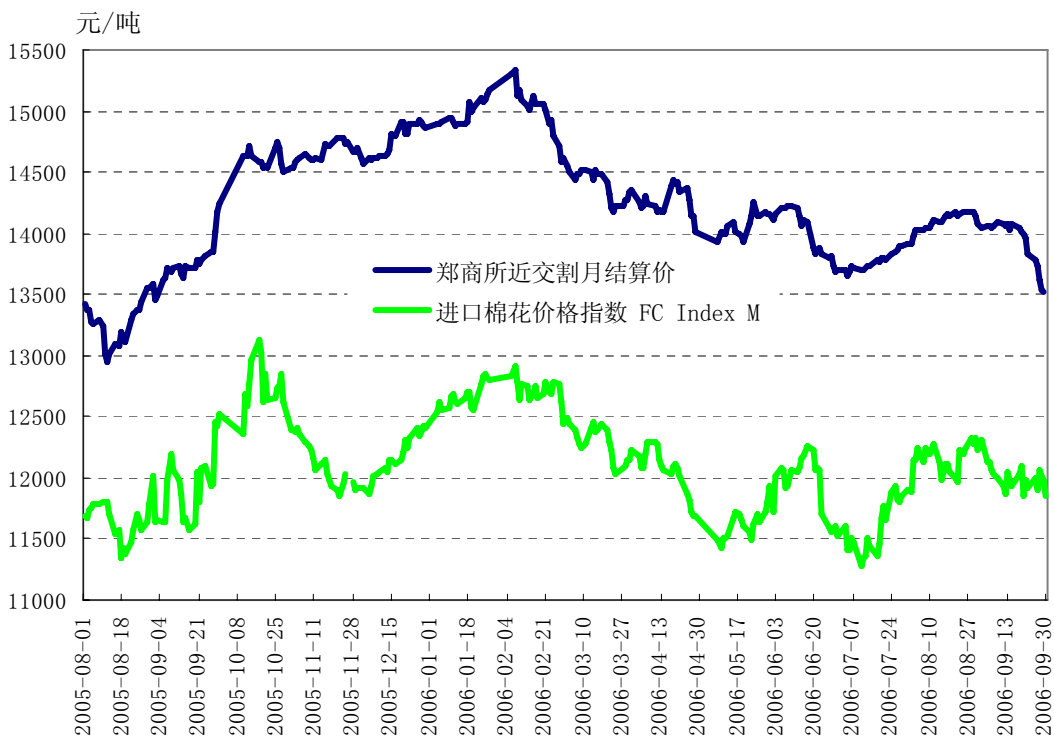


图7 郑州白糖期货价与现货价走势图

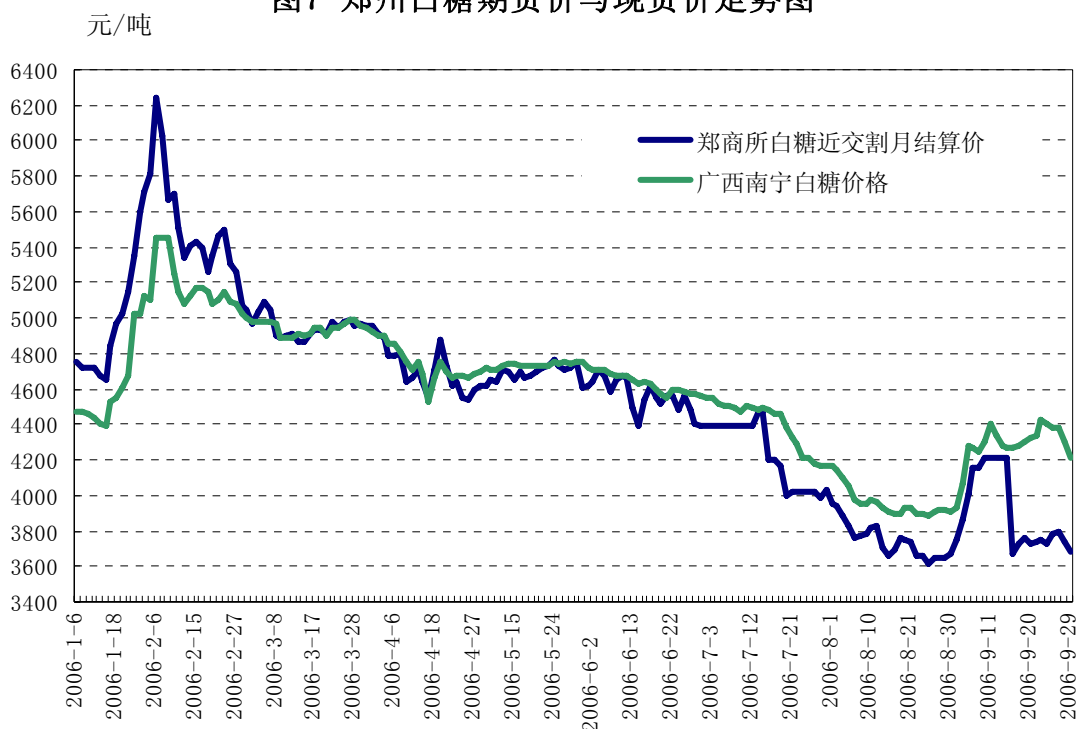
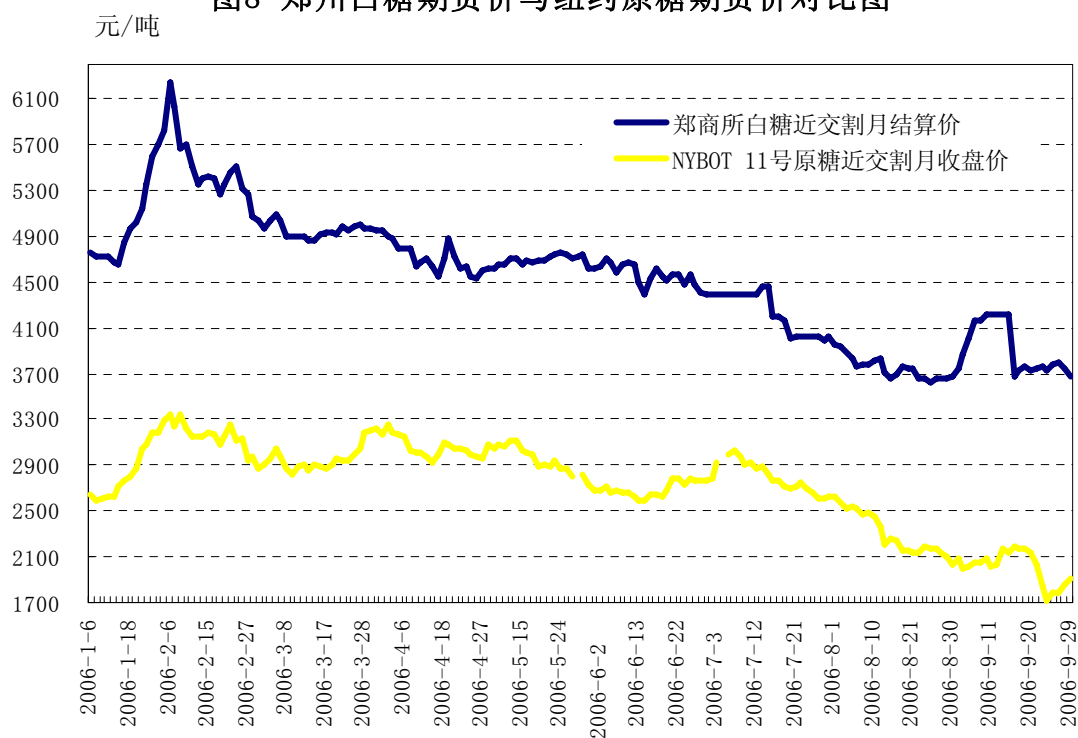


图8 郑州白糖期货价与纽约原糖期货价对比图



二、郑州商品交易所 9 月份交易统计

成交量

成交量	当月	去年同期	同比%	当年累计	去年同期累计	同比%
一号棉花	99,820	1,797,588	-94.45%	3,323,464	15,801,362	-78.97%
白糖	9,351,880	-	-	38,663,296	-	-
优质强筋小麦	3,365,664	2,161,988	55.67%	14,140,440	25,510,680	-44.57%
硬冬白小麦	2,760	15,540	-82.24%	43,716	1,907,818	-97.71%
合计	12,820,124	3,975,116	222.51%	56,170,916	43,219,860	29.97%

注：1.成交量单位：手；2.成交量按双边计算；3.合约单位：小麦、白糖 10 吨/手，棉花 5 吨/手；4.含期转现。

成交金额

成交金额	当月	去年同期	同比%	当年累计	去年同期累计	同比%
一号棉花	684,060	12,984,740	-94.73%	24,873,393	111,417,891	-77.68%
白糖	31,969,214	-	-	159,211,260	-	-
优质强筋小麦	5,413,105	3,574,418	51.44%	23,151,163	43,255,314	-46.48%
硬冬白小麦	4,083	23,459	-82.59%	64,630	2,971,176	-97.82%
合计	38,070,462	16,582,617	129.58%	207,300,446	157,644,380	31.50%

注：1、成交金额：万元；2、交易金额双边计算；3、含期转现。

持仓量

持仓量	当月	去年同期	同比%	上月	环比%
一号棉花	21,024	72,244	-70.90%	18,346	14.60%
白糖	132,876	-	-	156,726	-15.22%
优质强筋小麦	135,444	283,100	-52.16%	111,342	21.65%
硬冬白小麦	92	23,650	-99.61%	124	-25.81%
合计	289,436	378,994	-23.63%	286,538	1.01%

注：1.持仓量单位：手；2.持仓量按双边计算；3.合约单位：小麦、白糖 10 吨 / 手，棉花 5 吨 / 手。

实物交割

	200609 交割量	200609 期转现	200509 交割量	200509 期转现	当年合约 累计	去年同期合约 累计
一号棉花	384	96	1,256	4,280	25,596	26,452
白糖	1,206	0	-	-	2,281	-
优质强筋小麦	12,421	90	1,943	0	49,713	18,676
硬冬白小麦	0	0	760	6	118	6,709
合计	14,011	186	3,959	4,286	77,708	51,837

注：1、合约交割量单位：手；2、交割量按单边计算；3、合约单位：小麦、白糖 10 吨 / 手，棉花 5 吨 / 手。

三、郑州商品交易所 9 月行情表

品 种	月开盘 (元/吨)	最高价 (元/吨)	最低价 (元/吨)	月收盘 (元/吨)	月末持仓量 (张)	持仓变化 (张)	月末结算价 (元/吨)	成交量 (手)	成交额 (亿元)
CF609	13935	14200	13935	14100	0	-724	14030	718	0.505
CF610	14095	14270	13140	13485	238	-518	13525	984	0.688
CF611	13745	13895	13500	13525	2,502	-5178	13560	46,202	31.724
CF612	13840	13925	13410	13500	5,210	1722	13510	23,642	16.083
CF701	13915	14300	13425	13535	7,420	4816	13520	22,080	15.082
CF703	14250	14400	13630	13730	1,844	1066	13720	2,836	1.961
CF704	14380	14380	13740	13820	896	342	13820	932	0.651
CF705	14245	14435	13835	13920	2,626	942	13920	1,716	1.205
CF707	14315	14560	14015	14090	250	172	14090	564	0.402
CF709	15030	15030	14230	14430	38	38	14350	146	0.105
小计	-	-	-	-	21,024	-	-	99,820	68.406
GN609	0	0	0	0	0	0		0	0
GN611	0	0	0	0	0	0		0	0
GN701	0	0	0	0	0	0		0	0
GN703	0	0	0	0	0	0		0	0
GN705	0	0	0	0	0	0		0	0
GN707	0	0	0	0	0	0		0	0
GN709	0	0	0	0	0			0	0
小计	-	-	-	-	0	-	-	0	0
SR609	3810	4230	3755	4230	2,414	-44	4208	598	0.246
SR611	3601	3850	3578	3659	978	-550	3679	1,838	0.684
SR701	3325	3613	3325	3469	4,172	-2466	3470	19,280	6.699
SR703	3302	3576	3284	3341	65,726	-27342	3350	6,637,492	2,259.95
SR705	3330	3629	3323	3369	44,140	6956	3377	2,505,886	864.213
SR707	3370	3675	3360	3418	14,896	-954	3422	182,212	63.49
SR709	3540	3726	3410	3480	2,964	2964	3479	4,574	1.637
小计	-	-	-	-	135,290	-	-	9,351,880	3,196.922
WS609	1477	1535	1460	1535	24	-24786	1535	4,414	0.659
WS611	1516	1610	1486	1609	4,258	-5224	1598	30,992	4.785
WS701	1553	1655	1532	1654	91,088	24616	1642	2,998,028	480.133
WS703	1586	1672	1568	1672	1,490	796	1656	6,622	1.081
WS705	1629	1718	1611	1703	29,912	22894	1696	310,204	52.129
WS707	1590	1610	1557	1605	4,610	1744	1595	9,844	1.565
WS709	1681	1756	1680	1756	4,086	4086	1746	5,560	0.959
小计	-	-	-	-	135,468	-	-	3,365,664	541.311
WT609	1502	1502	1442	1442	0	0	1472	4	0.001

WT611	1455	1520	1445	1463	4	-50	1467	664	0.098
WT701	1455	1492	1450	1480	48	16	1477	382	0.056
WT703	1460	1496	1442	1486	12	0	1481	568	0.084
WT705	1450	1529	1450	1491	18	8	1489	508	0.076
WT707	1480	1502	1443	1485	4	-12	1485	592	0.088
WT709	1500	1510	1456	1507	6	6	1486	42	0.006
小计	-	-	-	-	92	-	-	2,760	.408
总计	-	-	-	-	291,874	-	-	12,820,124	3,807.046

注： 1、成交量、成交额、月末持仓量均按双边计算； 2、不含期转现。

四、郑州商品交易所 9 月分品种每日结算价统计表

棉花 CF												
交易日期	609	610	611	612	701	703	704	705	707	709	成交量	持仓量
2006-9-1	14050	14130	13845	13885	13980	14145	14205	14305	14360		6,806	17,956
2006-9-4	14065	14050	13675	13740	13855	14035	14115	14200	14340		10,078	18,430
2006-9-5	14060	14070	13675	13735	13845	14015	14110	14190	14295		4,342	18,630
2006-9-6	14050	14150	13745	13795	13890	14060	14110	14200	14440		5,986	17,792
2006-9-7	14060	14205	13785	13820	13910	14090	14185	14310	14440		4,136	17,532
2006-9-8	14090	14215	13800	13790	13900	14085	14205	14275	14340		3,414	17,190
2006-9-11	14080	14145	13695	13680	13785	13985	14065	14150	14290		5,190	18,504
2006-9-12	14055	14110	13745	13720	13820	13995	14080	14175	14290		3,910	18,206
2006-9-13	14080	14060	13815	13795	13890	14070	14135	14225	14325		3,888	17,860
2006-9-14	14030	14080	13795	13800	13925	14125	14200	14240	14325		3,508	16,988
2006-9-15		14075	13765	13765	13895	14090	14200	14280	14325	14200	2,358	17,162
2006-9-18		14050	13735	13690	13840	14025	14115	14230	14320	14200	3,608	17,232
2006-9-19		14005	13715	13645	13775	13950	14055	14160	14245	14525	4,128	17,570
2006-9-20		14000	13675	13540	13650	13860	13960	14065	14215	14410	5,172	18,558
2006-9-21		13965	13745	13565	13665	13880	13980	14070	14245	14440	2,914	18,256
2006-9-22		13830	13690	13470	13555	13775	13865	13970	14155	14335	5,286	19,682
2006-9-25		13775	13660	13460	13505	13695	13820	13895	14135	14320	5,694	20,642
2006-9-26		13740	13610	13480	13490	13670	13765	13860	14135	14320	6,856	21,658
2006-9-27		13620	13615	13535	13540	13730	13830	13915	14085	14320	5,954	21,110
2006-9-28		13535	13610	13535	13545	13745	13845	13940	14090	14400	3,292	20,926
2006-9-29		13525	13560	13510	13520	13720	13820	13920	14090	14350	3,300	21,024
强筋小麦 WS												
交易日期	609	611	701	703	705	707	709	成交量	持仓量			
2006-9-1	1471	1511	1558	1593	1635	1588		112,010	92,100			
2006-9-4	1472	1490	1538	1577	1616	1570		107,684	98,754			

2006-9-5	1479	1493	1541	1580	1618	1573		87,962	103,120
2006-9-6	1485	1512	1559	1594	1640	1585		131,556	89,186
2006-9-7	1490	1515	1563	1598	1643	1585		105,576	87,956
2006-9-8	1497	1536	1585	1616	1666	1597		141,368	101,034
2006-9-11	1520	1548	1599	1623	1677	1601		244,108	101,858
2006-9-12	1502	1529	1579	1611	1657	1583		155,520	100,778
2006-9-13	1502	1541	1589	1621	1670	1587		172,096	106,988
2006-9-14	1502	1555	1603	1637	1682	1595		204,410	122,110
2006-9-15	1502	1554	1604	1637	1683	1593		178,008	117,976
2006-9-18	1502	1574	1623	1657	1703	1604		195,340	130,878
2006-9-19	1529	1581	1629	1659	1707	1604		166,526	138,318
2006-9-20	1535	1584	1632	1663	1709	1606		250,760	140,480
2006-9-21	1535	1569	1619	1648	1691	1592		216,176	124,682
2006-9-22		1567	1615	1633	1679	1586	1693	166,196	121,990
2006-9-25		1561	1606	1623	1666	1572	1702	135,144	114,956
2006-9-26		1562	1605	1621	1669	1576	1712	128,792	116,480
2006-9-27		1573	1619	1639	1681	1583	1727	158,796	121,290
2006-9-28		1580	1624	1640	1681	1585	1728	125,536	119,030
2006-9-29		1598	1642	1656	1696	1595	1746	182,100	135,444

硬冬白小麦 WT

交易日期	609	611	701	703	705	707	709	成交量	持仓量
2006-9-1	1459	1457	1465	1478	1482	1477		44	132
2006-9-4	1472	1455	1455	1478	1498	1477		50	140
2006-9-5	1472	1456	1456	1476	1498	1470		194	136
2006-9-6	1472	1456	1455	1476	1498	1472		36	144
2006-9-7	1472	1451	1461	1476	1498	1472		24	128
2006-9-8	1472	1455	1468	1483	1484	1483		160	126
2006-9-11	1472	1458	1466	1483	1484	1479		158	126
2006-9-12	1472	1458	1461	1483	1500	1475		198	118
2006-9-13	1472	1450	1463	1475	1490	1475		290	82
2006-9-14	1472	1465	1475	1477	1494	1486		572	84
2006-9-15	1472	1462	1468	1477	1500	1490		60	88
2006-9-18	1472	1475	1475	1481	1503	1490		118	86
2006-9-19	1472	1475	1475	1487	1503	1490		22	86
2006-9-20	1472	1475	1473	1487	1506	1490		56	82
2006-9-21	1472	1494	1473	1483	1500	1490		296	82
2006-9-22		1483	1472	1488	1492	1490	1530	84	88
2006-9-25		1483	1472	1488	1495	1490	1500	120	102
2006-9-26		1473	1472	1481	1491	1490	1500	98	98
2006-9-27		1473	1480	1481	1493	1490	1500	52	98
2006-9-28		1472	1477	1481	1489	1485	1500	74	88

2006-9-29		1467	1477	1481	1489	1485	1486	54	92
白糖 SR									
交易日期	609	611	701	703	705	707	709	成交量	持仓量
2006-9-1	3864	3669	3384	3351	3387	3426		237048	141530
2006-9-4	3969	3692	3415	3358	3406	3462		747520	119828
2006-9-5	4013	3724	3437	3382	3429	3470		539848	127354
2006-9-6	4160	3691	3425	3374	3411	3446		447042	131528
2006-9-7	4160	3657	3439	3378	3420	3463		337266	127136
2006-9-8	4208	3720	3494	3422	3460	3507		622880	139112
2006-9-11	4208	3774	3486	3430	3472	3515		541766	132776
2006-9-12	4208	3706	3445	3361	3403	3448		373142	131902
2006-9-13	4208	3616	3417	3335	3378	3417		433362	133418
2006-9-14	4208	3623	3473	3415	3461	3508		440606	132950
2006-9-15		3674	3471	3412	3455	3499	3553	299916	132084
2006-9-18		3725	3518	3484	3533	3583	3651	368832	147568
2006-9-19		3764	3571	3527	3580	3626	3656	656384	149238
2006-9-20		3727	3549	3486	3529	3572	3656	696900	150174
2006-9-21		3740	3570	3466	3503	3550	3597	545230	134604
2006-9-22		3755	3547	3420	3457	3501	3549	387766	133306
2006-9-25		3732	3496	3328	3357	3404	3438	346912	141390
2006-9-26		3787	3497	3343	3375	3429	3480	488936	144728
2006-9-27		3800	3509	3371	3394	3444	3497	338696	147366
2006-9-28		3736	3486	3340	3366	3408	3466	306340	146184
2006-9-29		3679	3470	3350	3377	3422	3479	195488	132876

注：1. 价格单位：元/吨；2. 成交量、持仓量按双边计算，单位：手；3. 含期转现。

五、公告

关于 CF709、SR709 合约基准价的通告

(2006) 第 13 号

现将 2006 年 9 月 15 日上市交易的各品种合约基准价通告如下：

CF709 14200 元/吨

SR709 3500 元/吨

特此通告，请及时转告广大投资者。

二 00 六年九月十四日

关于 WS709、WT709、GN709 合约基准价的通告

(2006) 第 14 号

现将 2006 年 9 月 22 日上市交易的各品种合约基准价通告如下:

WS709 1640 元/吨

WT709 1530 元/吨

GN709 3000 元/吨

特此通告, 请及时转告广大投资者。

二 00 六年九月二十一日

关于 06/07 年产交割棉重量溢短计价标准的通告

(2006) 第 15 号

各会员单位:

根据《郑州商品交易所棉花交割细则》第二十二规定, 经广泛深入调研, 确定 06/07 年度生产的交割棉重量溢短的计价标准为 13000 元/吨。

特此通告, 请及时转告广大投资者。

二 00 六年九月二十六日

关于取消河南国家粮食储备库交割仓库资格的通告

(2006) 第 16 号

各会员单位:

在 2006 年郑州商品交易所组织的强麦出库复检中, 河南国家粮食储备库拒不执行规则, 不接受郑州商品交易所的监管, 造成了恶劣影响。经研究决定, 取消河南国家粮食储备库交割仓库资格。

特此通告。

二 00 六年九月二十八日

关于 2006/07 制糖年度白糖交割入库费用的通告

(2006) 第 17 号

各会员单位:

根据《郑州商品交易所白糖交割细则》第十九条之规定, 现将 2006/07 制糖年度(2006 年 10 月 1 日至 2007 年 9 月 30 日)开展白糖期货交割业务的交割仓库及其入库收费标准公布如下:

一、广西柳州国家粮食储备库

汽车入库: 9 元/吨(卸车、搬运、码垛)

火车入库: 19 元/吨(铁路代转、卸车、库内运输、码垛)

二、广西中糖物流有限公司

汽车入库: 10 元/吨(卸车、上堆、理货)

集装箱入库: 14 元/吨(掏箱、卸车、上堆、理货)

火车入库: 北海港口专用线运输: 32 元/吨(含火车、汽车对装、短途运输、上堆)

船运入库: 北海港入库费用 35 元/吨(含卸船、装车、短途运输、卸车、上堆、理货; 过驳装卸费、港务港建等费用另计)

三、广西南宁国家粮食储备库

汽车入库: 15 元/吨(卸车、搬运、码垛)

火车入库: 25 元/吨(卸车、站台落地、装车、库内短运、码垛)

船舶入库: 25 元/吨

四、湛江糖库储运有限公司

汽车入库: 10 元/吨(卸车、库内运输堆垛)

火车入库: 32 元/吨(火车卸车、货车装车、车站到仓库短运、货车卸车、库内运输堆垛)

船运入库: 47 元/吨(卸船、货车装车、港口到仓库短运、货车卸车、库内短途运输堆垛)

五、南海华商实业有限公司

汽车入库: 12 元/吨(卸车、搬运、码垛等)

火车入库: 22 元/吨(铁路代转、卸车、码垛等)

船运入库: 24 元/吨(卸船、搬运、码垛等), 不含港建费

六、昆明国家粮食储备有限公司

汽车入库: 10 元/吨(卸车、搬运、码垛等);

火车入库: 30 元/吨(铁路代转、卸火车、装汽车、库内短运、码垛等)

七、上海东方通海物流有限公司

汽车入库: 12 元/吨

集装箱入库: 20 元/吨(卸车、库内运输、堆垛、铁路费用、整理费)

火车入库: 25 元/吨 (卸车、库内运输、堆垛、铁路费用)

船运入库: 24 元/吨 (0.5 元/吨港务费另计)

八、中糖世纪股份有限公司江苏分公司

汽车入库: 非集装箱 11 元/吨, 集装箱 14 元/吨 (卸车、打关、规格堆码)

船运入库: 34.5 元/吨 (卸船、装车、港杂费、短运、卸车、打关、规格堆码)

九、中糖世纪股份有限公司河南分公司

汽车入库: 18 元/吨 (卸车、库内短运、码垛)

集装箱入库: 20 元/吨 (掏箱、卸车、库内短运、码垛)

火车入库: 28 元/吨 (专用线使用费、装车、短运、码垛)

十、天津工艺品进出口 (集团) 公司艺达储运贸易公司

汽车入库: 汽车到货 10 元/吨 (卸车、码垛)

集装箱入库: 24 元/吨 (掏箱、卸车、短运、码垛)

火车入库: 25 元/吨 (卸车、搬运、码垛)。

二 00 六年九月二十九日

六、市场综述

本月小麦期货价格振荡上扬。主力合约 WS701 当月波动区间为 1532 - 1655 元, 最大波幅 123 元/吨, 月底报收于 1654 元, 较上月涨 99 元/吨。

本月棉花期货价格继续下跌。主力合约 CF611 当月波动区间为 13500-13895 元, 最大波幅 395 元/吨, 月底报收于 13525 元, 较上月跌 175 元/吨。

本月白糖期货价格低位振荡。主力合约 SR703 当月波动区间为 3284 - 3576 元, 最大波幅 292 元/吨, 月底收报 3341 元, 较上月涨 69 元/吨。

郑州期货市场本月总成交量 12, 820, 124 手, 其中成交强麦期货合约 3, 365, 664 手、硬麦期货合约 2, 760 手、棉花期货合约 99, 820 手、白糖期货合约 9, 351, 880 手。截至 9 月 29 日, 总持仓量达 291, 874 手, 其中强麦持仓量 135, 468 手、硬麦 92 手, 棉花 21, 024 手, 白糖 135, 290 手。

七、动态摘要

2006年9月4日,郑商所白砂糖合约交易成交量再创历史新高,共成交标准合约747520张。

2006年9月18日,郑商所与印度多种商品交易所(MCX)签署合作谅解备忘录。

2006年9月19日,参加“中部论坛”会议的中央政治局委员、湖北省委书记俞正声、省长罗清泉,安徽省委书记郭金龙、省长王金山,湖南省省长周伯华等领导同志,在河南省委书记徐光春、省长李成玉、省委秘书长李柏拴陪同下视察了郑商所。理事长王献立简要介绍了郑商所的发展情况。俞正声对郑商所在促进农业经济发展等方面的作用给予充分肯定,希望郑商所紧紧抓住中部崛起的战略机遇,做好工作,为国民经济发展做出更大贡献。湖南省长周伯华、安徽省长王金山一致表示,希望菜籽油期货早日上市,使湖南、安徽广大农民能够利用期货市场指导生产。俞正声同志说,你们要抓紧工作,促进菜籽油期货早日上市。湖北是油菜籽生产大省,广大农民需要油菜籽价格信息,以更好地利用市场手段促进油菜产业的发展。据统计,湖北、湖南、安徽三省油菜籽产量占全国80%左右。

2006年9月20日,芝日加哥期权交易所(CBOE)执行副主席Edward Tilly一行访问郑商所。

2006年9月20日,郑商所总交易成交量再创历史新高,共成交标准合约952888张,打破了在2003年10月23日创造的887446张的历史最高记录。

2006年9月21日,郑商所与蒙特利尔交易所(MX)签署合作谅解备忘录。



地址：郑州市未来大道 69 号

邮编：450008

电话：0086-371-65610069

传真：0086-371-65613068

<http://www.czcw.com.cn>