

2006 · 10  
总第 18 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 10 月份交易统计.....	6
三、郑州商品交易所 10 月行情表.....	7
四、郑州商品交易所 10 月分品种每日结算价统计表.....	8
五、市场综述.....	10
六、动态摘要.....	10

### 一、小麦、棉花、白糖价格走势

图1 郑州小麦期货价与现货价走势图

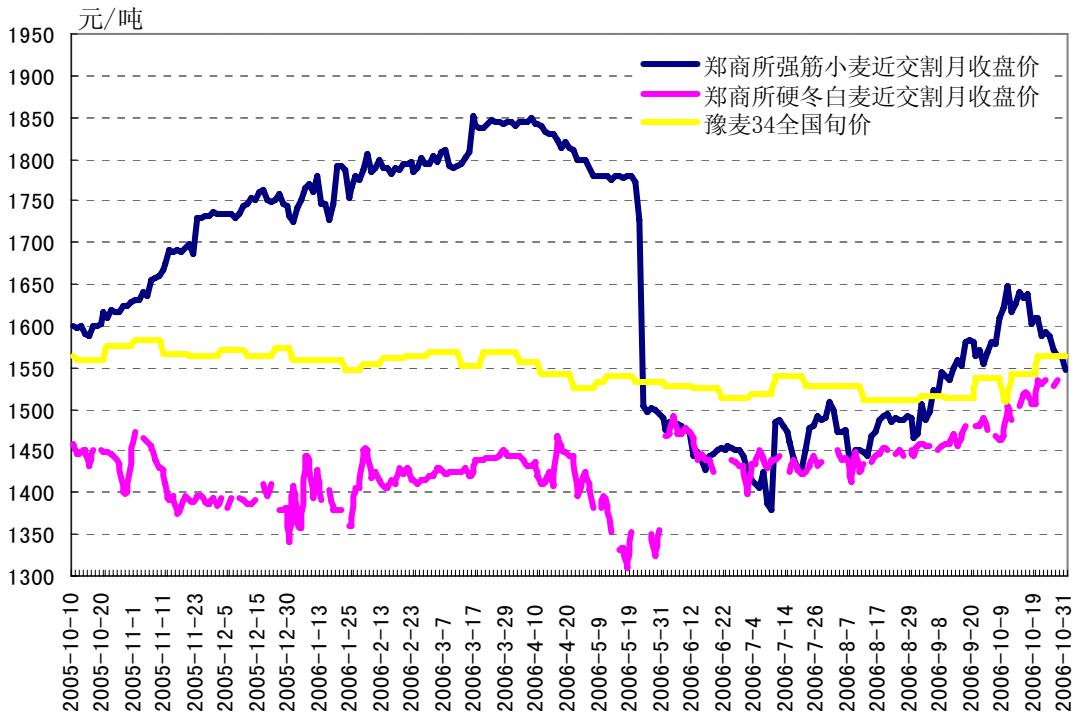


图2 郑州小麦期货价与CBOT小麦期货价走势图

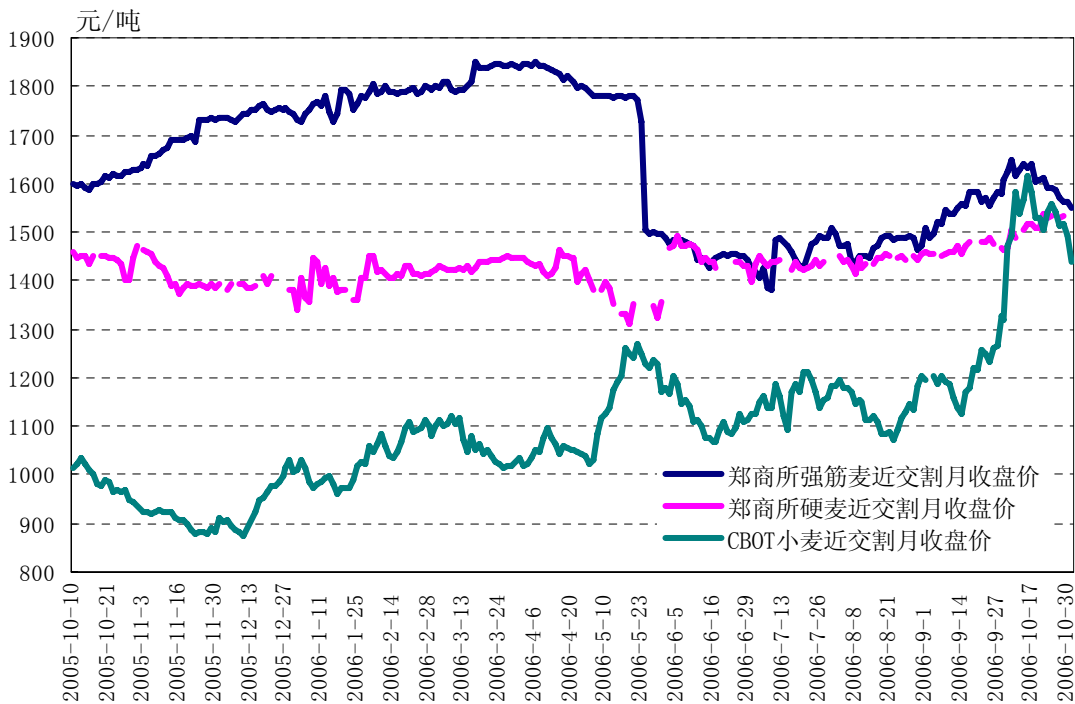


图3 郑州强筋小麦价与进口硬质小麦到岸价对比图

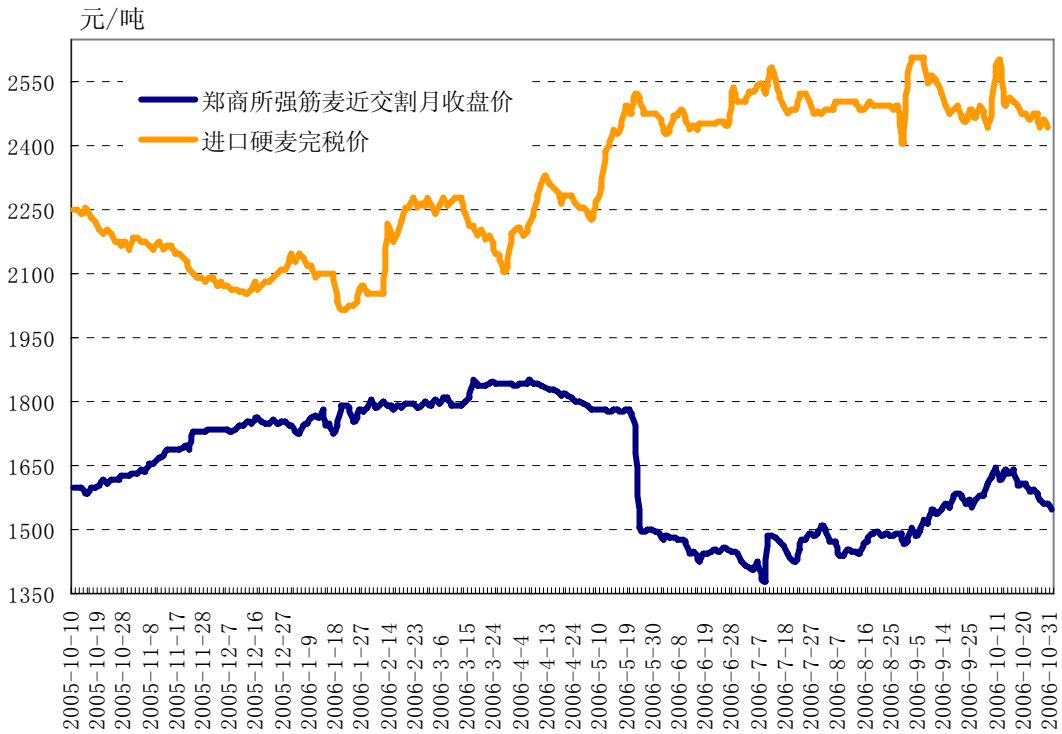


图4 郑州棉花期货价格与中国棉花价格指数对比图

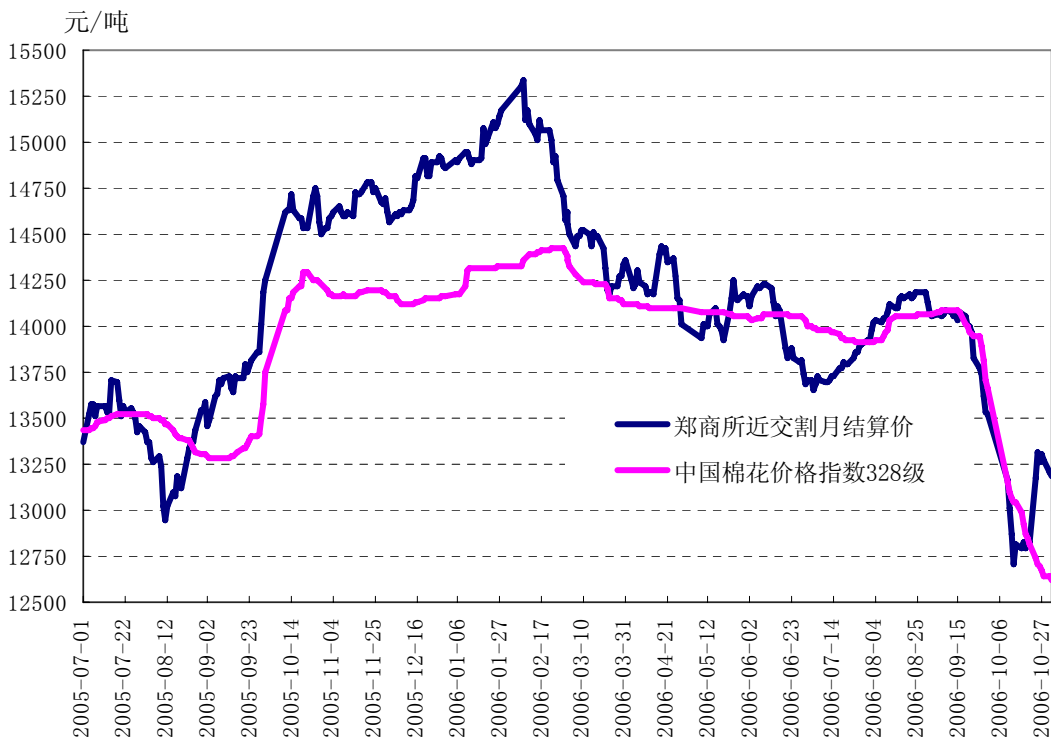


图5 郑州棉花期货与纽约棉花期货价格走势对比图

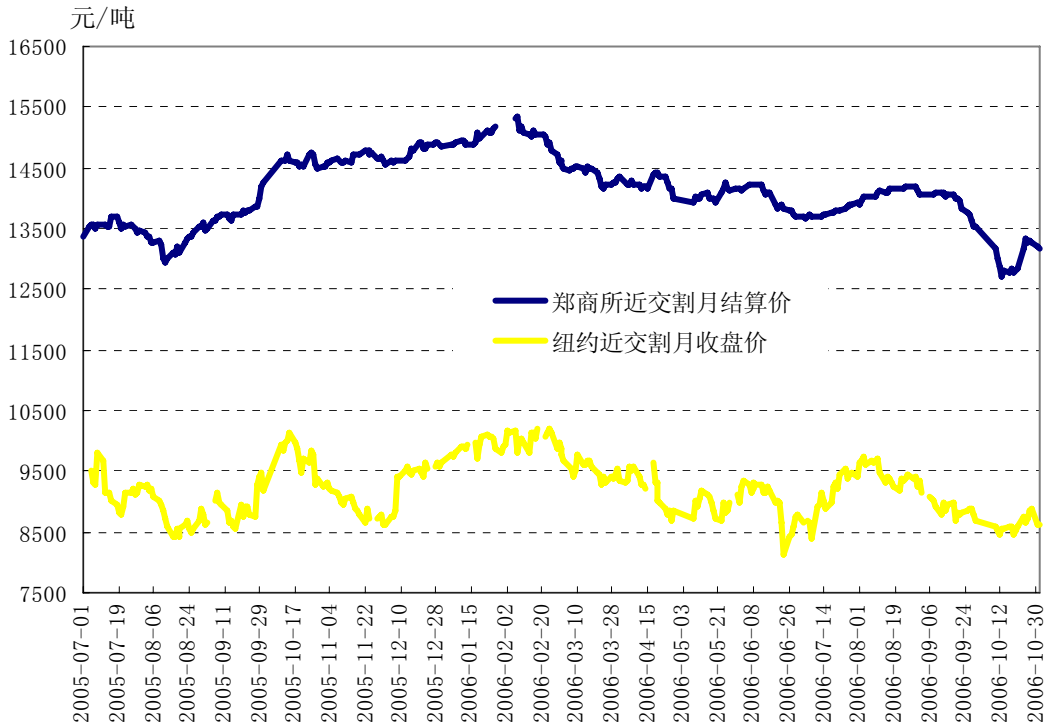


图6 郑州棉花期货价格与进口棉花价格指数对比图

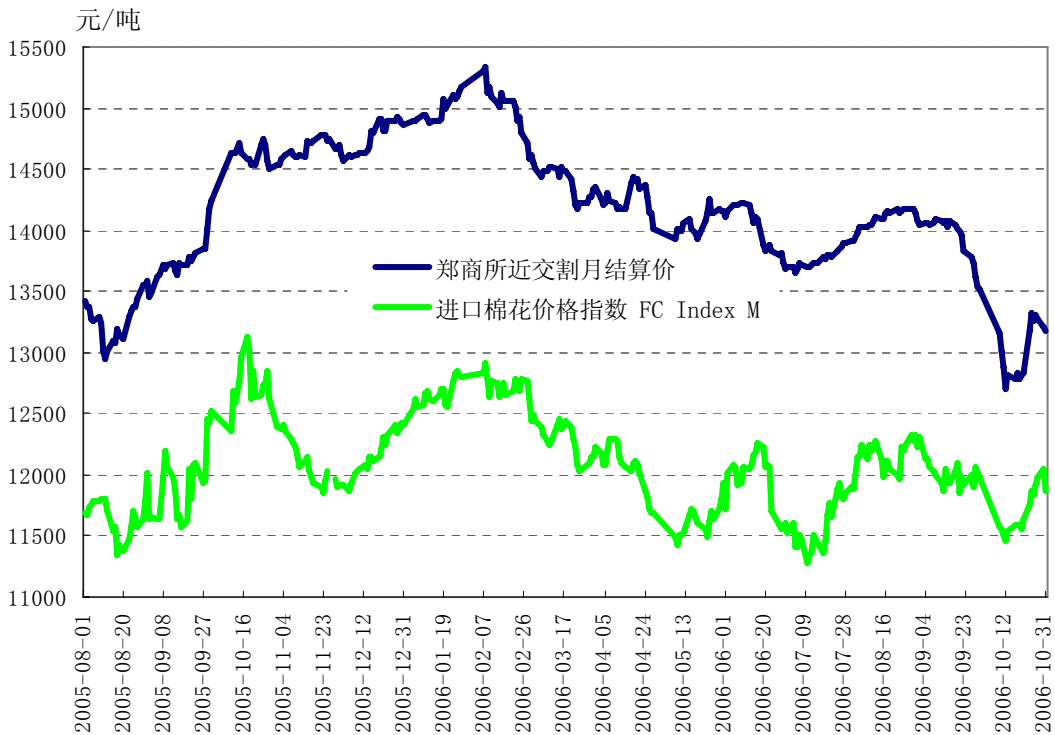


图7 郑州白糖期货价与现货价走势图

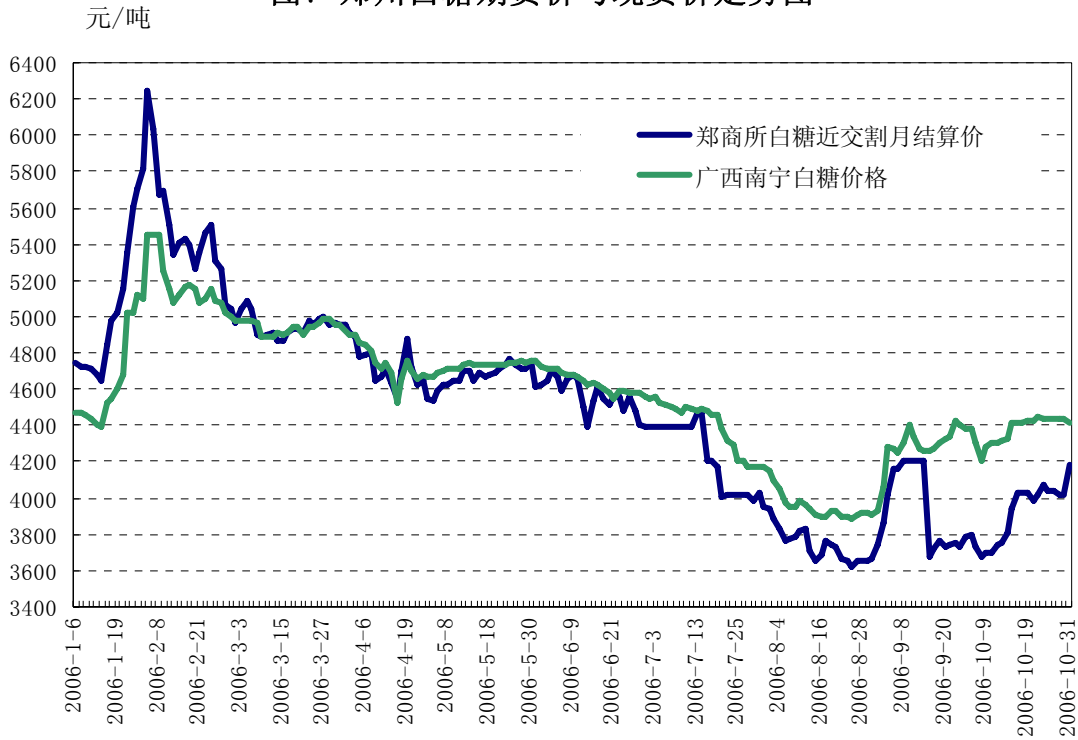
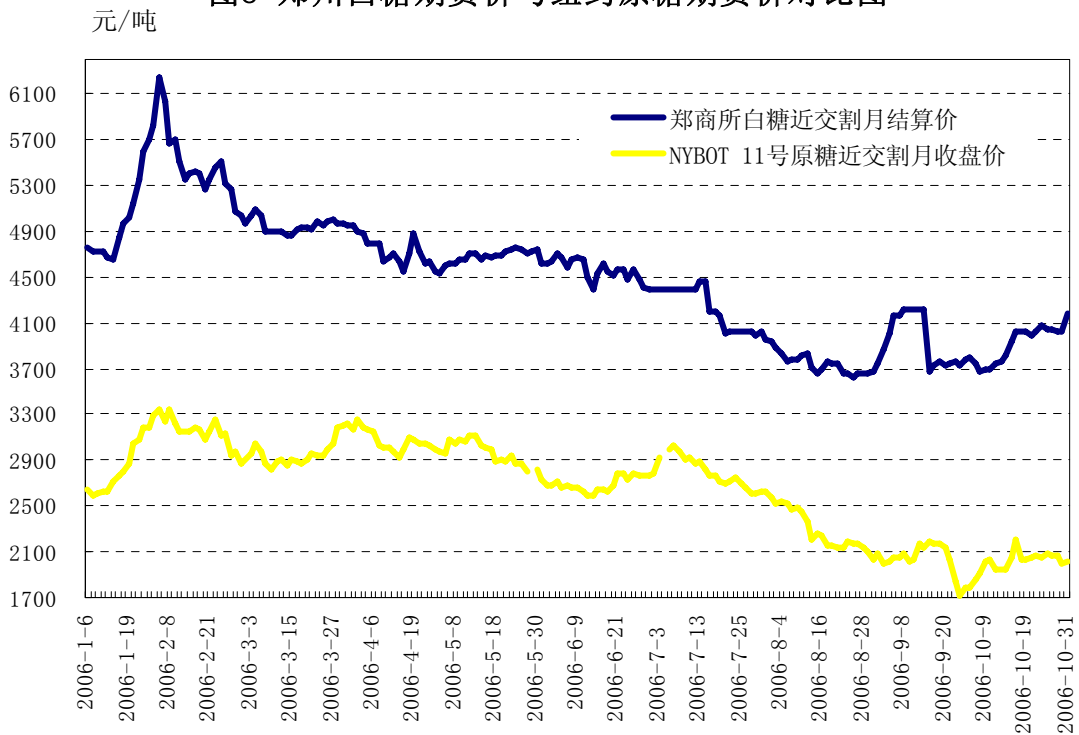


图8 郑州白糖期货价与纽约原糖期货价对比图



## 二、郑州商品交易所 10 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	139,870	1,888,492	-92.59%	3,463,334	17,689,854	-80.42%
白糖	8,801,080	-	-	47,464,376	-	-
优质强筋小麦	4,041,630	2,287,708	76.67%	18,182,070	27,798,388	-34.59%
硬冬白小麦	5,398	19,224	-71.92%	49,114	1,927,042	-97.45%
合计	12,987,978	4,195,424	209.57%	69,158,894	47,415,284	45.86%

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	939,264	14,576,546	-93.56%	25,812,657	125,994,436	-79.51%
白糖	32,562,152	-	-	191,773,412	-	-
优质强筋小麦	6,906,561	3,944,483	75.09%	30,057,724	47,199,797	-36.32%
硬冬白小麦	8,214	28,403	-71.08%	72,844	2,999,579	-97.57%
合计	40,416,190	18,549,432	117.88%	247,716,636	176,193,812	40.59%

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	30,178	82,798	-63.55%	21,024	43.54%
白糖	164,928	-	-	132,876	24.12%
优质强筋小麦	188,488	359,442	-47.56%	135,444	39.16%
硬冬白小麦	304	12,444	-97.56%	92	230.43%
合计	383,898	454,684	-15.57%	289,436	32.64%

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

	200610 交割量	200610 期转现	200510 交割量	200510 期转现	当年合约 累计	去年同期合约 累计
一号棉花	108	0	1,456	2,380	25,704	29,780
白糖	-	-	-	-	2,281	-
优质强筋小麦	-	-	-	-	49,713	18,676
硬冬白小麦	-	-	-	-	118	6,709
合计	108	0	1,456	2,380	77,816	55,165

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 10 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)
CF610	13695	13695	12605	12780	0	-238	12825	276	0.178
CF611	13405	13405	12995	13140	982	-1520	13180	2,708	1.787
CF612	13385	13475	13045	13205	2,920	-2290	13235	8,832	5.849
CF701	13380	13595	13105	13315	12,366	4946	13340	101,078	67.627
CF703	13550	13765	13320	13555	4,288	2444	13585	12,608	8.566
CF704	13620	13980	13425	13680	2,802	1906	13720	4,614	3.162
CF705	13700	13960	13520	13820	6,260	3634	13865	8,590	5.939
CF707	14000	14100	13680	14000	412	162	14025	572	0.399
CF709	14120	14400	13905	14340	148	110	14290	592	0.42
<b>小计</b>	-	-	-	-	<b>30,178</b>	-	-	<b>139,870</b>	<b>93.926</b>
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	0
<b>小计</b>	-	-	-	-	<b>0</b>	-	-	<b>0</b>	<b>0</b>
SR611	3700	4181	3700	4181	8	-970	4179	1,152	0.44
SR701	3457	3937	3456	3785	2,554	-1618	3769	15,676	5.87
SR703	3342	3878	3338	3696	38,482	-27244	3684	3,940,020	1,436.32
SR705	3371	3917	3365	3732	85,014	40874	3735	4,567,234	1,708.81
SR707	3407	3965	3407	3784	27,512	12616	3790	241,284	91.085
SR709	3500	4012	3500	3853	11,358	8394	3844	35,714	13.69
<b>小计</b>	-	-	-	-	<b>164,928</b>	-	-	<b>8,801,080</b>	<b>3,256.215</b>
WS611	1623	1657	1548	1548	3,172	-1086	1561	7,318	1.188
WS701	1669	1701	1608	1611	39,544	-51544	1620	1,889,120	316.428
WS703	1675	1727	1656	1659	5,948	4458	1669	15,654	2.639
WS705	1716	1777	1702	1705	101,792	71880	1716	1,910,006	331.936
WS707	1611	1738	1610	1659	13,578	8968	1669	113,524	19.201
WS709	1759	1856	1759	1794	24,454	20368	1802	106,008	19.265
<b>小计</b>	-	-	-	-	<b>188,488</b>	-	-	<b>4,041,630</b>	<b>690.656</b>
WT611	1467	1510	1413	1413	2	-2	1413	104	0.015
WT701	1472	1556	1470	1483	52	4	1508	730	0.111
WT703	1489	1546	1471	1526	22	10	1523	432	0.065
WT705	1475	1555	1475	1526	138	120	1532	964	0.147
WT707	1484	1555	1484	1525	52	48	1527	1,828	0.275



WT709	1504	1595	1465	1586	38	32	1586	1,340	0.209
小计	-	-	-	-	304	-	-	5,398	.821
总计	-	-	-	-	383,898	-	-	12,987,978	4,041.619

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 10 月分品种每日结算价统计表

棉花 CF											
交易日期	610	611	612	701	703	704	705	707	709	成交量	持仓量
2006-10-9	13160	13325	13340	13380	13610	13715	13815	13960	14225	6,134	21,144
2006-10-10	13015	13270	13305	13365	13575	13665	13775	13920	14225	3,730	21,552
2006-10-11	12875	13155	13200	13265	13485	13570	13675	13805	14055	7,062	23,274
2006-10-12	12710	13015	13090	13175	13370	13470	13550	13720	14055	8,970	23,602
2006-10-13	12820	13100	13140	13255	13445	13555	13640	13805	14130	6,334	24,250
2006-10-16	12790	13075	13150	13265	13465	13560	13660	13845	14085	4,920	24,886
2006-10-17	12825	13135	13230	13355	13550	13660	13750	13935	14280	9,942	25,410
2006-10-18	12790	13100	13180	13305	13510	13640	13695	13875	14190	6,802	25,520
2006-10-19	12810	13085	13165	13250	13470	13565	13680	13895	14125	3,542	25,316
2006-10-20	12825	13075	13185	13305	13515	13610	13710	13915	14140	4,086	25,578
2006-10-23		13170	13310	13415	13600	13710	13785	13990	14140	11,952	27,424
2006-10-24		13320	13375	13485	13685	13770	13885	14040	14235	13,416	28,330
2006-10-25		13265	13345	13445	13645	13740	13845	14020	14250	6,462	28,342
2006-10-26		13305	13395	13495	13685	13780	13890	14065	14320	8,726	29,332
2006-10-27		13275	13415	13530	13720	13810	13910	14070	14265	10,858	29,318
2006-10-30		13205	13335	13460	13675	13785	13895	14015	14275	9,914	29,306
2006-10-31		13180	13235	13340	13585	13720	13865	14025	14290	17,020	30,178
强筋小麦 WS											
交易日期	611	701	703	705	707	709	成交量	持仓量			
2006-10-9	1467	1476	1489	1488	1485	1504	217,722	188,488			
2006-10-10	1467	1495	1502	1505	1489	1498	285,784	157,590			
2006-10-11	1467	1482	1492	1508	1492	1525	262,004	174,086			
2006-10-12	1467	1482	1492	1510	1497	1525	258,060	169,144			
2006-10-13	1467	1496	1508	1522	1516	1553	257,178	176,080			
2006-10-16	1467	1519	1508	1528	1529	1573	330,702	201,806			
2006-10-17	1467	1506	1503	1532	1530	1559	339,226	197,750			
2006-10-18	1457	1507	1508	1534	1517	1577	250,462	199,740			
2006-10-19	1413	1509	1520	1536	1529	1569	260,956	184,022			
2006-10-20	1413	1541	1522	1537	1531	1584	223,894	184,820			

2006-10-23	1413	1538	1523	1535	1531	1565	250,160	188,530
2006-10-24	1413	1532	1518	1538	1528	1565	211,924	182,766
2006-10-25	1413	1532	1513	1528	1532	1568	164,006	181,470
2006-10-26	1413	1521	1513	1522	1535	1560	204,728	181,908
2006-10-27	1413	1528	1507	1535	1540	1560	141,840	188,428
2006-10-30	1413	1528	1523	1535	1531	1565	220,976	197,116
2006-10-31	1413	1508	1523	1532	1527	1586	162,008	196,572

**硬冬白小麦 WT**

交易日期	611	701	703	705	707	709	成交量	持仓量
2006-10-9	1624	1668	1680	1712	1615	1764	114	304
2006-10-10	1646	1693	1711	1738	1640	1786	46	98
2006-10-11	1628	1671	1687	1715	1625	1765	236	130
2006-10-12	1639	1685	1701	1727	1637	1780	96	136
2006-10-13	1629	1683	1701	1735	1676	1791	1,852	122
2006-10-16	1633	1685	1717	1760	1725	1814	148	136
2006-10-17	1636	1686	1720	1760	1716	1832	178	170
2006-10-18	1610	1662	1698	1743	1699	1827	898	164
2006-10-19	1609	1655	1700	1744	1695	1832	146	168
2006-10-20	1605	1661	1714	1759	1696	1839	140	184
2006-10-23	1595	1649	1695	1740	1674	1821	248	254
2006-10-24	1595	1657	1707	1750	1674	1830	242	286
2006-10-25	1591	1646	1693	1737	1669	1824	144	304
2006-10-26	1564	1633	1674	1722	1672	1808	70	298
2006-10-27	1577	1636	1681	1730	1691	1820	72	296
2006-10-30	1563	1624	1665	1715	1674	1804	58	328
2006-10-31	1561	1620	1669	1716	1669	1802	710	332

**白糖 SR**

交易日期	611	701	703	705	707	709	成交量	持仓量
2006-10-9	3700	3494	3392	3427	3479	3508	255350	139986
2006-10-10	3700	3527	3439	3472	3517	3560	279806	140902
2006-10-11	3746	3524	3421	3450	3496	3552	220664	148206
2006-10-12	3754	3538	3424	3451	3494	3546	195812	149630
2006-10-13	3808	3581	3468	3489	3531	3588	299164	161064
2006-10-16	3943	3619	3555	3572	3615	3681	521756	187136
2006-10-17	4029	3751	3669	3683	3733	3763	843056	158580
2006-10-18	4031	3745	3697	3711	3761	3783	777128	171614
2006-10-19	4031	3748	3681	3693	3737	3765	808052	179238
2006-10-20	3985	3782	3712	3738	3791	3836	494966	181430
2006-10-23	4019	3887	3803	3834	3895	3957	590530	177856

2006-10-24	4072	3887	3820	3867	3911	3951	747972	154926
2006-10-25	4035	3812	3752	3802	3848	3885	625670	153632
2006-10-26	4035	3802	3742	3808	3861	3912	714104	160940
2006-10-27	4020	3813	3750	3815	3863	3915	522442	158466
2006-10-30	4020	3752	3678	3751	3805	3858	384346	159890
2006-10-31	4179	3769	3684	3735	3790	3844	520262	164928

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、市场综述

本月小麦期货价格冲高回落。主力合约 WS705 当月波动区间为 1702 - 1777 元，最大波幅 75 元/吨，月底报收于 1705 元，较上月涨 2 元/吨。

本月棉花期货价格探底回升。主力合约 CF701 当月波动区间为 13105 - 13595 元，最大波幅 490 元/吨，月底报收 13315 元，较上月跌 220 元/吨。

本月白糖期货价格稳步上扬。主力合约 SR705 当月波动区间为 3365-3917 元，最大波幅 552 元/吨，月底报收 3732 元，较上月涨 363 元/吨。

本月郑州期货市场总成交量 12, 987, 978 手，其中成交强麦期货合约 4, 041, 630 手、硬麦期货合约 5, 398 手、棉花期货合约 139, 870 手、白糖期货合约 8, 801, 080 手。截至 10 月 31 日，总持仓量达 383, 898 手，其中强麦持仓量 188, 488 手、硬麦 304 手，棉花 30, 178 手，白糖 164, 928 手。

## 六、动态摘要

10 月 16 日，郑商所白砂糖合约持仓量再创历史新高，持仓达到了 187136 张标准合约。

10 月 17 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 843056 张。

10 月 17 日，郑商所总交易成交量再创历史新高，共成交标准合约 1104358 张。

10 月 17 日—19 日，交易所对入市代表及相关人员进行了业务知识培训。

10 月 13 日、20 日、27 日，郑商所为提高员工整体业务素质和促进内部学习的积极性，分别就风险管理、内部控制、厂库交割等课题举行了内部员工培训会。



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>