

2006 · 06
总第 14 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 6 月份交易统计.....	6
三、郑州商品交易所 6 月行情表.....	7
四、郑州商品交易所 6 月分品种每日结算价统计表.....	8
五、市场综述.....	10
六、动态摘要.....	11

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

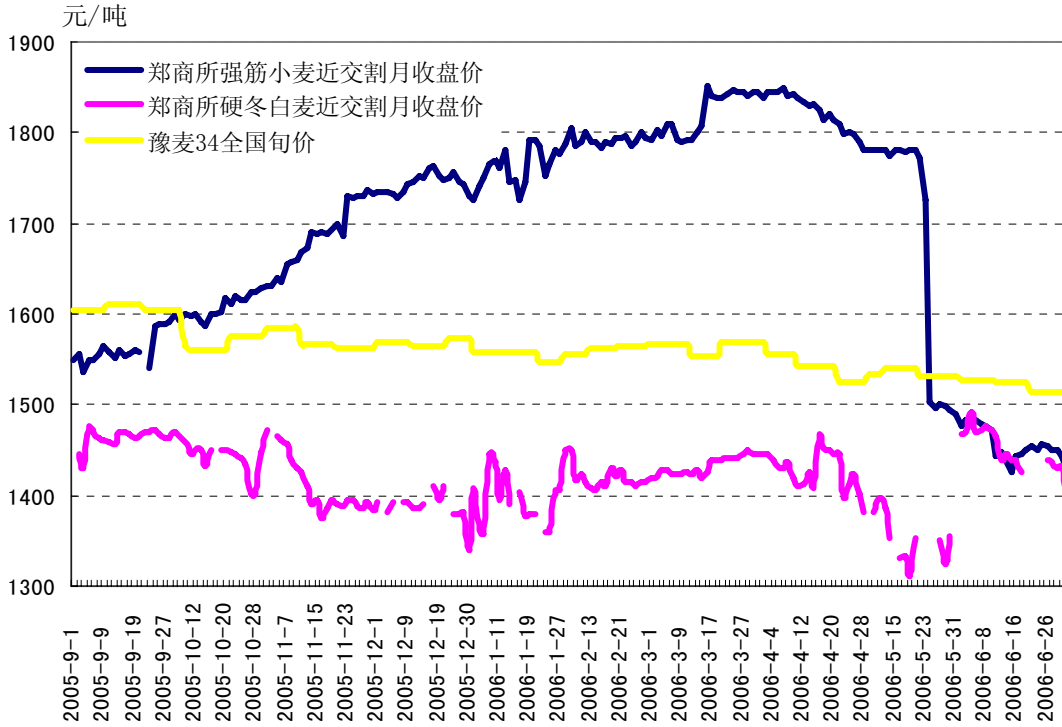
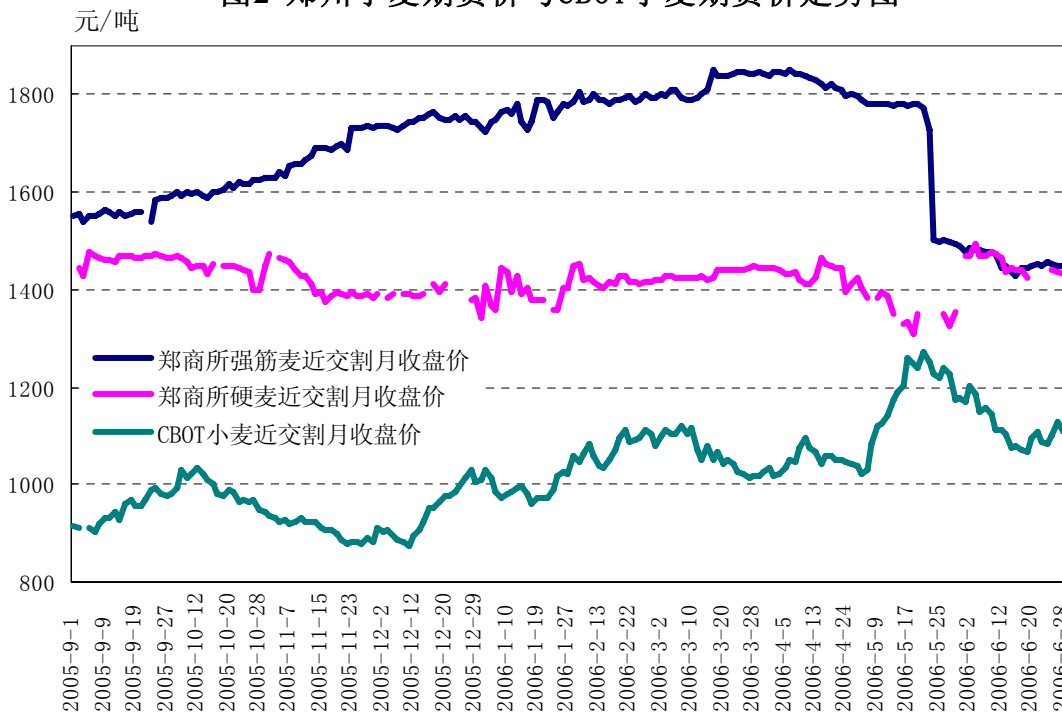


图2 郑州小麦期货价与CBOT小麦期货价走势图



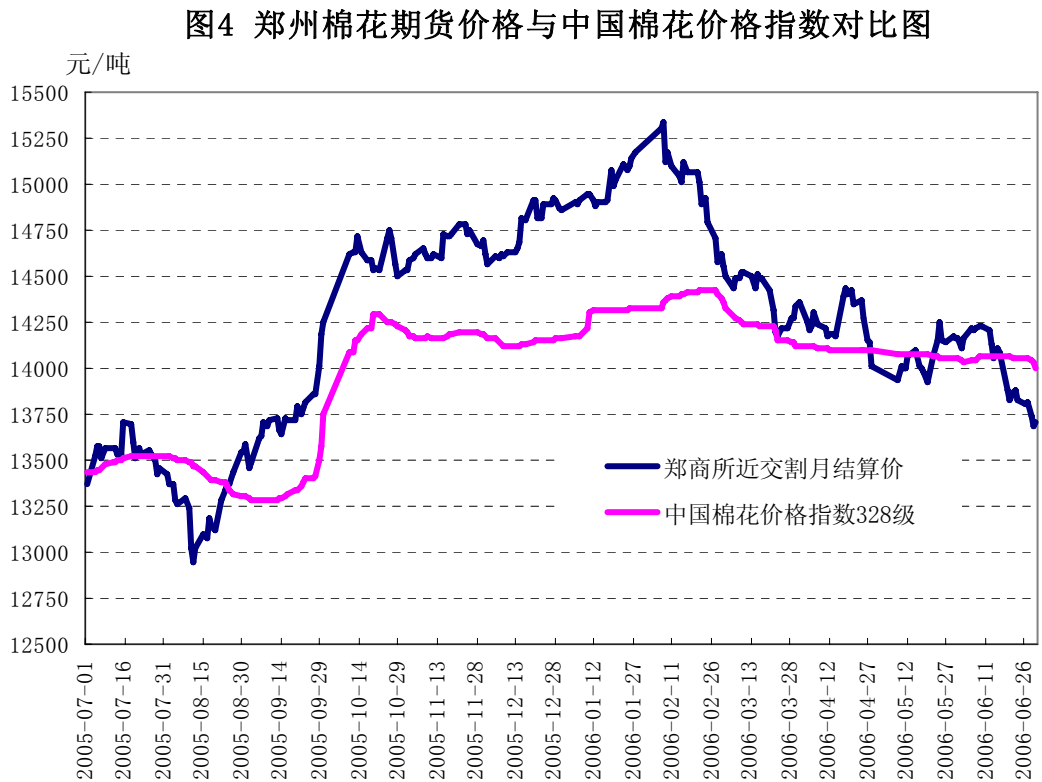
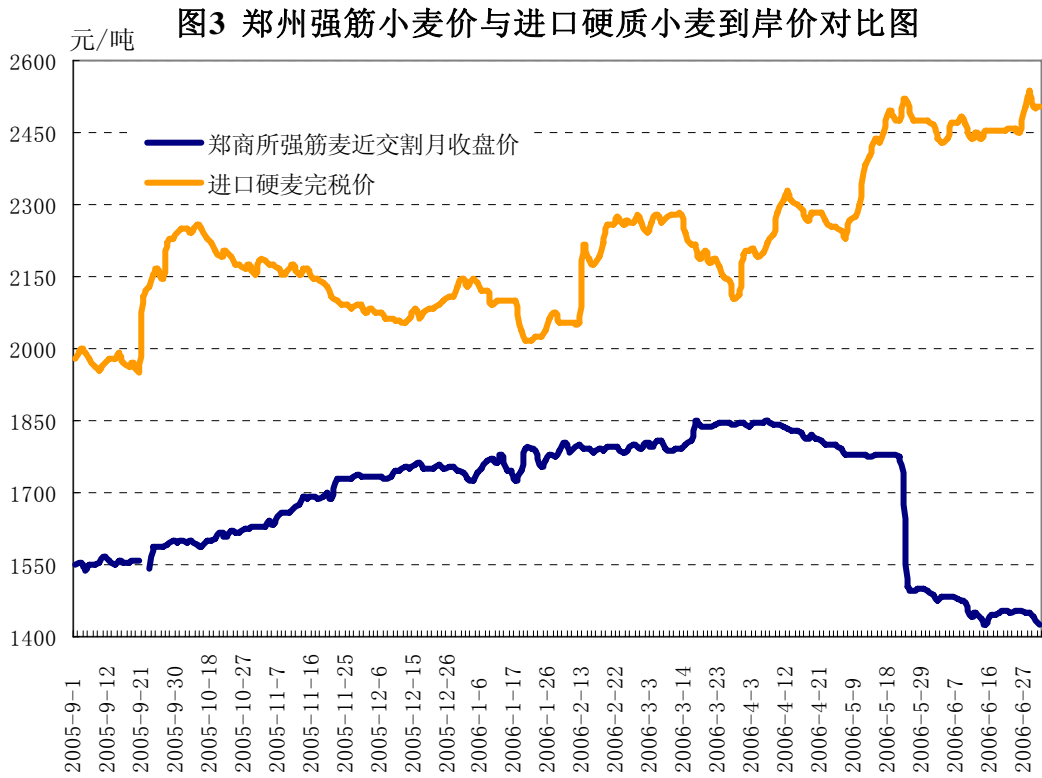


图5 郑州棉花期货与纽约棉花期货价格走势对比图

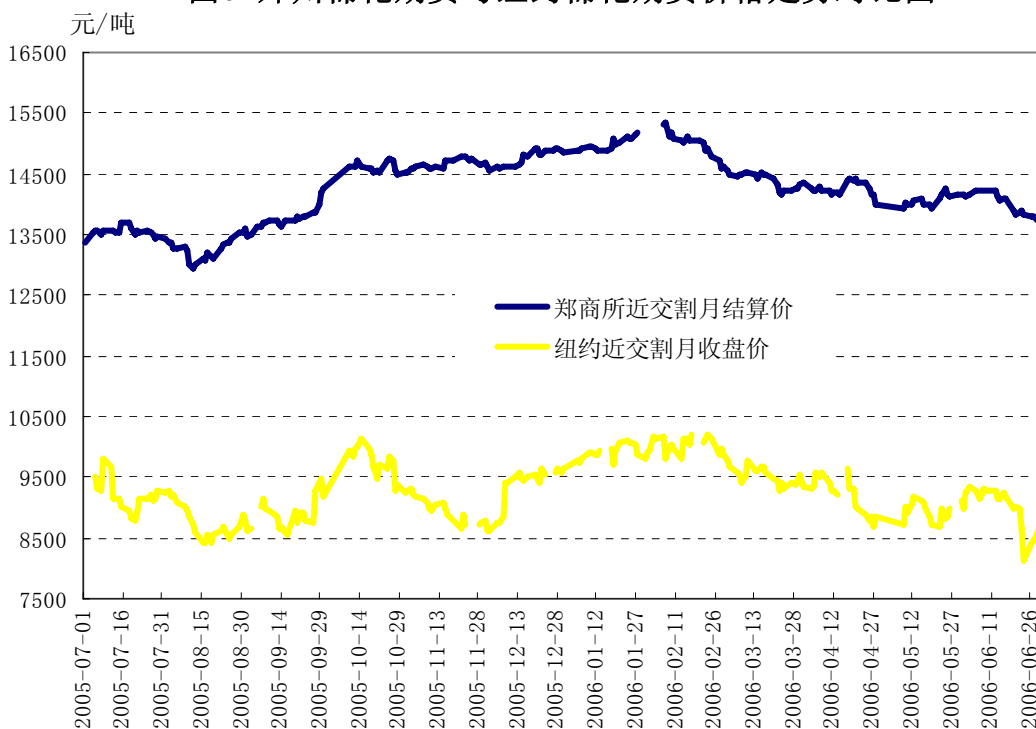


图6 郑州棉花期货价格与进口棉花价格指数对比图

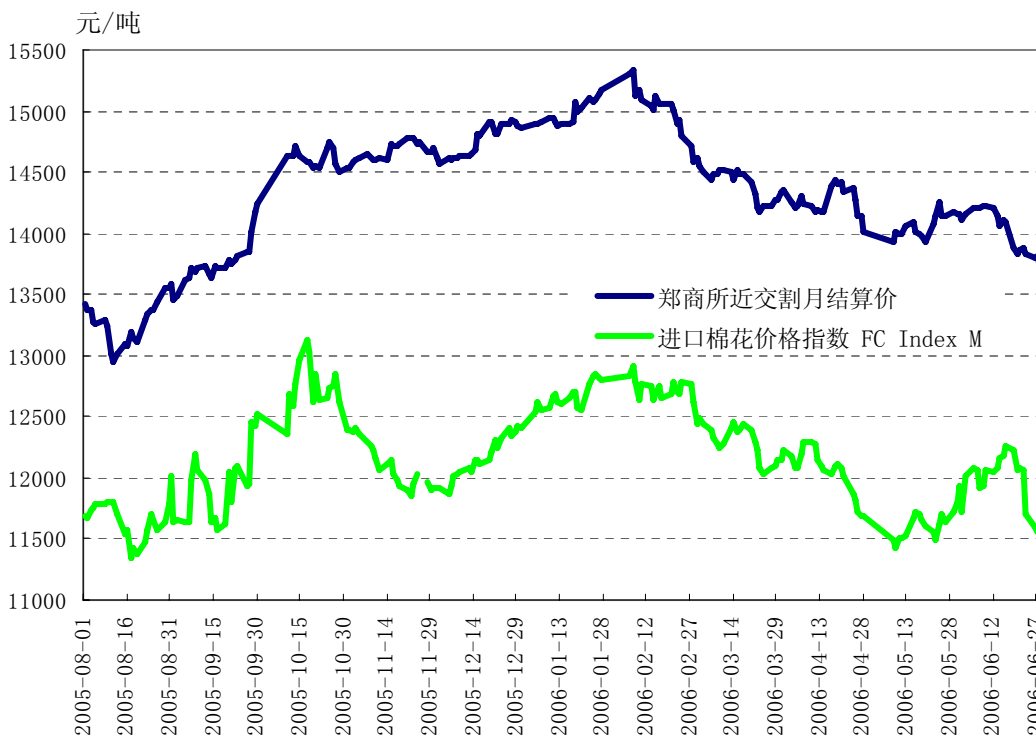


图7 郑州白糖期货价与现货价走势图

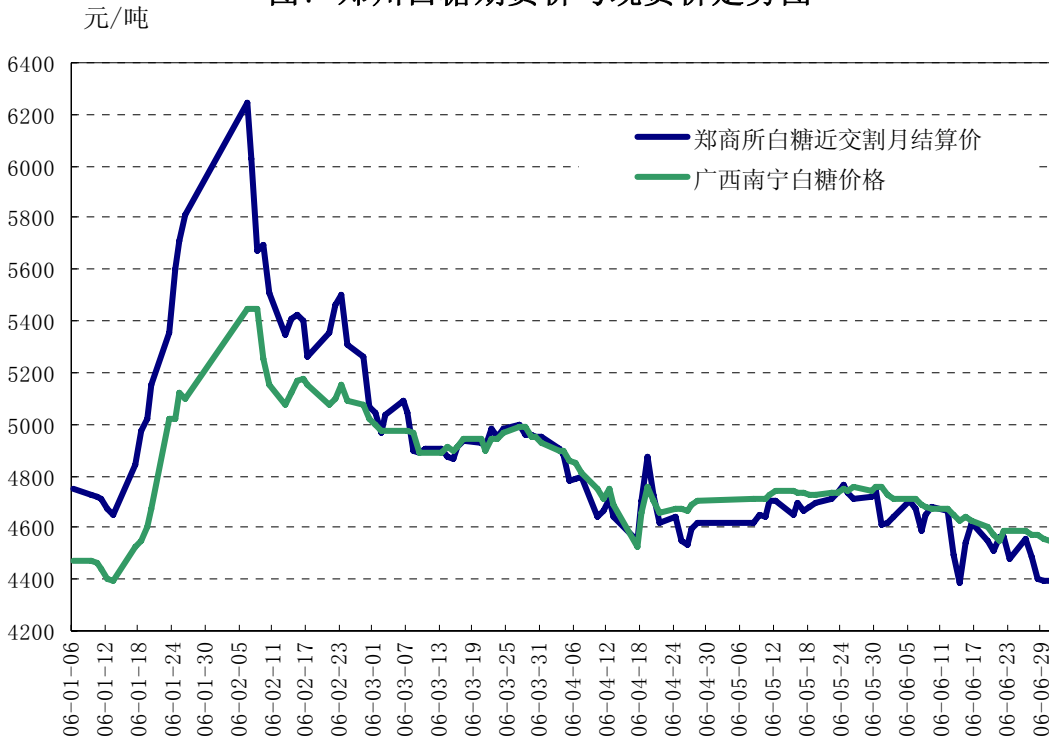
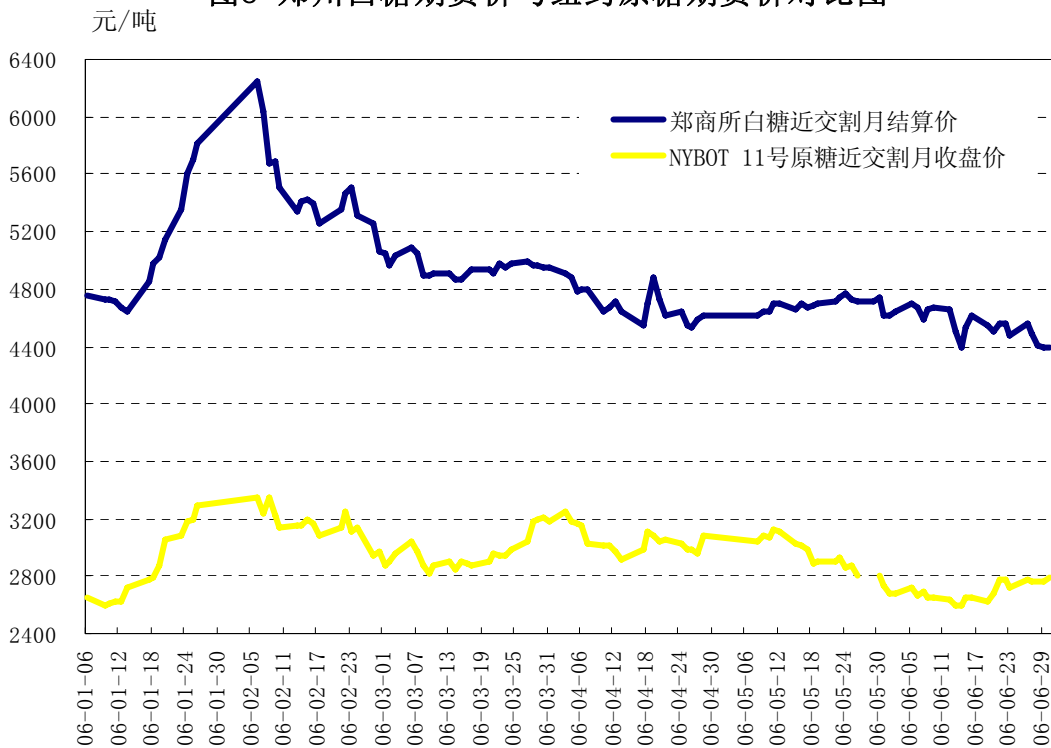


图8 郑州白糖期货价与纽约原糖期货价对比图



二、郑州商品交易所 6 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	204,108	2,262,730	-90.98%	2,935,762	9,867,494	-70.25%
白糖	5,116,410	-	-	16,421,232	-	-
优质强筋小麦	947,870	2,750,356	-65.54%	7,043,814	18,468,344	-61.86%
硬冬白小麦	3,058	88,084	-96.53%	33,734	1,759,596	-98.08%
合计	6,271,446	5,101,170	22.94%	26,434,542	30,095,434	-12.16%

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	1,478,746	16,067,824	-90.80%	22,142,335	69,255,971	-68.03%
白糖	21,972,135	-	-	78,550,825	-	-
优质强筋小麦	1,511,768	4,763,397	-68.26%	11,898,031	31,534,432	-62.27%
硬冬白小麦	4,532	135,009	-96.64%	49,903	2,745,246	-98.18%
合计	24,967,181	20,966,231	19.08%	112,641,094	103,535,649	8.79%

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	40,366	99,954	-59.62%	45,084	-10.46%
白糖	122,226	-	-	98,380	24.24%
优质强筋小麦	117,298	244,542	-52.03%	172,234	-31.90%
硬冬白小麦	274	29,240	-99.06%	300	-8.67%
合计	280,164	373,736	-25.04%	315,998	-11.34%

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

	200606 交割量	200606 期转现	200506 交割量	200506 期转现	当年合约 累计	去年同期合约 累计
一号棉花	2,460	888	2,464	1016	15,208	15,036
白糖	-	-	-	-	1,013	-
优质强筋小麦	-	-	-	-	31,610	16,636
硬冬白小麦	-	-	-	-	111	5,793
合计	2,460	888	2,464	1,016	47,942	37,465

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 6 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)
CF606	14080	14250	13980	14200	0	-5806	14055	7,302	5.177
CF607	14185	14420	13660	13715	6,868	-11986	13705	32,556	22.967
CF608	14460	14700	13830	13930	9,192	324	13920	72,616	52.391
CF609	14840	15100	14200	14285	11,418	5956	14285	68,162	49.817
CF610	14950	15250	14405	14485	3,426	1754	14480	8,458	6.252
CF611	14910	15295	14530	14590	3,478	1812	14590	6,256	4.658
CF612	15015	15320	14625	14685	2,120	724	14675	3,042	2.277
CF701	15110	15495	14770	14810	1,824	914	14805	2,870	2.167
CF703	15330	15550	14860	14920	474	170	14920	668	0.508
CF704	15300	15580	14960	14995	454	308	14980	682	0.521
CF705	15400	15730	15010	15060	1,112	1112	15085	1,496	1.141
小计	-	-	-	-	40,366	-	-	204,108	147.875
GN607	0	0	0	0	0	0		0	0
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
小计	-	-	-	-	0	-	-	0	0
SR607	4640	4820	4316	4428	134	70	4394	766	0.352
SR609	4618	4640	4165	4371	8,068	-2504	4367	17,450	7.649
SR611	4550	4550	3935	4164	2,840	-486	4122	4,912	2.094
SR701	4560	4598	3936	4185	14,018	-7458	4156	121,256	52.616
SR703	4640	4682	3975	4272	78,074	15132	4243	4,613,112	1,979.25
SR705	4780	4783	4028	4338	19,092	19092	4309	358,914	155.253
小计	-	-	-	-	122,226	-	-	5,116,410	2,197.214
WS607	1483	1488	1401	1426	5,930	-4910	1425	19,392	2.838
WS609	1603	1605	1511	1524	43,206	-50020	1524	251,046	38.981
WS611	1650	1654	1559	1574	42,164	-14436	1573	518,506	83.203
WS701	1695	1702	1606	1623	23,938	13092	1622	150,066	24.669
WS703	1721	1725	1632	1643	750	28	1646	4,902	0.816
WS705	1791	1791	1662	1683	1,310	1310	1681	3,958	0.669
小计	-	-	-	-	117,298	-	-	947,870	151.177
WT607	1300	1325	1254	1266	12	-14	1266	40	0.005
WT609	1470	1516	1392	1398	140	14	1398	1,110	0.16
WT611	1549	1549	1426	1465	72	-40	1465	586	0.087

WT701	1502	1535	1450	1490	34	10	1483	292	0.044
WT703	1530	1563	1460	1510	12	0	1499	310	0.047
WT705	1643	1643	1488	1540	4	4	1525	720	0.111
小计	-	-	-	-	274	-	-	3,058	.453
总计	-	-	-	-	280,164	-	-	6,271,446	2,496.718

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 6 月分品种每日结算价统计表

棉花 CF													
交易日期	606	607	608	609	610	611	612	701	703	704	705	成交量	持仓量
2006-6-1	14110	14270	14475	14835	14960	15000	15050	15150	15275	15310	15300	7,942	43,970
2006-6-2	14160	14340	14585	14935	15050	15105	15135	15215	15315	15360	15400	15,132	47,626
2006-6-5	14215	14395	14655	15005	15135	15170	15195	15280	15355	15410	15485	14,520	49,788
2006-6-6	14210	14370	14615	14965	15100	15140	15165	15270	15350	15405	15500	5,672	49,514
2006-6-7	14215	14370	14600	14955	15100	15135	15175	15290	15370	15410	15500	5,206	48,802
2006-6-8	14230	14390	14635	14995	15130	15165	15200	15310	15370	15440	15515	7,144	49,440
2006-6-9	14225	14400	14645	15050	15185	15220	15260	15360	15470	15505	15585	13,610	51,834
2006-6-12	14210	14365	14615	15055	15205	15255	15285	15435	15515	15550	15620	10,194	50,664
2006-6-13	14135	14275	14510	14960	15150	15190	15230	15345	15460	15500	15550	13,846	49,710
2006-6-14	14055	14170	14400	14865	15040	15070	15140	15255	15320	15400	15495	10,440	43,114
2006-6-15		14105	14335	14735	14930	15000	15060	15225	15320	15340	15420	12,088	41,254
2006-6-16		14085	14305	14715	14910	14990	15050	15165	15255	15315	15305	5,390	41,236
2006-6-19		13885	14090	14495	14710	14825	14900	15025	15150	15210	15245	16,504	40,574
2006-6-20		13830	14030	14425	14655	14770	14860	14985	15150	15205	15260	6,136	40,114
2006-6-21		13870	14100	14500	14715	14830	14910	15035	15190	15270	15295	6,054	40,248
2006-6-22		13885	14105	14490	14705	14825	14905	15020	15155	15235	15290	4,618	39,828
2006-6-23		13825	14060	14415	14630	14755	14835	14975	15120	15235	15275	9,032	40,172
2006-6-26		13805	14030	14405	14605	14725	14815	14965	15135	15215	15225	8,144	40,588
2006-6-27		13810	14030	14410	14595	14705	14800	14935	15105	15180	15205	6,200	39,984
2006-6-28		13740	13930	14285	14490	14595	14680	14825	14980	15020	15065	10,808	40,776
2006-6-29		13685	13895	14260	14460	14570	14660	14790	14905	15000	15040	8,710	40,692
2006-6-30		13705	13920	14285	14480	14590	14675	14805	14920	14980	15085	6,718	40,366
强筋小麦 WS													
交易日期	WS 607	WS 609	WS 611	WS 701	WS 703	WS 705	成交量	持仓量					
2006-6-1	1479	1589	1639	1684	1710	1747	76,038	163,484					
2006-6-2	1484	1579	1629	1673	1695	1731	62,748	159,946					
2006-6-5	1483	1588	1638	1682	1713	1732	51,966	159,704					
2006-6-6	1482	1586	1635	1680	1712	1730	42,692	158,666					

2006-6-7	1479	1591	1640	1686	1720	1739	58,308	156,430
2006-6-8	1478	1590	1639	1686	1718	1734	29,008	154,840
2006-6-9	1477	1583	1633	1681	1709	1733	50,868	153,824
2006-6-12	1453	1581	1631	1676	1701	1725	157,854	116,986
2006-6-13	1444	1556	1606	1654	1683	1707	70,462	148,136
2006-6-14	1432	1524	1573	1622	1646	1671	69,152	133,616
2006-6-15	1428	1525	1574	1622	1645	1672	46,378	125,788
2006-6-16	1434	1522	1572	1618	1647	1675	36,936	120,100
2006-6-19	1447	1521	1571	1618	1641	1673	28,346	120,096
2006-6-20	1448	1518	1565	1612	1636	1667	29,746	120,506
2006-6-21	1454	1520	1571	1619	1641	1671	40,524	120,944
2006-6-22	1455	1529	1579	1626	1651	1678	41,456	119,590
2006-6-23	1449	1521	1569	1616	1639	1671	30,324	116,950
2006-6-26	1452	1526	1574	1623	1643	1675	30,518	121,390
2006-6-27	1455	1529	1577	1626	1645	1674	25,954	121,044
2006-6-28	1453	1530	1578	1627	1651	1683	24,756	121,336
2006-6-29	1445	1520	1569	1618	1637	1676	30,122	120,770
2006-6-30	1425	1524	1573	1622	1646	1681	29,450	117,298

硬冬白小麦 WT

交易日期	WT 607	WT 609	WT 611	WT 701	WT 703	WT 705	成交量	持仓量
2006-6-1	1341	1470	1480	1509	1530	1550	188	316
2006-6-2	1341	1470	1485	1510	1528	1560	252	316
2006-6-5	1341	1493	1490	1500	1522	1560	98	320
2006-6-6	1341	1477	1492	1521	1526	1580	74	326
2006-6-7	1341	1475	1482	1509	1526	1562	26	326
2006-6-8	1308	1477	1485	1510	1526	1565	164	330
2006-6-9	1308	1472	1486	1494	1526	1565	36	336
2006-6-12	1313	1471	1478	1494	1526	1592	42,118	151,050
2006-6-13	1313	1465	1472	1497	1510	1557	286	354
2006-6-14	1313	1464	1473	1483	1501	1559	208	328
2006-6-15	1313	1442	1473	1483	1505	1571	36	330
2006-6-16	1254	1440	1479	1483	1505	1549	20	316
2006-6-19	1290	1425	1462	1480	1506	1540	36	312
2006-6-20	1290	1425	1459	1490	1506	1535	24	308
2006-6-21	1290	1425	1467	1473	1494	1523	294	306
2006-6-22	1325	1425	1457	1500	1516	1527	34	320
2006-6-23	1325	1425	1469	1495	1516	1522	100	300
2006-6-26	1325	1440	1472	1502	1518	1522	36	280
2006-6-27	1325	1433	1474	1478	1518	1522	30	278

2006-6-28	1325	1431	1470	1478	1504	1522	14	276
2006-6-29	1325	1434	1470	1478	1510	1522	810	280
2006-6-30	1266	1398	1465	1483	1499	1525	266	274
白糖 SR								
交易日期	607	609	611	701	703	705	成交量	持仓量
2006-6-1	4621	4588	4487	4540	4644	4658	116100	100606
2006-6-2	4642	4595	4496	4503	4571	4641	194810	92338
2006-6-5	4703	4610	4510	4549	4639	4704	150206	97426
2006-6-6	4671	4594	4493	4510	4592	4649	164772	102390
2006-6-7	4588	4571	4450	4460	4522	4572	191336	107008
2006-6-8	4653	4594	4470	4486	4552	4598	133210	107648
2006-6-9	4677	4549	4415	4420	4470	4513	172800	109234
2006-6-12	4661	4459	4372	4395	4443	4487	157854	116986
2006-6-13	4498	4301	4228	4253	4302	4342	141426	110254
2006-6-14	4389	4222	4033	4103	4105	4146	327464	93154
2006-6-15	4539	4312	4105	4134	4164	4218	240542	96364
2006-6-16	4616	4329	4133	4158	4204	4248	249532	99720
2006-6-19	4551	4290	4054	4064	4113	4157	203292	105838
2006-6-20	4511	4283	4027	4018	4060	4127	282098	106032
2006-6-21	4562	4336	4101	4110	4181	4250	298036	103816
2006-6-22	4562	4395	4201	4221	4299	4368	244190	103858
2006-6-23	4479	4308	4132	4150	4228	4298	220748	107246
2006-6-26	4560	4372	4182	4178	4267	4326	372044	113190
2006-6-27	4485	4376	4160	4192	4278	4338	414694	117854
2006-6-28	4403	4350	4132	4142	4226	4284	265442	118782
2006-6-29	4394	4342	4113	4118	4200	4266	223254	119724
2006-6-30	4394	4367	4122	4156	4243	4309	352560	122226

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

本月小麦持续下探，低位整理。主力合约 WS611 当月波动区间为 1559 - 1654 元/吨，月底收报 1574 元/吨，较上月跌 87 元/吨。

本月棉花期货冲高回落，后期稳步下跌。主力合约 CF609 当月波动区间为 14200 - 15100 元/吨，月底收报 14285 元/吨，较上月跌 550 元/吨。

本月白糖期货振荡下行,触底回稳。主力合约 SR703 当月波动区间为 3975 - 4682 元/吨,月底收报 4272 元/吨,较上月跌 504 元/吨。

本月共成交期货合约 6271446 手,其中强麦 947870 手,硬麦 3058 手,棉花 204108 手,白糖 5116410 手。截至 6 月 30 日,总持仓量达 280164 手,其中强麦 117298 手,硬麦 274 手,棉花 40366 手,白糖 122226 手。

六、动态摘要

6 月 2 日,郑商所在北京举办白糖期货投资论坛。

6 月 4 日,郑商所在杭州举办白糖和棉花期货培训会。

6 月 7 日,郑商所与东京谷物商品交易所签署《合作谅解备忘录》。

6 月 7 日,郑商所邀请河南省委党校教授来所进行“八荣八耻”专题辅导讲座。

6 月 14 日,新加坡奥兰国际有限公司访问郑商所。

6 月 16 日,美国德克萨斯州农场局代表团一行参观郑商所。

6 月 27 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 414694 张。

6 月 30 日,郑商所白砂糖合约持仓量再创历史新高,持仓达到了 122226 张标准合约。

6 月 30 日,郑商所举行庆祝中国共产党成立 85 周年大会。



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>