

2006 · 08
总第 16 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 8 月份交易统计.....	6
三、郑州商品交易所 8 月行情表.....	7
四、郑州商品交易所 8 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

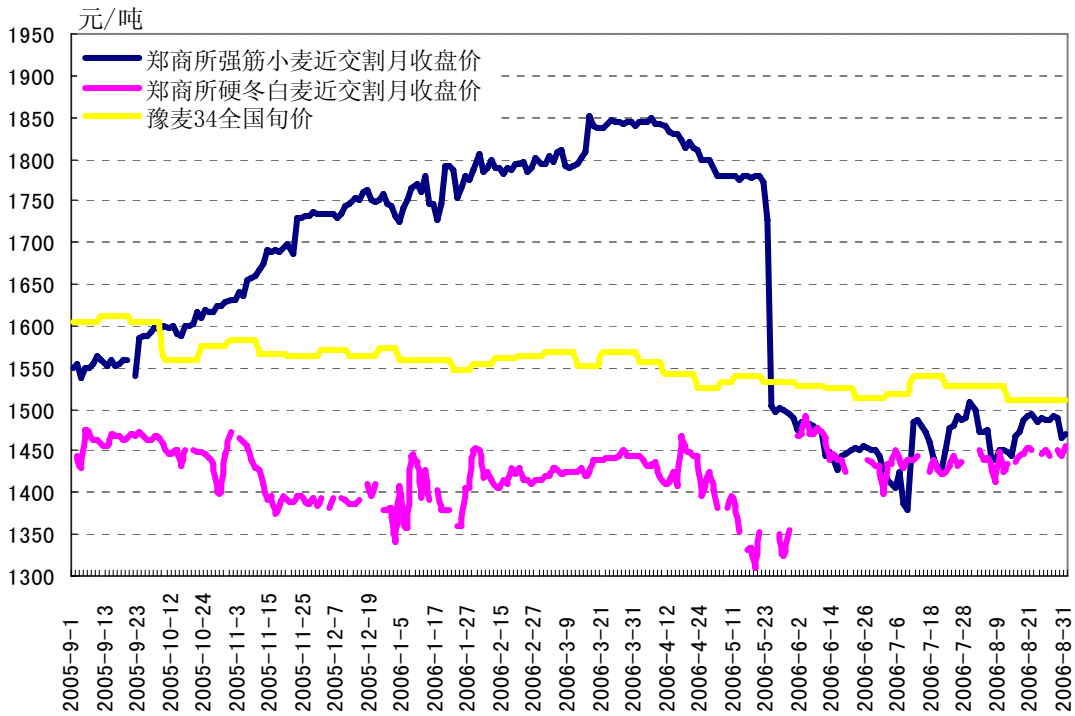


图2 郑州小麦期货价与CBOT小麦期货价走势图

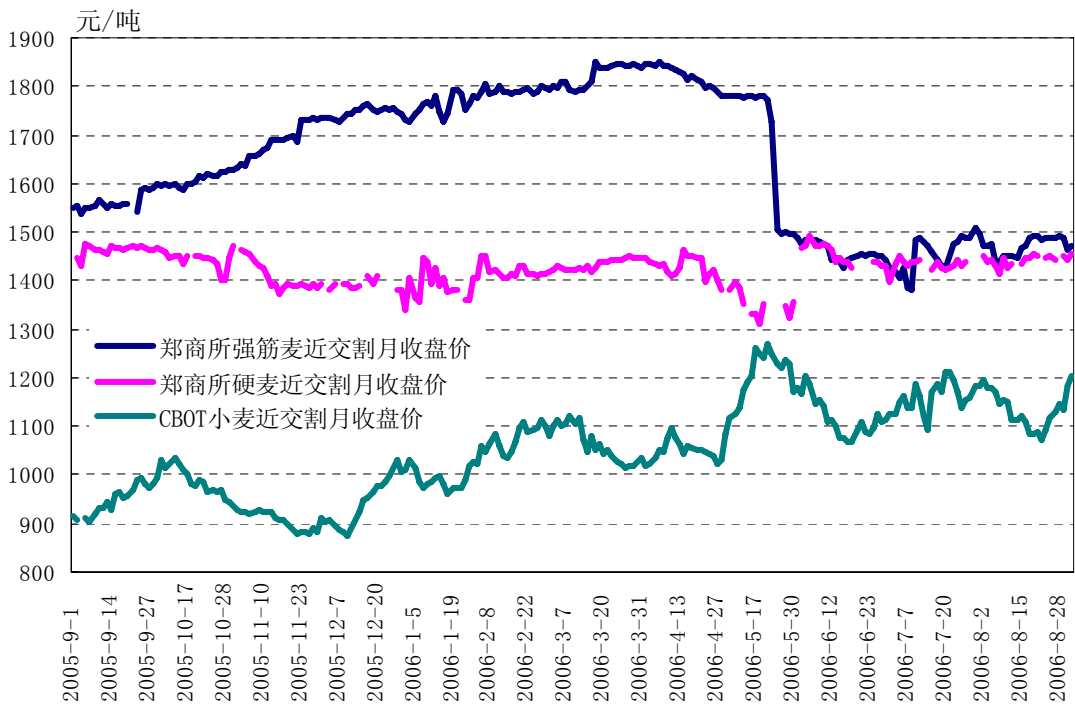


图3 郑州强筋小麦价与进口硬质小麦到岸价对比图

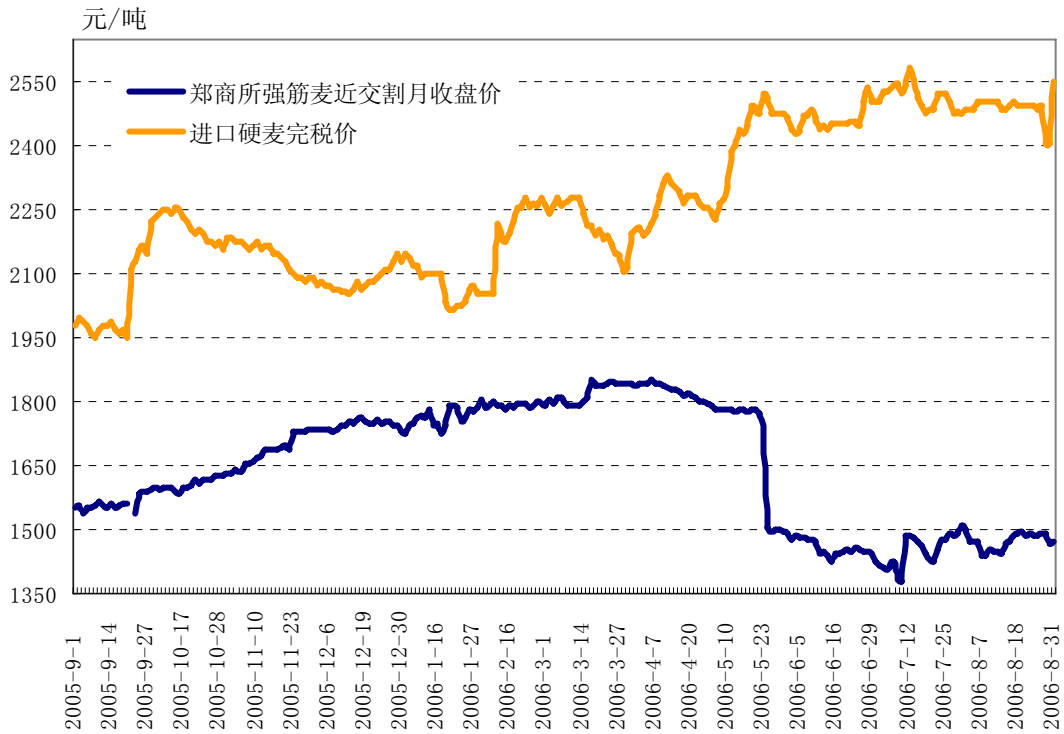


图4 郑州棉花期货价格与中国棉花价格指数对比图

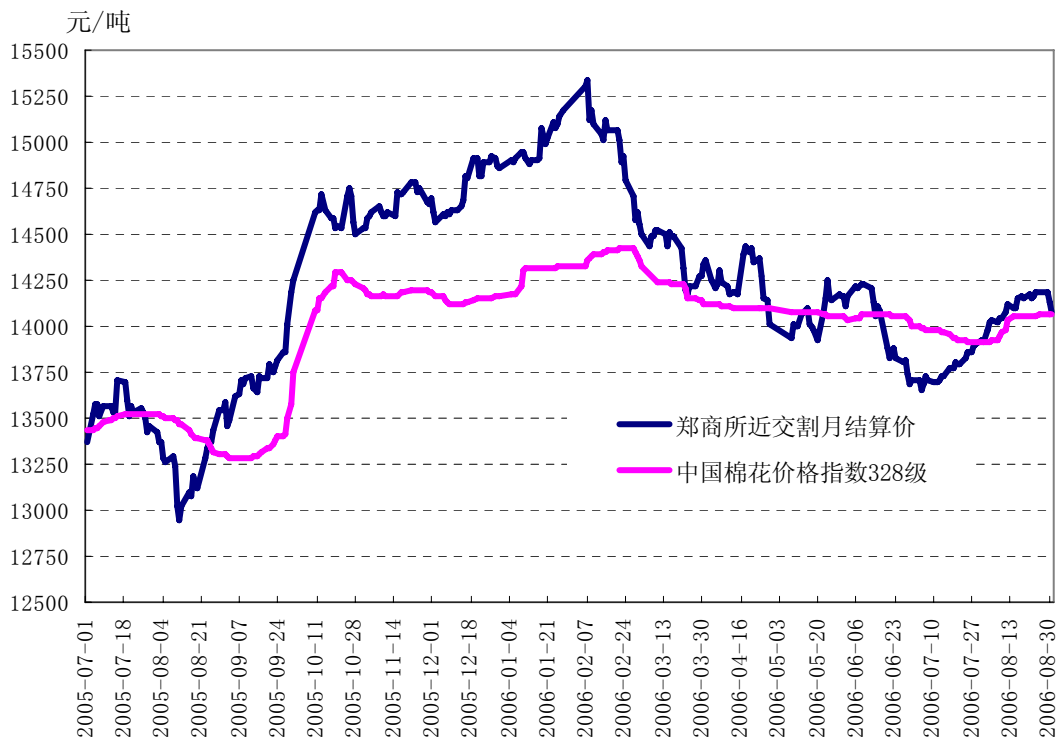


图5 郑州棉花期货与纽约棉花期货价格走势对比图

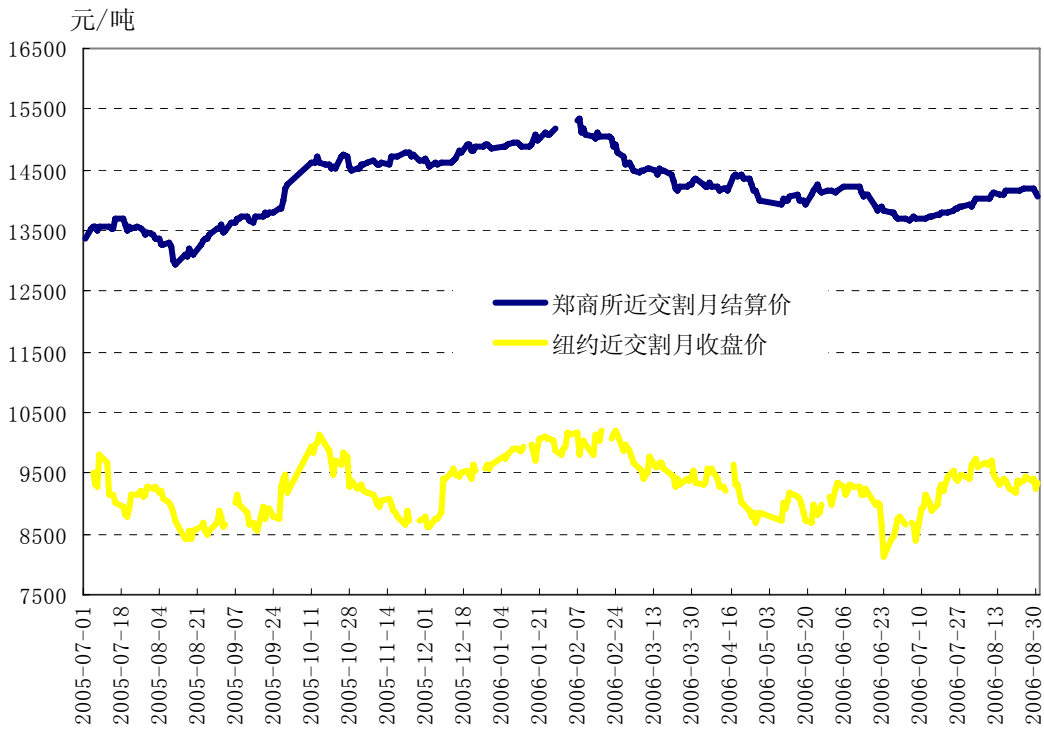


图6 郑州棉花期货价格与进口棉花价格指数对比图

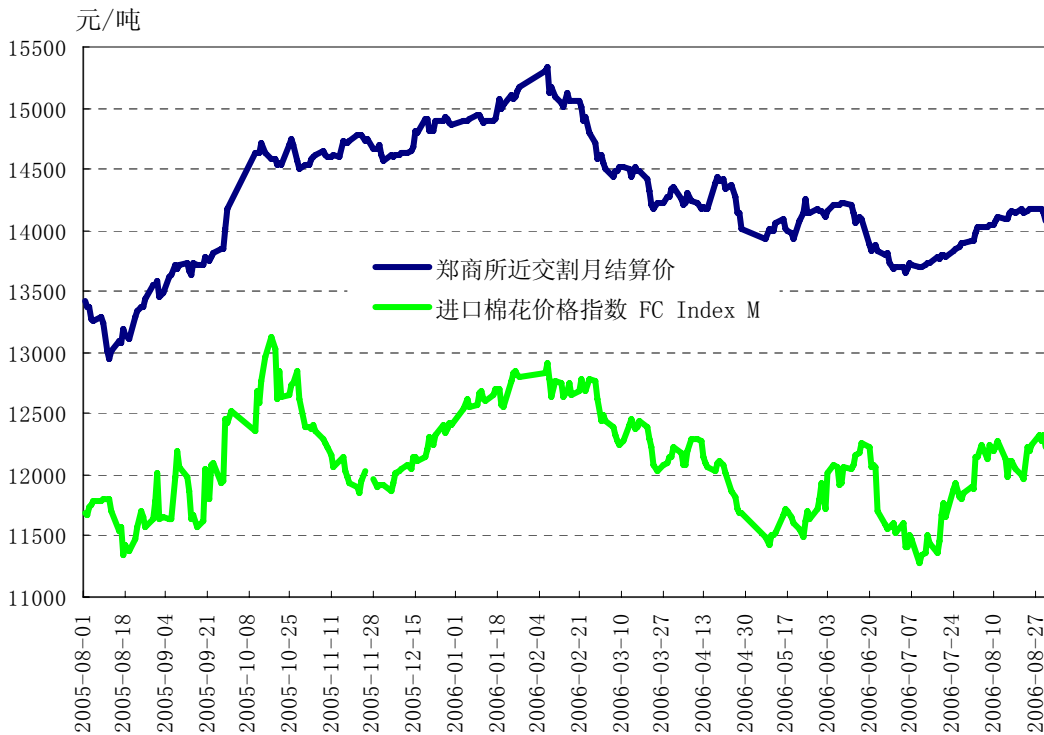


图7 郑州白糖期货价与现货价走势图

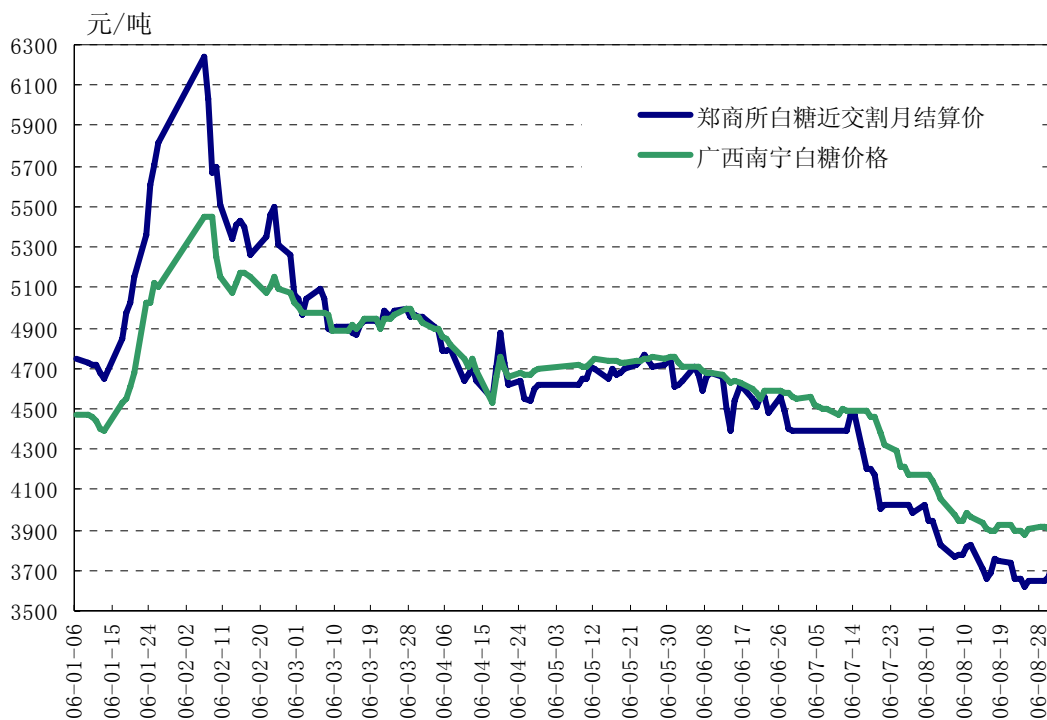
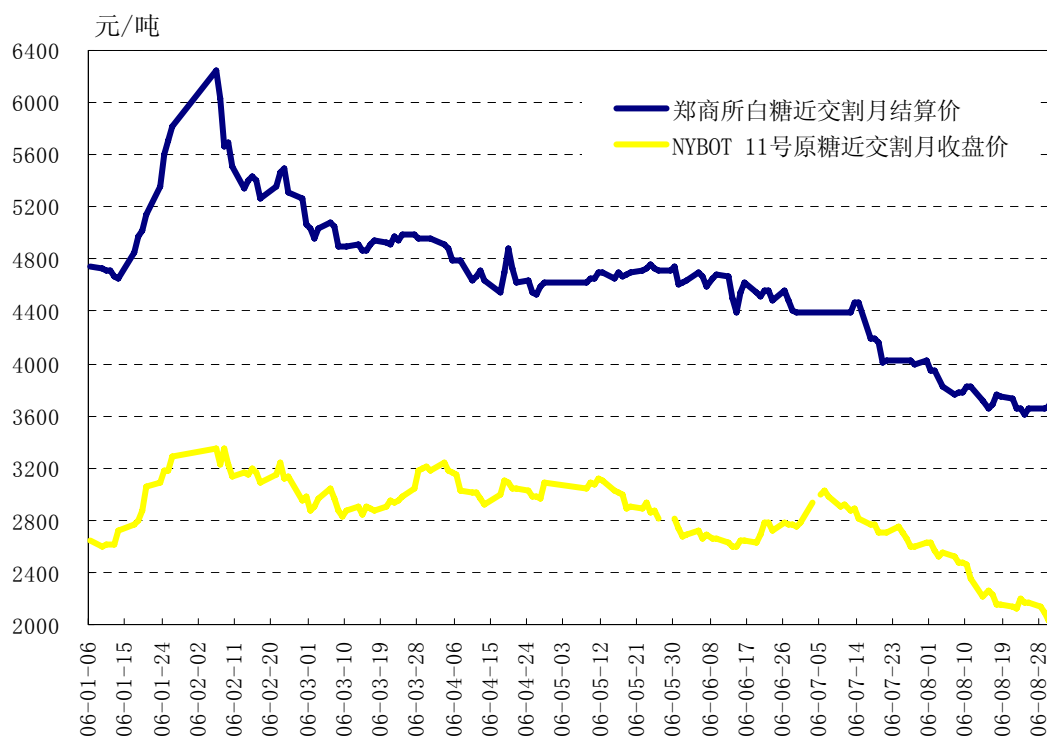


图8 郑州白糖期货价与纽约原糖期货价对比图



二、郑州商品交易所 8 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	1,100,301	13,099,305	-91.60%	24,189,333	98,433,148	-75.43%
白糖	25,424,697	-	-	127,242,045	-	-
优质强筋小麦	3,857,596	4,195,768	-8.06%	17,738,058	39,680,897	-55.30%
硬冬白小麦	4,968	67,752	-92.67%	60,547	2,947,716	-97.95%
合计	30,387,562	17,362,825	75.02%	169,229,983	141,061,761	19.97%

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	153,962	1,900,968	-91.90%	3,223,644	14,003,774	-76.98%
白糖	7,166,540	-	-	29,311,416	-	-
优质强筋小麦	2,462,188	2,557,938	-3.74%	10,774,776	23,348,692	-53.85%
硬冬白小麦	3,388	45,060	-92.48%	40,956	1,892,278	-97.84%
合计	9,786,078	4,503,966	117.28%	43,350,792	39,244,744	10.46%

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	18,346	64,444	-71.53%	27,790	-33.98%
白糖	156,726	-	-	153,460	2.13%
优质强筋小麦	111,342	294,794	-62.23%	118,712	-6.21%
硬冬白小麦	124	24,790	-99.50%	164	-24.39%
合计	286,538	384,028	-25.39%	300,126	-4.53%

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

	200608 交割量	200608 期转现	200508 交割量	200508 期转现	当年合约 累计	去年同期合约 累计
一号棉花	1,840	1,168	1,616	1,132	25,116	20,916
白糖	-	-	-	-	1,075	-
优质强筋小麦	-	-	-	-	37,202	16,733
硬冬白小麦	-	-	-	-	118	5,943
合计	1,840	1,168	1,616	1,132	63,511	43,592

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 8 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)
CF608	13925	14195	13890	14035	0	-4484	14095	6,034	4.229
CF609	14055	14260	14000	14000	724	-5792	14075	9,056	6.414
CF610	14220	14480	14025	14040	756	-2276	14070	7,516	5.364
CF611	14360	14595	13680	13700	7,680	2112	13745	98,036	70.063
CF612	14390	14665	13745	13775	3,488	268	13810	18,660	13.38
CF701	14520	14755	13820	13840	2,604	-34	13890	10,208	7.33
CF703	14615	14865	13985	13985	778	250	14080	1,394	1.007
CF704	14630	14870	14095	14140	554	184	14160	884	0.644
CF705	14700	15000	14170	14175	1,684	260	14240	1,662	1.22
CF707	15095	15190	14310	14310	78	68	14360	512	0.381
小计	-	-	-	-	18,346	-	-	153,962	110.030
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
小计	-	-	-	-	0	-	-	0	0
SR609	4000	4000	3563	3816	2,458	-3954	3744	5,478	2.084
SR611	3912	3920	3410	3520	1,528	-54	3535	1,990	0.725
SR701	3915	3923	3246	3300	6,638	-3128	3270	40,686	14.748
SR703	3960	3966	3210	3272	93,068	-5398	3246	5,664,600	2,011.83
SR705	3995	3999	3241	3305	37,184	626	3278	1,291,098	455.775
SR707	3990	3990	3270	3349	15,850	15174	3311	162,688	57.312
小计	-	-	-	-	156,726	-	-	7,166,540	2,542.470
WS609	1509	1520	1437	1470	24,810	-4510	1471	26,150	3.844
WS611	1562	1562	1480	1506	9,482	-14650	1504	114,694	17.426
WS701	1614	1614	1527	1555	66,472	6354	1552	2,256,214	353.89
WS703	1624	1626	1549	1588	694	-216	1581	9,814	1.561
WS705	1657	1662	1601	1630	7,018	3296	1628	48,488	7.95
WS707	1600	1620	1565	1585	2,866	2356	1587	6,828	1.088
小计	-	-	-	-	111,342	-	-	2,462,188	385.760
WT609	1459	1502	1400	1415	0	-64	1459	216	0.031
WT611	1451	1456	1412	1455	54	10	1455	618	0.089
WT701	1453	1479	1415	1464	32	-4	1463	660	0.097
WT703	1493	1496	1437	1481	12	2	1478	1,068	0.158

WT705	1518	1529	1449	1485	10	4	1477	476	0.071
WT707	1420	1502	1420	1486	16	12	1486	350	0.052
小计	-	-	-	-	124	-	-	3,388	.497
总计	-	-	-	-	286,538	-	-	9,786,078	3,038.756

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 8 月分品种每日结算价统计表

棉花 CF												
交易日期	608	609	610	611	612	701	703	704	705	707	成交量	持仓量
2006-8-1	13910	14065	14170	14275	14350	14450	14580	14625	14725	14660	7,070	26,726
2006-8-2	13975	14175	14305	14440	14505	14630	14740	14785	14875	14980	17,896	28,800
2006-8-3	14025	14225	14360	14530	14595	14690	14810	14850	14915	14920	10,994	29,860
2006-8-4	14035	14205	14370	14535	14600	14700	14835	14860	14915	14920	8,552	29,562
2006-8-7	14020	14185	14345	14505	14570	14670	14795	14850	14890	14970	6,666	29,196
2006-8-8	14040	14195	14335	14500	14590	14685	14795	14865	14900	15025	6,098	28,986
2006-8-9	14040	14155	14280	14435	14530	14620	14750	14800	14865	15030	4,732	28,828
2006-8-10	14080	14200	14330	14465	14550	14640	14765	14810	14885	14905	5,266	28,392
2006-8-11	14115	14215	14360	14515	14605	14695	14820	14810	14900	14905	8,228	28,396
2006-8-14	14095	14175	14280	14370	14465	14535	14640	14675	14830	14820	11,642	23,328
2006-8-15		14100	14130	14160	14270	14355	14480	14550	14650	14740	7,924	22,004
2006-8-16		14150	14140	14145	14250	14345	14475	14550	14650	14905	6,502	21,478
2006-8-17		14160	14145	14090	14185	14275	14440	14555	14635	14805	6,350	20,858
2006-8-18		14150	14195	14130	14200	14310	14510	14555	14645	14795	4,370	20,254
2006-8-21		14170	14260	14180	14245	14340	14500	14545	14650	14795	5,426	20,170
2006-8-22		14150	14255	14170	14240	14325	14450	14515	14595	14795	3,458	19,616
2006-8-23		14165	14300	14260	14315	14395	14520	14545	14785	14795	4,362	19,468
2006-8-24		14180	14275	14235	14305	14375	14510	14550	14660	14795	2,922	19,316
2006-8-25		14180	14275	14240	14305	14390	14505	14550	14675	14795	1,802	19,304
2006-8-28		14180	14290	14225	14275	14345	14490	14550	14675	14795	2,518	18,770
2006-8-29		14180	14240	14155	14190	14260	14420	14500	14575	14690	3,292	18,378
2006-8-30		14135	14160	13955	14015	14055	14225	14320	14360	14500	9,168	17,714
2006-8-31		14075	14070	13745	13810	13890	14080	14160	14240	14360	8,724	18,346
强筋小麦 WS												
交易日期	609	611	701	703	705	707	成交量	持仓量				
2006-8-1	1504	1553	1602	1620	1649	1602	108,292	117,314				
2006-8-2	1477	1533	1580	1598	1632	1581	124,372	110,922				
2006-8-3	1473	1526	1573	1595	1629	1583	127,956	111,320				

2006-8-4	1473	1524	1573	1597	1633	1585	62,854	108,056
2006-8-7	1454	1502	1548	1577	1619	1572	98,840	100,234
2006-8-8	1442	1490	1537	1570	1609	1572	84,386	98,812
2006-8-9	1446	1496	1544	1577	1617	1586	97,230	99,460
2006-8-10	1456	1505	1552	1576	1630	1593	102,746	100,542
2006-8-11	1449	1500	1547	1576	1627	1590	73,288	96,726
2006-8-14	1447	1494	1541	1578	1620	1584	56,736	94,474
2006-8-15	1458	1510	1557	1588	1634	1596	95,768	99,840
2006-8-16	1474	1524	1572	1600	1640	1599	128,864	103,016
2006-8-17	1476	1529	1577	1609	1650	1611	138,770	108,124
2006-8-18	1492	1539	1587	1610	1654	1612	131,204	109,404
2006-8-21	1494	1535	1584	1611	1654	1612	141,710	109,770
2006-8-22	1483	1523	1571	1601	1644	1604	144,754	107,178
2006-8-23	1489	1528	1577	1607	1653	1609	114,360	107,296
2006-8-24	1484	1527	1575	1604	1649	1605	100,112	108,362
2006-8-25	1488	1521	1570	1599	1644	1601	70,498	108,916
2006-8-28	1489	1530	1579	1609	1652	1605	69,310	113,180
2006-8-29	1488	1530	1578	1607	1650	1599	103,556	112,360
2006-8-30	1481	1516	1562	1600	1634	1591	138,998	108,876
2006-8-31	1471	1504	1552	1581	1628	1587	147,584	111,342

硬冬白小麦 WT

交易日期	609	611	701	703	705	707	成交量	持仓量
2006-8-1	1444	1450	1468	1484	1498	1463	76	158
2006-8-2	1455	1451	1473	1484	1504	1463	102	178
2006-8-3	1446	1442	1471	1484	1504	1463	56	166
2006-8-4	1446	1442	1462	1484	1504	1463	44	164
2006-8-7	1446	1432	1454	1471	1501	1463	138	152
2006-8-8	1446	1430	1439	1461	1497	1462	234	156
2006-8-9	1434	1439	1452	1472	1498	1462	116	152
2006-8-10	1434	1425	1444	1471	1498	1487	214	154
2006-8-11	1451	1438	1448	1478	1498	1479	208	118
2006-8-14	1451	1438	1441	1478	1512	1478	14	112
2006-8-15	1450	1431	1436	1472	1512	1462	80	114
2006-8-16	1450	1447	1466	1478	1507	1462	132	140
2006-8-17	1450	1444	1464	1478	1502	1471	206	136
2006-8-18	1450	1454	1468	1483	1502	1491	116	148
2006-8-21	1441	1452	1468	1481	1507	1491	62	148
2006-8-22	1441	1452	1464	1480	1497	1490	76	146
2006-8-23	1440	1443	1464	1485	1497	1492	162	144

2006-8-24	1440	1450	1459	1480	1497	1491	70	132
2006-8-25	1440	1445	1460	1477	1497	1486	858	134
2006-8-28	1440	1445	1464	1478	1501	1486	76	132
2006-8-29	1459	1452	1465	1478	1497	1486	70	120
2006-8-30	1459	1443	1465	1478	1491	1486	12	118
2006-8-31	1459	1455	1463	1478	1477	1486	266	124
白糖 SR								
交易日期	609	611	701	703	705	707	成交量	持仓量
2006-8-1	3969	3875	3860	3877	3938	3948	225,514	147,242
2006-8-2	3944	3890	3861	3892	3930	3958	175,850	141,876
2006-8-3	3884	3841	3813	3830	3883	3899	222,908	136,380
2006-8-4	3827	3825	3810	3834	3881	3902	128,474	141,916
2006-8-7	3764	3702	3744	3742	3800	3823	201,562	162,958
2006-8-8	3775	3770	3776	3832	3837	3860	392,800	149,752
2006-8-9	3781	3758	3795	3806	3853	3883	499,722	150,956
2006-8-10	3820	3729	3778	3801	3836	3858	236,058	148,344
2006-8-11	3828	3730	3736	3733	3795	3807	229,576	164,416
2006-8-14	3710	3590	3612	3614	3665	3670	165,272	171,370
2006-8-15	3659	3560	3477	3488	3538	3566	413,338	146,308
2006-8-16	3691	3600	3488	3495	3544	3567	260,436	138,868
2006-8-17	3762	3612	3486	3511	3539	3565	221,498	136,856
2006-8-18	3746	3652	3524	3558	3576	3602	315,450	122,946
2006-8-21	3736	3581	3482	3433	3520	3538	382,640	144,102
2006-8-22	3663	3587	3422	3419	3458	3481	345,754	140,716
2006-8-23	3654	3558	3407	3360	3419	3450	398,446	146,680
2006-8-24	3617	3550	3389	3383	3413	3434	569,918	152,778
2006-8-25	3650	3560	3397	3383	3413	3440	298,158	148,926
2006-8-28	3653	3550	3415	3370	3418	3447	274,196	152,944
2006-8-29	3653	3485	3371	3283	3343	3371	307,958	167,782
2006-8-30	3669	3500	3307	3255	3290	3313	433,280	153,830
2006-8-31	3744	3520	3270	3272	3278	3311	467,732	156,726

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

本月小麦期货价格宽幅振荡，呈现高位回落，低位反弹的走势。主力合约 WS701

当月波动区间为 1527 - 1614 元, 最大波幅 87 元/吨, 月底报收于 1555 元, 较上月跌 53 元/吨。

月初棉花期货价格振荡上扬, 中旬开始转弱, 月底深幅下挫。主力合约 CF611 当月波动区间为 13680-14595 元, 最大波幅 915 元/吨, 月底报收于 13700 元, 较上月跌 660 元/吨。

白糖期货屡创新低, 放量下跌。主力合约 SR703 当月波动区间为 3210 - 3966 元, 最大波幅 756 元/吨, 月底收报 3272 元, 较上月跌 695 元/吨。

郑州期货市场本月总成交量 9786078 手, 其中成交强麦期货合约 2462188 手、硬麦期货合约 3388 手、棉花期货合约 153962 手、白糖期货合约 7166540 手。截至 8 月 31 日, 总持仓量达 286538 手, 其中强麦持仓量 111342 手、硬麦 124 手, 棉花 18346 手, 白糖 156726 手。

六、动态摘要

8 月 14 日, 郑商所白砂糖期货合约持仓量再创历史新高, 持仓达到了 171370 张标准合约。

8 月 18 日, 郑商所举行交割知识培训会, 全体员工参加学习和讨论。

8 月 24 日, 郑商所白砂糖期货合约交易成交量再创历史新高, 共成交标准合约 569918 张。



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>