

2007. 10
总第30期

月度市场报告

 郑州商品交易所

ZCE MONTHLY REPORT

目 录

一、市场综述.....	2
二、小麦、棉花、白糖、PTA、菜籽油价格走势图.....	3
三、郑州商品交易所 10 月份交易统计.....	8
四、郑州商品交易所 10 月行情表.....	9
五、郑州商品交易所 10 月分品种每日结算价统计表.....	10
六、公告.....	13
七、动态摘要.....	14

一、市场综述

本月郑州期货市场总成交量 26,798,418 手,成交额为 10143.04 亿元,同比分别增长了 106.33%和 150.96%,环比分别增长了 8.01%和 28%。其中成交强麦期货合约 6,046,370 手、硬麦期货合约 2,418 手、棉花期货合约 1,347,452 手、白糖期货合约 17,129,498 手、PTA 期货合约 2,250,416 手、菜籽油期货合约 22,264 手。截至 10 月 31 日,总持仓量达 1,137,764 手,其中强麦持仓量 285,804 手、硬麦持仓量 928 手,棉花持仓量 128,336 手,白糖持仓量 564,882 手,精对苯二甲酸 (PTA) 持仓量 143,694 手、菜籽油持仓量 14,120 手。

本月强麦走出了先扬后抑、低位回升的振荡行情。主力合约 WS805 当月波动区间为 1985-2102 元,最大波幅 117 元/吨,月底报收 2058 元/吨,较上月末涨 31 元/吨,涨幅 1.53%。

棉花成交活跃,期价先扬后抑,冲高回落。主力合约 CF805 当月波动区间为 14470-15660 元,最大波幅 1190 元/吨,月底报收 15255 元/吨,较上月末涨 340 元/吨,涨幅 2.28%。

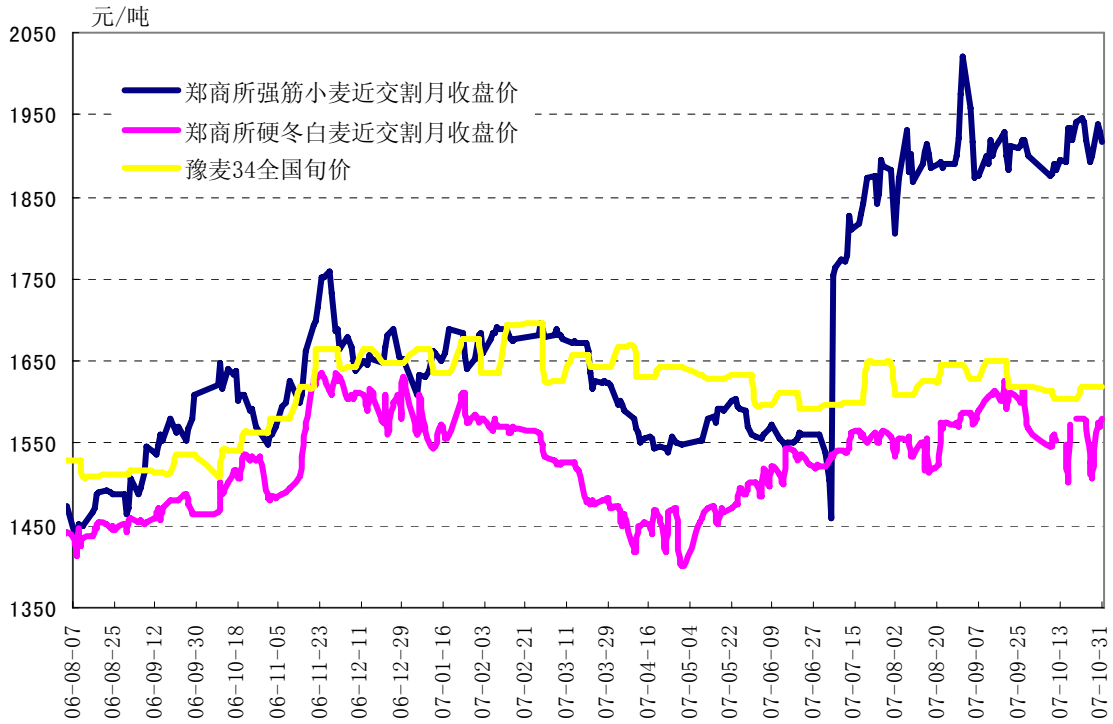
白糖成交稳定,期价先扬后抑,高位回落。主力合约 SR805 当月波动区间为 3865-4235 元,最大波幅 370 元/吨,月底报收 3971 元/吨,较上月末涨 55 元/吨,涨幅 1.40%。

精对苯二甲酸 (PTA) 成交放量,期价持续下跌。主力合约 TA712 当月波动区间为 7300-7898 元,最大波幅 598 元/吨,月底报收 7388 元/吨,较上月末跌 524 元/吨,跌幅 6.62%。

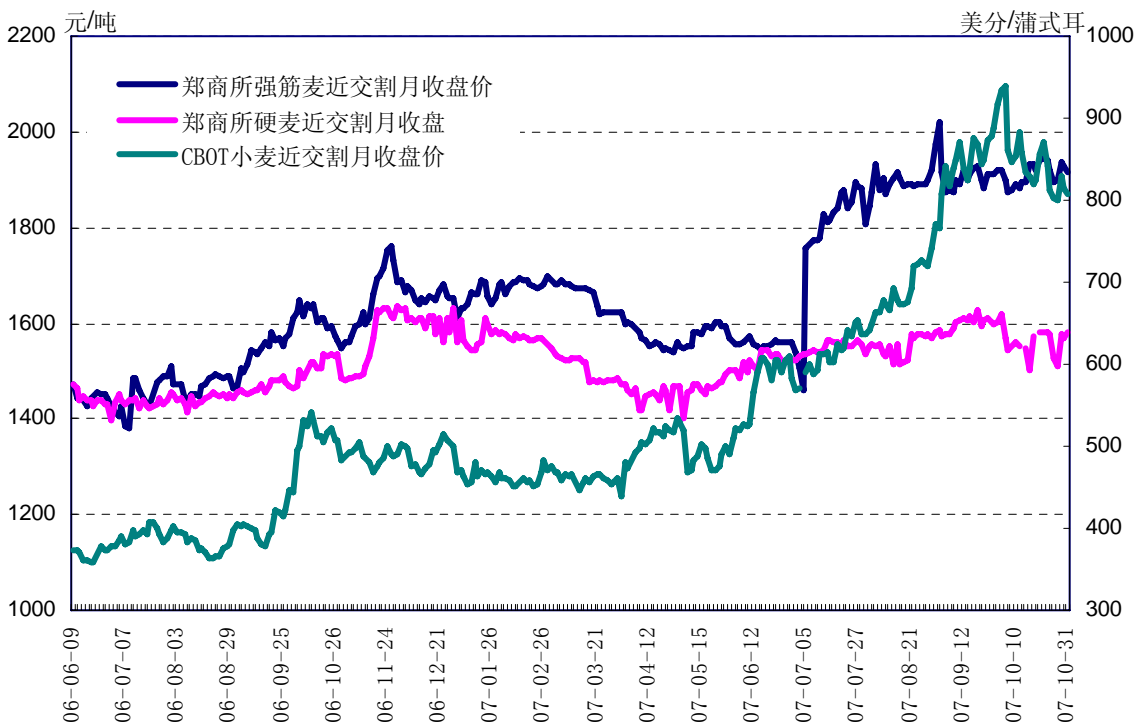
菜籽油期货稳步上扬,进入下旬后涨幅加大。主力合约 R0801 当月波动区间为 9300-9898 元,最大波幅 598 元/吨,月底报收 9860 元/吨,较上月末涨 450 元/吨,涨幅 4.78%。

二、小麦、棉花、白糖、PTA、菜籽油价格走势

郑州小麦期货价与现货价走势对比图



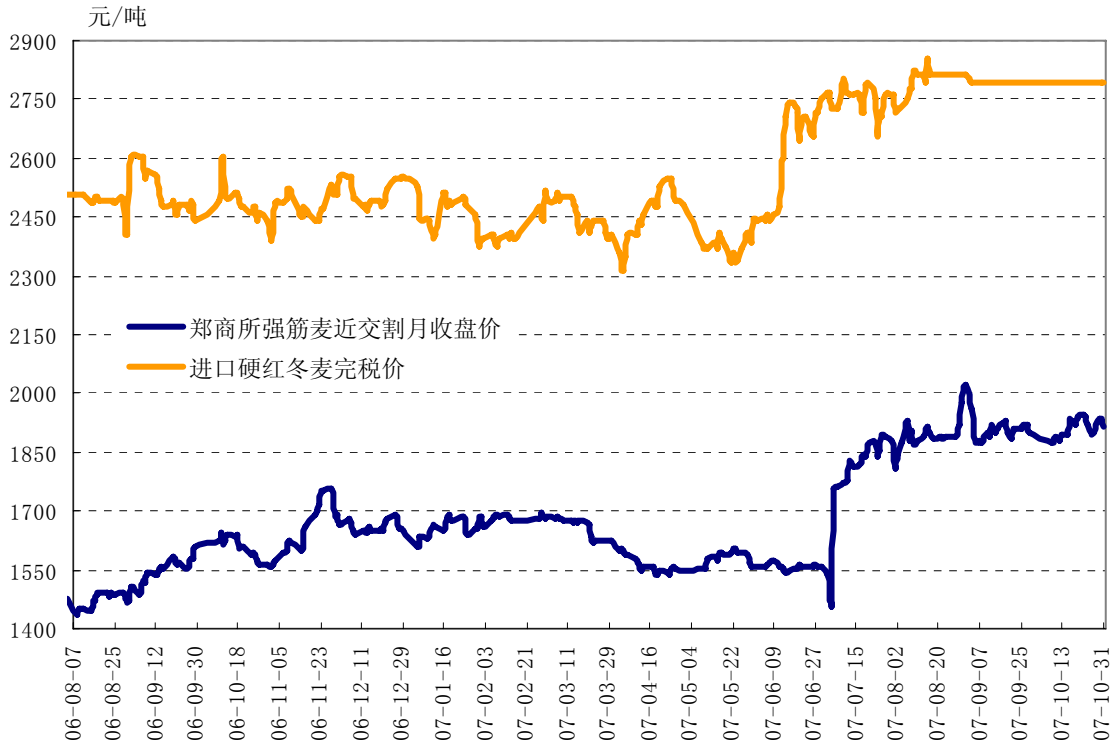
郑州小麦期货价与CBOT小麦期货价走势对比图



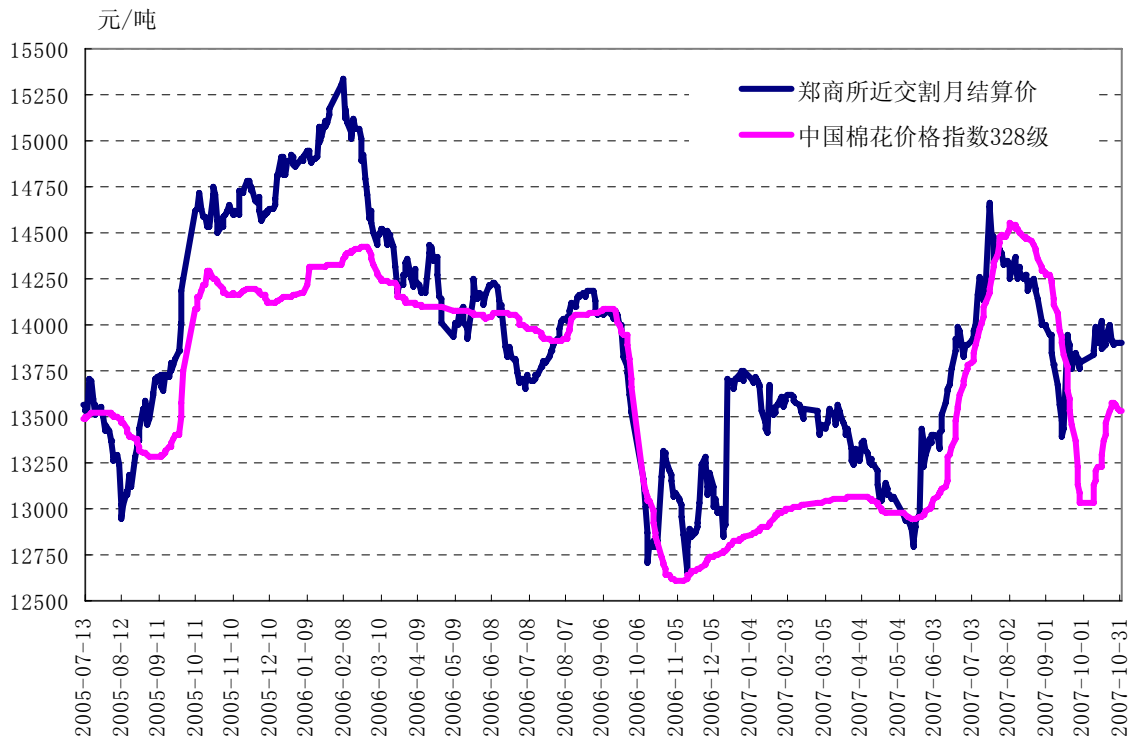
注：强麦近交割月 2007 年 7 月转月，7 月 4 日 707 合约收盘价 1460 元/吨，7 月 5 日转月为 709

合约, 收盘价 1755 元/吨。

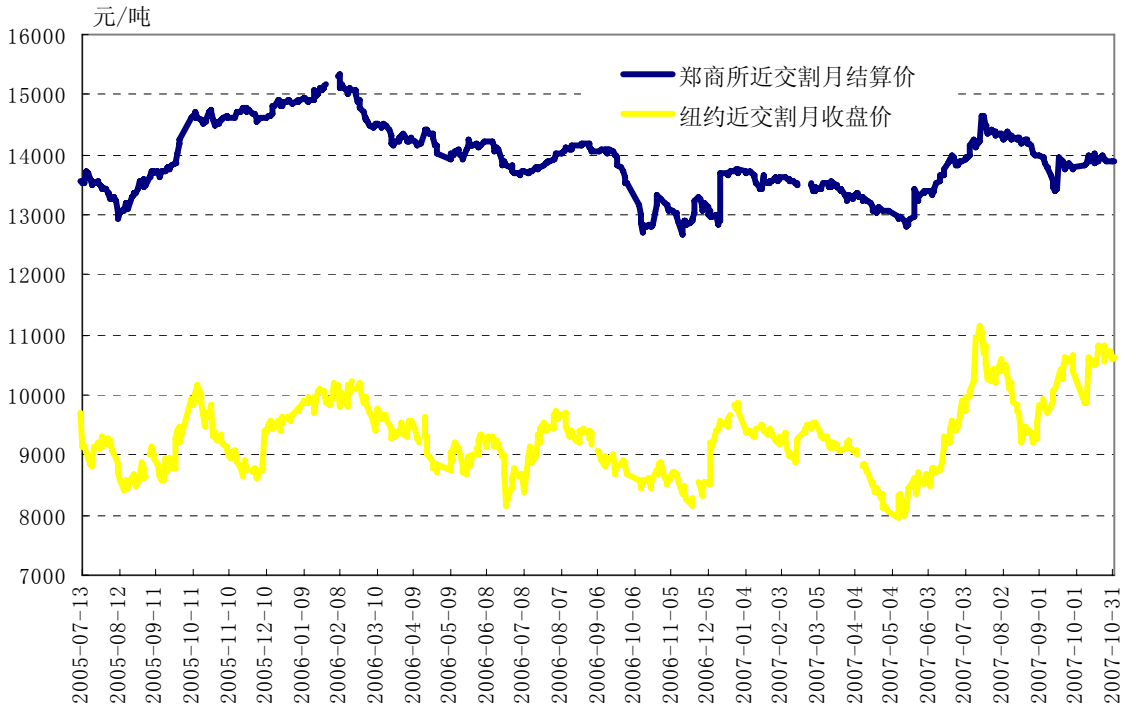
郑州强筋小麦价与进口硬质小麦到岸价走势对比图



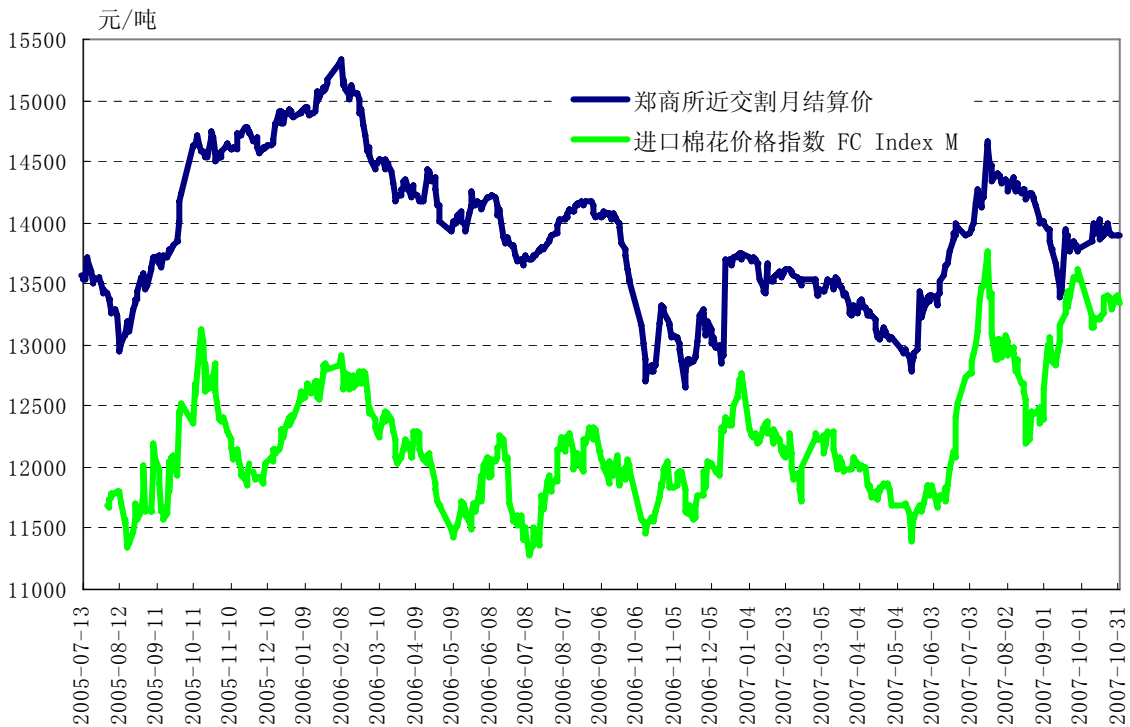
郑州棉花期货价格与中国棉花价格指数对比图



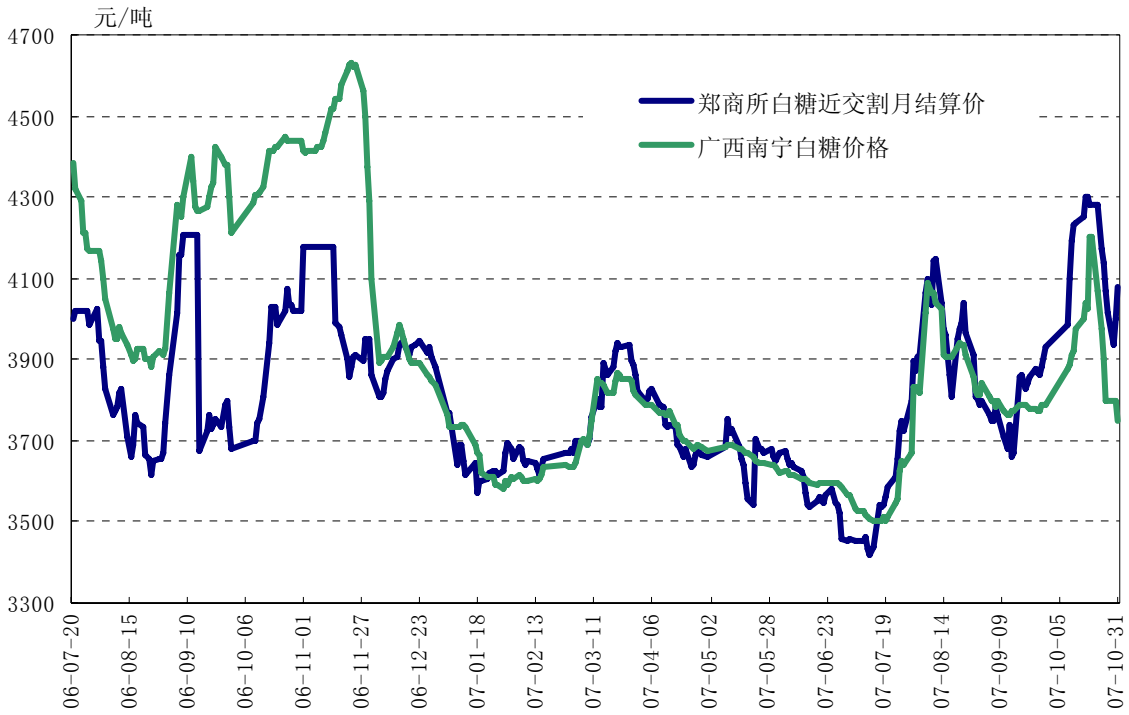
郑州棉花期货与纽约棉花期货价格走势对比图



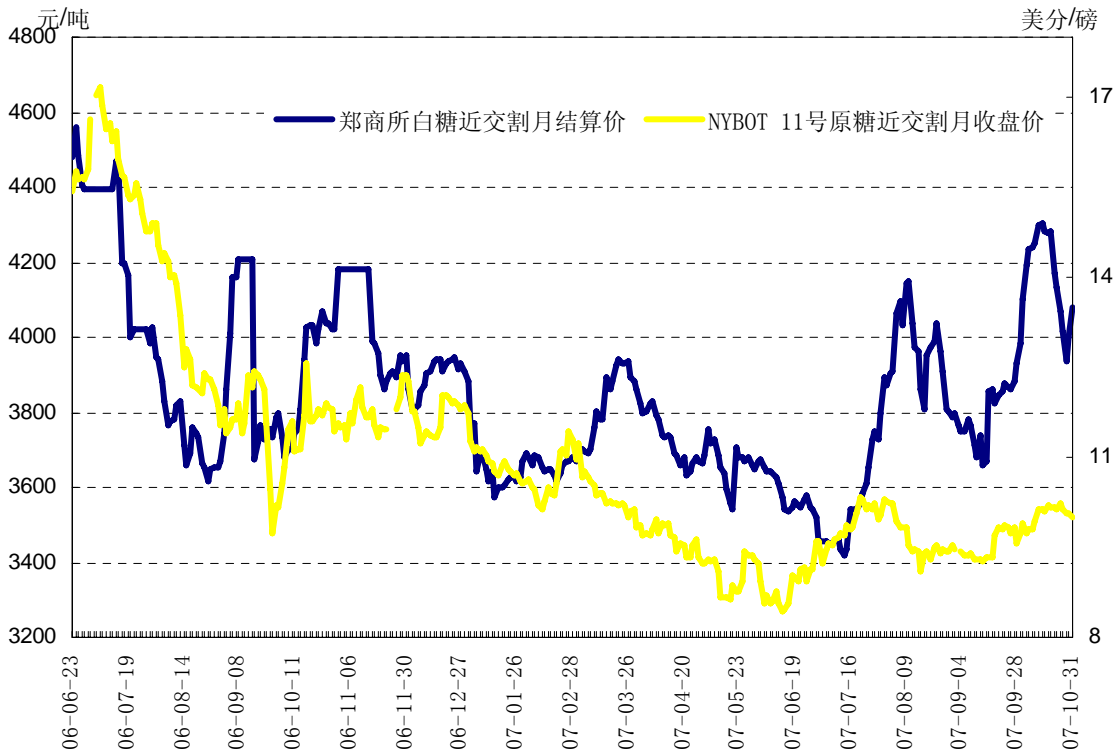
郑州棉花期货价格与进口棉花价格指数对比图



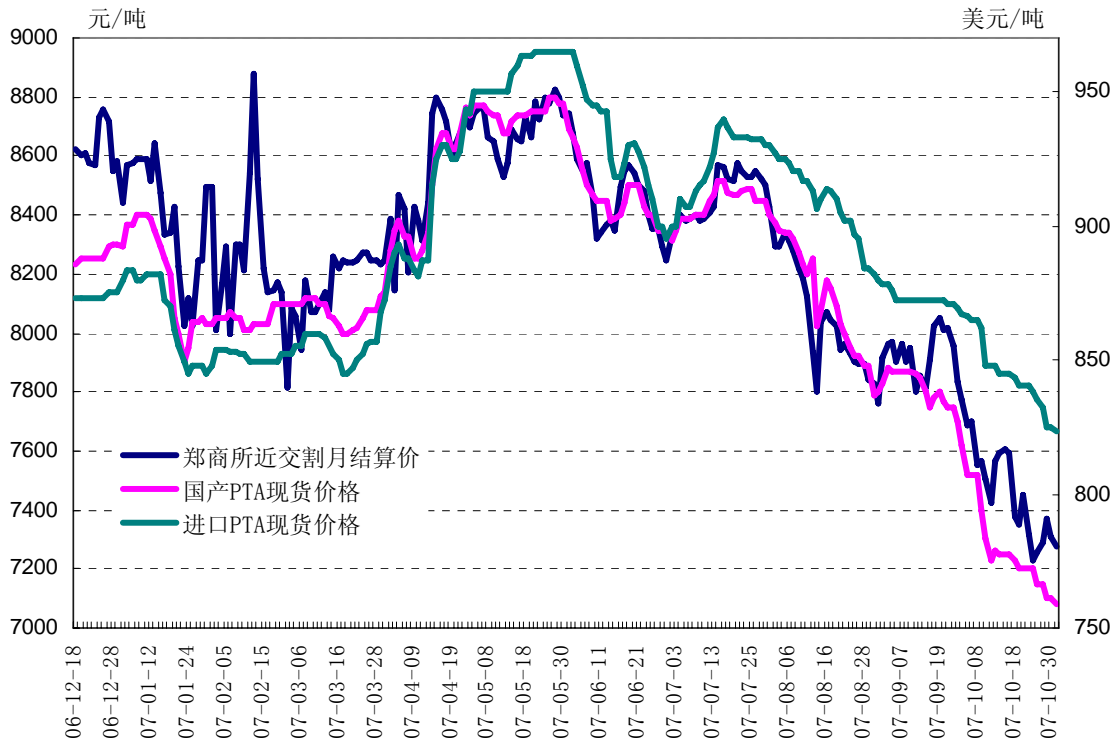
郑州白糖期货价与现货价走势对比图



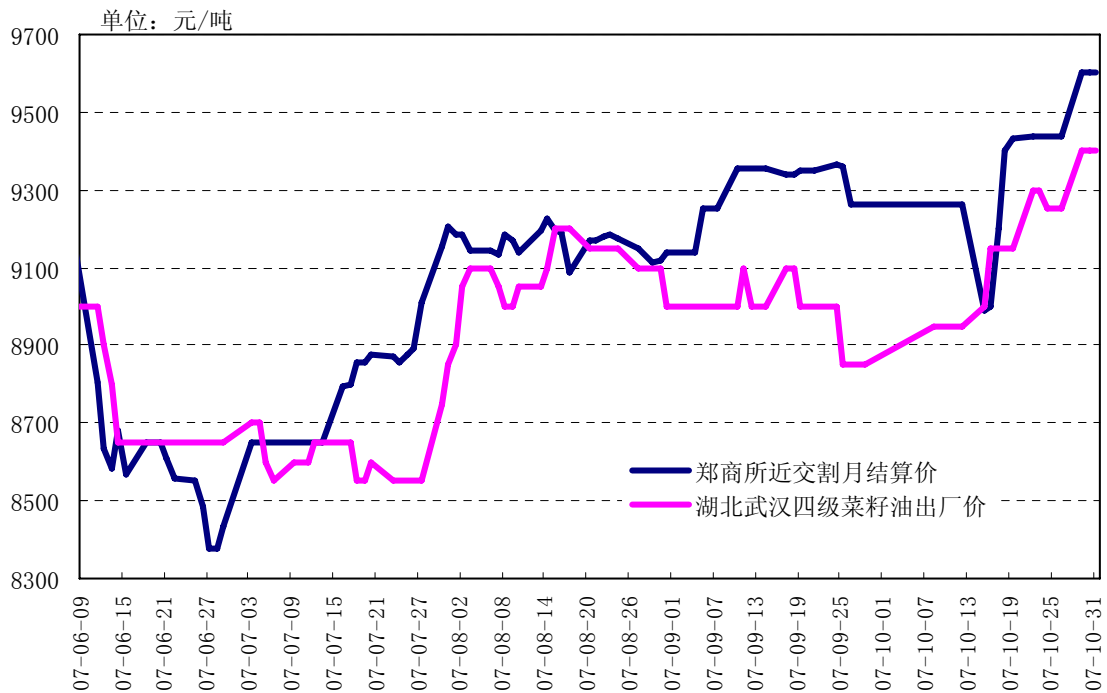
郑州白糖期货价与纽约原糖期货价走势对比图



郑州PTA期货价格与现货价走势图



郑州菜籽油期货价格与现货价走势对比图



三、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	1,347,452	139,870	863.36%	4,724,096	3,463,334	36.40%
菜籽油	22,264	-	-	1,261,386	-	-
白糖	17,129,498	8,801,080	94.63%	63,828,996	47,464,376	34.48%
PTA	2,250,416	-	-	5,143,416	-	-
优质强筋小麦	6,046,370	4,041,630	49.60%	62,788,754	18,182,070	245.33%
硬冬白小麦	2,418	5,398	-55.21%	40,834	49,114	-16.86%
合计	26,798,418	12,987,978	106.33%	137,787,482	69,158,894	99.23%

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	10,313,949	939,264	998.09%	34,712,458	25,812,657	34.48%
菜籽油	107,380	-	-	5,558,045	-	-
白糖	70,007,951	32,562,152	115.00%	245,337,552	191,773,412	27.93%
PTA	8,603,350	-	-	20,881,391	-	-
优质强筋小麦	12,393,750	6,906,561	79.45%	119,609,441	30,057,724	297.93%
硬冬白小麦	4,120	8,214	-49.84%	66,011	72,844	-9.38%
合计	101,430,499	40,416,191	150.97%	426,164,898	247,716,637	72.04%

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	128,336	30,178	325.26%	113,340	13.23%
菜籽油	14,120	-	-	8,496	66.20%
白糖	564,882	164,928	242.50%	404,030	39.81%
PTA	143,694	-	-	61,996	131.78%
优质强筋小麦	285,804	188,488	51.63%	307,394	-7.02%
硬冬白小麦	928	304	205.26%	1,048	-11.45%
合计	1,137,764	383,898	196.37%	896,304	26.94%

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

	200710 交割量	200710 期转现	200610 交割量	200610 期转现	当年合约 累计	去年同期合约 累计

一号棉花	0	0	108	0	28,340	26,748
菜籽油	0	0	0	0	3,540	0
白糖	0	0	0	0	8,467	2,281
PTA	2,103	33	0	0	27,517	0
优质强筋小麦	0	0	0	0	20,902	49,713
硬冬白小麦	0	0	0	0	71	118
合计	2,103	33	108	0	88,837	78,860

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。

四、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)
CF711	13845	14095	13700	13905	350	-18	13900	946	0.659
CF801	14230	15035	14230	14635	20,516	-15742	14585	118,484	87.31
CF803	14560	15295	14560	14910	6,444	656	14850	15,362	11.513
CF805	14770	15660	14770	15255	94,608	26296	15195	1,198,432	920.773
CF807	15155	15840	15120	15480	5,628	3450	15435	12,182	9.505
CF809	15360	16220	15360	15870	790	354	15875	2,046	1.635
小计	-	-	-	-	128,336	-	-	1,347,452	1,031.395
GN711	0	0	0	0	0	0		0	0
GN801	0	0	0	0	0	0		0	0
GN803	0	0	0	0	0	0		0	0
GN805	0	0	0	0	0	0		0	0
GN807	0	0	0	0	0	0		0	0
GN809	0	0	0	0	0	0		0	0
小计	-	-	-	-	0	-	-	0	0
RO711	9000	9600	8990	9600	1,626	78	9600	258	0.121
RO801	9300	9898	9300	9860	11,870	5276	9838	19,798	9.557
RO803	9430	10200	9308	9800	6	-10	9782	290	0.141
RO805	9254	9896	9254	9880	528	194	9852	1,812	0.87
RO807	9450	9650	9100	9598	8	6	9466	14	0.007
RO809	9450	9640	9388	9600	82	80	9596	92	0.044
小计	-	-	-	-	14,120	-	-	22,264	10.738
SR711	3931	4360	3908	4030	2,104	-436	4080	7,512	3.119
SR801	3716	4041	3703	3760	37,056	-13814	3776	163,188	63.29
SR803	3784	4116	3784	3845	12,730	4376	3866	27,596	10.949
SR805	3870	4235	3865	3971	394,802	103574	3994	15,749,110	6,433.71
SR807	3908	4294	3908	4058	108,978	59892	4081	1,130,718	468.207
SR809	3965	4394	3958	4123	9,212	7260	4150	51,374	21.526

小计	-	-	-	-	564,882	-	-	17,129,498	7,000.795
TA710	7546	7718	7340	7350	0	-3416	7348	3,884	1.466
TA711	7664	7852	7200	7268	1,830	1522	7276	3,698	1.385
TA712	7752	7898	7300	7388	71,956	15000	7410	1,686,186	643.974
TA801	7940	8054	7470	7566	67,052	65888	7588	550,314	210.967
TA802	8046	8122	7652	7720	896	888	7732	2,090	0.814
TA803	8242	8318	7800	7870	1,176	1166	7892	2,066	0.82
TA804	8316	8316	7980	8020	44	32	8014	154	0.063
TA805	8320	8696	7984	8136	250	216	8142	750	0.309
TA806	8374	8586	8210	8300	320	240	8300	748	0.312
TA807	8848	8900	8300	8340	42	36	8374	96	0.041
TA808	8900	8900	8328	8472	34	34	8510	128	0.055
TA809	8900	9020	8300	8610	34	32	8664	150	0.065
TA810	8002	8868	8000	8868	60	60	8740	152	0.065
小计	-	-	-	-	143,694	-	-	2,250,416	860.335
WS711	1874	1955	1860	1917	7,614	266	1918	6,932	1.328
WS801	1910	2005	1900	1968	49,780	-11304	1970	103,788	20.213
WS803	1939	2067	1939	2017	2,502	-504	2021	2,456	0.491
WS805	1988	2102	1985	2058	191,958	-16498	2062	5,664,942	1,160.39
WS807	1943	2058	1943	2021	12,050	1334	2025	36,996	7.446
WS809	2055	2188	2040	2154	21,900	5116	2156	231,256	49.505
小计	-	-	-	-	285,804	-	-	6,046,370	1,239.375
WT711	1550	1590	1503	1580	110	-110	1574	232	0.036
WT801	1665	1665	1585	1625	174	-70	1623	394	0.064
WT803	1663	1744	1651	1680	68	16	1685	172	0.029
WT805	1680	1779	1679	1738	472	0	1740	1,062	0.184
WT807	1719	1790	1675	1752	68	10	1745	234	0.041
WT809	1782	1854	1761	1805	36	34	1813	324	0.059
小计	-	-	-	-	928	-	-	2,418	0.412
总计	-	-	-	-	1,137,764	-	-	26,798,418	10,143.050

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。

五、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	711	801	803	805	807	809	成交量	持仓量
2007-10-8	13840	14475	14790	15075	15325	15665	64876	115946
2007-10-9	13855	14570	14865	15160	15390	15735	79358	128542
2007-10-10	13990	14800	15085	15395	15615	15985	146672	144296
2007-10-11	13920	14745	15055	15340	15570	15930	69976	144398
2007-10-12	13905	14820	15135	15430	15640	16010	99950	154098

2007-10-15	14025	14925	15220	15540	15755	16120	76674	160552
2007-10-16	13865	14875	15175	15490	15695	16055	67098	158388
2007-10-17	13885	14945	15225	15550	15755	16145	85756	163534
2007-10-18	13895	14820	15095	15415	15615	16020	56798	160118
2007-10-19	13935	14920	15210	15530	15730	16100	61112	163146
2007-10-22	13995	14945	15225	15570	15765	16145	121974	171230
2007-10-23	13915	14750	14965	15375	15530	15985	113922	158606
2007-10-24	13915	14665	14915	15250	15475	15865	53012	153774
2007-10-25	13890	14495	14755	15080	15330	15780	78792	133442
2007-10-26	13900	14565	14820	15150	15380	15805	40410	130814
2007-10-29	13900	14715	14970	15320	15555	15970	52710	132028
2007-10-30	13900	14615	14875	15220	15455	15885	38130	129028
2007-10-31	13900	14585	14850	15195	15435	15875	40232	128336

强筋小麦 WS

交易日期	711	801	803	805	807	809	成交量	持仓量
2007-10-8	1882	1915	1957	2002	1973	2069	293,928	292,868
2007-10-9	1869	1914	1960	1999	1973	2071	270,238	292,966
2007-10-10	1887	1929	1963	2018	1998	2092	290,216	298,326
2007-10-11	1886	1927	1971	2019	1992	2096	249,374	303,710
2007-10-12	1890	1929	1973	2021	1995	2098	251,272	296,818
2007-10-15	1888	1931	1972	2023	1998	2100	238,030	302,380
2007-10-16	1909	1950	1995	2048	2023	2135	466,794	316,710
2007-10-17	1933	1975	2016	2074	2049	2164	485,192	321,546
2007-10-18	1922	1963	2011	2058	2031	2146	323,552	310,116
2007-10-19	1934	1979	2021	2075	2044	2162	249,572	314,548
2007-10-22	1932	1978	2028	2072	2039	2160	355,064	332,920
2007-10-23	1948	1983	2027	2078	2043	2163	455,372	308,270
2007-10-24	1923	1963	2021	2057	2019	2144	365,418	307,264
2007-10-25	1897	1939	1987	2027	1999	2120	353,990	283,112
2007-10-26	1900	1944	1992	2034	2003	2127	218,624	275,088
2007-10-29	1914	1974	2024	2063	2027	2155	372,766	281,898
2007-10-30	1934	1977	2023	2070	2034	2163	493,810	296,216
2007-10-31	1918	1970	2021	2062	2025	2156	313,158	285,804

硬冬白小麦 WT

交易日期	711	801	803	805	807	809	成交量	持仓量
2007-10-8	1548	1604	1704	1713	1725	1796	108	1,040
2007-10-9	1546	1606	1704	1713	1714	1774	82	1,038
2007-10-10	1557	1604	1664	1718	1730	1785	156	1,032
2007-10-11	1554	1606	1664	1722	1732	1792	122	1,050
2007-10-12	1554	1605	1667	1723	1723	1788	78	1,056
2007-10-15	1546	1610	1671	1723	1739	1790	136	1,056
2007-10-16	1547	1614	1693	1731	1748	1811	192	1,088

2007-10-17	1569	1617	1699	1748	1747	1837	290	1,064
2007-10-18	1569	1613	1670	1738	1741	1809	52	1,072
2007-10-19	1580	1621	1675	1749	1764	1834	64	1,098
2007-10-22	1580	1606	1677	1740	1764	1801	46	1,084
2007-10-23	1580	1620	1670	1741	1772	1817	92	1,040
2007-10-24	1570	1617	1666	1731	1749	1820	140	1,030
2007-10-25	1529	1606	1671	1719	1728	1799	228	1,032
2007-10-26	1547	1613	1664	1734	1728	1810	144	992
2007-10-29	1574	1629	1682	1744	1748	1825	296	976
2007-10-30	1571	1624	1682	1751	1751	1814	92	964
2007-10-31	1574	1623	1685	1740	1745	1813	100	928

白糖 SR

交易日期	711	801	803	805	807	809	成交量	持仓量
2007-10-8	3985	3731	3815	3895	3944	3993	509,508	430,028
2007-10-9	4099	3808	3902	3996	4039	4092	1,111,472	501,906
2007-10-10	4192	3894	3973	4077	4129	4167	1,425,196	498,078
2007-10-11	4233	3911	3979	4091	4140	4186	1,311,414	532,798
2007-10-12	4238	3938	3999	4114	4182	4228	1,131,716	493,622
2007-10-15	4252	3939	4010	4120	4197	4252	957,688	512,162
2007-10-16	4301	4002	4082	4193	4264	4317	1,075,776	530,508
2007-10-17	4303	3999	4080	4193	4245	4310	1,033,336	528,354
2007-10-18	4281	3956	4035	4165	4226	4278	1,074,836	526,618
2007-10-19	4280	3953	4039	4167	4228	4286	737,806	530,364
2007-10-22	4281	3872	3964	4097	4145	4211	935,620	553,364
2007-10-23	4173	3844	3943	4068	4109	4172	873,944	546,286
2007-10-24	4136	3844	3939	4060	4104	4165	648,000	554,180
2007-10-25	4069	3779	3881	4015	4066	4123	911,184	526,694
2007-10-26	4014	3779	3877	3999	4046	4112	927,876	549,314
2007-10-29	3935	3852	3947	4079	4135	4203	999,452	577,532
2007-10-30	4002	3838	3938	4067	4141	4210	751,850	576,816
2007-10-31	4080	3776	3866	3994	4081	4150	712,824	564,882

菜籽油 RO

交易日期	711	801	803	805	807	809	成交量	持仓量
2007-10-8	9260	9352	9496	9312	9322	9332	222	8,458
2007-10-9	9260	9378	9438	9388	9322	9332	658	8,574
2007-10-10	9260	9444	9438	9450	9322	9332	1,036	8,838
2007-10-11	9260	9474	9438	9460	9322	9332	934	9,236
2007-10-12	9260	9488	9438	9478	9322	9332	472	9,376
2007-10-15	8992	9488	9438	9504	9322	9332	382	9,422
2007-10-16	9000	9490	9438	9526	9322	9332	880	9,688
2007-10-17	9200	9474	9438	9526	9322	9332	468	9,730
2007-10-18	9400	9456	9438	9480	9322	9332	182	9,692

2007-10-19	9430	9492	9438	9504	9322	9332	1,246	10,144
2007-10-22	9436	9456	9438	9482	9322	9420	298	10,094
2007-10-23	9436	9492	9314	9508	9322	9420	538	10,358
2007-10-24	9436	9584	9314	9560	9450	9436	3,084	11,674
2007-10-25	9436	9674	9680	9674	9450	9500	3,374	12,694
2007-10-26	9436	9760	9536	9722	9450	9464	1,904	13,094
2007-10-29	9600	9836	9902	9798	9450	9602	3,366	14,182
2007-10-30	9600	9858	9902	9796	9418	9574	2,636	14,084
2007-10-31	9600	9838	9782	9852	9466	9596	584	14,120

PTA (TA)

交易日期	710	711	712	801	802	803	804	805	806	807	808	809	810	成交量	持仓量
2007-10-8	7550	7666	7798	7920	8062	8148	8230	8146	8374	8602	8800	8556		22822	65028
2007-10-9	7564	7672	7814	7934	7980	8156	8220	8262	8374	8602	8800	8556		32900	71138
2007-10-10	7502	7630	7748	7872	7980	8040	8220	8298	8338	8602	8800	8556		51254	78774
2007-10-11	7422	7536	7658	7794	7980	7984	8220	8278	8328	8614	8800	8556		38646	82036
2007-10-12	7568	7642	7776	7908	8012	8126	8200	8378	8210	8600	8800	8556		127582	98964
2007-10-15	7590	7734	7846	7998	8012	8126	8200	8402	8406	8600	8674	8672		117392	117520
2007-10-16	7604	7728	7838	7978	8100	8118	8200	8448	8390	8600	8674	8760		167010	145790
2007-10-17	7592	7704	7846	8012	8094	8118	8200	8432	8406	8600	8770	8760		182074	177922
2007-10-18	7374	7524	7688	7850	7952	8038	8158	8282	8354	8600	8476	8562		225980	176784
2007-10-19	7348	7462	7612	7782	7900	8038	8238	8282	8362	8672	8476	8750		125850	157054
2007-10-22		7448	7576	7766	7872	8014	8238	8252	8344	8672	8480	8582	8438	208126	162180
2007-10-23		7316	7432	7624	7786	7966	8238	8206	8316	8672	8486	8582	8540	165952	163794
2007-10-24		7230	7406	7588	7748	7910	8238	8162	8312	8672	8486	8426	8582	87784	155736
2007-10-25		7256	7378	7544	7706	7858	8238	8166	8272	8620	8598	8510	8614	135650	143440
2007-10-26		7290	7400	7582	7722	7894	8238	8160	8272	8500	8468	8720	8614	144728	143528
2007-10-29		7370	7472	7670	7832	7980	8238	8294	8398	8510	8500	8720	8740	169508	157378
2007-10-30		7312	7438	7610	7742	7886	8014	8178	8332	8404	8556	8720	8740	113550	137232
2007-10-31		7276	7410	7588	7732	7892	8014	8142	8300	8374	8510	8664	8740	133608	143694

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。

六、公告

关于 2007/08 年度棉花指定交割仓库的通告

(2007) 第 27 号

现将 2007/08 年度棉花指定交割仓库通告如下：

衡水市棉麻总公司储备库
 菏泽市棉麻公司
 湖北银丰仓储物流有限责任公司
 中国储备棉管理总公司徐州直属库

河南储备物资管理局四三二处
南阳市棉花储运有限公司
河南豫棉物流有限公司
中国储备棉管理总公司青岛直属库 (暂停入库业务)
中棉集团廊坊储运有限公司 (暂停入库业务)
芜湖市棉麻有限责任公司 (暂停入库业务)
湖南六九 0 一单位 (暂停入库业务)
天津宏棉股份有限公司杨柳青仓库 (暂停入库业务)
山东省禹城棉麻有限公司 (暂停入库业务)

特此通告。

二 00 七年十月十一日

关于 TA810 合约基准价的通告

(2007) 第 28 号

现将 2007 年 10 月 22 日上市交易合约基准价通告如下:

TA810 8600 元/吨

特此通告, 请及时转告广大投资者。

二 00 七年十月十九日

七、动态摘要

2007 年 10 月 13 日, 郑商所举办棉花期货分析师培训班, 来自期货公司研发及市场人员、大型涉棉企业期货操作人员百余人参加了培训。

2007 年 10 月 25 日, 郑商所举办菜籽油期货座谈会, 来自国内大型菜籽油企业专业人员和部分期货公司研发及市场人员 20 余人参加了座谈。

2007 年 10 月 23-26 日, 广东省证监局、广东证券期货业协会和部分郑商所广东会员一行十余人到郑商所考察。



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>