

2007. 02
总第22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、PTA 价格走势图	2
二、郑州商品交易所 2 月份交易统计.....	6
三、郑州商品交易所 2 月行情表.....	7
四、郑州商品交易所 2 月分品种每日结算价统计表.....	8
五、公告.....	11
六、市场综述.....	11
七、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

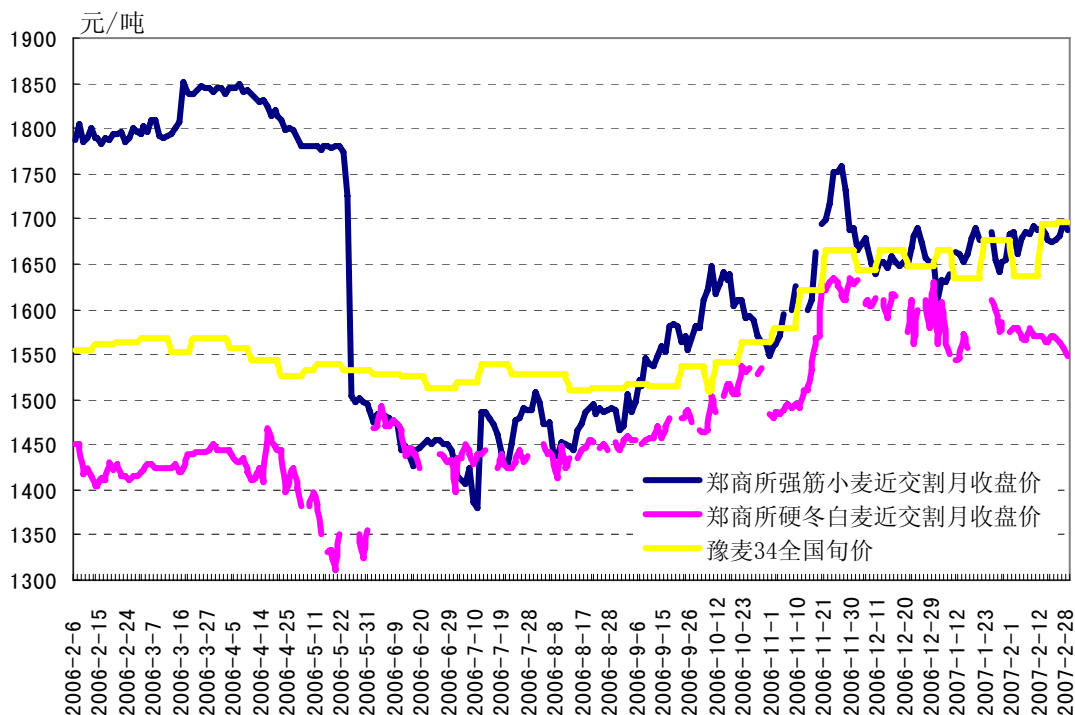


图2 郑州小麦期货价与CBOT小麦期货价走势图

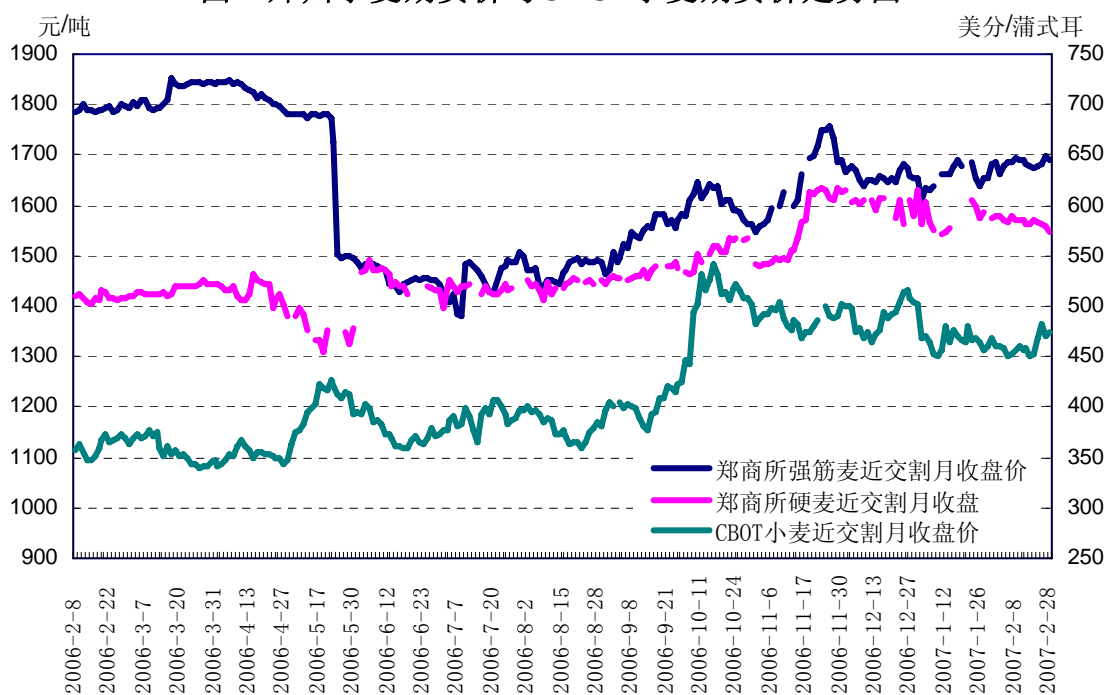


图3 郑州强筋小麦价与进口硬质小麦到岸价对比图

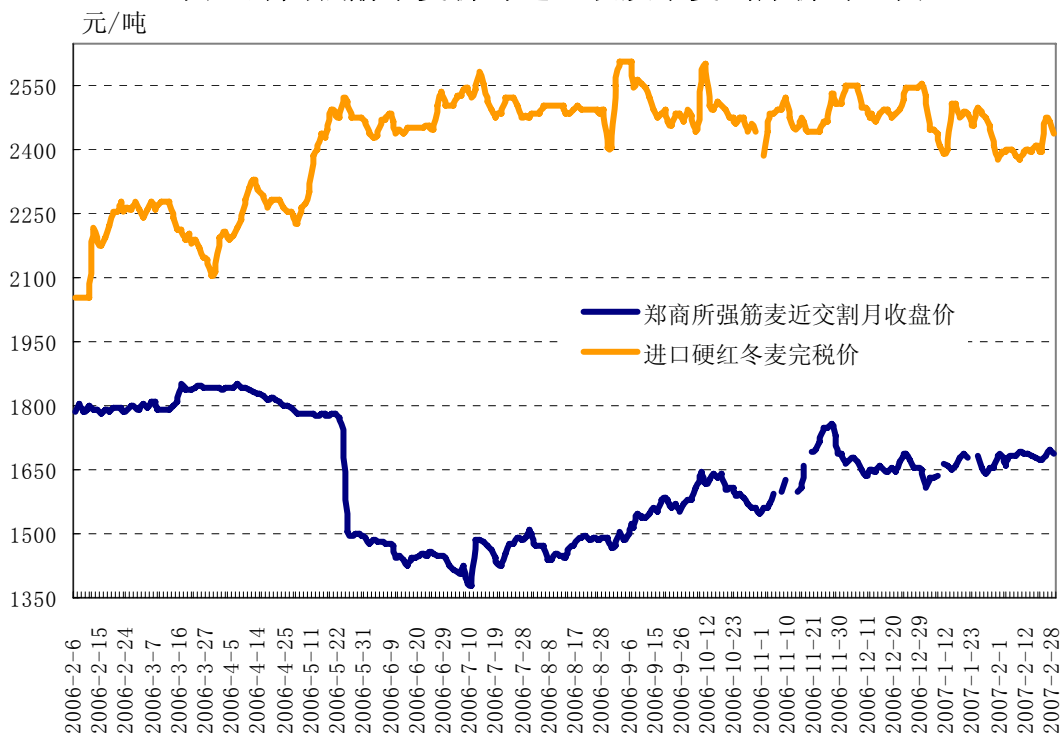


图4 郑州棉花期货价格与中国棉花价格指数对比图

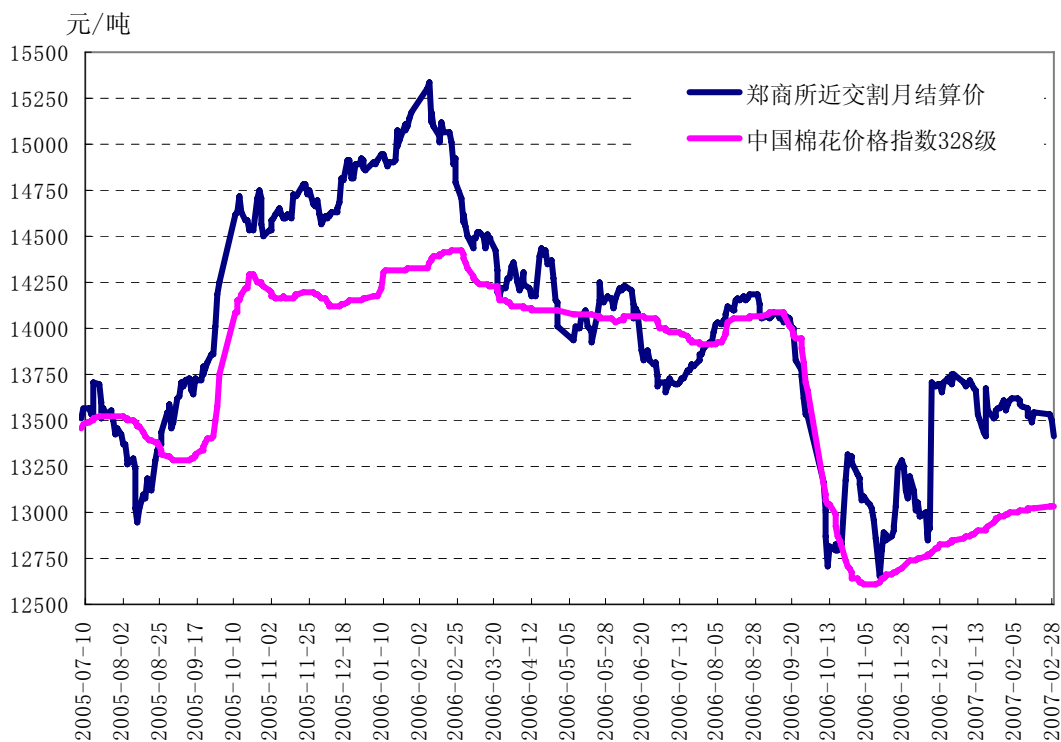


图5 郑州棉花期货与纽约棉花期货价格走势对比图

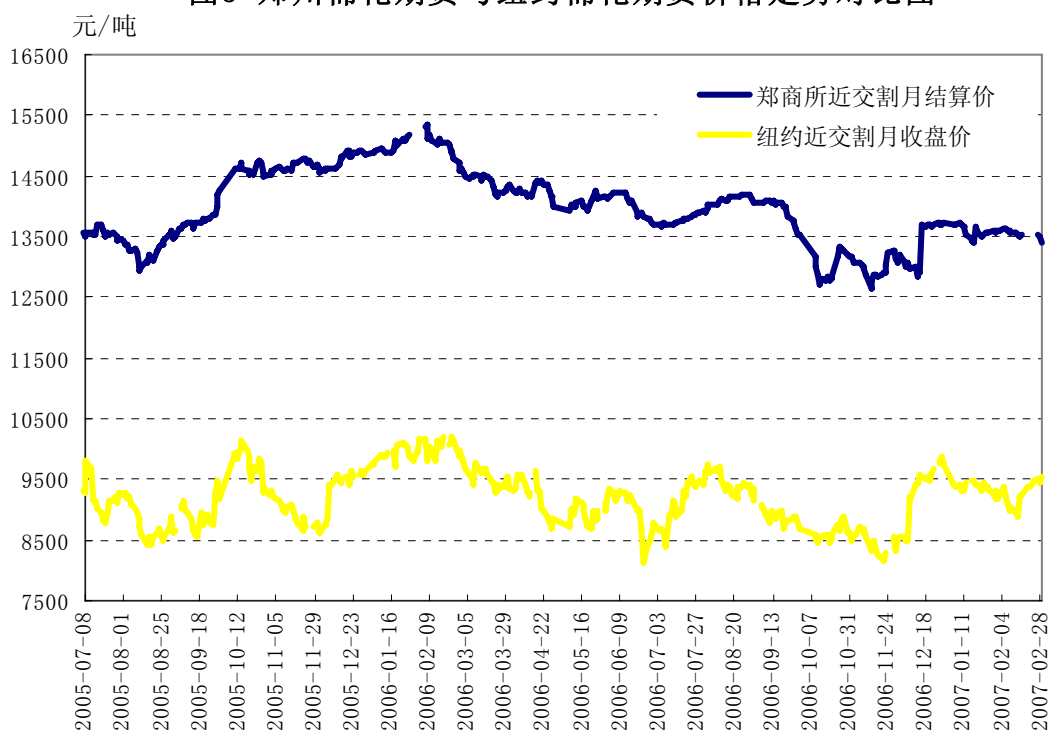


图6 郑州棉花期货价格与进口棉花价格指数对比图

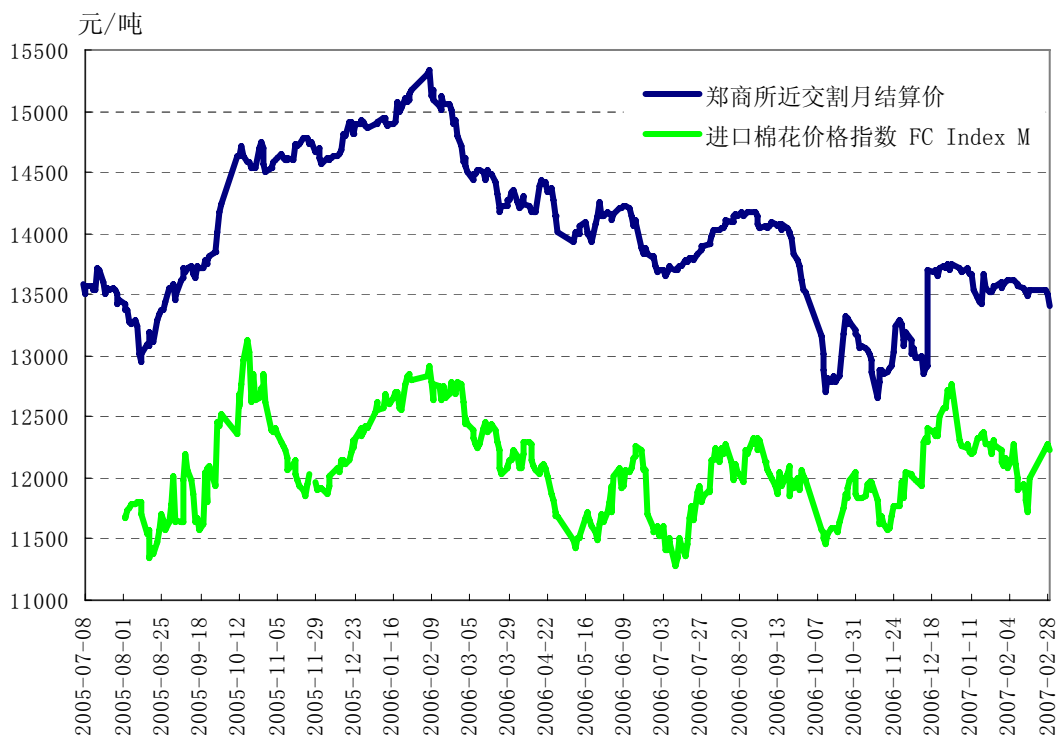


图7 郑州白糖期货价与现货价走势图

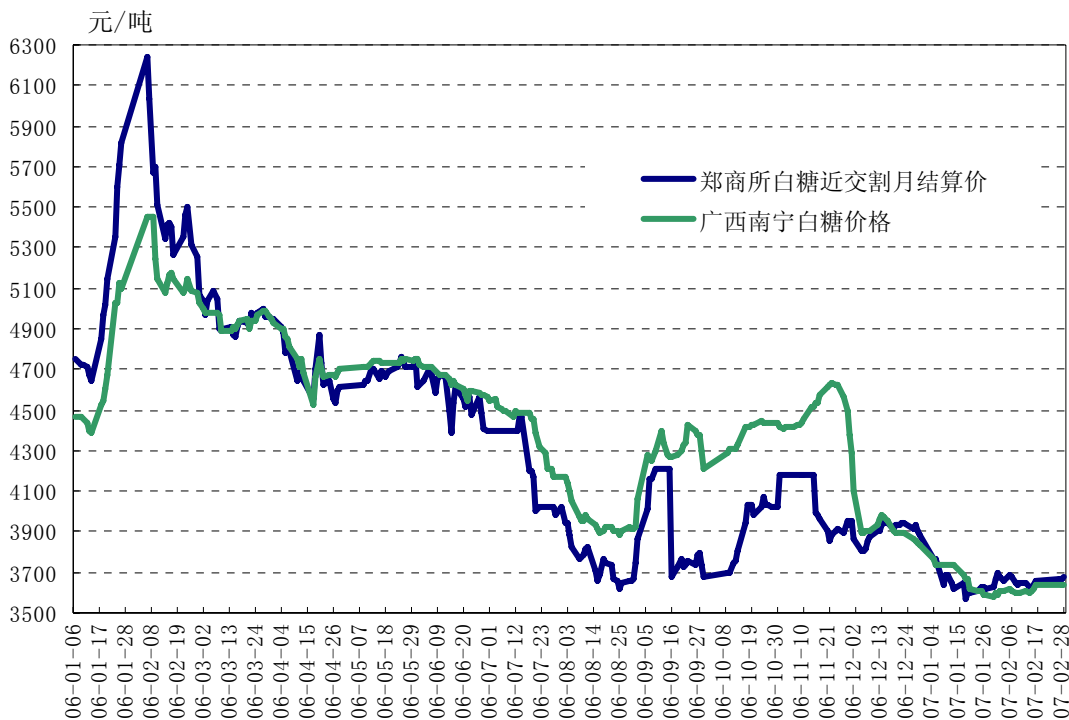
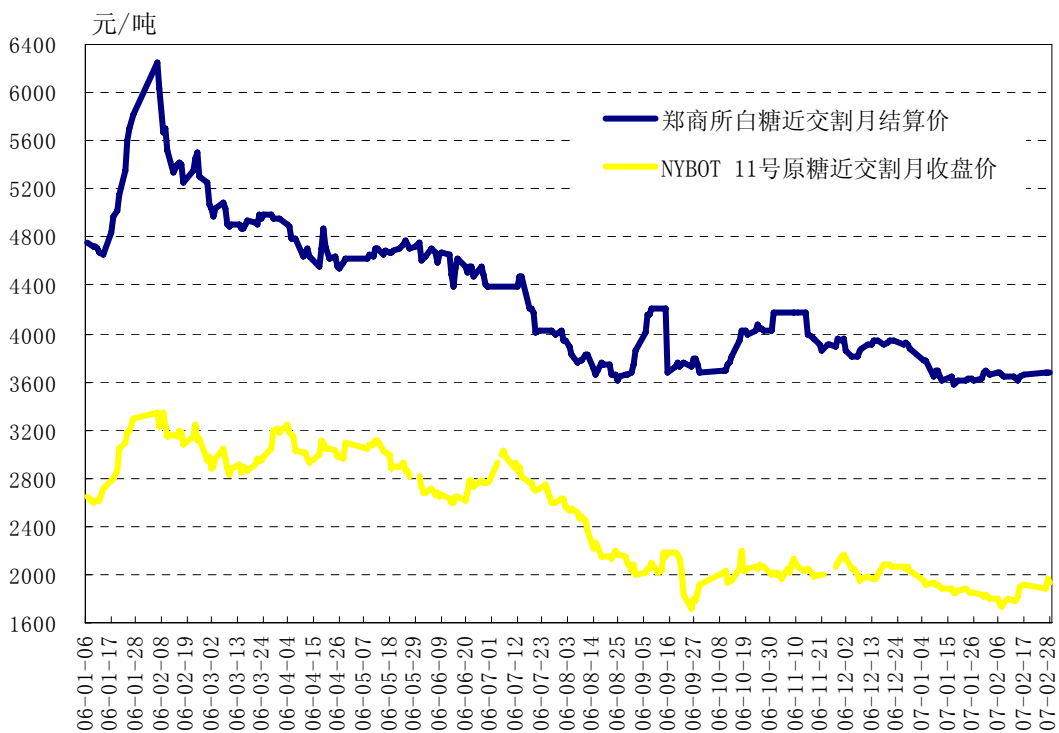
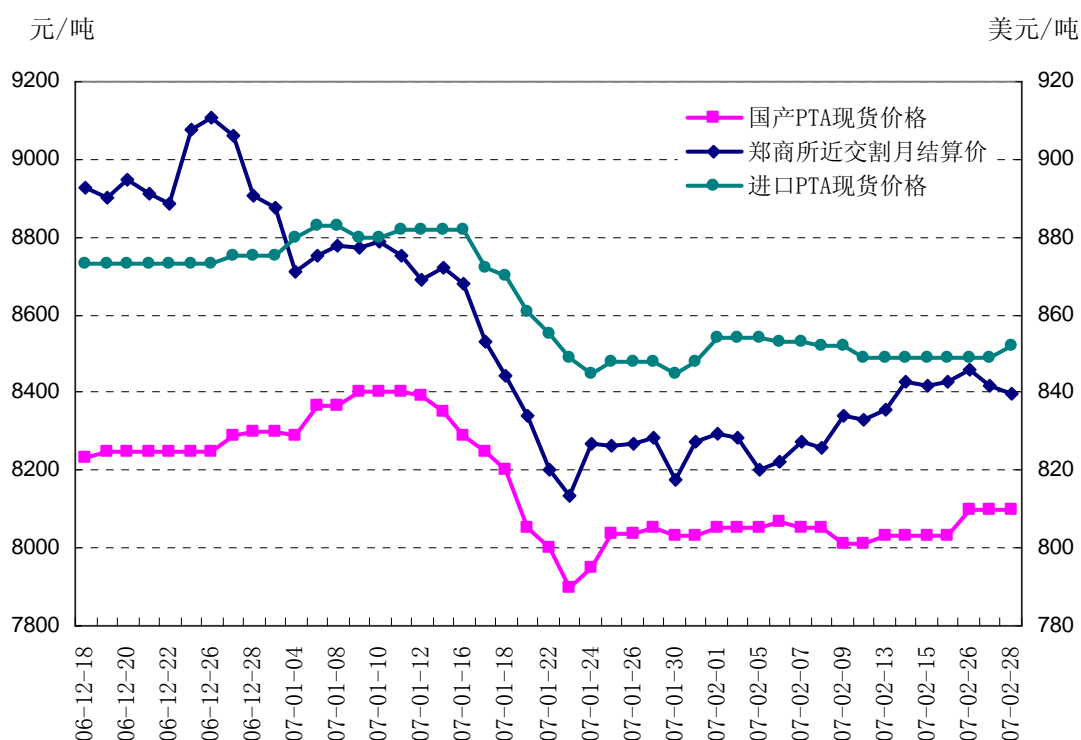


图8 郑州白糖期货价与纽约原糖期货价对比图



郑州PTA期货价格与现货价走势图



二、郑州商品交易所 2 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	59,212	871,666	-93.21%	196,244	1,751,324	-88.79%
白糖	1,621,992	1,083,318	49.72%	3,687,440	1,675,562	120.07%
PTA	414,682	-	-	1,102,704	-	-
优质强筋小麦	2,537,554	973,338	160.71%	6,570,142	2,267,824	189.71%
硬冬白小麦	2,254	2,818	-20.01%	6,740	6,992	-3.60%
合计	4,635,694	2,931,140	58.15%	11,563,270	5,701,702	102.80%

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、PTA 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	412,868	6,714,795	-93.85%	1,372,414	13,483,499	-89.82%
白糖	6,089,813	6,022,493	1.12%	13,670,674	9,182,806	48.87%
PTA	1,726,971	-	-	4,631,881	-	-
优质强筋小麦	4,675,349	1,700,008	175.02%	12,085,226	3,967,607	204.60%
硬冬白小麦	3,646	4,124	-11.59%	10,873	10,199	6.61%
合计	12,908,647	14,441,420	-10.61%	31,771,067	26,644,111	19.24%

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	61,148	70,992	-13.87%	58,996	3.65%
白糖	154,298	34,638	345.46%	150,124	2.78%
PTA	24,784	-	-	25,686	-3.51%
优质强筋小麦	208,836	296,882	-29.66%	180,544	15.67%
硬冬白小麦	1,088	862	26.22%	1,004	8.37%
合计	450,154	403,374	11.60%	416,354	8.12%

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、PTA5 吨 / 手。

实物交割

	200702 交割量	200702 期转现	200602 交割量	200602 期转现	当年合约 累计	去年同期合约 累计
一号棉花	-	-	-	-	4,320	1,544
白糖	-	-	-	-	65	0
PTA	363	0	-	-	363	-
优质强筋小麦	-	-	-	-	5,439	12,333
硬冬白小麦	-	-	-	-	30	41
合计	363	0	0	0	10,217	13,918

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、PTA 5 吨 / 手。

三、郑州商品交易所 2 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)
CF703	13600	13650	13350	13450	4,430	-144	13410	1,198	0.81
CF704	13770	13805	13540	13560	4,758	-182	13575	550	0.378
CF705	13935	13985	13675	13740	36,806	-4392	13755	41,074	28.474
CF707	14150	14240	13995	14050	13,238	6146	14060	14,070	9.939
CF709	14565	14640	14380	14410	950	278	14420	1,038	0.75
CF711	14605	14680	14350	14410	580	132	14425	560	0.407
CF801	14600	14780	14550	14580	386	314	14590	722	0.529
小计	-	-	-	-	61,148	-	-	59,212	41.287
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
GN711	0	0	0	0	0	0		0	0
GN801	0	0	0	0	0	0		0	0
小计	-	-	-	-	0	-	-	0	0

SR703	3680	3730	3603	3660	6,304	-9244	3680	19,218	7.048
SR705	3726	3838	3651	3831	99,556	6752	3807	1,368,740	511.688
SR707	3791	3917	3737	3914	31,896	5812	3897	167,238	64.184
SR709	3852	3988	3809	3981	13,078	978	3967	57,608	22.503
SR711	3821	3936	3746	3936	2,438	-580	3914	5,832	2.264
SR801	3800	3925	3755	3903	1,026	456	3897	3,356	1.295
小计	-	-	-	-	154, 298	-	-	1, 621, 992	608. 981
TA702	7986	8880	7986	8524	0	-726	8524	584	0.248
TA703	8144	8300	7900	8042	890	-398	8136	2,334	0.942
TA704	8186	8396	8060	8294	2,580	1602	8280	5,766	2.38
TA705	8280	8550	8156	8422	19,798	286	8396	398,800	166.116
TA706	8324	8588	8206	8474	1,008	-1258	8448	5,940	2.483
TA707	8356	8582	8238	8464	504	-412	8464	1,244	0.523
TA708	8608	8608	8608	8608	2	2	8608	2	0.001
TA709	8468	8656	8468	8600	2	2	8600	8	0.003
TA710	8390	8450	8390	8450	0	0	8420	4	0.002
小计	-	-	-	-	24, 784	-	-	414, 682	172. 697
WS703	1683	1697	1643	1650	278	-1110	1650	1,466	0.246
WS705	1683	1706	1668	1684	27,694	-10438	1681	49,550	8.357
WS707	1681	1740	1670	1733	5,858	-514	1723	6,312	1.077
WS709	1804	1911	1792	1908	122,078	8426	1891	2,302,898	424.761
WS711	1829	1913	1816	1910	38,668	18122	1897	154,568	28.787
WS801	1864	1943	1853	1942	14,260	13806	1923	22,760	4.308
小计	-	-	-	-	208, 836	-	-	2, 537, 554	467. 535
WT703	1450	1541	1426	1426	14	-12	1426	158	0.023
WT705	1566	1588	1541	1548	186	18	1545	170	0.027
WT707	1578	1619	1535	1580	48	0	1570	220	0.035
WT709	1616	1624	1597	1612	264	18	1613	364	0.059
WT711	1633	1652	1601	1620	562	50	1622	478	0.078
WT801	1699	1699	1620	1650	14	10	1650	864	0.143
小计	-	-	-	-	1, 088	-	-	2, 254	0. 365
总计	-	-	-	-	450, 154	-	-	4, 635, 694	1, 290. 865

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 2 月分品种每日结算价统计表

棉花 CF									
交易日期	703	704	705	707	709	711	801	成交量	持仓量
2007-2-1	13610	13770	13940	14155	14565	14630	14665	3,334	59,292
2007-2-2	13615	13755	13925	14155	14525	14630	14710	2,536	59,446
2007-2-5	13620	13775	13945	14180	14600	14630	14700	3,036	59,560

2007-2-6	13625	13785	13950	14190	14580	14645	14735	3,454	59,986
2007-2-7	13605	13765	13900	14155	14515	14630	14700	3,302	59,376
2007-2-8	13590	13755	13865	14135	14470	14570	14665	2,794	59,102
2007-2-9	13575	13735	13865	14130	14435	14480	14605	2,732	59,312
2007-2-12	13560	13730	13870	14130	14435	14420	14600	2,156	58,944
2007-2-13	13520	13685	13825	14085	14395	14395	14585	3,528	59,274
2007-2-14	13535	13685	13830	14105	14415	14450	14610	2,900	59,116
2007-2-15	13485	13630	13800	14070	14400	14450	14585	3,226	59,086
2007-2-16	13540	13700	13865	14140	14455	14500	14635	4,614	59,392
2007-2-26	13535	13715	13905	14195	14515	14540	14665	6,856	59,534
2007-2-27	13500	13680	13865	14155	14495	14500	14630	4,976	60,494
2007-2-28	13410	13575	13755	14060	14420	14425	14590	9,768	61,148

强筋小麦 WS

交易日期	703	705	707	709	711	801	成交量	持仓量
2007-2-1	1684	1686	1684	1815	1837	1869	212,638	179,196
2007-2-2	1679	1677	1676	1801	1824	1859	205,246	170,810
2007-2-5	1679	1685	1685	1814	1836	1870	132,136	164,306
2007-2-6	1679	1680	1682	1807	1830	1864	128,120	161,118
2007-2-7	1686	1691	1703	1827	1844	1880	272,392	166,576
2007-2-8	1660	1691	1703	1835	1848	1884	180,080	164,870
2007-2-9	1665	1695	1708	1846	1862	1898	145,712	162,514
2007-2-12	1650	1684	1701	1836	1854	1887	154,350	162,030
2007-2-13	1660	1678	1695	1827	1845	1880	108,070	153,724
2007-2-14	1650	1678	1699	1834	1850	1884	57,828	148,642
2007-2-15	1650	1672	1696	1828	1844	1875	59,424	141,326
2007-2-16	1670	1678	1702	1839	1856	1883	54,960	137,642
2007-2-26	1670	1695	1725	1875	1891	1918	195,000	156,954
2007-2-27	1664	1696	1730	1893	1902	1934	254,728	178,220
2007-2-28	1650	1681	1723	1891	1897	1923	376,870	208,836

硬冬白小麦 WT

交易日期	703	705	707	709	711	801	成交量	持仓量
2007-2-1	1466	1574	1576	1613	1632	1651	76	990
2007-2-2	1466	1575	1566	1611	1626	1663	70	996
2007-2-5	1488	1569	1566	1613	1628	1663	72	1,004
2007-2-6	1488	1568	1583	1611	1628	1663	34	1,004
2007-2-7	1480	1568	1591	1614	1639	1662	428	1,014
2007-2-8	1496	1575	1597	1610	1635	1658	54	1,028
2007-2-9	1513	1576	1599	1614	1631	1657	98	1,048
2007-2-12	1490	1570	1599	1614	1623	1656	104	1,130
2007-2-13	1490	1559	1595	1611	1640	1656	108	1,052
2007-2-14	1490	1564	1573	1607	1623	1655	720	1,040
2007-2-15	1469	1570	1588	1605	1612	1661	120	1,040

2007-2-16	1469	1571	1598	1606	1615	1642	24	1,044
2007-2-26	1469	1567	1598	1613	1633	1642	96	1,042
2007-2-27	1471	1556	1577	1617	1640	1650	124	1,054
2007-2-28	1426	1545	1570	1613	1622	1650	126	1,088

白糖 SR

交易日期	703	705	707	709	711	801	成交量	持仓量
2007-2-1	3678	3728	3808	3872	3820	3779	235,682	160,222
2007-2-2	3657	3712	3795	3866	3806	3784	151,532	155,762
2007-2-5	3683	3735	3825	3890	3831	3787	139,542	152,868
2007-2-6	3682	3731	3828	3902	3849	3807	127,458	152,778
2007-2-7	3652	3682	3770	3848	3793	3774	111,690	140,902
2007-2-8	3642	3664	3753	3825	3781	3766	63,434	139,534
2007-2-9	3648	3684	3776	3845	3807	3781	48,522	138,616
2007-2-12	3646	3688	3778	3851	3812	3792	43,592	139,056
2007-2-13	3632	3677	3768	3841	3796	3775	29,312	137,522
2007-2-14	3617	3694	3791	3864	3820	3802	59,344	138,960
2007-2-15	3637	3731	3831	3900	3862	3838	88,790	136,472
2007-2-16	3657	3792	3886	3968	3920	3898	105,914	137,134
2007-2-26	3671	3783	3872	3949	3907	3893	92,068	140,324
2007-2-27	3672	3791	3887	3961	3917	3894	99,224	142,712
2007-2-28	3680	3807	3897	3967	3914	3897	225,888	154,298

精对苯二甲酸 TA

交易日期	702	703	704	705	706	707	708	709	710	成交量	持仓量
2007-2-1	8008	8120	8192	8296	8332	8356				25,954	25,774
2007-2-2	8164	8040	8178	8284	8280	8282				41,346	24,462
2007-2-5	8290	8026	8098	8200	8234	8270				34,598	24,506
2007-2-6	8000	8022	8104	8220	8274	8310				24,230	24,472
2007-2-7	8298	8064	8156	8272	8350	8380				28,676	23,464
2007-2-8	8298	8024	8152	8260	8348	8390				29,506	24,336
2007-2-9	8214	8100	8218	8338	8426	8468				44,752	25,464
2007-2-12	8540	7982	8230	8332	8420	8468				27,544	21,434
2007-2-13	8880	8120	8256	8354	8424	8464				24,732	21,974
2007-2-14	8524	8202	8308	8426	8486	8528				46,394	27,322
2007-2-15		8218	8304	8420	8478	8522	8500	8500	8500	20,824	25,642
2007-2-16		8138	8302	8428	8482	8518	8608	8500	8500	8,600	24,114
2007-2-26		8146	8332	8460	8500	8520	8608	8562	8420	28,838	26,532
2007-2-27		8174	8298	8418	8470	8518	8608	8562	8420	15,058	25,906
2007-2-28		8136	8280	8396	8448	8464	8608	8600	8420	13,630	24,784

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 TA708、TA709、TA710 合约基准价的通告 (2007) 第 3 号

现将 2007 年 2 月 15 日上市交易的 PTA 合约基准价通告如下:

TA708 8500 元/吨

TA709 8500 元/吨

TA710 8500 元/吨

特此通告, 请及时转告广大投资者。

二〇〇七年二月十四日

六、市场综述

本月小麦期货价格振荡上扬。主力合约 WS709 当月波动区间为 1792 - 1911 元, 最大波幅 119 元/吨, 月底报收 1908 元, 较上月末涨 105 元/吨, 涨幅 5.8%。

本月棉花期货价格振荡趋弱。主力合约 CF705 当月波动区间为 13675 - 13985 元, 最大波幅 310 元/吨。月底报收 13740 元, 较上月末跌 175 元/吨, 跌幅 1.3%。

本月白糖期货价格先抑后扬, 反弹冲高。主力合约 SR705 当月波动区间为 3651 - 3838 元, 最大波幅 187 元/吨, 月底报收 3831 元/吨, 较上月末涨 99 元/吨, 涨幅 2.7%。

本月 PTA 期货价格小幅扬升。主力合约 TA705 当月波动区间为 8156 - 8550 元, 最大波幅 394 元/吨, 月底报收 8422 元/吨, 较上月末涨 150 元/吨, 涨幅 1.8%。

本月郑州期货市场总成交量 4,635,694 手, 其中成交强麦期货合约 2,537,554 手、硬麦期货合约 2,254 手、棉花期货合约 59,212 手、白糖期货合约 1,621,992 手、PTA 期货合约 414,682 手。截至 2 月 28 日, 总持仓量达 450,154 手, 其中强麦持仓量 208,836 手、硬麦 1,088 手, 棉花 61,148 手, 白糖 154,298 手, 精对苯二甲酸 (PTA) 24,784 手。

七、动态摘要

2 月 2 日和 9 日, 郑商所为提高员工整体业务素质 and 促进内部学习的积极性, 就 Excel 办公应用专题举行了内部员工培训。

2 月 12 日, 郑商所召开由全体员工参加的 2006 年度工作总结暨表彰大会, 传达全国证券期货监管工作会议精神, 表彰优秀员工, 回顾总结 2006 年的工作, 安排部署 2007 年的重点工作。

2 月 14 日，郑商所向会员单位发布风险提示函，提请各会员单位注意做好 2007 年春节休市期间的风险防范工作。

2 月 15 日，郑商所举办员工春节联欢活动。



 郑州商品交易所

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.czce.com.cn>