

# 2014年Q4主导产品

传承 CME、CBOT、NYMEX 和 COMEX 四大交易所的传统，芝商所市场汇集来自全球各地的商业性生产商及制造商、机构投资者、对冲基金、自营交易公司及积极的个人交易者，为这些市场参与者提供最为广泛且任何一家交易所上市的基准期货和期权合约。它创建了一个深度且多元化的流动资金池，让您管理风险的同时，利用每一个机会并在每笔交易上获得最大可能的回报。

在下表中您将看到基于利率、股指、能源、外汇、农产品及金属的领先期货与期权合约。

## 利率

合约	期货代码*	期权代码*	合约规模	最低变动价位	期货				期权			
					日均成交量 (ADV)	电子交易%	ADV 名义金额 (百万美元)	未平仓量	ADV	电子交易%	ADV 名义金额 (百万美元)	未平仓量
欧洲美元 <sup>1</sup>	GE	GE	1,000,000美元	临近价格: 0.0025 = 6.25美元 其它: 0.005 = 12.50美元	2,882,044	98%	2,882,044美元	10,361,647	915,470	14%	914,974美元	23,948,297
10 年期国债 <sup>2</sup>	ZN	OZN	100,000美元	1/32之1/2 = 15.625美元	1,411,528	95%	141,153美元	2,608,757	400,963	66%	40,096美元	3,204,136
5 年期国债 <sup>2</sup>	ZF	OZF	100,000美元	1/32之1/4 = 7.8125美元	777,708	94%	77,771美元	1,834,632	108,797	58%	10,880美元	692,697
美国国债 <sup>2</sup>	ZB	OZB	100,000美元	1/32 = 31.25美元	389,677	96%	38,968美元	879,287	69,231	75%	6,923美元	382,609
2 年期国债 <sup>2</sup>	ZT	OZT	200,000美元	1/32之1/4 = 15.625美元	320,299	90%	64,060美元	1,243,158	13,774	56%	2,755美元	243,938
超级国债 <sup>2</sup>	UB	OUN	100,000美元	1/32 = 31.25美元	101,976	92%	10,198美元	524,052	724	38%	72美元	5,850
30 天联邦基金 <sup>2</sup>	ZQ	OZQ	5,000,000美元	临近价格: 0.0025 = 10.4175美元 其它: 0.0050 = 20,835美元	45,240	99%	226,198美元	748,614	75	2%	373美元	21,389
可交割掉期期货 <sup>2</sup>	T1U, F1U, N1U, B1U	-	100,000美元	2年 = 1/32之1/4 5年、10年、30年 = 1/32之1/2	7,325	86%	732美元	92,834	-	-	-	-

1. 这些合约按照 CME 规则和条例挂牌交易并受其约束。

2. 这些合约按照 CBOT 规则和条例挂牌交易并受其约束。

## 股指

合约	期货代码*	期权代码*	合约规模	最低变动价位	期货				期权 <sup>3</sup>			
					日均成交量 (ADV)	电子交易%	ADV 名义金额 (百万美元)	未平仓量	ADV	电子交易%	ADV 名义金额 (百万美元)	未平仓量
E-迷你标普500指数 <sup>1</sup>	ES	ES	50美元	0.25 = 12.50美元 日历价差 0.05 = 2.50美元	1,834,034	100%	181,607美元	2,779,007	573,901	100%	56,937美元	2,948,001
E-迷你纳斯达克100指数 <sup>1</sup>	NQ	NQ	20美元	0.25 = 5.00美元 0.05 = 1.00美元	333,578	100%	27,215美元	334,666	10,911	100%	890美元	64,065
E-迷你道琼斯指数 (5美元) <sup>2</sup>	YM	OYMC/OYMP	5美元	1.00 = 5.00美元	171,458	100%	14,613美元	116,054	820	100%	0美元	18,944
日经 225 指数 (日元) <sup>1</sup>	NIY	-	500日元	5.00 = 2500日元	64,505	99%	4,687美元	103,321	-	-	-	-
日经 225 指数 (美元) <sup>1</sup>	NKD	KN/JN	5美元	5.00 = 25.00美元	23,681	100%	1,975美元	62,143	-	-	-	-
E-迷你S&P中型股400指数 <sup>1</sup>	EMD	EMD	100美元	0.10 = 10.00美元 日历价差 0.05 = 5.00美元	23,205	100%	3,214美元	80,443	1	100%	0美元	8
标普500指数 <sup>1</sup>	SP	CS/PS	250美元	0.10 = 25.00美元 日历价差 0.05 = 12.50美元	14,261	7%	7,118美元	127,777	56,975	0%	28,250美元	349,307

1. 这些合约按照 CME 规则和条例挂牌交易并受其约束。

\*所显示代码为 CME Globex 产品代码。

2. 这些合约按照 CBOT 规则和条例挂牌交易并受其约束。

3. 所显示期权仅限于美式期权。

能源												
合约	期货代码*	期权代码*	合约规模	最低变动价位	期货				期权			
					日均成交量 (ADV)	电子交易%	ADV 名义金额 (百万美元)	未平仓量	ADV	电子交易%	ADV 名义金额 (百万美元)	未平仓量
原油 (WTI)	CL	LO	1,000美国桶	每桶0.01美元	660,347	96%	48,627美元	1,468,497	199,164	55%	13,191美元	3,975,370
天然气	NG	ON, LN	10,000 百万英国热量单位	每百万英国热量单位 0.001美元 (0.1美分)	322,441	96%	12,505美元	939,402	93,714	12%	3,493美元	4,031,385
RBOB 汽油	RB	OB	42,000美国加仑	每加仑0.0001 美元	135,396	91%	11,480美元	331,633	1,600	20%	136美元	34,190
纽约港超低硫柴油	HO	OH	42,000美国加仑	每加仑0.0001 美元	151,864	91%	14,731美元	345,635	4,405	6%	426美元	186,700
原油 (布伦特)	BZ	BE	1,000美国桶	每桶0.01美元	96,813	99%	7,718美元	140,181	2,629	0%	205美元	344,582

外汇												
合约	期货代码*	期权代码*	合约规模	最低变动价位	期货				期权			
					日均成交量 (ADV)	电子交易%	ADV 名义金额 (百万美元)	未平仓量	ADV	电子交易%	ADV 名义金额 (百万美元)	未平仓量
欧元/美元	6E	6E	125,000欧元	每欧元变动价位0.0001美元 (12.50美元/合约)	249,419	98%	39,009美元	388,528	43,346	96%	6,766美元	355,352
日元/美元	6J	6J	12,500,000日元	每日元变动价位0.000001美元 (12.50美元/合约)	205,867	98%	22,566美元	224,087	15,750	91%	1,721美元	192,401
澳币/美元	6A	6A	100,000澳币	每澳币变动价位0.0001美元 (10.00美元/合约)	105,056	99%	8,989美元	119,285	6,561	97%	560美元	70,112
英镑/美元	6B	6B	62,500英镑	每英镑变动价位0.0001美元 (6.25美元/合约)	93,938	99%	9,297美元	143,197	10,501	96%	1,039美元	103,390
加币/美元	6C	6C	100,000加币	每加币变动价位 0.0001美元 (10.00美元/合约)	64,914	99%	5,712美元	96,257	5,401	99%	475美元	53,488
墨比索/美元	6M	6M	500,000墨比索	每墨比索变动价位0.000025美 元 (12.50美元/合约)	47,352	95%	1,699美元	129,234	94	86%	3美元	2,694
瑞郎/美元	6S	6S	125,000瑞郎	每瑞郎变动价位0.0001美元 (12.50美元/合约)	47,125	99%	6,115美元	59,056	1,547	98%	200美元	24,342

这些合约按照 CME 规则和条例挂牌交易并受其约束。

农产品												
合约	期货代码*	期权代码*	合约规模	最低变动价位	期货				期权			
					日均成交量 (ADV)	电子交易%	ADV 名义金额 (百万美元)	未平仓量	ADV	电子交易%	ADV 名义金额 (百万美元)	未平仓量
玉米 <sup>2</sup>	ZC	OZC	5,000 蒲式耳	每蒲式耳0.0025美元	272,941	93%	5,194美元	1,236,694	80,271	61%	1,508美元	1,044,139
大豆 <sup>2</sup>	ZS	OZS	5,000 蒲式耳	每蒲式耳0.0025美元	239,547	94%	12,077美元	599,377	81,765	59%	4,096美元	702,513
豆油 <sup>2</sup>	ZW	OZW	5,000 蒲式耳	每蒲式耳0.0025美元	104,773	96%	2,058美元	355,341	6,626	29%	130美元	90,495
豆粕 <sup>2</sup>	ZL	OZL	60,000 磅	每磅0.0001美元	96,055	95%	3,374美元	341,247	13,555	51%	474美元	194,283
芝加哥软红冬麦 <sup>2</sup>	ZM	OZM	100 短吨	每短吨0.1美元	95,989	98%	2,688美元	371,349	24,197	52%	689美元	313,948
活牛 <sup>1</sup>	LE	LE	40,000 磅	每磅0.00025美元	47,401	90%	3,119美元	266,498	14,860	71%	977美元	269,866
瘦肉猪 <sup>1</sup>	HE	HE	40,000 磅	每磅0.00025美元	30,900	91%	1,113美元	214,654	8,515	86%	310美元	180,569
堪萨斯硬红冬小麦 <sup>3</sup>	KE	OKE	5,000 蒲式耳	每蒲式耳0.0025美元	22,783	96%	697美元	131,572	1,795	37%	55美元	46,776

1. 这些合约按照 CME 规则和条例挂牌交易并受其约束。

\* 所显示代码为 CME Globex 产品代码。

2. 这些合约按照 CBOT 规则和条例挂牌交易并受其约束。

金属												
合约	期货代码*	期权代码*	合约规模	最低变动价位	期货				期权			
					日均成交量 (ADV)	电子交易%	ADV 名义金额 (百万美元)	未平仓量	ADV	电子交易%	ADV 名义金额 (百万美元)	未平仓量
黄金 <sup>1</sup>	GC	OG	100 金衡盎司	每金衡盎司0.10美元	182,627	95%	21,892美元	371,646	37,870	64%	4,551美元	1,400,302
铜 <sup>1</sup>	HG	HX	25,000 磅	每磅0.0005美元	57,128	97%	4,259美元	160,435	61	88%	5美元	1,526
白银 <sup>1</sup>	SI	SO	5,000 金衡盎司	每金衡盎司0.005美元 (直接交易)； 每金衡盎司0.001美元 (价差/结算)	53,337	96%	4,387美元	151,215	7,884	75%	649美元	183,570
铂金 <sup>2</sup>	PL	PO	50 金衡盎司	每金衡盎司0.10美元	13,181	95%	810美元	64,119	296	10%	18美元	8,971
钯金 <sup>2</sup>	PA	PAO	100 金衡盎司	每金衡盎司0.05美元	5,469	93%	429美元	33,168	280	7%	22美元	4,059

1. 这些合约按照 COMEX 规则和条例挂牌交易并受其约束。 2. 这些合约按照 NYMEX 规则和条例挂牌交易并受其约束。

## 推出的产品

产品名称	资产类别	产品代码	推出日期
伊利诺伊盆地煤炭期货交易	EN	ILB	10月20日
USD 马来西亚棕榈油互换	AG	OPS (CME ClearPort)	11月3日
纽约商品交易所 (nymex) 原油中曲线选项	EN	LM1-LM5	11月24日
钢铁铁矿石期货	MT	TIC	12月8日

## 全球合作伙伴数据

作为一家全球性公司，芝商所深知与其它主要的交易所及公司合作的重要性，我们相信这将为我们所有的客户创造巨大的价值。请参看下表中我们6家全球合作伙伴交易所的主要产品抽样，所有这些产品均可通过 CME Globex 进行交易。

巴西交易所 (BM&FBOVESPA)			
产品名称	代码	日均成交量 (2014年7月及8月)	截止2014年8月的未平仓量
DI	BR:DI1	1,067,892	11,867,340
迷你巴西 Ibovespa 指数	BR:DOL	391,503	24,508
美元	BR:WIN	356,846	850,006
巴西 Ibovespa 指数	BR:IND	110,355	383,524
迷你美元	BR:WDL	42,436	4,663
马来西亚交易所 (BMD)			
毛棕榈油期货	FCPO	44,647	212,741
FTSE 吉隆坡指数期货	FKLI	8,939	20,798
迪拜商品交易所 (DME)			
DME 阿曼原油期货	OQD	6,895	21,912
韩国证券期货交易所 (KRX)			
KOSPI 200 指数期货	KS	10,952	—
墨西哥衍生品交易所 (MexDer)			
美元-墨比索期货	M:DA	99,996	1,159,108
28 日银行间利率期货	M:TE28	23,248	2,616,121
IPC 指数期货	M:IPC	2,686	43,562
2024 年 12 月债券	M:DC24	2,295	35,423
2031 年 5 月债券	M:MY31	1,260	23,969
迷你 IPC 指数期货	M:MIP	825	1,601

欲了解这些产品，请访问

[cme.com/leadingproducts](http://cme.com/leadingproducts)

芝商所总部

20 South Wacker Drive  
Chicago, Illinois 60606  
[cme.com](http://cme.com)

芝商所区域办事处

芝加哥	纽约	伦敦
+1 312 930 1000	+1 212 299 2000	+44 20 3379 3700
新加坡	卡尔加里	香港
+65 6593 5555	+1 403 444 6876	+852 2582 2202
休斯顿	圣保罗	首尔
+1 713 658 9292	+55 11 2565 5999	+82 2 6336 6722
东京	华盛顿	
+81 3242 6232	+1 202 638 3838	

期货与掉期交易具有亏损的风险，因此并不适于所有投资者。期货和掉期均为杠杆投资，由于只需要具备某合约市值一定百分比的资金就可进行交易，所以损失可能会超出最初为某一期货和掉期头寸而存入的金额。因此，交易者只能使用其有能力承受损失风险但又不会影响其生活方式的资金来进行该等投资。由于无法保证这些资金在每笔交易中都能获利，所以该等资金中仅有一部分可投入某笔交易。

本资料中所含信息与任何资料不得被视作在任何司法管辖区买入或卖出金融工具、提供金融建议、创建交易平台、促进或吸收存款、或提供任何其它金融产品或任何类型金融服务的要约或邀请。本资料中所含信息仅供参考，并非为了提供建议，且不应被解释为建议。本资料并未考虑到您的目标、财务状况或需要。您根据本资料采取行动前，应当获得适当的专业建议。

本资料中所含信息均如实提供，不含任何类型的担保，无论是明示或暗示。芝商所对任何错误或遗漏概不承担责任。

CME Group 和“芝商所”是CME Group Inc.的注册商标。地球标志、E-mini、E-micro、Globex、CME和Chicago Mercantile Exchange是Chicago Mercantile Exchange Inc. ( “CME” ) 的注册商标。CBOT是Board of Trade of the City of Chicago, Inc. ( “CBOT” ) 的注册商标。ClearPort和NYMEX是New York Mercantile Exchange, Inc. ( “NYMEX” ) 的注册商标。此商标未经所有者书面批准，不得修改、复制、储存在可检索系统里、传递、复印、发布或以其它方式使用。

CME、CBOT及NYMEX均分别在新加坡注册为认可的可市场运营商以及在香港特区注册为认可的自动化交易服务提供者。除上述内容之外，本资料所含信息并不构成提供任何境外金融工具市场的直接渠道，或《金融工具与交易法》（1948年第25条法律，修订案）界定之境外金融工具市场交易的清算服务。CME欧洲交易所股份有限公司注册及受权的服务并不含盖以任何形式在亚洲任何管辖区内（包括香港、新加坡及日本）提供金融服务。芝商所实体在中华人民共和国或台湾概无注册、获得许可或声称提供任何种类的金融服务。本资料在韩国及澳大利亚境内根据《金融投资服务与资本市场法》第9章第5款及相关规则、《2001年企业法》（澳洲联邦）及相关规则的规定，将发布受众仅限于“职业投资者”；其发行应受到相应限制。

2014年CME Group®版权所有，保留所有权利。