

# 2015年Q1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	合约大小	最低变动价位	期货				期权			
					日均交易量 (ADV)	电子交易%	ADV名义金额 (百万美元)	未平仓量	日均交易量 (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 其他: 0.005=12.50美元	2,801,947	98%	2,801,947美元	10,798,008	1,007,254	14%	1,006,322美元	26,479,069
10年期国债 <sup>2</sup>	ZN	OZN	100,000美元	1/32的1/2 = 15.625美元	1,409,428	96%	140,943美元	2,767,663	428,181	61%	42,818美元	1,822,342
5年期国债 <sup>2</sup>	ZF	OZF	100,000美元	1/32的1/4 = 7.8125美元	814,522	94%	81,452美元	1,982,117	93,503	59%	9,350美元	618,407
2年期国债 <sup>2</sup>	ZT	OZT	200,000美元	1/32的1/4 = 15.625美元	368,712	91%	73,742美元	1,353,836	12,329	60%	2,466美元	105,776
美国国债 <sup>2</sup>	ZB	OZB	100,000美元	1/32 = 31.25美元	356,571	94%	35,657美元	426,004	74,210	69%	7,421美元	292,862
超级国债 <sup>2</sup>	UB	OUN	100,000美元	1/32 = 31.25美元	125,721	90%	12,572美元	571,434	681	55%	68美元	3,477
30天联邦基金 <sup>2</sup>	ZQ	QZQ	5,000,000美元	临近价格: 0.0025=10.4175美元 其他: 0.0050=20.835美元	61,766	99%	308,832美元	777,368	1,983	7%	9,913美元	96,980
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	6,696	87%	670美元	89,440	-	-	-	-

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	合约大小	最低变动价位	期货				期权 <sup>3</sup>			
					日均交易量 (ADV)	电子交易%	ADV名义金额 (百万美元)	未平仓量	日均交易量 (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 价差 0.05 = 2.50美元	1,687,774	100%	173,176美元	2,663,980	484,473	100%	49,740美元	3,056,975
E-迷你纳斯达克100指数 <sup>1</sup>	NQ	NQ	20美元	0.25 = 5.00 美元 价差 0.05 = 1.00 美元	277,255	100%	23,724美元	319,836	5,957	100%	510美元	53,042
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	157,647	100%	13,930美元	97,342	706	100%	0美元	18,962
日经225指数 (日元) <sup>1</sup>	NIY	-	500日元	5.00 = 2500日元	51,790	100%	3,938美元	98,700	-	-	-	-
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 价差 0.05 = 5.00美元	22,081	100%	3,265美元	87,474	-	-	-	-
日经225指数(美元) <sup>1</sup>	NKD	KN/JN	5美元	5.00 = 25.00美元	17,570	100%	1,596美元	59,404	-	-	-	-
标普500指数 <sup>1</sup>	SP	CS/PS	250美元	0.10 = 25.00美元 价差 0.05 = 12.50美元	13,638	7%	7,016美元	102,704	43,304	0%	22,226美元	412,382

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。

3. 所示期权仅限于美式期权。

\*所示行情代码为CME Globex产品代码。



能源												
合约	期货代码	期权代码	合约大小	最低变动价位	期货				期权			
					日均交易量(ADV)	电子交易%	ADV名义金额(百万美元)	未平仓量	日均交易量(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	896,081	96%	45,742美元	1,740,134	210,661	54%	9,685美元	4,956,241
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)	342,404	96%	9,862美元	998,123	81,861	12%	2,268美元	3,327,017
RBOB汽油	RB	OB	42,000 美国加仑	每加仑0.0001美元	161,552	92%	11,388美元	389,410	1,253	24%	87美元	32,026
纽约港超低硫柴油	HO	OH	42,000 美国加仑	每加仑0.0001美元	159,355	91%	11,904美元	364,522	3,892	10%	297美元	182,609
原油(布伦特)	BZ	BE	1,000 美国桶	每桶0.01美元	131,756	99%	7,603美元	155,456	4,247	0%	154美元	398,289

这些合约按照NYMEX规则和条例挂牌交易并受其约束。

外汇												
合约	期货代码	期权代码	合约大小	最低变动价位	期货				期权			
					日均交易量(ADV)	电子交易%	ADV名义金额(百万美元)	未平仓量	日均交易量(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)	277,449	99%	38,751美元	459,746	58,197	97%	8,163美元	439,391
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)	160,591	99%	16,868美元	177,478	10,288	95%	1,080美元	123,797
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)	107,492	99%	10,144美元	182,514	13,278	96%	1,253美元	174,869
澳元/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)	101,865	99%	7,963美元	138,260	6,562	97%	512美元	82,309
加元/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)	74,628	99%	5,992美元	110,447	5,886	98%	474美元	67,324
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)	45,253	97%	1,502美元	157,688	85	75%	3美元	1,998
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)	25,146	98%	3,301美元	34,149	1,267	95%	168美元	21,460

1. 这些合约按照CME规则与条例挂牌交易并受其约束。

农产品												
合约	期货代码	期权代码	合约大小	最低变动价位	期货				期权			
					日均交易量 (ADV)	电子交易%	ADV名义金额 ( 百万美元 )	未平仓量	日均交易量 ( 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	301,493	94%	5,913美元	1,349,885	84,026	57%	1,655美元	1,329,229
大豆 <sup>2</sup>	ZS	OZS	5,000蒲式耳	每蒲式耳0.0025美元	204,080	94%	10,119美元	763,912	72,741	61%	3,612美元	821,529
芝加哥软红冬麦 <sup>2</sup>	ZW	OZW	5,000蒲式耳	每蒲式耳0.0025美元	111,359	98%	2,907美元	431,772	28,074	51%	736美元	381,144
豆油 <sup>2</sup>	ZL	OZL	60,000磅	每磅0.0001美元	98,652	97%	1,878美元	383,769	7,542	31%	143美元	115,247
豆粕 <sup>2</sup>	ZM	OZM	100短吨	每短吨10美分	82,776	95%	2,739美元	346,338	11,333	61%	374美元	188,564
活牛 <sup>1</sup>	LE	LE	40,000磅	每磅0.00025美元	55,155	93%	3,342美元	278,224	16,018	72%	972美元	298,565
瘦肉猪 <sup>1</sup>	HE	HE	40,000磅	每磅0.00025美元	42,429	93%	1,251美元	216,988	12,889	80%	372美元	267,376
堪萨斯硬红冬小麦 <sup>2</sup>	KE	OKE	5,000蒲式耳	每蒲式耳0.0025美元	27,851	96%	780美元	154,679	2,624	36%	74美元	51,594

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。

\*所示行情代码为CME Globex产品代码。

金属												
合约	期货代码	期权代码	合约大小	最低变动价位	期货				期权			
					日均交易量 (ADV)	电子交易%	ADV名义金额 ( 百万美元 )	未平仓量	日均交易量 ( 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	188,035	94%	22,975美元	387,585	31,615	62%	3,864美元	1,430,364
铜 <sup>1</sup>	HG	HX	25,000磅	每磅0.0005美元	69,125	97%	4,547美元	170,125	140	58%	9美元	2,505
白银 <sup>1</sup>	SI	SO	100 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 )	50,021	96%	4,191美元	170,105	5,881	73%	498美元	173,468
铂金 <sup>2</sup>	PL	PO	50金衡盎司	每金衡盎司0.10美元	13,963	95%	826美元	68,848	278	7%	17美元	6,540
钯金 <sup>2</sup>	PA	PAO	100金衡盎司	每金衡盎司0.05美元	5,696	94%	447美元	31,497	238	8%	18美元	8,018

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
欧洲天然气	EN	ON	1月19日
公斤黄金	MT	GCK	1月26日
国债滚动	IR	ZBH5:ZBMF	2月17日
短期新作豆粕期权	AG	OMD	2月23日
短期新作豆油期权	AG	OLD	2月23日
纽约Buckeye燃油期货	EN	BUC	3月23日
循环储存原油期货	EN	LPS	3月30日
可可期货	AG	CCC	3月30日
NYMEX欧洲和韩国苯期货	EN	BEA, BSA	3月30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。

### 巴西商品期货交易所(BM&FBOVESPA)

产品名称	代码	ADV ( 2015年1月和2月 )	未平仓量 ( 2015年2月 )
DI	BR:DI1	1,026,167	15,357,177
迷你美元	BR:WDL	348,206	65,741
美元	BR:DOL	328,446	1,333,075
IBOV	BR:IND	65,481	477,328
迷你Ibov	BR:WIN	54,066	14,829

### 马来西亚交易所(BMD)

毛棕榈油期货	FCPO	53,231	190,872
FTSE 吉隆坡指数期货	FKLI	11,076	32,552

### 迪拜商品交易所 (DME)

DME阿曼原油期货	OQD	7,258	19,153
-----------	-----	-------	--------

### 韩国证券期货交易所 (KRX)

韩国KOSPI200指数	KS	11,230	-
--------------	----	--------	---

### 墨西哥衍生品交易所(MexDer)

28天同业拆借IR期货	M:TE28	40,541	2,533,652
美元-比索期货	M:DA	34,413	642,564
IPC 指数期货	M:IPC	3,100	30,260
2024年12月债券	M:DC24	2,874	45,616
迷你IPC	M:MIP	1,860	5,725
2031年5月债券	M:MY31	390	24,269
30年期债券期货	M:M30	251	1,800

### 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)

#### 芝商所全球办事处

芝加哥 +1 312 930 1000	东京 +81 3242 6232	圣保罗 +55 11 2565 5999	香港 +852 2582 2200
新加坡 +65 6593 5555	纽约 +1 212 299 2000	华盛顿 +1 202 638 3838	首尔 +82 2 6336 6722
休斯顿 +1 713 658 9292	卡尔加里 +1 403 444 6876	伦敦 +44 20 3379 3700	

#### 亚洲地区免责声明

期货与掉期交易具有亏损的风险，因此并不适合所有投资者。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，所以损失可能会超过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。本资料也可能会包含或涉及到未经芝商所或其管理人员、员工或代理设计、验证或测试的信息。芝商所不对该等信息承担任何责任，也不认可其信息的准确性和完整性。芝商所对该等信息或向您提供的超级链接并不担保不会侵犯到第三方权利。如果本资料含有外部网站的链接，芝商所并不对任何第三方或其提供的服务及/或产品予以认可、推荐、同意、保证或推介。

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、储存在检索系统里、传递、复印、发布或以其它方式使用。

Dow Jones是道琼斯公司的注册商标。所有其它注册商标为其各自所有者的产权。所有关于规则与细节之事项均遵循正式的CME、CBOT和NYMEX规则，并可被其替代。在所有涉及合约规格的情况下，均应参考当前的规则。

CME、CBOT及NYMEX均分别在新加坡注册为认可的金融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条第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。

2015年CME Group®和芝商所版权所有，保留所有权利。

PM210SC/0/0415