

## 外汇产品

# 外汇合约规格

芝商所是全球最大的受管制外汇交易市场，且是世界两大外汇平台之一，每天的流动资金超过 1,000 亿美元。我们提供受管制的集中市场，为所有参与者提供平等享有 49 种期货的权利，包括 2 种 E-迷你和 6 种 E-micro 合约，以及基于 20 种世界主要货币和新兴市场货币的 32 种期权

合约。如果您目前交易现货 / 现金外汇，则是时候考虑外汇期货了。外汇期货市场相比现金外汇市场的关键优势包括市场定价公开且透明化、具成本效益且有无可比拟的安全性。有关详细信息，请访问：[www.cmegroup.com/fx](http://www.cmegroup.com/fx)。

## 顶级外汇期货产品

产品	合约单位	清算	最小变动价位	合约代码	合约月份	最后交易日 (收盘)	交易时间 所有显示的时间均是指中部时间
澳元 / 美元	100,000 澳元	实物交割	0.0001 美元 / 澳元增幅 (10.00 美元 / 合约)	GLOBEX 6A PIT AD AON Code LA	3 月份季度周期 (3 月、6 月、 9 月、12 月) 的六个月份	紧接合约月第三个星期三前的 第二个交易日 (通常是星期一) (中部时间上午 9:16)	PIT 星期一至星期五，上午 7:20 – 下午 2:00 GLOBEX 星期日下午 5:00 – 次日下午 4:00。 星期一至星期五，下午 5:00 – 次日下午 4:00， 但星期五收盘时间为下午 4:00，星期日重新开盘 时间为下午 5:00。
加元 / 美元	100,000 加元	实物交割	0.0001 美元 / 加元增幅 (10.00 美元 / 合约)	GLOBEX 6C PIT CD AON Code LK	3 月份季度周期 (3 月、6 月、 9 月、12 月) 的六个月份	紧接合约月第三个星期三前的 交易日 (通常是星期二) (中部时间上午 9:16)	PIT 星期一至星期五，上午 7:20 – 下午 2:00 GLOBEX 星期日下午 5:00 – 次日下午 4:00。 星期一至星期五，下午 5:00 – 次日下午 4:00， 但星期五收盘时间为下午 4:00，星期日重新开盘 时间为下午 5:00。
瑞郎 / 美元	125,000 瑞郎	实物交割	0.0001 美元 / 瑞郎增幅 (12.50 美元 / 合约)	GLOBEX 6S PIT SF AON Code LS	3 月份季度周期 (3 月、6 月、 9 月、12 月) 的六个月份	紧接合约月第三个星期三前的 第二个交易日 (通常是星期一) (中部时间上午 9:16)	PIT 星期一至星期五，上午 7:20 – 下午 2:00 GLOBEX 星期日下午 5:00 – 次日下午 4:00。 星期一至星期五，下午 5:00 – 次日下午 4:00， 但星期五收盘时间为下午 4:00，星期日重新开盘 时间为下午 5:00。
欧元 / 美元	125,000 欧元	实物交割	0.0001 美元 / 欧元增幅 (12.50 美元 / 合约)	GLOBEX 6E PIT EC AON Code UG	3 月份季度周期 (3 月、6 月、 9 月、12 月) 的六个月份	紧接合约月第三个星期三前的 第二个交易日 (通常是星期一) (中部时间上午 9:16)	PIT 星期一至星期五，上午 7:20 – 下午 2:00 GLOBEX 星期日下午 5:00 – 次日下午 4:00。 星期一至星期五，下午 5:00 – 次日下午 4:00， 但星期五收盘时间为下午 4:00，星期日重新开盘 时间为下午 5:00。
英镑 / 美元	62,500 英镑	实物交割	0.0001 美元 / 英镑增幅 (6.25 美元 / 合约)	GLOBEX 6B PIT BP AON Code LP	3 月份季度周期 (3 月、6 月、 9 月、12 月) 的六个月份	紧接合约月第三个星期三前的 第二个交易日 (通常是星期一) (中部时间上午 9:16)	PIT 星期一至星期五，上午 7:20 – 下午 2:00 GLOBEX 星期日下午 5:00 – 次日下午 4:00。 星期一至星期五，下午 5:00 – 次日下午 4:00， 但星期五收盘时间为下午 4:00，星期日重新开盘 时间为下午 5:00。
日元 / 美元	12,500,000 日元	实物交割	0.000001 美 元 / 日元增幅 (12.50 美元 / 合约)	GLOBEX 6J PIT JY AON Code LJ	3 月份季度周期 (3 月、6 月、 9 月、12 月) 的六个月份	紧接合约月第三个星期三前的 第二个交易日 (通常是星期一) (中部时间上午 9:16)	PIT 星期一至星期五，上午 7:20 – 下午 2:00 GLOBEX 星期日下午 5:00 – 次日下午 4:00。 星期一至星期五，下午 5:00 – 次日下午 4:00， 但星期五收盘时间为下午 4:00，星期日重新开盘 时间为下午 5:00。

## E-Micro 外汇期货

产品	合约单位	结算	最小变动价位	合约价值	合约代码	合约月份	最后交易日 (收盘)	交易时间 (所有显示的时间均是指中部时间)
澳元 / 美元	10,000 澳元	现金结算	0.0001 美元 / 澳元合约 (=1.00 美元)	如果美元 / 澳元 = 0.6600, 那么合约价值 = 6,600 美元 (= 10,000 澳元 x 0.6600 美元 / 澳元)	GLOBEX M6A	3月份季度周期 (3月、6月、9月、12月) 的两个月份	紧接合约月第三个星期三前的第二个交易日 (通常是星期一) (中部时间上午 9:16)	GLOBEX 星期日下午 5:00 – 次日下午 4:00。星期一至星期五, 下午 5:00 – 次日下午 4:00, 但星期五收盘时间为下午 4:00, 星期日重新开盘时间为下午 5:00。
欧元 / 美元	12,500 欧元	现金结算	0.0001 美元 / 欧元合约 (=1.25 美元)	如果美元 / 欧元 = 1.3000, 那么合约价值 = 16,250 美元 (= 12,500 欧元 x 1.3000 美元 / 欧元)	GLOBEX M6E	3月份季度周期 (3月、6月、9月、12月) 的两个月份	紧接合约月第三个星期三前的第二个交易日 (通常是星期一) (中部时间上午 9:16)	GLOBEX 星期日下午 5:00 – 次日下午 4:00。星期一至星期五, 下午 5:00 – 次日下午 4:00, 但星期五收盘时间为下午 4:00, 星期日重新开盘时间为下午 5:00。
英镑 / 美元	6,250 英镑	现金结算	0.0001 美元 / 英镑合约 (=0.625 美元)	如果美元 / 英镑为 1.5000, 那么合约价值 = 9,375 美元 (= 6,250 英镑 x 1.5000 美元 / 英镑)	GLOBEX M6B	3月份季度周期 (3月、6月、9月、12月) 的两个月份	紧接合约月第三个星期三前的第二个交易日 (通常是星期一) (中部时间上午 9:16)	GLOBEX 星期日下午 5:00 – 次日下午 4:00。星期一至星期五, 下午 5:00 – 次日下午 4:00, 但星期五收盘时间为下午 4:00, 星期日重新开盘时间为下午 5:00。
美元 / 加元	10,000 美元	现金结算	0.0001 加元 / 美元合约 (=1.00 加元)	如果加元 / 美元 = 1.2500, 那么合约价值 = 12,500 加元 (= 10,000 美元 x 1.2500 加元 / 美元)	GLOBEX M6C	3月份季度周期 (3月、6月、9月、12月) 的两个月份	紧接合约月第三个星期三前的交易日 (通常是星期二) (中部时间上午 9:16)	GLOBEX 星期日下午 5:00 – 次日下午 4:00。星期一至星期五, 下午 5:00 – 次日下午 4:00, 但星期五收盘时间为下午 4:00, 星期日重新开盘时间为下午 5:00。
美元 / 瑞郎	10,000 美元	现金结算	0.0001 瑞郎 / 美元合约 (=1.00 瑞郎)	如果瑞郎 / 美元 = 1.2000, 那么合约价值 = 12,000 瑞郎 (= 10,000 美元 x 1.2000 瑞郎 / 美元)	GLOBEX M6S	3月份季度周期 (3月、6月、9月、12月) 的两个月份	紧接合约月第三个星期三前的第二个交易日 (通常是星期一) (中部时间上午 9:16)	GLOBEX 星期日下午 5:00 – 次日下午 4:00。星期一至星期五, 下午 5:00 – 次日下午 4:00, 但星期五收盘时间为下午 4:00, 星期日重新开盘时间为下午 5:00。
美元 / 日元	10,000 美元	现金结算	0.01 日元 / 美元合约 (=100 日元)	如果日元 / 美元为 93.00, 那么合约价值 = 930,000 日元 (= 10,000 美元 x 93.00 日元 / 美元)	GLOBEX M6J	3月份季度周期 (3月、6月、9月、12月) 的两个月份	紧接合约月第三个星期三前的第二个交易日 (通常是星期一) (中部时间上午 9:16)	GLOBEX 星期日下午 5:00 – 次日下午 4:00。星期一至星期五, 下午 5:00 – 次日下午 4:00, 但星期五收盘时间为下午 4:00, 星期日重新开盘时间为下午 5:00。

### 芝商所总部

20 South Wacker Drive  
Chicago, Illinois 60606  
cme.com

info@cme.com  
800 331 3332  
312 930 1000

### 芝商所区域办事处

**纽约**  
212 299 2000

**休斯敦**  
713 658 9292

**华盛顿特区**  
202 638 3838

**伦敦**  
+44 20 7796 7100

**新加坡**  
+65 6593 5555

**东京**  
+81 3 5403 4829

**圣保罗**  
+55 11 2565 5999

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部分投入某笔交易。

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。

本资料中所有关于规则与规格之事项均遵循正式的CME、CBOT和NYMEX规则，并可被其替代。所有涉及合约规格的事宜均应参照当前的规则。

本资料中所含信息如实提供，不含任何类型的担保，无论是明示或暗示。

芝商所、CME Group和CME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。

CME、CBOT及NYMEX均分别在新加坡注册为认可的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涵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。