

2014 年 9 月

能源月刊

全球能源市场交易概况

- 交易要点
- 期货
- 期权
- 历史波动率
- CFTC 持仓报告

能源交易要点

2014 年 9 月

- 2014 年 9 月轻质低硫原油期货的日均成交量为 610,667 手合约，去年同期为 556,958 手合约，同比增长 9.64%。
 - 2014 年 9 月轻质低硫原油期货的日均成交量为 121,100 手合约，去年同期为 108,063 手合约，同比增长 12.06%。
 - 2014 年 9 月天然气期货的日均成交量为 267,797 手合约，去年同期为 287,062 手合约，同比降低 6.71%。
 - 2014 年 9 月取暖油期货的日均成交量为 136,950 手合约，去年同期为 119,225 手合约，同比增长 14.87%。
 - 2014 年 9 月无铅汽油期货的日均成交量为 151,109 手合约，去年同期为 125,828 手合约，同比增长 20.09%。
 - 2014 年 9 月布兰特原油金融期货的日均成交量为 85,343 手合约，去年同期为 44,275 手合约，同比增长 92.96%。
-

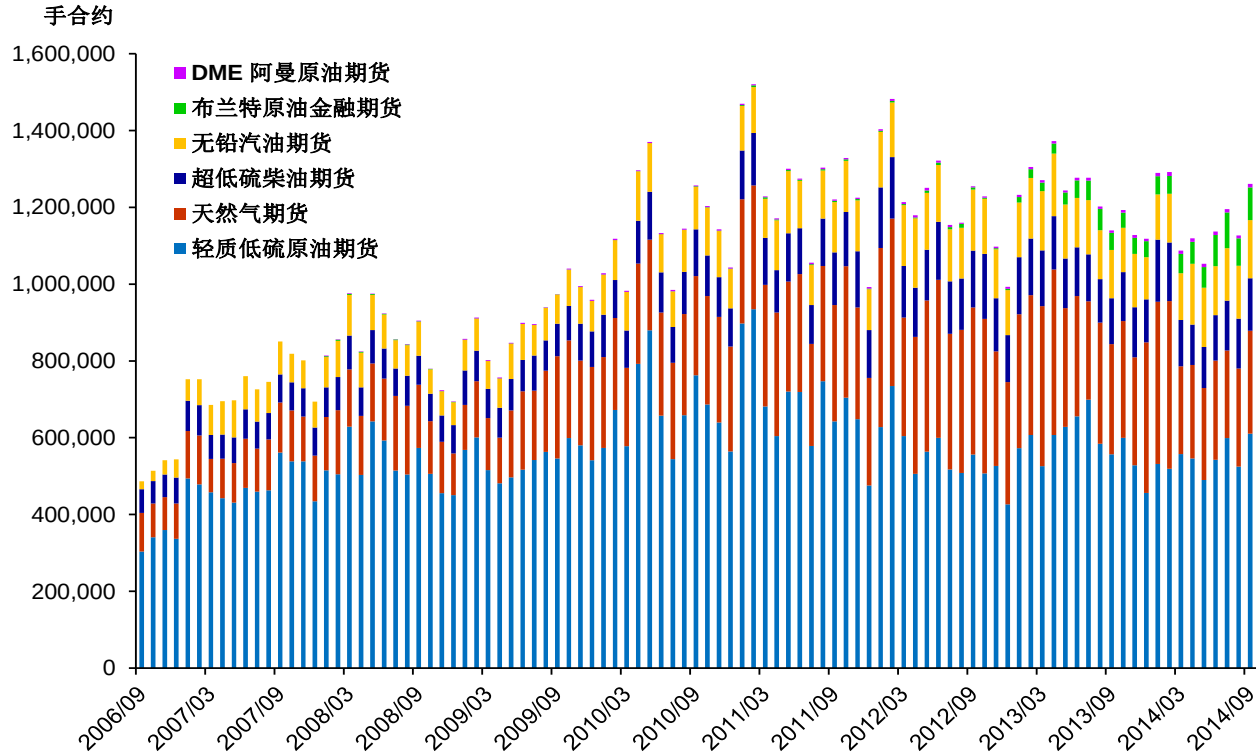


日均成交量与持仓量 - 2014年9月

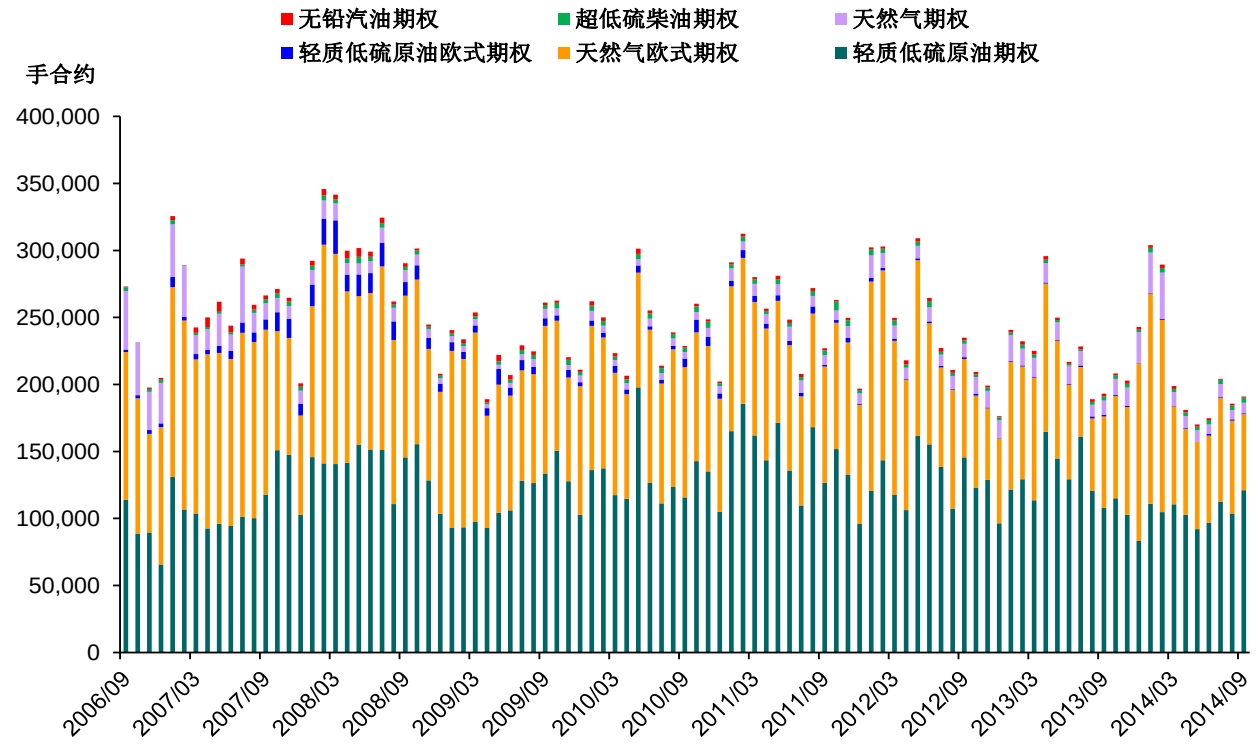
		日均成交量			持仓量		美制公制现货月价格转换		
		合约代码 电子交易/ 公开竞价	合约	名义额 百万美元	合约	名义额 百万美元	现货月 美元月底结算价	天然气= 美元/立方米 其它=美元/吨	20 天 历史波动率
轻质低硫原油									
	期货	CL	610,667	\$55,668	1,485,856	\$135,451	91.16	\$668.48	20.99%
	期权	LO	121,100		2,346,064				
	欧式期权	LC	676		123,492				
天然气									
	期货	NG	267,797	\$11,036	937,715	\$38,643	4.121	\$0.15	29.29%
	期权	ON	7,889		114,887				
	欧式期权	LN	56,636		3,826,325				
超低硫柴油									
	期货	HO	136,950	\$15,245	376,640	\$41,928	265.05	\$830.36	11.12%
	期权	OH	3,786		80,554				
无铅汽油									
	期货	RB	151,109	\$15,469	285,698	\$29,246	243.73	\$873.27	18.44%
	期权	OB	916		17,941				
DME 阿曼原油									
	期货	OQ	8,919		15,449				
布兰特原油金融									
	期货	BZ	85,434		125,805		94.67		14.13%
PJM 现金结算电力									
	期货和掉期期货	JM+L1*	298		34,259				
	期权	JO+PML+6O*	596		90,454				

* L1 按 JM 合约单位调整；PML 和 6O 按 JO 合约单位调整。

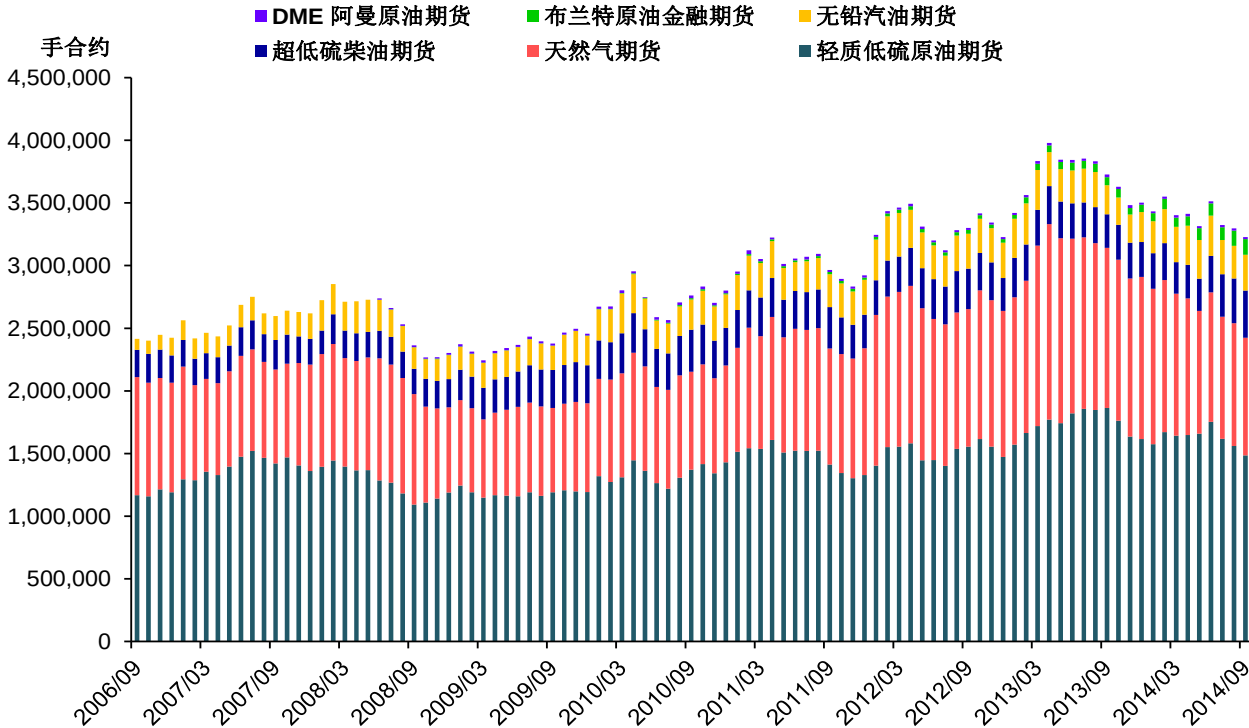
期货 - 日均成交量



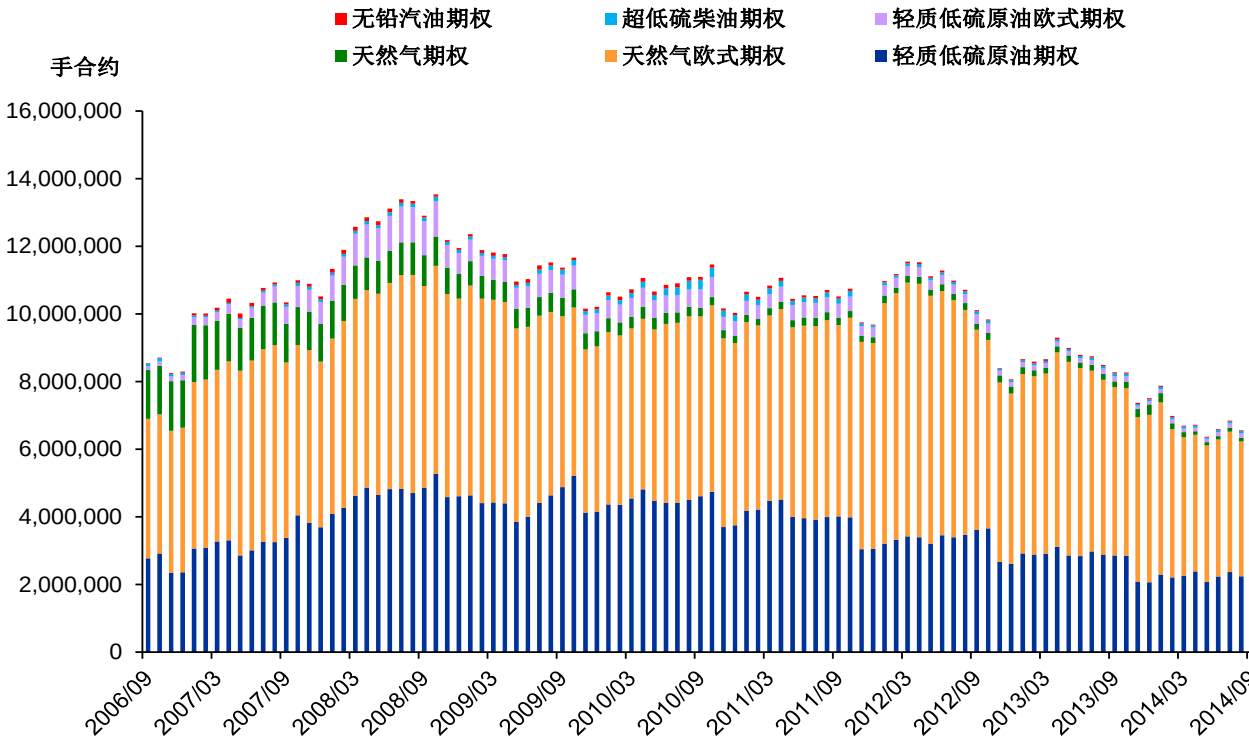
期权 - 日均成交量



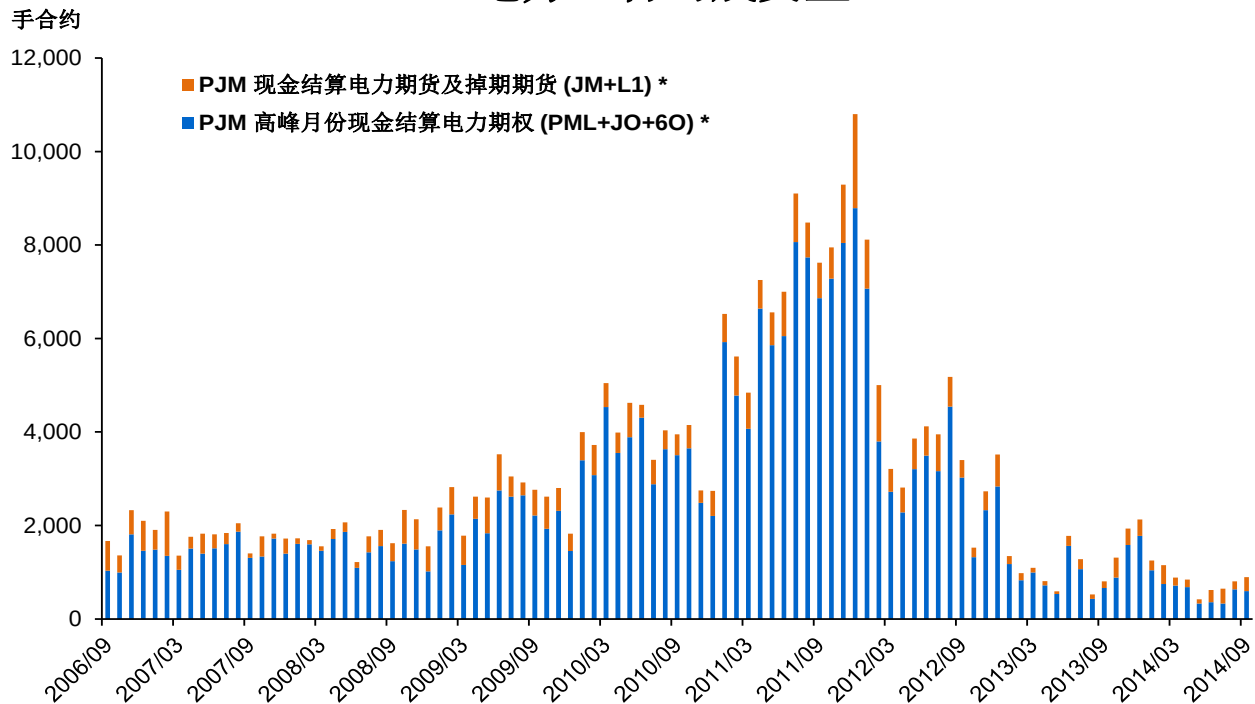
期货 - 月末持仓量



期权 - 月末持仓量

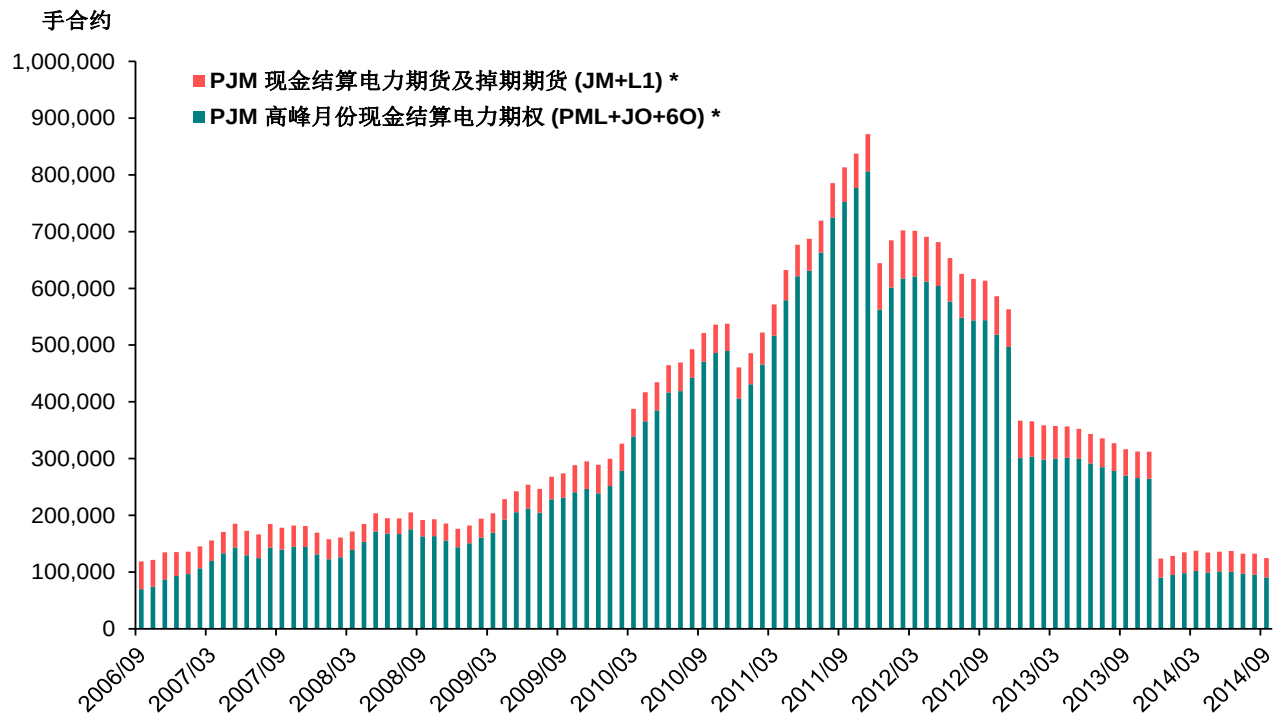


电力 - 日均成交量



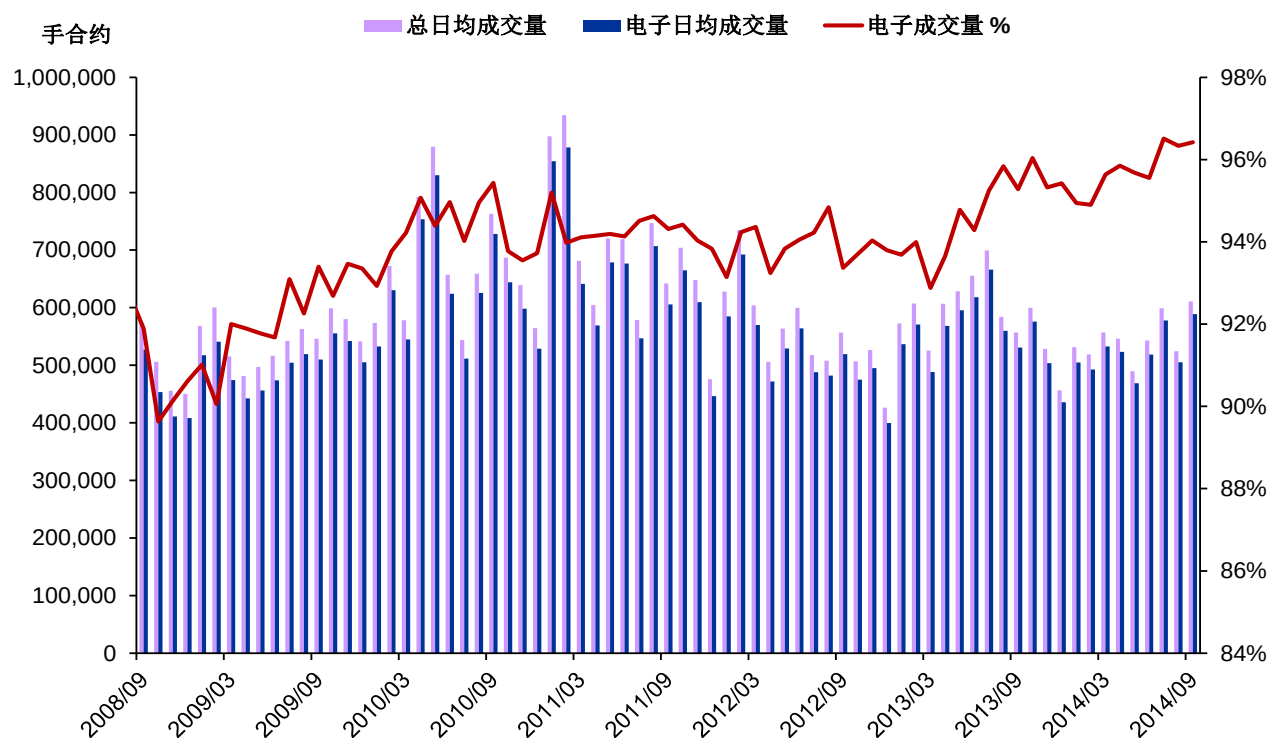
* L1 按 JM 合约单位调整；PML 和 6O 按 JO 合约单位调整。

电力 - 月末持仓量

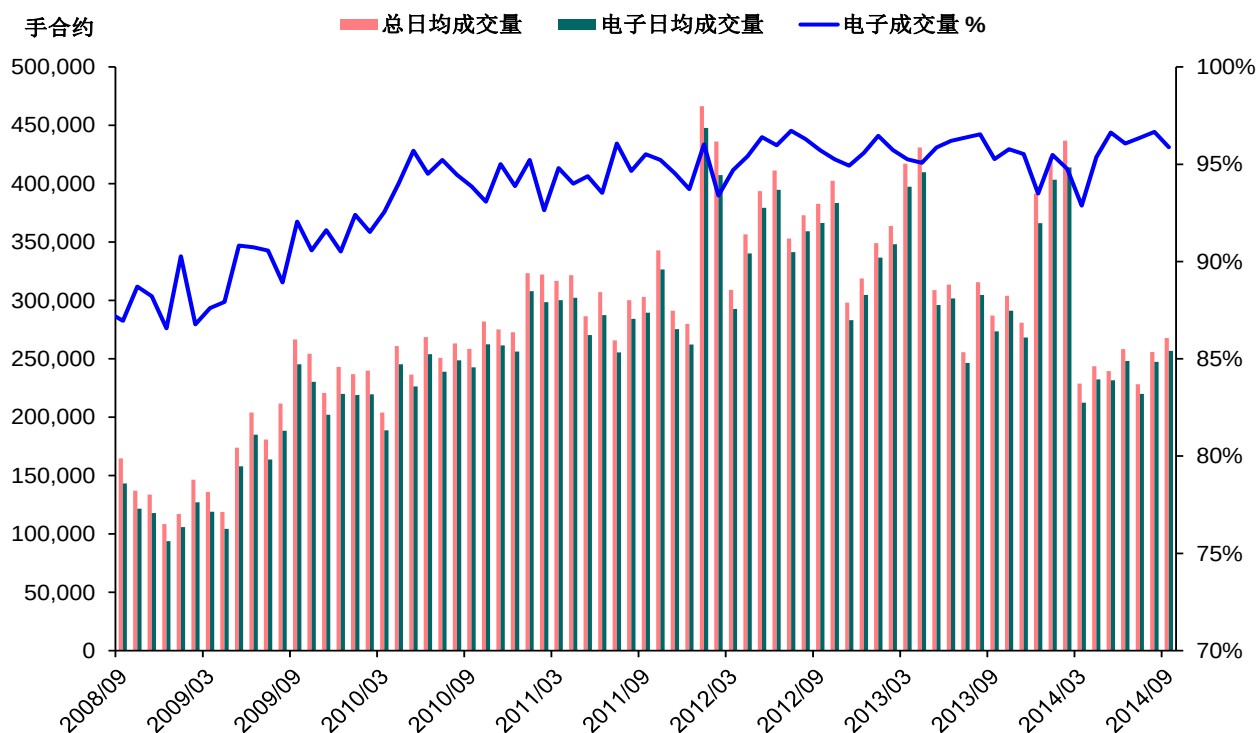


* L1 按 JM 合约单位调整；PML 和 6O 按 JO 合约单位调整。

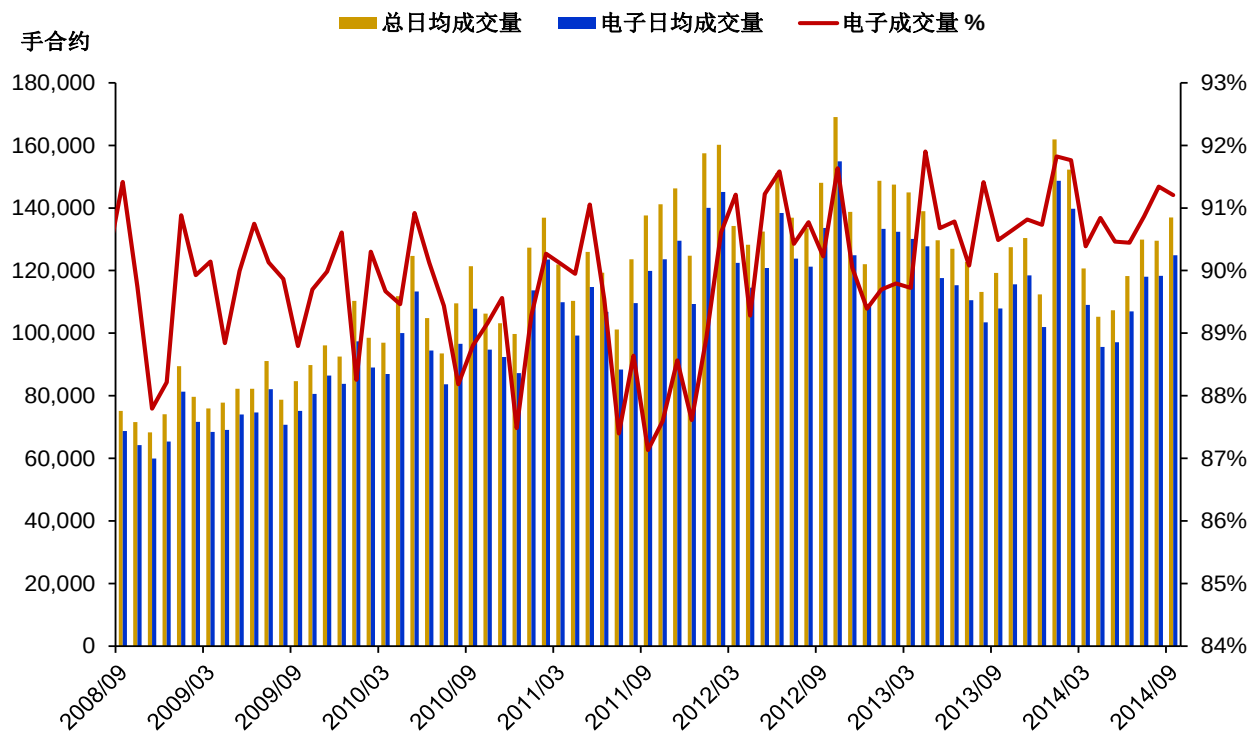
轻质低硫原油期货 - 电子日均成交量



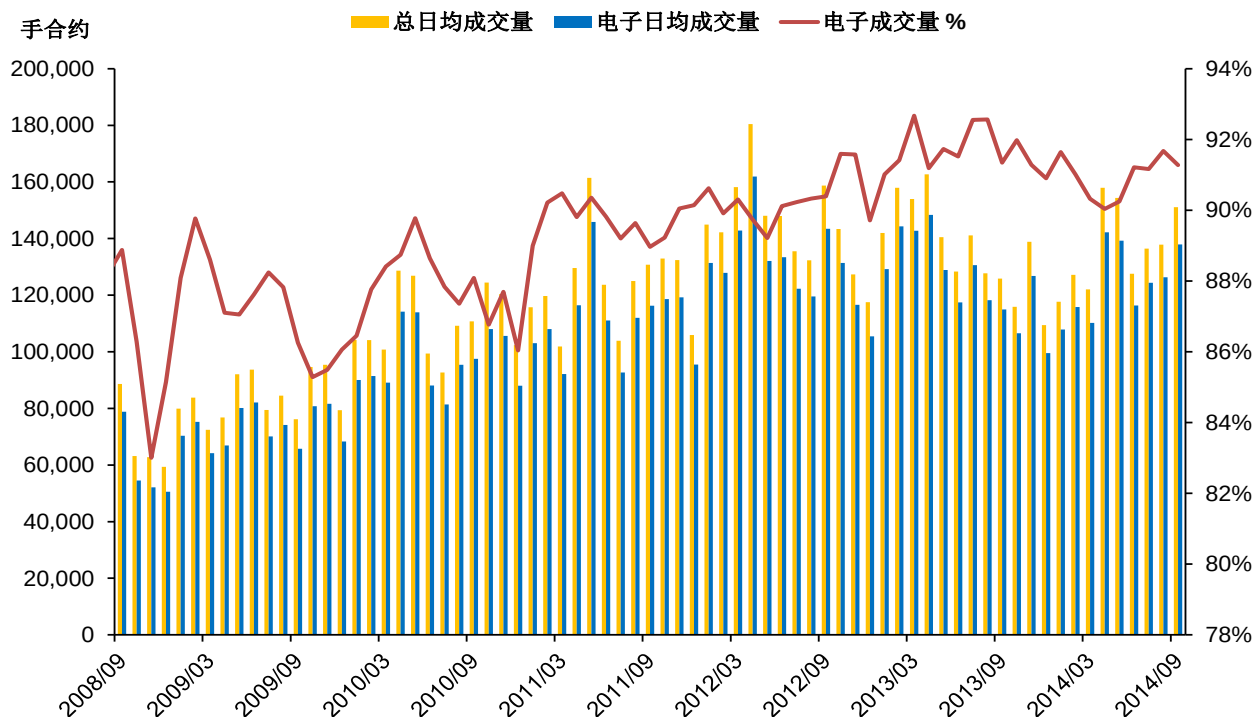
天然气期货 - 电子日均成交量



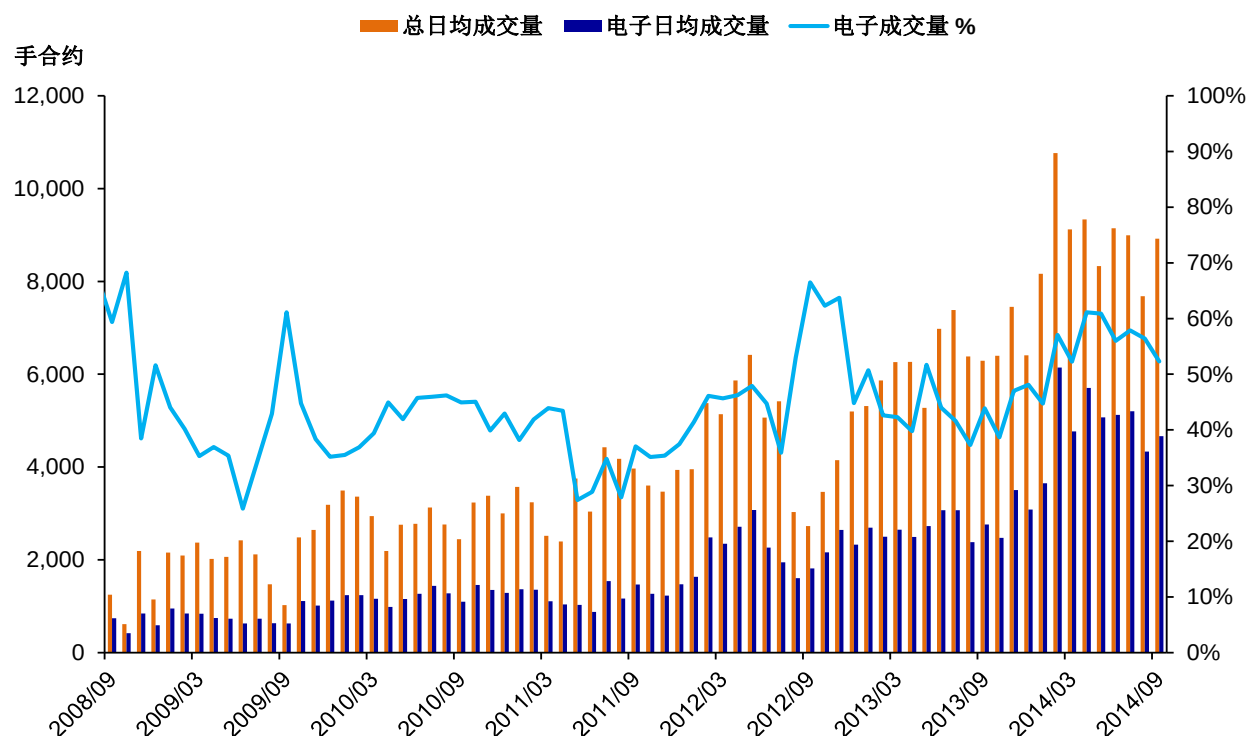
超低硫柴油期货 - 电子日均成交量



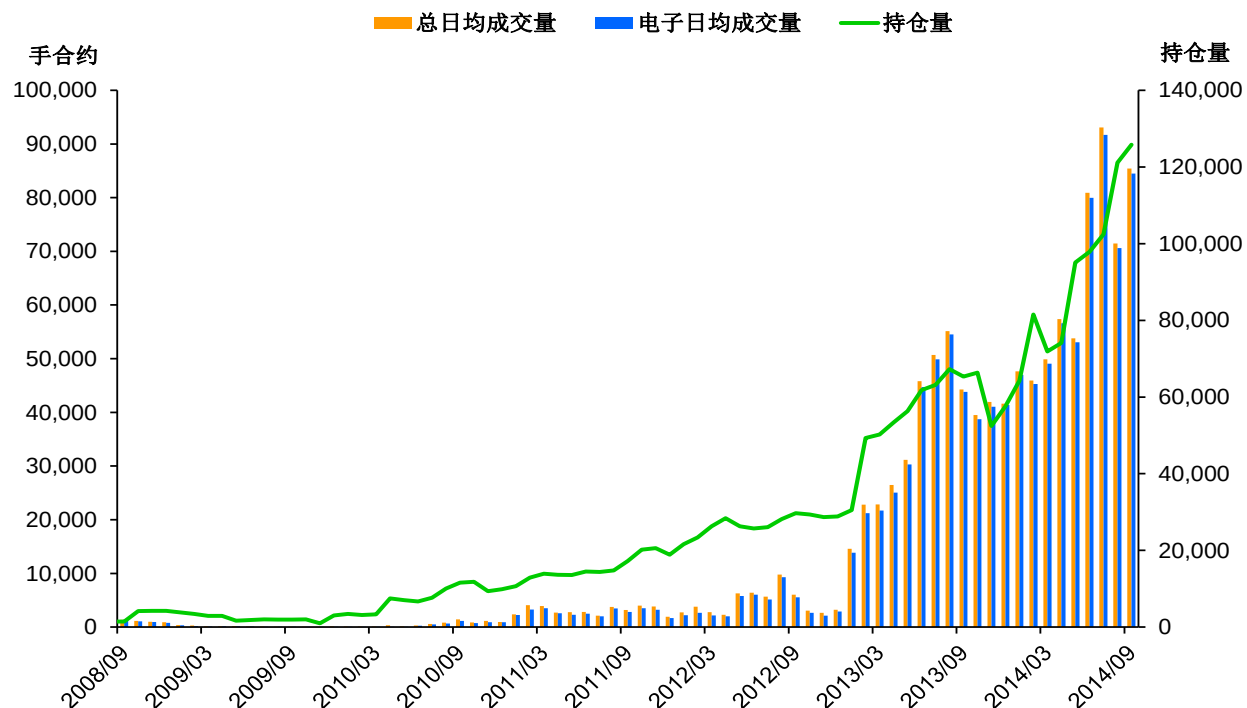
无铅汽油期货 - 电子日均成交量



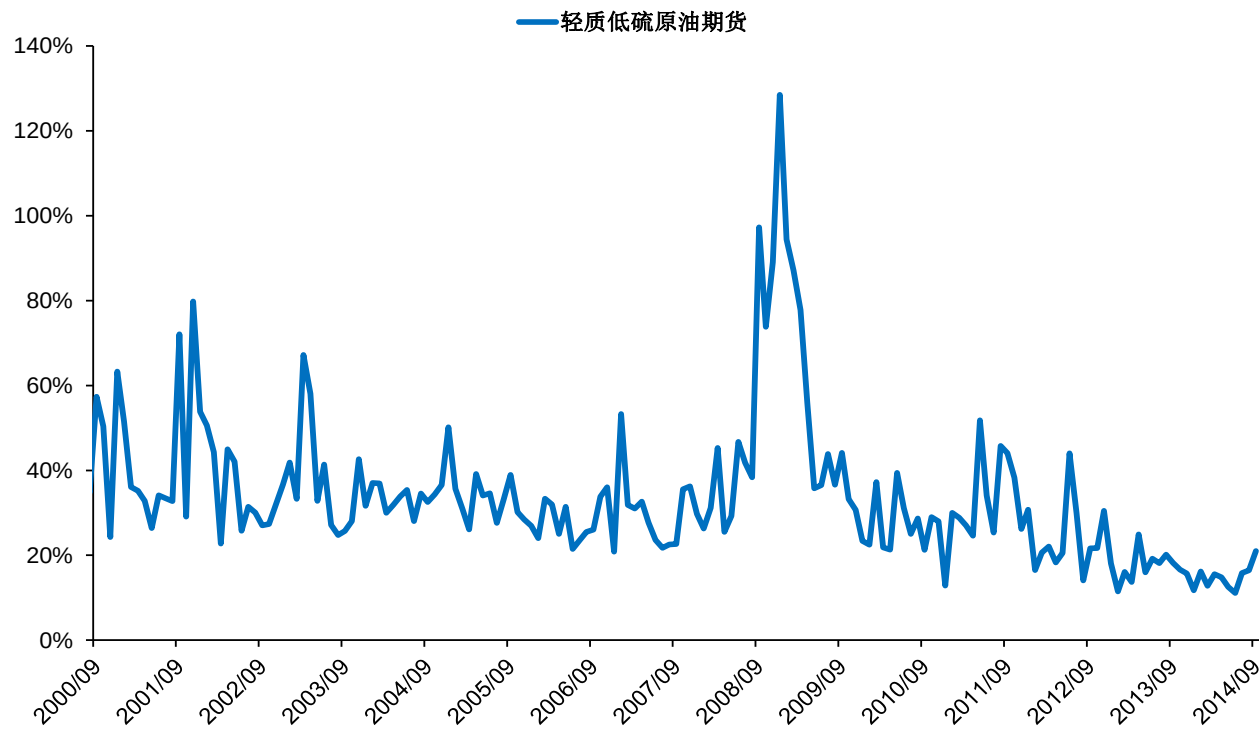
DME 阿曼原油期货 - 电子日均成交量



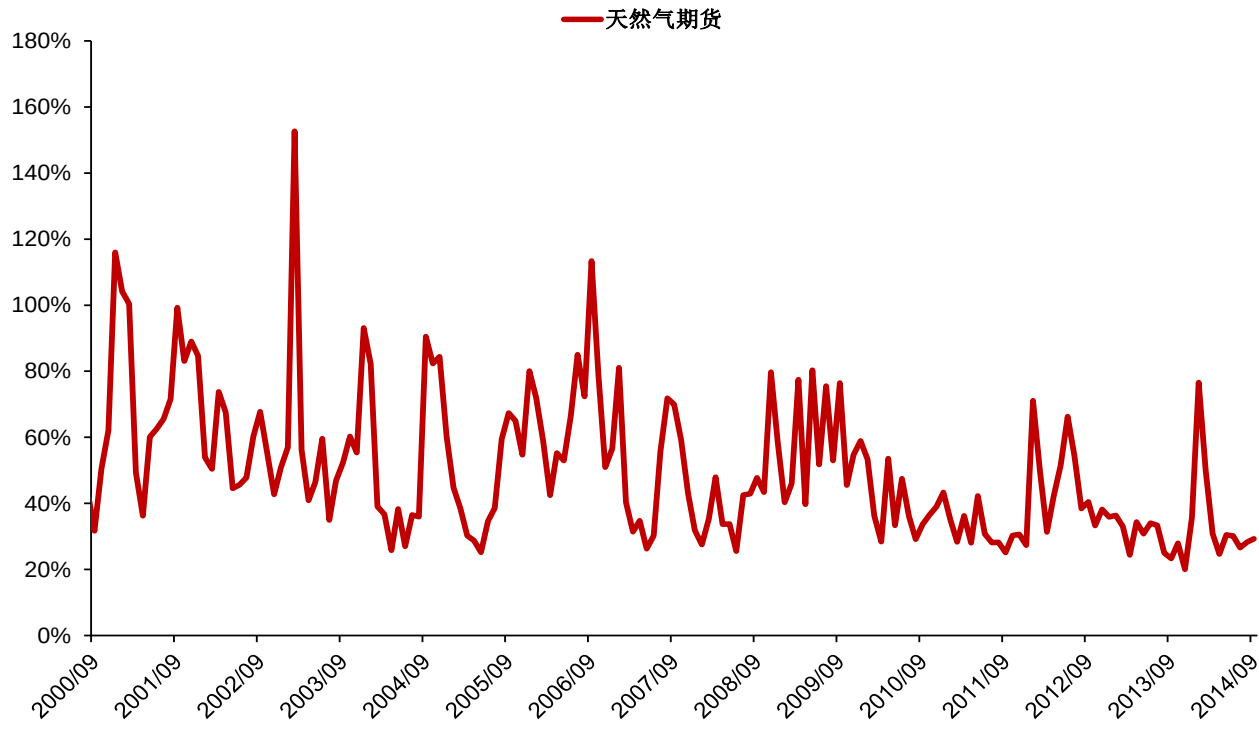
布兰特原油期货 - 日均成交量和持仓量



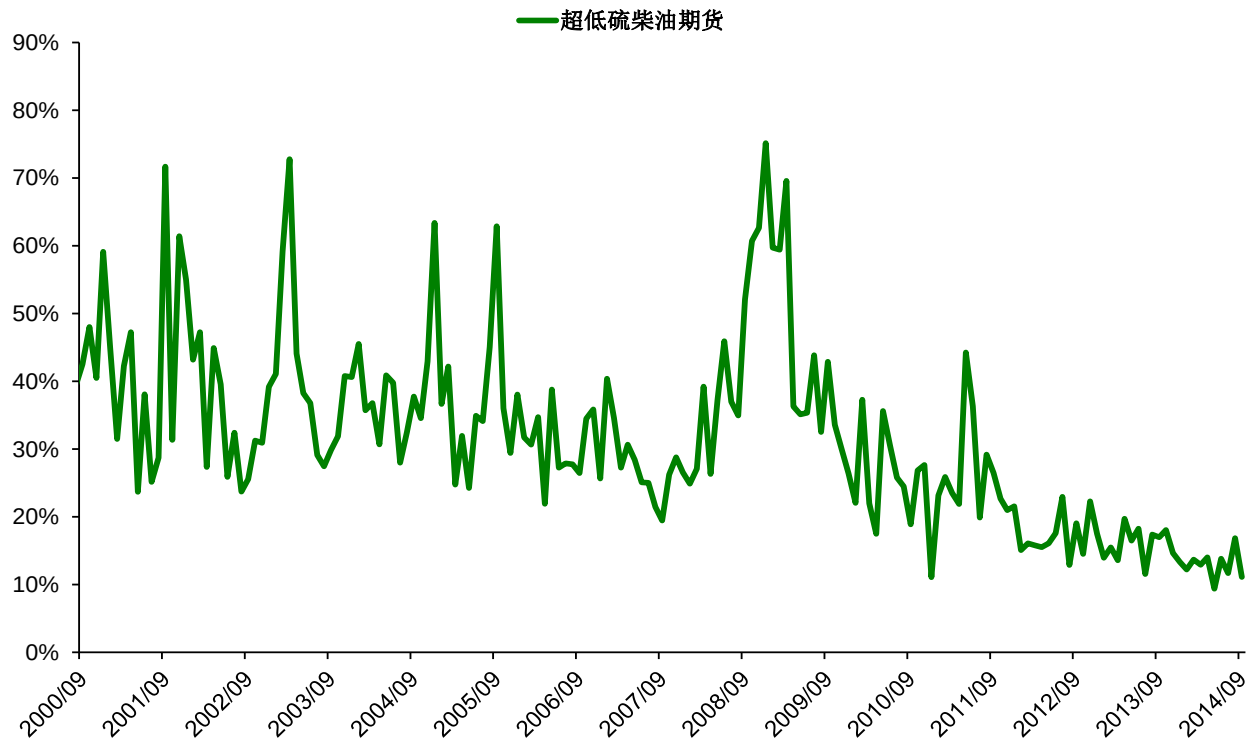
轻质低硫原油期货 - 现货月20天历史波动率



天然气期货 - 现货月20天历史波动率



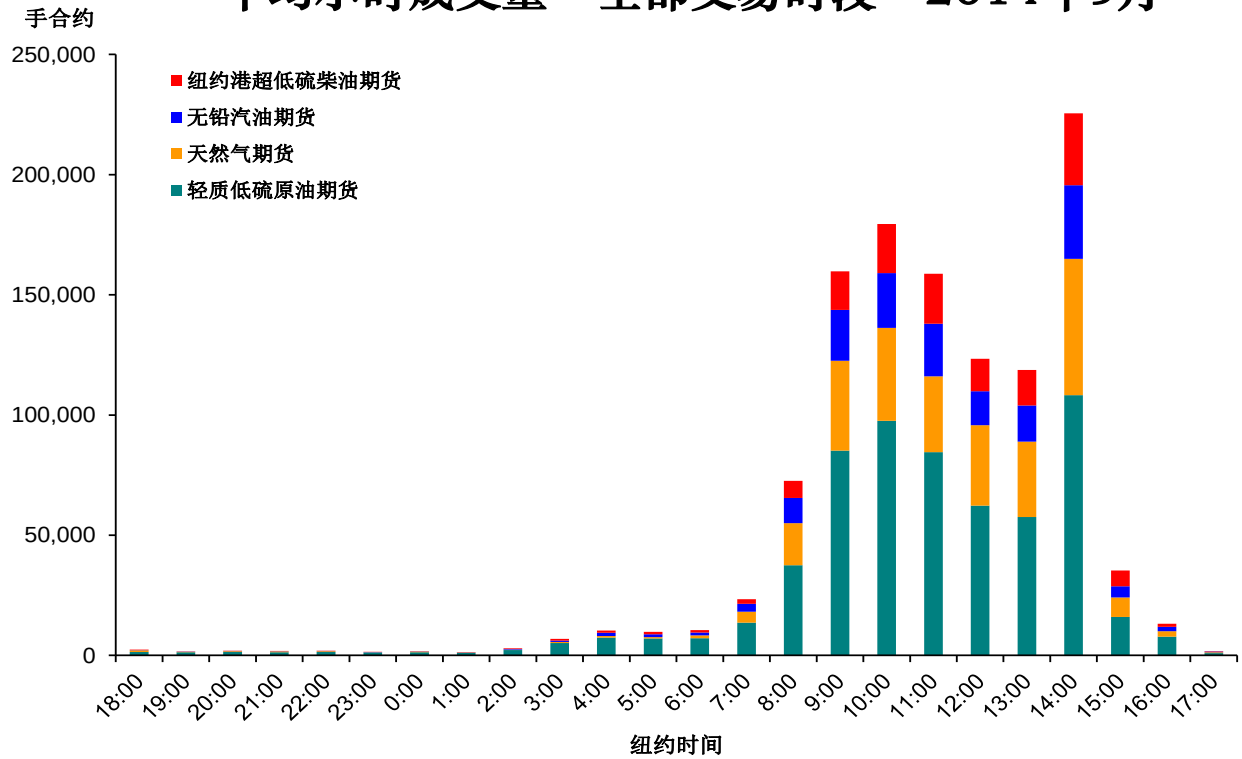
超低硫柴油期货 - 现货月20天历史波动率



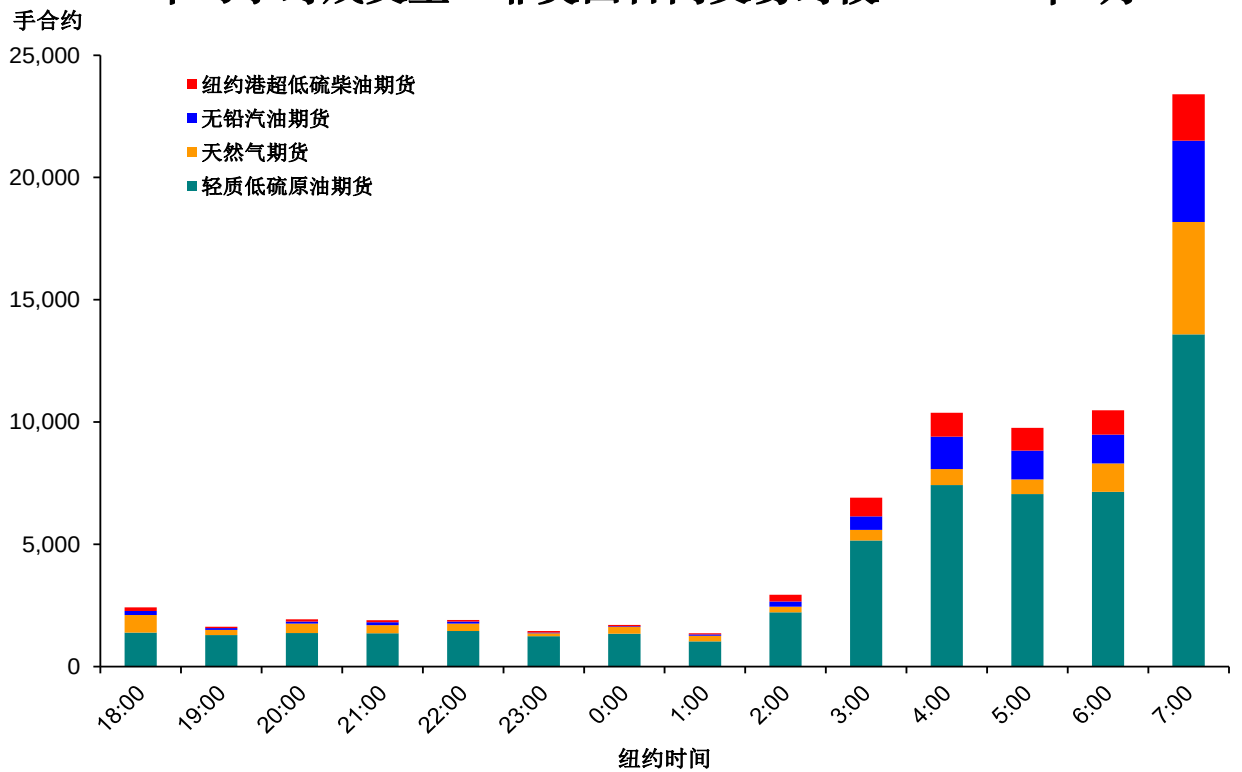
无铅汽油期货 - 现货月20天历史波动率



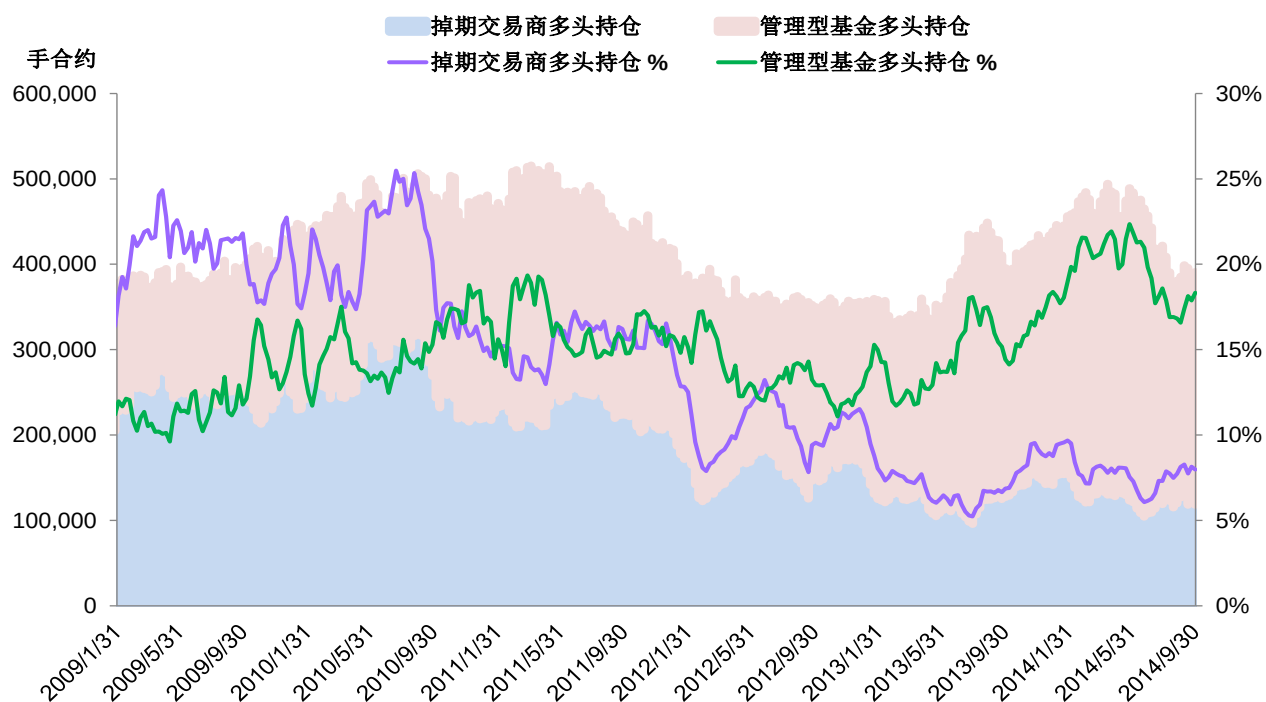
平均小时成交量 - 全部交易时段 - 2014年9月



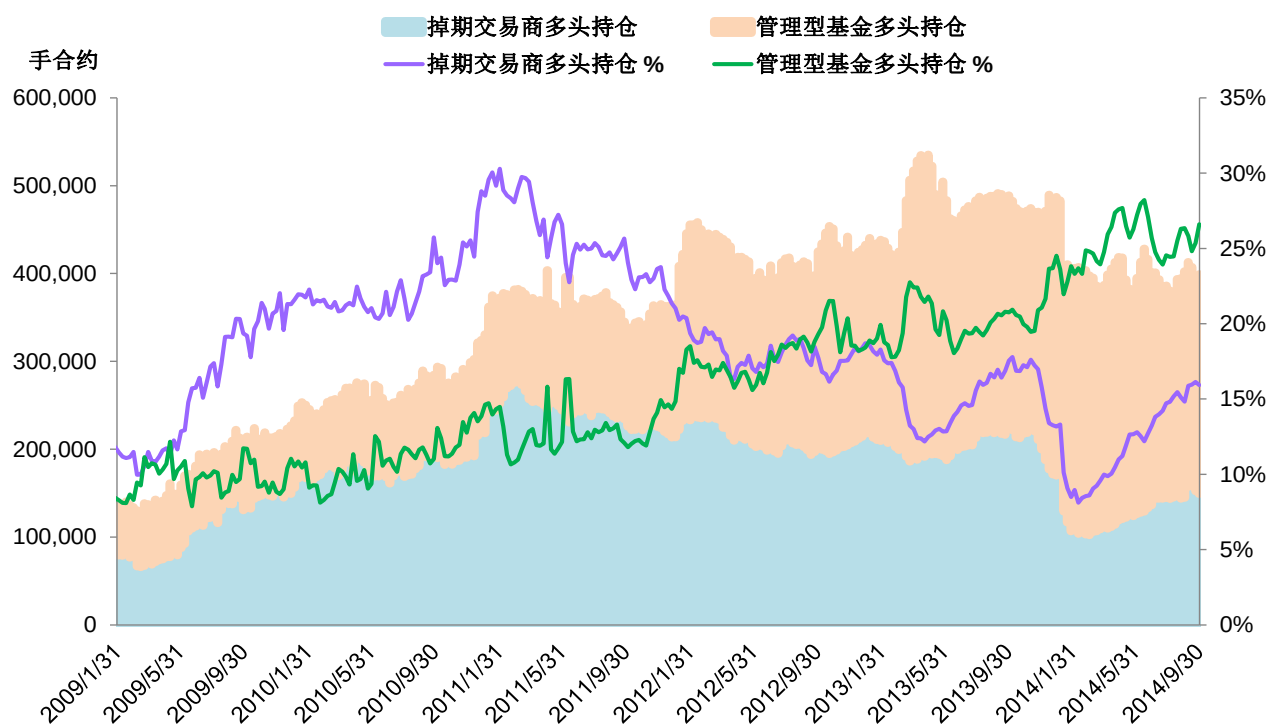
平均小时成交量 - 非美国日间交易时段 - 2014年9月



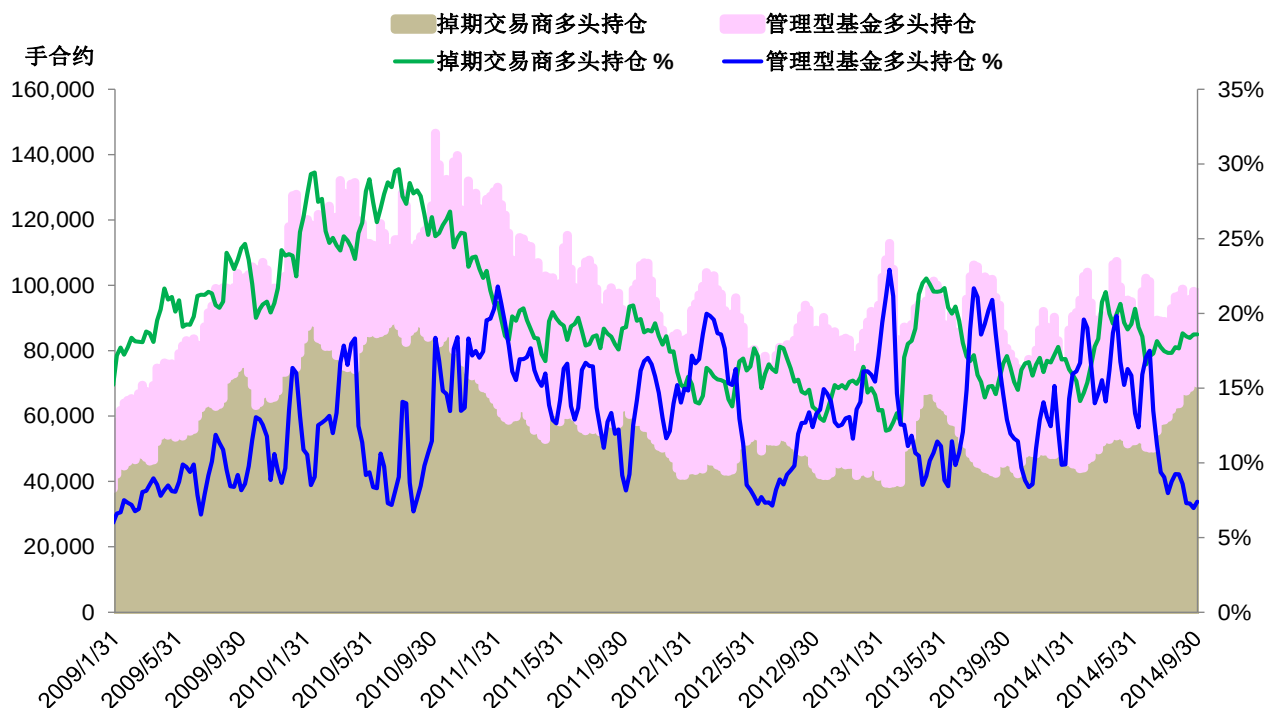
CFTC 持仓报告 - 轻质低硫原油期货多头持仓



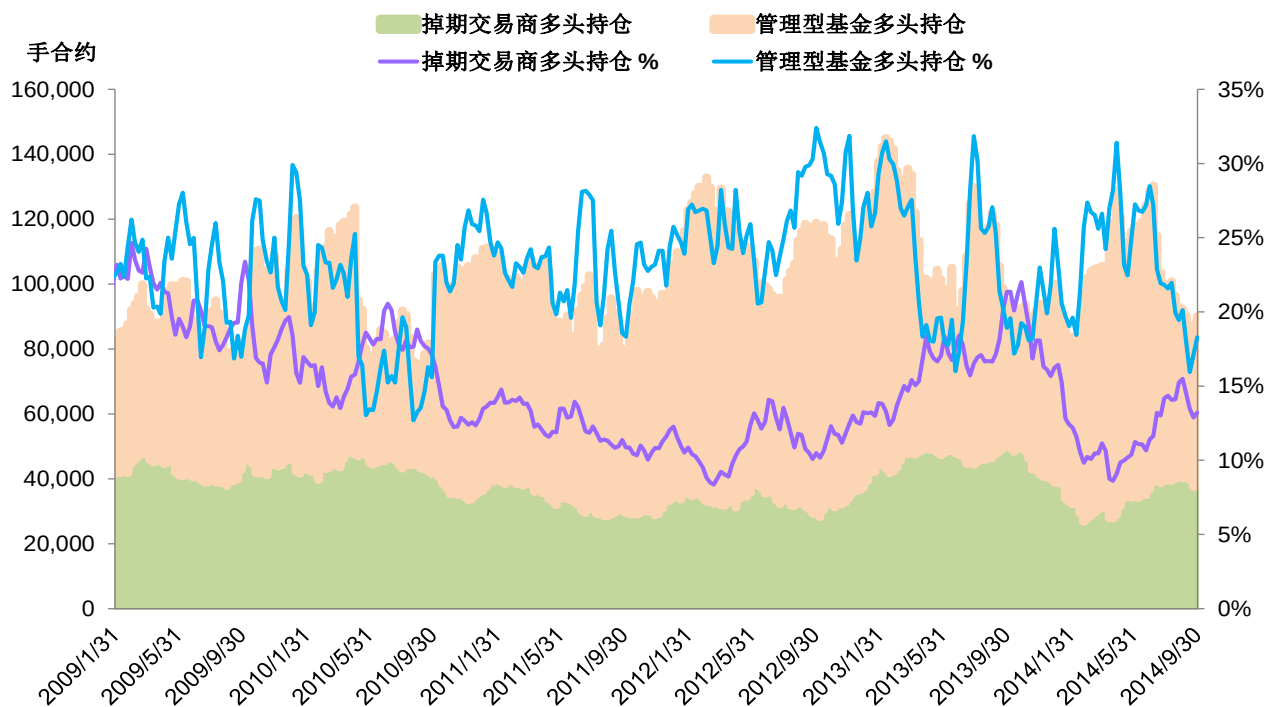
CFTC 持仓报告 - 天然气期货多头持仓



CFTC 持仓报告 - 超低硫柴油期货多头持仓



CFTC 持仓报告 - 无铅汽油期货多头持仓





CME GROUP HEADQUARTERS

20 South Wacker Drive
Chicago, Illinois 60606
cmegroup.com

info@cmegroup.com
+1 800 331 3332
+1 312 930 1000

CME GROUP REGIONAL OFFICES

New York
+1 212 299 2000

Calgary
+1 403 444 6876

São Paulo
+55 11 2565 5999

Washington D.C.
+1 202 638 3838

London
+44 20 3379 3700

Hong Kong
+852 3101 7696

Seoul
+82 2 6336 6722

Singapore
+65 6593 5555

Houston
+1 713 658 9292

Tokyo
+81 3242 6232

Futures trading is not suitable for all investors, and involves the risk of loss. Futures are a leveraged investment, and because only a percentage of a contract's value is required to trade, it is possible to lose more than the amount of money deposited for a futures position. Therefore, traders should only use funds that they can afford to lose without affecting their lifestyles. And only a portion of those funds should be devoted to any one trade because they cannot expect to profit on every trade.

All references to options refer to options on futures.

CME Group is a trademark of CME Group, Inc. The Globe Logo, CME, Chicago Mercantile Exchange, and Globex are trademarks of Chicago Mercantile Exchange Inc. CBOT and the Chicago Board of Trade are trademarks of the Board of Trade of the City of Chicago. New York Mercantile Exchange and NYMEX are registered trademarks of the New York Mercantile Exchange, Inc. All other trademarks are the properties of their respective owners. The information within this brochure has been compiled by CME Group for general purposes only. CME Group assumes no responsibility for any errors or omissions. Additionally, all examples in this brochure are hypothetical situations, used for explanation purposes only, and should not be considered investment advice or the results of actual market experience. All matters pertaining to rules and specifications herein are made subject to and are superseded by official CME, CBOT, and NYMEX rules. Current rules should be consulted in all cases concerning contract specifications.