

期货公司风险管理子公司场外衍生品标的概况

资产类型	标的资产类型	标的资产品种	标的资产对应合约	交易所
商品	贵金属	白银	各期货合约	上期所
		AGTD		
		黄金	各期货合约	上期所
		AU+M+SC	0.875*黄金+0.122*豆粕+1.236*原油	
		AU9999		上海黄金交易所
		AUTD		上海黄金交易所
		COMEX 黄金	各期货合约	纽约商品交易所
		伦敦黄金现货		
		伦敦金银市场协会黄金		
		钯金		
	上海金		上海黄金交易所	
	黑色能化	热轧卷板	期现价差：唐山 Q195 热轧带钢 2.5*295-355 盛丰兆丰宏兴均价/期货合约价格	
			期现价差：唐山 Q195 热轧带钢 2.5*295-355 盛丰兆丰宏兴均价/期货合约价格	
			期现价差：广东乐从 Q235B 热轧卷板 4.75x1500xC 本钢燕钢均价/	

		期货合约价格	
		各期货合约	上期所
		期货合约跨月价差	上期所
热轧卷板和焦炭价差		期货合约价差	上期所和大商所
铁矿石		主力合约价格指数	大商所
		期现价差：PB 粉（PBF）青岛港日照港均价/期货合约价格	
		期现价差：PB 块（PBL）青岛港日照港均价/期货合约价格	
		期现价差：PB 粉青岛日照均价 - 期货合约价格	
		各期货合约	大商所
		期货合约跨月价差	大商所
焦炭		主力合约价格指数	大商所
		各期货合约	大商所
		期货合约跨月价差	大商所
焦煤		各期货合约	大商所
螺纹钢		期现价差：唐山 HRB400E 螺纹钢 18-25mm 河钢唐钢河北津西东海特钢均价/期货合约价格	
		期现价差：唐山 Q235 方坯 150x150mm 鑫达东华凯恒均价/期货合约价格	
		期现价差：北京 HRB400E 螺纹钢 Φ18-22mm 敬业/期货合约价格	
		各期货合约	上期所
		期货合约跨月价差	上期所
螺纹钢和热轧卷板价差		期货合约价差	上期所

螺纹钢和焦炭价差	期货合约价差	上期所和大商所
硅铁	各期货合约	郑商所
锰硅	各期货合约	郑商所
不锈钢	各期货合约	上期所
大商所钢铁炉料成本指数	SRMCI	大商所
钢材现货	杭州 HRB400 螺纹钢 16-25mm 沙钢永钢中天均价	
	北京 HRB400E 螺纹钢 Φ18-22mm 敬业	
	博兴 Q235B 热轧板卷 4.75*1500*C 中铁	
	成都螺纹.NULL	
	广东乐从 Q235B 热轧卷板 4.75x1500xC 本钢燕钢均价	
	广州 HRB400E 螺纹钢 Φ18-25mm 韶钢湘钢珠海粤钢均价	
	邯郸 Q235B 普中板 14-22mm 邯钢普阳元宝山均价	
	杭州螺纹 HRB400 16-25mm, 沙钢永刚中天均价	
	乐从 Q235B 普中板 14-40mm(唐钢、柳钢)	
	乐从 Q235B 热卷 4.75*1500*C (本钢、燕钢)	
	乐从冷轧卷板 DC01 1.0*1250.C 本钢唐钢本钢浦项均价	
	南京 HRB400 螺纹钢 Φ16-25mm 马钢永钢南钢	
	山东博兴 SPHC 热轧卷板 3.0*1010*C 中铁普阳邢台德龙均价	
	上海螺纹 HRB400 16-25mm, 联鑫桂鑫镔鑫均价	
	沈阳 HRB400E 螺纹钢 Φ18-25mm 新抚钢通钢均价	
	唐山 Q195 热轧带钢 2.5*295-355 盛丰兆丰宏兴均价	
	唐山 Q235 方坯 150x150mm 鑫达东华凯恒均价	

		张家港 Q235B 热轧卷板 4.75x1500xC 沙钢	
铁矿石掉期指数		CPIS07	
铁矿石现货		卡拉加斯粉 (IOCJ) 青岛港和日照港均价/PB 粉 (PBF) 青岛港和日照港均价	
		59.5%金布巴粉 (JMBF) -PB 粉 (PBF) 青岛港日照港均价	
		PB 粉 (PBF) 青岛港日照港均价	
		PB 块 (PBL) 青岛港日照港均价	
		金布巴粉(JMBF/59.5%) 青岛港日照港均价	
		金布巴粉(JMBF/60.5%) 青岛港日照港均价	
		卡拉加斯粉 (IOCJ) 青岛港日照港均价	
新交所铁矿石		各期货合约	新加坡交易所
石油沥青		各期货合约	上期所
		期货合约跨月价差	上期所
苯乙烯		各期货合约	大商所
		期货合约跨月价差	大商所
乙二醇		各期货合约	大商所
		期货合约跨月价差	大商所
玻璃		各期货合约	郑商所
燃料油		各期货合约	上期所
		期货合约跨月价差	上期所
ICE 燃料油		各期货合约	洲际交易所
聚乙烯		主力合约价格指数	大商所
		各期货合约	大商所

		期货合约跨月价差	大商所
	聚乙烯和聚氯乙烯价差	期货合约价差	大商所
	甲醇	各期货合约	郑商所
		期货合约跨月价差	郑商所
	20号胶	各期货合约	能源中心
		期货合约跨月价差	能源中心
	液化石油气	各期货合约	大商所
	聚丙烯	主力合约价格指数	大商所
		各期货合约	大商所
		期货合约跨月价差	大商所
	聚丙烯和甲醇价差	期货合约价差	大商所和郑商所
	聚丙烯和聚氯乙烯价差	期货合约价差	大商所
	PTA和乙二醇价差	期货合约价差	郑商所和大商所
	PTA现货	PTA现货	
	天然橡胶	各期货合约	上期所
		期货合约跨月价差	上期所
		期现价差	上期所
	纯碱	各期货合约	郑商所
	原油	各期货合约	能源中心
		期货合约跨月价差	能源中心
	纸浆	期现价差	上期所

		各期货合约	上期所
		期货合约跨月价差	上期所
	PTA	各期货合约	郑商所
		期货合约跨月价差	郑商所
	TCE 原油	各期货合约	东京商品交易所
	尿素	期货合约跨月价差	郑商所
		各期货合约	郑商所
	聚氯乙烯	期货合约跨月价差	大商所
		各期货合约	大商所
	WTI 原油	各期货合约	纽约商业交易所
	动力煤	期现价差	郑商所
		期货合约跨月价差	郑商所
		各期货合约	郑商所
	布伦特原油	各期货合约	洲际交易所
	新交所天胶	各期货合约	新交所
农产品	豆一	各期货合约	大商所
	苹果	各期货合约	郑商所
	豆二	各期货合约	大商所
	玉米	玉米期货价格指数	大商所
		主力合约价格指数	大商所
		各期货合约	大商所
		期货合约跨月价差	大商所
	CBOT 大豆	各期货合约	芝加哥期货交易

			所
	CBOT 玉米	各期货合约	芝加哥期货交易所
	棉花	各期货合约	郑商所
		期货合约跨月价差	郑商所
	红枣	各期货合约	郑商所
	玉米淀粉	各期货合约	大商所
		期货合约跨月价差	大商所
	棉纱	各期货合约	郑商所
	玉米和玉米淀粉价差	期货合约价差	大商所
	ICE 棉花	各期货合约	洲际交易所
	鸡蛋	各期货合约	大商所
		期货合约跨月价差	大商所
	豆粕	豆粕期货价格指数	大商所
		主力合约价格指数	大商所
		各期货合约	大商所
		期货合约跨月价差	大商所
	豆粕和玉米价差	期货合约价差	大商所
	豆粕和菜粕价差	期货合约价差	大商所和郑商所
	菜油	各期货合约	郑商所
	菜油和棕榈油价差	期货合约价差	郑商所和大商所
	菜油和豆油价差	期货合约价差	郑商所和大商所
	棕榈油	各期货合约	大商所

		期货合约跨月价差	大商所
	PTA 和棉花价差	期货合约价差	郑商所
	菜粕	各期货合约	郑商所
	粳米	各期货合约	大商所
	白糖	各期货合约	郑商所
	豆油	各期货合约	大商所
		期货合约跨月价差	大商所
	豆油和豆粕价差	期货合约价差	大商所
	豆油和棕榈油价差	期货合约价差	大商所
	牛饲料价格指数	0.5*玉米+0.15*豆粕	大商所
	猪饲料价格指数	0.68*玉米+0.2*豆粕	大商所
有色	铝	期现价差：A00 铝（巩义）- AL2004 期货合约	
		各期货合约	上期所
		期货合约跨月价差	上期所
	铜	各期货合约	上期所
		期货合约跨月价差	上期所
		期现价差：CU2006 期货合约-湿法铜	
		期现价差：CU2009.SHF-铜标准仓单	
		LME 铜内外盘价差（LME 铜-沪铜）	伦敦金属交易所 和上期所
	LME 铝	各期货合约	伦敦金属交易所
	LME 镍	各期货合约	伦敦金属交易所
	LME 铅	各期货合约	伦敦金属交易所

		LME 铜	各期货合约	伦敦金属交易所
		LME 锡	各期货合约	伦敦金属交易所
		LME 锌	各期货合约	伦敦金属交易所
		镍	各期货合约	上期所
		铅	各期货合约	上期所
		锡	各期货合约	上期所
		锌	各期货合约	上期所
			期货合约跨月价差	上期所
权益	个股	个股	沪深交易所、港交所上市的股票	沪深交易所、港交所等
	基金	基金	沪深交易所上市的公募基金	沪深交易所
			私募基金	
	指数	中证 500 股指期货	各期货合约	中金所
		沪深 300 股指期货	各期货合约	中金所
		上证 50 股指期货	各期货合约	中金所
		中证 500 指数		
		沪深 300 指数		
		上证 50 指数		
		上证 180 指数		
		创业板指数		
		高铁产业指数		
		国证保证指数		
国证农业指数				

		国证食品指数		
		金融指数		
		商务指数		
		央视创新指数		
		证券公司指数		
		证券龙头指数		
		综企指数		
利率	LIBOR	LIBOR		
	LPR	LPR		
	国股银票转贴现	国股银票转贴现		上海票据交易所
	国债	十年期国债期货	各期货合约	中金所
	国债	五年期国债期货	各期货合约	中金所
	公司债	公司债	沪深交易所上市的公司债	沪深交易所
外汇	美元兑人民币	美元兑离岸人民币		
		新交所美元兑离岸人民币期货	各期货合约	新加坡交易所
		港交所美元兑人民币期货	各期货合约	香港交易所
信用	公司债	公司债	沪深交易所上市的公司债	沪深交易所

注：以上资产分类将随市场发展不断扩充。