

期货风险管理公司风险控制指标基差价差风险系数表

序号	交易所	品种	代码	基差价差 风险系数	序号	交易所	品种	代码	基差价差 风险系数
1	上期所	铜	CU	0.5%	38	郑商所	PTA	TA	2.0%
2		铝	AL	1.0%	39		尿素	UR	4.5%
3		锌	ZN	1.0%	40		锰硅	SM	2.0%
4		铅	PB	1.0%	41		硅铁	SF	3.0%
5		镍	NI	1.5%	42		短纤	PF	2.0%
6		锡	SN	1.5%	43		花生	PK	3.0%
7		不锈钢	SS	2.0%	44		黄大豆1号	A	3.0%
8		螺纹钢	RB	2.5%	45		黄大豆2号	B	3.0%
9		热轧卷板	HC	2.0%	46	豆粕	M	2.0%	
10		线材	WR	8.5%	47	豆油	Y	2.0%	
11		黄金	AU	0.5%	48	棕榈油	P	3.0%	
12		白银	AG	0.5%	49	玉米	C	1.5%	
13		天然橡胶	RU	1.5%	50	玉米淀粉	CS	2.5%	
14		燃料油	FU	4.0%	51	鸡蛋	JD	6.0%	
15		石油沥青	BU	3.0%	52	粳米	RR	1.5%	
16		纸浆	SP	2.5%	53	聚乙烯	L	1.5%	
17	能源中心	原油	SC	2.5%	54	大商所	聚氯乙烯	V	2.0%
18		低硫燃料油	LU	2.5%	55		聚丙烯	PP	2.0%
19		20号胶	NR	1.5%	56		苯乙烯	EB	3.0%
20		国际铜	BC	1.0%	57		乙二醇	EG	2.0%
21	郑商所	强麦	WH	20.0%	58		液化石油气	PG	3.0%
22		普麦	PM	20.0%	59		铁矿石	I	4.0%
23		早籼稻	RI	20.0%	60		焦煤	JM	7.0%
24		晚籼稻	LR	20.0%	61		焦炭	J	5.5%
25		粳稻	JR	20.0%	62		纤维板	FB	7.0%
26		苹果	AP	6.5%	63		胶合板	BB	19.0%
27		红枣	CJ	5.0%	64	生猪	LH	6.0%	
28		棉花	CF	2.0%	65	中金所	沪深300股指期货	IF	0.5%
29		棉纱	CY	20.0%	66		上证50股指期货	IH	0.5%
30		白糖	SR	1.5%	67		中证500股指期货	IC	1.0%
31		油菜籽	RS	20.0%	68		中证1000股指期货	IM	1.0%
32		菜籽油	OI	2.0%	69		2年期国债	TS	0.5%
33		菜籽粕	RM	3.0%	70		5年期国债	TF	0.5%
34		动力煤	ZC	20.0%	71		10年期国债	T	0.5%
35		玻璃	FG	4.0%	72	港交所	恒生指数期货	HSIF	1.0%
36		纯碱	SA	5.5%	73	其它	其它品种	——	10.0%
37		甲醇	MA	3.0%					

说明：

1. 此表用于计算《期货风险管理公司风险控制指标管理办法（试行）》市场风险资本准备中的基差价差风险，不定期更新；
2. 各品种基差价差风险系数根据万德2019年12月至2022年11月三年区间的收盘价数据计算。