

2022年04月19日

量化统计日报

恒泰期货研究所

【姓名：宋栋鸣】

【从业资格编号：F3062205】

【投资咨询编号：Z0014510】

【联系电话：021-68405077】

【电子邮箱：

songdongming@cnhtqh.com.cn】

摘要

全品种和板块摘要

成交额 (亿元)	原油	沪深300	螺纹钢	中证500	棕榈油
	1428	1343	1262	1037	806
持仓额 (亿元)	中证500	沪深300	铜	螺纹钢	铁矿石
	550	309	164	149	142
成交额变化	纤维板	焦炭	不锈钢	鸡蛋	粳米
	126.19%	105.66%	89.09%	-43.71%	-46.48%
持仓额变化	不锈钢	镍	纸浆	焦炭	焦煤
	14.87%	8.92%	8.86%	-7.84%	-11.69%
涨跌幅	镍	生猪	玻璃	铁矿石	焦煤
	3.44%	3.38%	3.07%	-3.27%	-4.39%
振幅	焦炭	焦煤	不锈钢	铁矿石	镍
	7.48%	7.39%	6.38%	6.18%	5.78%
板块成交额 (亿元)	化工	煤焦钢矿	股指期货	油脂油料	有色
	3390	3354	2927	2546	2099
板块持仓额 (亿元)	股指期货	煤焦钢矿	化工	有色	油脂油料
	966	454	393	351	319
板块成交额 变化	谷物	有色	煤焦钢矿	软商品	国债期货
	48.53%	33.60%	27.63%	-23.40%	-24.92%
板块持仓额 变化	谷物	有色	非金属建材	化工	能源
	3.77%	2.82%	1.71%	-0.86%	-5.40%

注：成交额变化、持仓额变化、涨跌幅等列出数值最高的3个（红色表示）和数值最低的2个（绿色表示），其他列出数值最大的5个（红色表示）。

从主要品种当日振幅与成交额分布图上看，交易应重点关注铁矿石、原油、螺纹钢、沪深300和豆粕等品种。

相关研究

《大宗商品基差与利润跟踪日报》

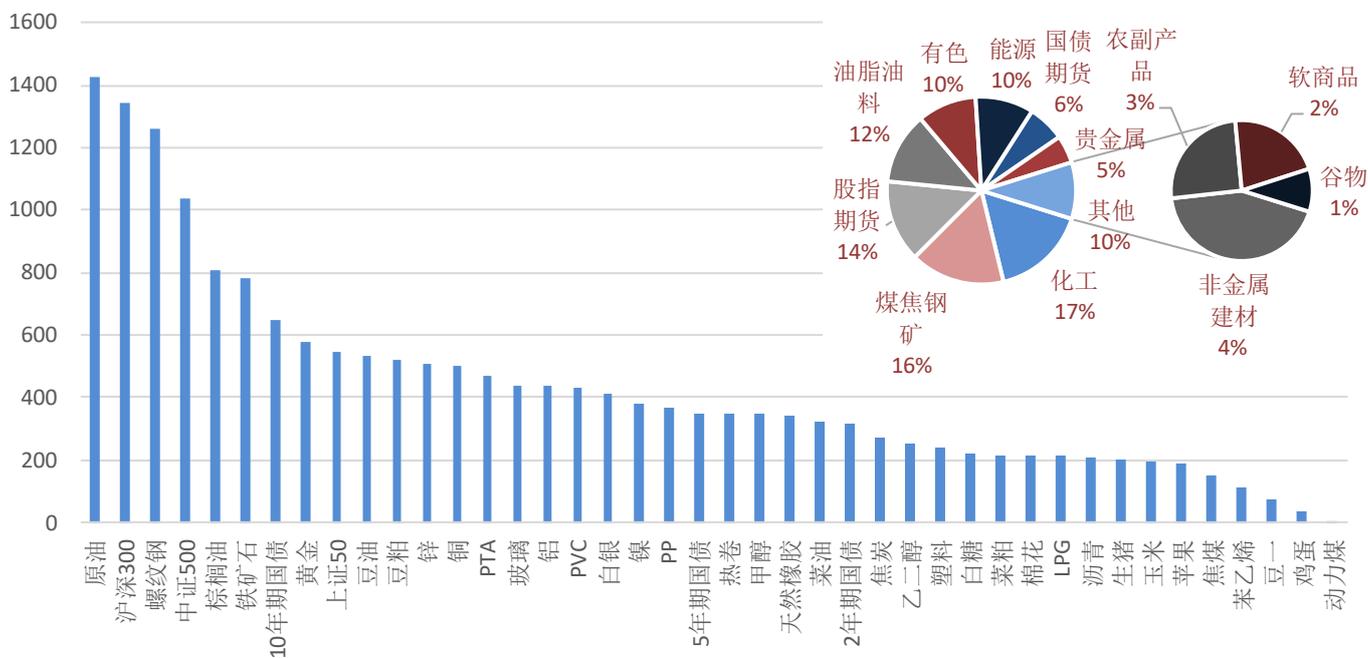
《期货合约价差跟踪》

附表目录:

- 1、 主要品种和板块当日成交额（亿元）（图 1）
- 2、 主要品种当日成交额增长率（图 2）
- 3、 主要品种和板块当日存量资金（亿元）（图 3）
- 4、 主要品种当日存量资金增长率（图 4）
- 5、 板块当日成交额增长率、存量资金增长率（图 5、图 6）
- 6、 主要品种当日、短期与中期涨跌幅（图 7）
- 7、 主要品种当日振幅（图 8）
- 8、 主要品种当日振幅与当日成交额分布（图 9）
- 9、 全品种价量数据（表 1）

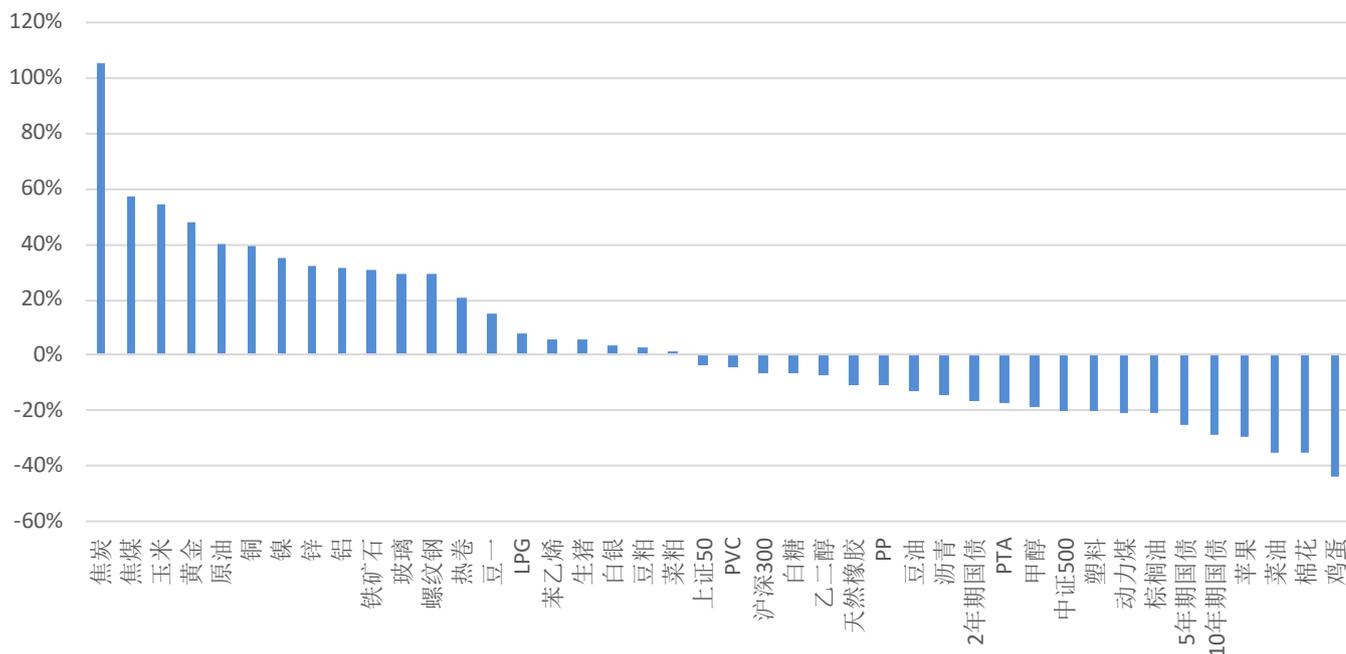
一、主要品种和板块的当日成交额和资金存量

图 1：主要品种和板块当日成交额（亿元）



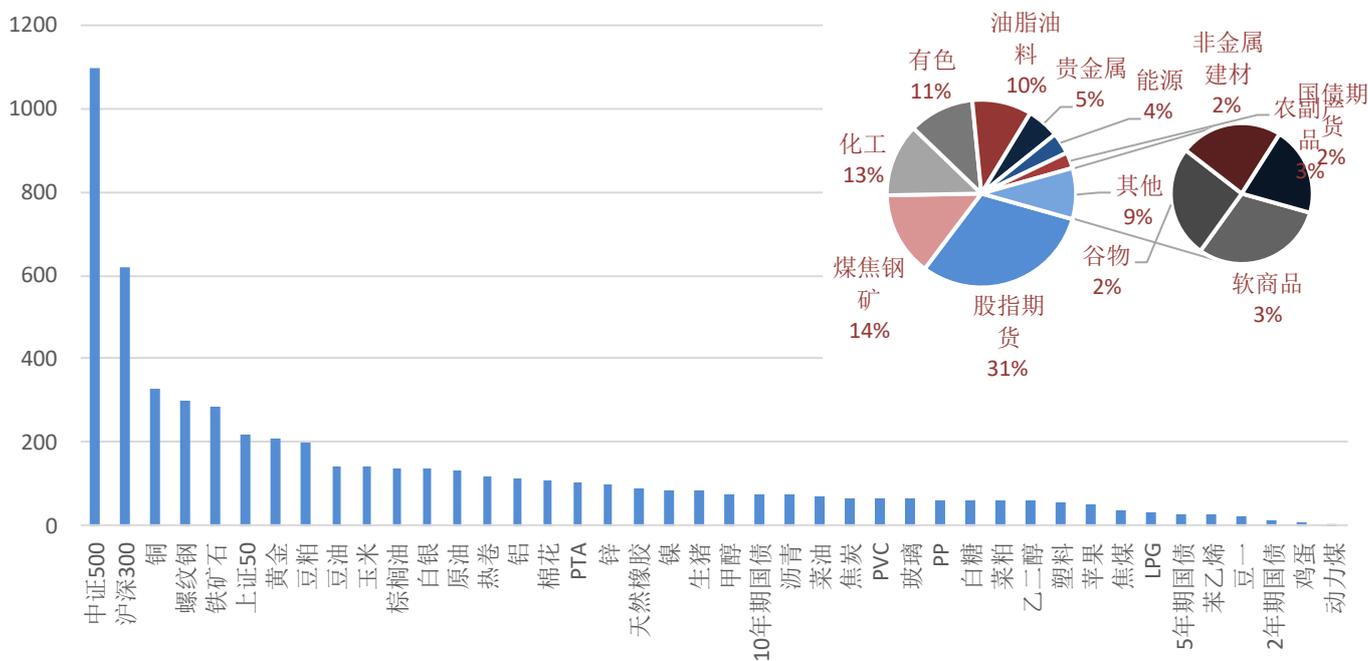
资料来源：WIND、恒泰期货

图 2：主要品种当日成交额增长率



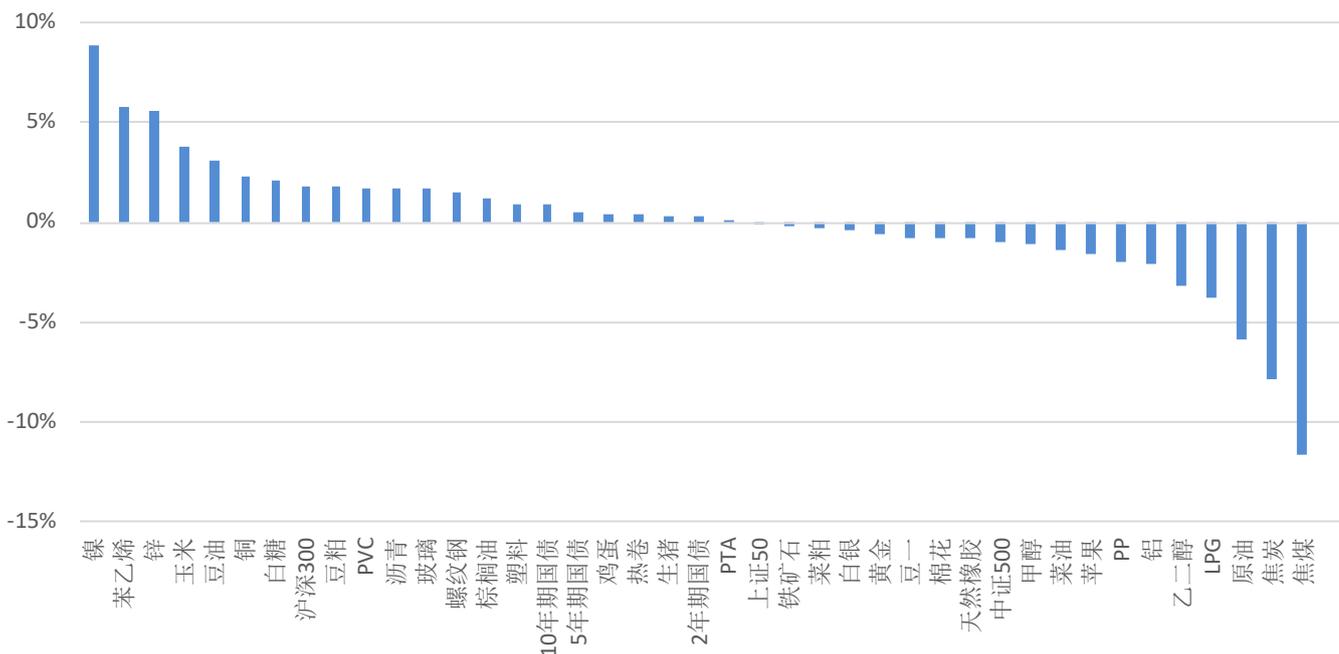
资料来源：WIND、恒泰期货

图 3：主要品种和板块的当日存量资金（亿元）



资料来源：WIND、恒泰期货

图 4：主要品种当日存量资金增长率



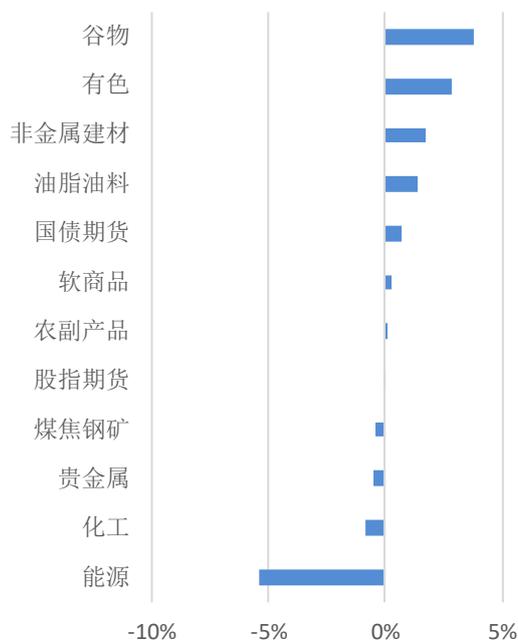
资料来源：WIND、恒泰期货

图 5：板块当日成交额增长率



资料来源：WIND、恒泰期货

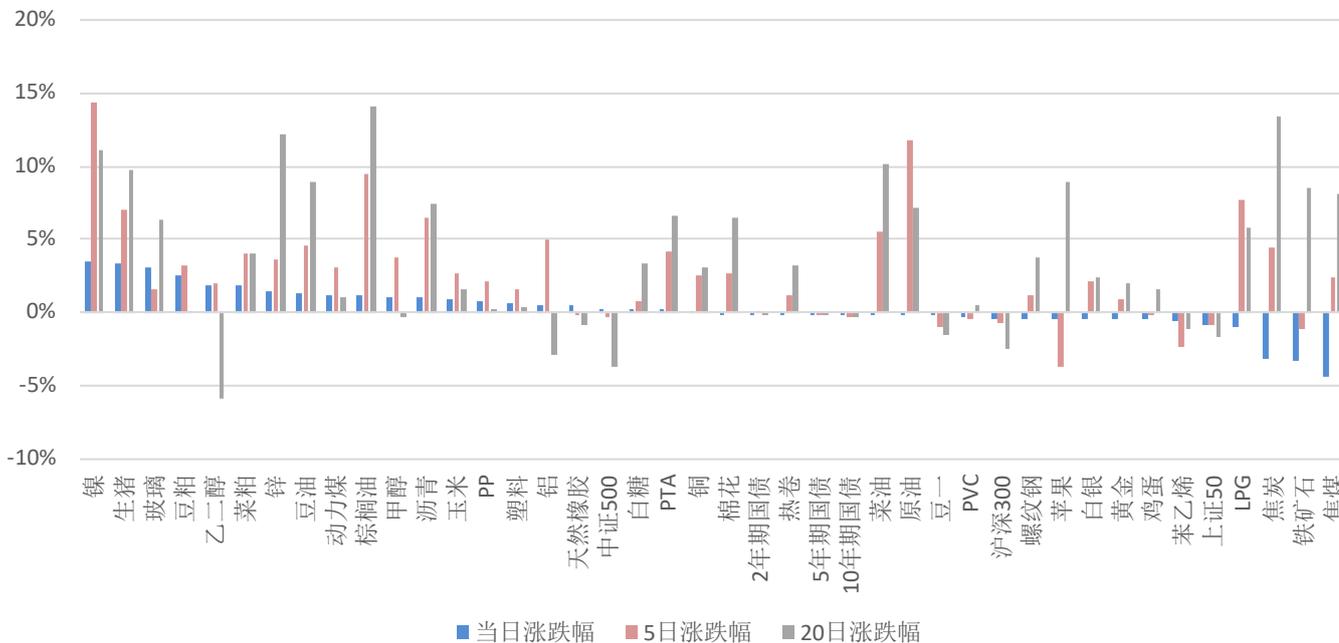
图 6：板块当日存量资金增长率



资料来源：WIND、恒泰期货

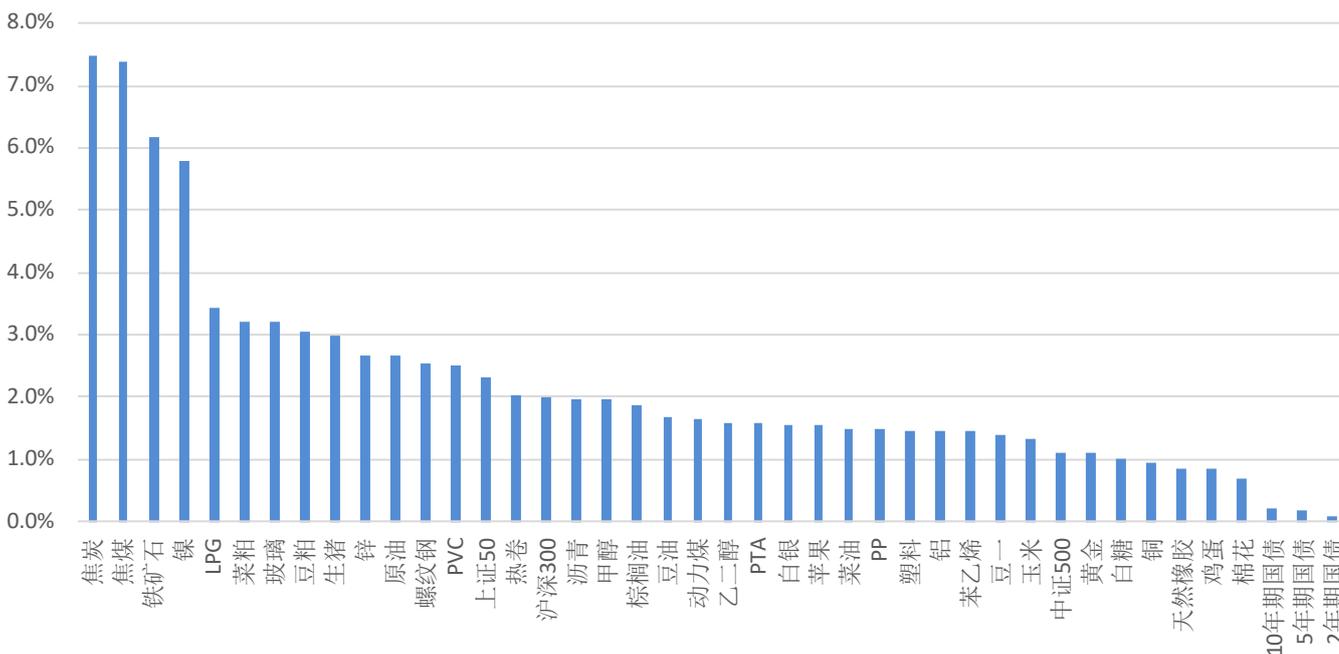
二、主要品种涨跌幅、振幅

图 7：主要品种当日、短期与中期涨跌幅



资料来源：WIND、恒泰期货

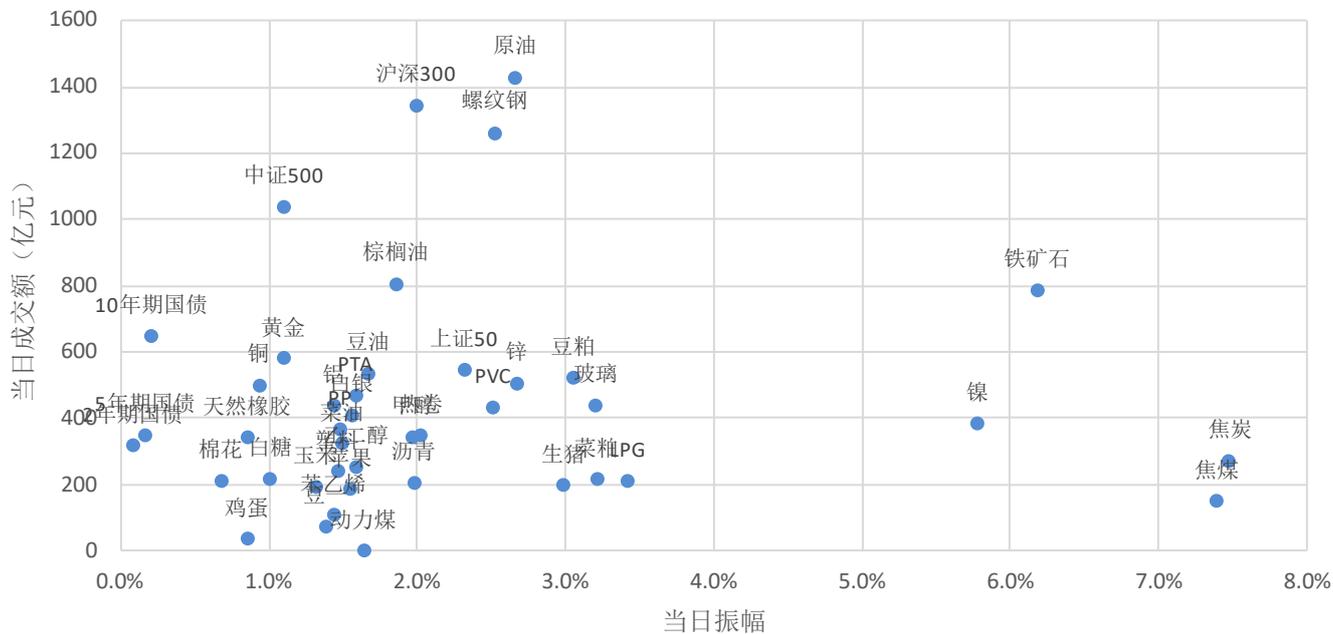
图 8：主要品种当日振幅



资料来源：WIND、恒泰期货

三、主要品种价量间关系

图 9：主要品种当日振幅与当日成交额分布



资料来源：WIND、恒泰期货

四、全品种价量数据

表 1：全品种价量数据

板块	品种	主力合约	开盘价	最高价	最低价	收盘价	涨跌幅	日增仓	持仓量	成交量
股指期货	沪深300	IF2205.CFE	4165	4188	4105.2	4134.8	-0.42%	+4432(+5.76%)	81341	75170
	上证50	IH2205.CFE	2893.8	2907.4	2840.4	2865	-0.81%	+1217(+3.34%)	37642	36691
	中证500	IC2205.CFE	6040.4	6087.8	6021.2	6066.6	0.28%	-3351(-3.41%)	94798	52752
国债期货	5年期国债	TF2206.CFE	101.6	101.645	101.475	101.51	-0.05%	+520(+0.51%)	102970	33400
	10年期国债	T2206.CFE	100.31	100.33	100.12	100.19	-0.05%	+219(+0.13%)	163200	58659
	2年期国债	TS2206.CFE	101.255	101.295	101.21	101.225	-0.03%	+120(+0.25%)	48907	15446
有色	铜	CU2205.SHF	74910	75500	74800	75040	0.15%	-7329(-4.68%)	149391	63367
	铝	AL2205.SHF	21895	22200	21885	21920	0.53%	-14592(-10.07%)	130305	183854
	锌	ZN2205.SHF	28310	28985	28225	28505	1.50%	-8848(-8.32%)	97544	179251
	铅	PB2205.SHF	15670	15715	15540	15560	-0.26%	-1575(-4.68%)	32050	31686
	镍	NI2205.SHF	234470	246000	232580	239830	3.44%	+1813(+3.49%)	53781	121313
	锡	SN2205.SHF	336690	346490	336200	339010	1.11%	+1308(+5.56%)	24839	32782
	国际铜	BC2206.INE	66890	67650	66860	67190	0.25%	-602(-5.28%)	10797	10753
贵金属	黄金	AU2206.SHF	408.5	409.04	404.56	405.1	-0.48%	-4539(-2.83%)	155858	106332
	白银	AG2206.SHF	5331	5335	5253	5258	-0.45%	-6133(-1.30%)	463983	417623
煤焦钢矿	螺纹钢	RB2210.SHF	5080	5128	5000	5011	-0.44%	+24045(+1.38%)	1772066	2283937
	热卷	HC2210.SHF	5200	5248	5143	5164	-0.04%	+3925(+0.62%)	639333	578474
	不锈钢	SS2205.SHF	19505	20750	19505	20265	2.95%	+2291(+4.72%)	50778	118363
	焦炭	J2209.DCE	4084	4164.5	3851	3898.5	-3.17%	+5722(+27.75%)	26345	49675
	焦煤	JM2209.DCE	3176	3236	3002	3015	-4.39%	+7911(+30.92%)	33495	61072
	铁矿石	I2209.DCE	925	942	885	887	-3.27%	+5648(+0.90%)	635050	684808
	硅铁	SF209.CZC	11186	11238	10758	10872	-2.46%	+17253(+13.15%)	148429	270412
	锰硅	SM209.CZC	9040	9114	8870	8940	-0.91%	-1780(-1.22%)	144460	205727
能源	燃料油	FU2209.SHF	4135	4192	4095	4106	-1.91%	-5077(-1.67%)	299773	804072
	原油	SC2206.INE	698.2	711.8	693.3	695.9	-0.23%	+15589(+80.27%)	35010	154448
	低硫燃料油	LU2207.INE	5201	5273	5133	5148	-2.46%	+24237(+275.01%)	33050	67605
	LPG	PG2205.DCE	6366	6391	6174	6219	-1.00%	-9163(-21.09%)	34281	83895
	动力煤	ZC205.CZC	816.2	829.6	816.2	829	1.20%	-55(-4.09%)	1289	142
化工	沥青	BU2206.SHF	3978	4016	3938	3957	1.07%	-9621(-3.08%)	302804	395711
	天然橡胶	RU2209.SHF	13500	13580	13465	13495	0.48%	-1197(-0.56%)	213722	215404
	纸浆	SP2209.SHF	7056	7250	7050	7194	1.93%	+21815(+14.36%)	173744	311737
	20号胶	NR2206.INE	11350	11410	11310	11350	0.18%	-1134(-3.09%)	35610	19968
	塑料	L2205.DCE	9039	9122	8990	8991	0.63%	-18845(-18.06%)	85529	195300
	PP	PP2205.DCE	8840	8969	8838	8838	0.82%	-40705(-27.64%)	106546	397583
	乙二醇	EG2205.DCE	4902	4980	4902	4932	1.86%	-28764(-14.38%)	171251	276160
	苯乙烯	EB2205.DCE	9656	9656	9517	9532	-0.66%	-311(-0.35%)	89726	144519
	PTA	TA209.CZC	6190	6276	6178	6218	0.16%	+25945(+2.95%)	905611	1132320
	短纤	PF205.CZC	7806	7988	7806	7916	1.10%	-2482(-7.86%)	29091	47440
	甲醇	MA209.CZC	2995	3027	2968	2976	1.09%	-9581(-1.32%)	717751	903828
	尿素	UR209.CZC	2842	2847	2775	2789	-0.43%	-424(-0.45%)	93280	67426
	纯碱	SA209.CZC	3242	3269	3188	3213	1.26%	-77092(-11.41%)	598812	852117
非金属建材	纤维板	FB2205.DCE	1301.5	1325	1293	1300.5	0.39%	+266(+11.38%)	2604	6156
	PVC	V2205.DCE	9204	9265	9034	9081	-0.37%	-29161(-18.21%)	130962	480532
	玻璃	FG209.CZC	2031	2091	2026	2081	3.07%	+8652(+1.43%)	614275	1011797

油脂油料	豆粕	M2209. DCE	3934	4033	3913	4029	2.49%	+39967(+3.20%)	1288043	1002291
	豆油	Y2209. DCE	10962	11114	10932	11090	1.37%	+25764(+6.43%)	426167	406922
	豆一	A2207. DCE	6156	6188	6103	6174	-0.24%	-2139(-1.93%)	108483	91494
	豆二	B2205. DCE	5148	5315	5148	5305	3.03%	+1062(+5.15%)	21695	24613
	棕榈油	P2209. DCE	11340	11532	11322	11458	1.13%	+16298(+5.55%)	309957	630094
	菜油	OI209. CZC	13308	13450	13251	13411	-0.10%	+1963(+1.26%)	157561	209388
	菜粕	RM209. CZC	3802	3881	3759	3866	1.79%	+11239(+3.51%)	331823	412107
	花生	PK210. CZC	9590	9634	9460	9486	0.53%	+3615(+5.07%)	74960	99742
谷物	玉米	C2209. DCE	2969	2998	2959	2991	0.94%	+54360(+4.95%)	1152917	456375
	粳米	RR2206. DCE	3415	3435	3415	3423	0.23%	+2111(+30.52%)	9027	5335
农副产品	玉米淀粉	CS2207. DCE	3340	3410	3330	3397	1.40%	-5376(-2.50%)	209554	151780
	生猪	LH2209. DCE	18000	18320	17920	18030	3.38%	+17487(+60.99%)	46157	39349
	鸡蛋	JD2209. DCE	4842	4846	4805	4810	-0.50%	+1613(+1.90%)	86557	61273
	苹果	AP210. CZC	8715	8850	8715	8765	-0.44%	-1762(-1.18%)	147655	195192
	红枣	CJ209. CZC	12005	12260	11920	11955	0.97%	+1483(+5.17%)	30144	22787
软商品	白糖	SR209. CZC	6039	6096	6035	6070	0.17%	+17261(+4.09%)	439605	255429
	棉花	CF209. CZC	21520	21660	21515	21570	-0.02%	+7090(+2.37%)	306171	117960
	棉纱	CY205. CZC	27775	27980	27635	27830	0.52%	-125(-6.49%)	1802	1408

资料来源：WIND、恒泰期货

免责声明：

本报告由恒泰期货研究所制作，在未获得恒泰期货股份有限公司授权的情况下，任何人和单位不得对本报告进行任何形式的修改、发布和复制。本报告基于本公司期货研究人员采用可信的公开资料和实地调研资料，但本公司对所用信息准确性和完整性不作任何保证，且本报告中的资料、建议、预测均反映报告初次发布时的判断，可能会随时调整，报告中的信息或所表达的意见不构成投资、法律、会计或税务的最终操作建议，本公司不就报告中的内容对最终操作建议作任何担保。在恒泰期货股份有限公司及其研究人员知情的范围内，恒泰期货股份有限公司及其期货研究人员以及财产上的利害关系人与所评价或推荐的产品不存在任何利害关系，同时提醒期货投资者，期市有风险，入市须谨慎。

恒泰期货股份有限公司

办公地址：

上海市浦东新区峨山路91弄120号2层201

公司网址：

<http://www.cnhtqh.com.cn>

微信号：

htqhw88

电子邮件：

htqh@cnhtqh.com.cn



相关关联机构：

恒泰证券股份有限公司

办公地址：

中国北京市西城区金融大街17号中国人寿中心11楼

公司网址：

<http://www.cnht.com.cn>

联系电话：

956088

恒泰盈沃资产管理有限公司

办公地址：

上海市浦东新区峨山路91弄120号2层201

公司网址：

<http://www.cnhtqh.com.cn/ywindex.shtml>

电子邮件：

htqh@cnhtqh.com.cn