

2022年04月22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	中证500	沪深300	棕榈油	螺纹钢
	1755	1731	1494	1074	877
持仓额 (亿元)	中证500	沪深300	铜	螺纹钢	铁矿石
	561	312	163	144	135
成交额变化	纤维板	鸡蛋	豆油	红枣	苯乙烯
	86.47%	71.24%	63.17%	-40.65%	-44.44%
持仓额变化	铅	花生	铜	棉纱	燃料油
	10.04%	6.58%	5.38%	-8.77%	-10.16%
涨跌幅	纤维板	低硫燃料油	镍	花生	苹果
	1.85%	1.45%	1.33%	-2.76%	-2.82%
振幅	LPG	原油	焦炭	铁矿石	燃料油
	4.10%	4.09%	4.06%	4.04%	3.87%
板块成交额 (亿元)	股指期货	化工	油脂油料	能源	煤焦钢矿
	3790	3758	3038	2438	2322
板块持仓额 (亿元)	股指期货	煤焦钢矿	化工	有色	油脂油料
	982	431	391	346	317
板块成交额 变化	谷物	贵金属	国债期货	煤焦钢矿	股指期货
	49.63%	36.27%	32.12%	-0.50%	-7.98%
板块持仓额 变化	贵金属	有色	国债期货	能源	煤焦钢矿
	3.15%	2.66%	1.67%	-2.41%	-2.47%

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，交易应重点关注原油、棕榈油、铁矿石、中证500和沪深300等品种。

相关研究

《大宗商品基差与利润跟踪日报》

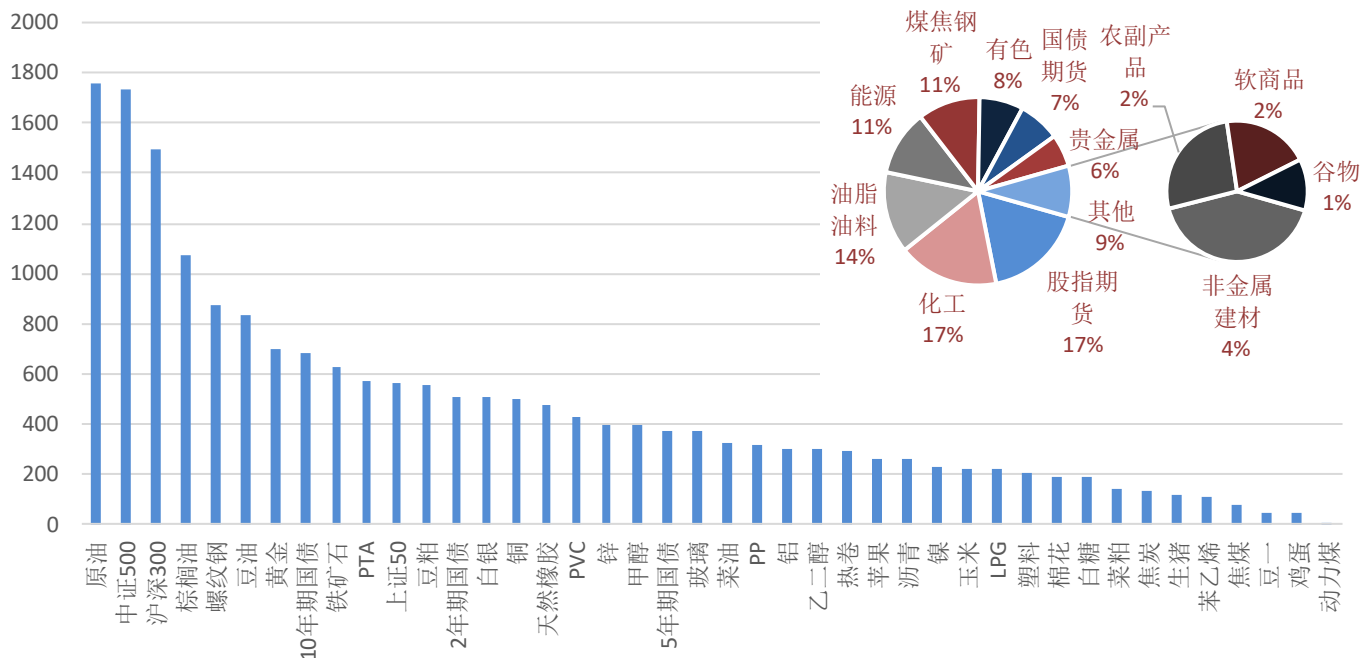
《期货合约价差跟踪》

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）

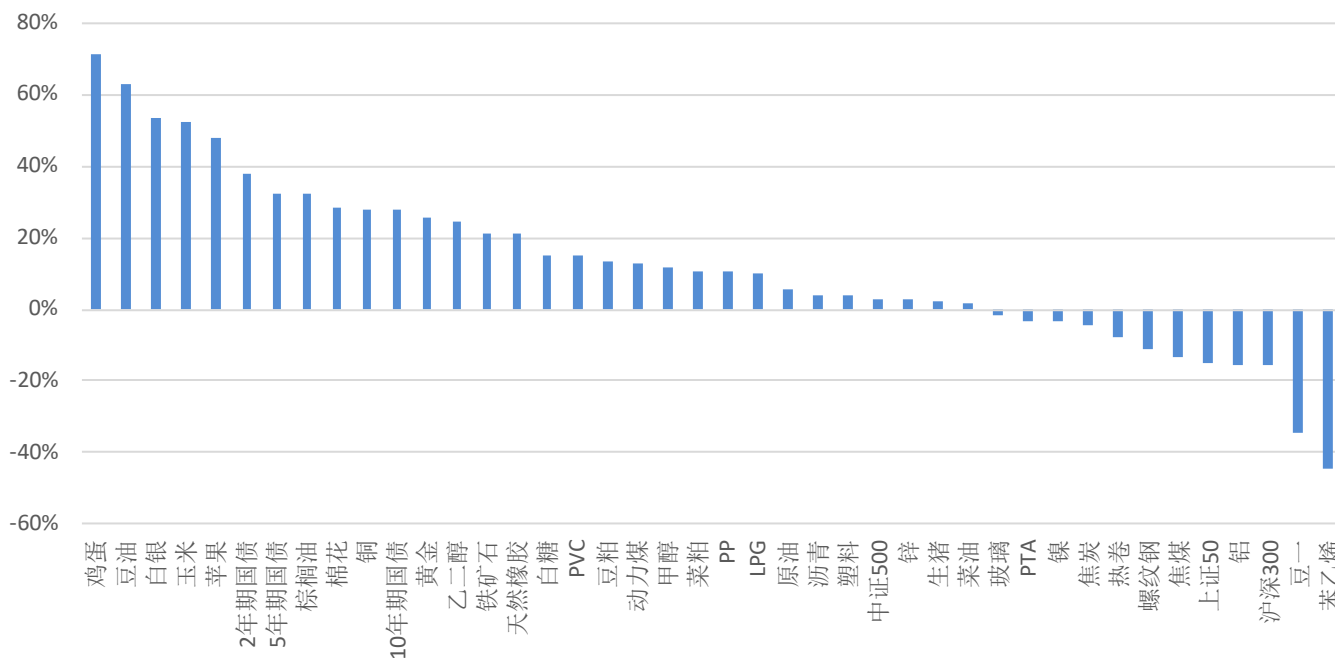
一、主要品种和板块的当日成交额和资金存量

图 1：主要品种和板块当日成交额（亿元）



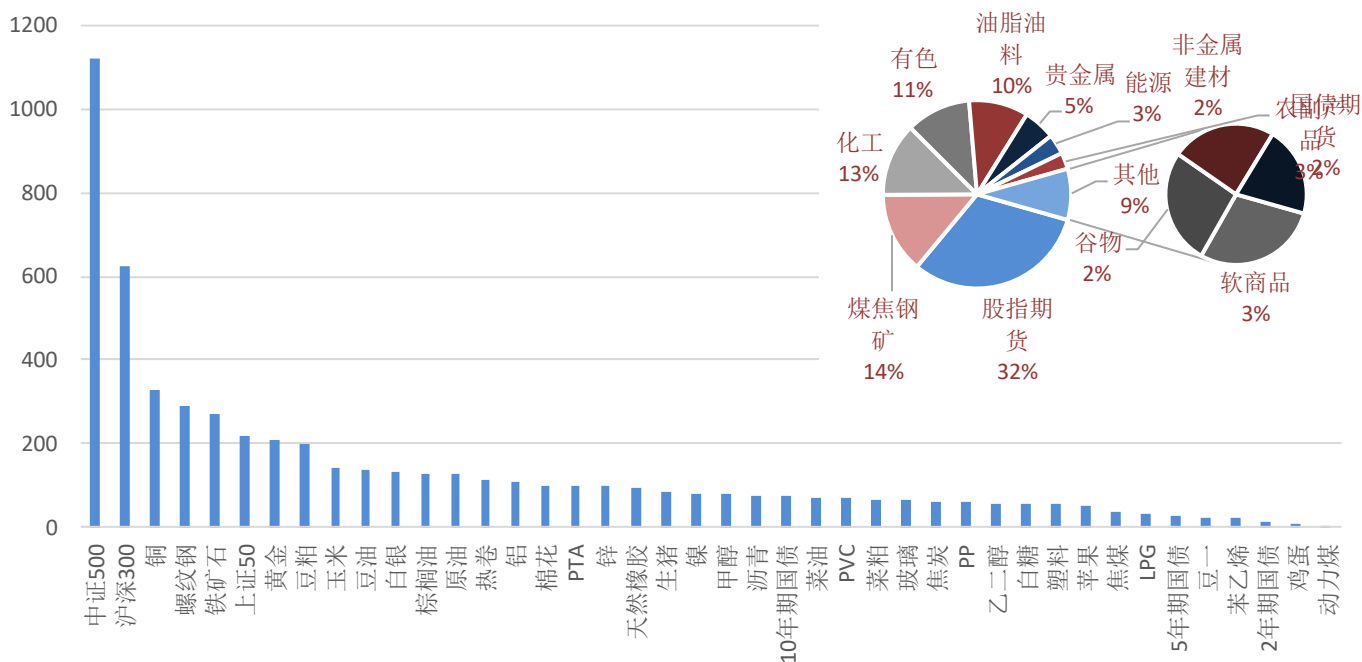
资料来源：WIND、恒泰期货

图 2：主要品种当日成交额增长率



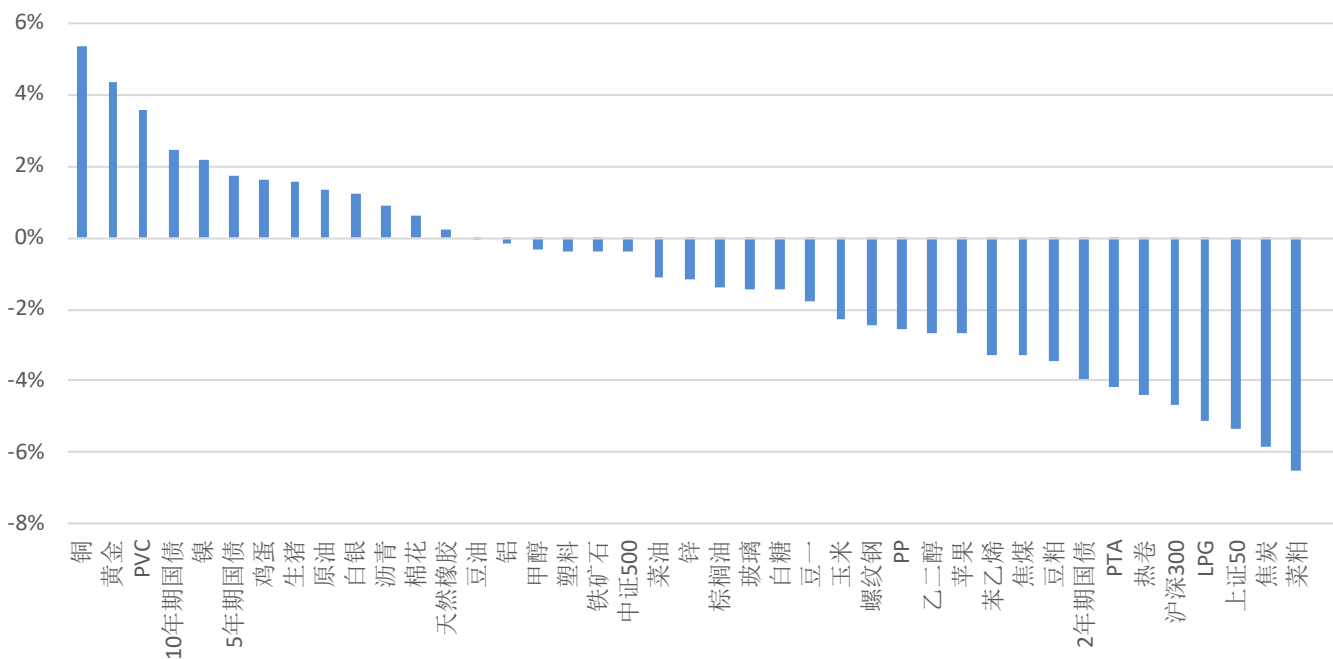
资料来源：WIND、恒泰期货

图 3：主要品种和板块的当日存量资金（亿元）



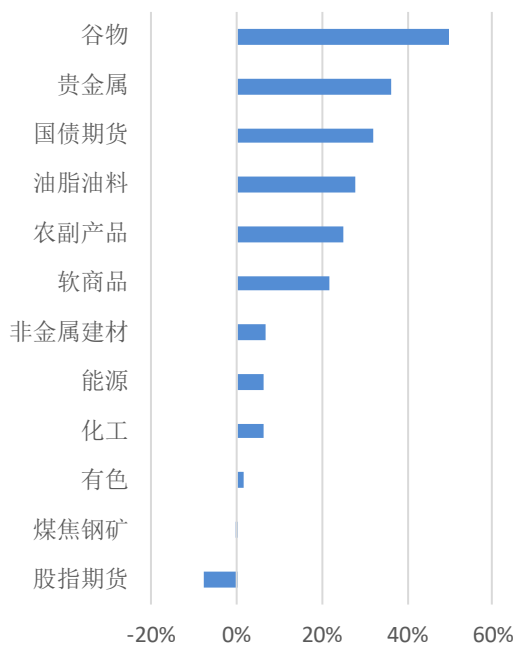
资料来源：WIND、恒泰期货

图 4：主要品种当日存量资金增长率



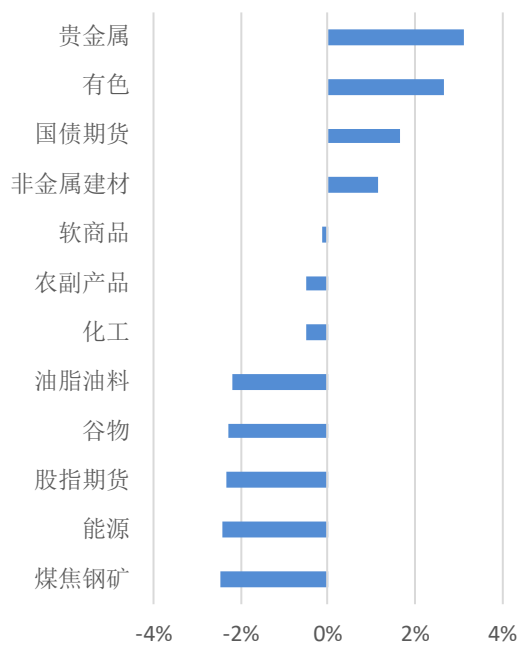
资料来源：WIND、恒泰期货

图 5：板块当日成交额增长率



资料来源：WIND、恒泰期货

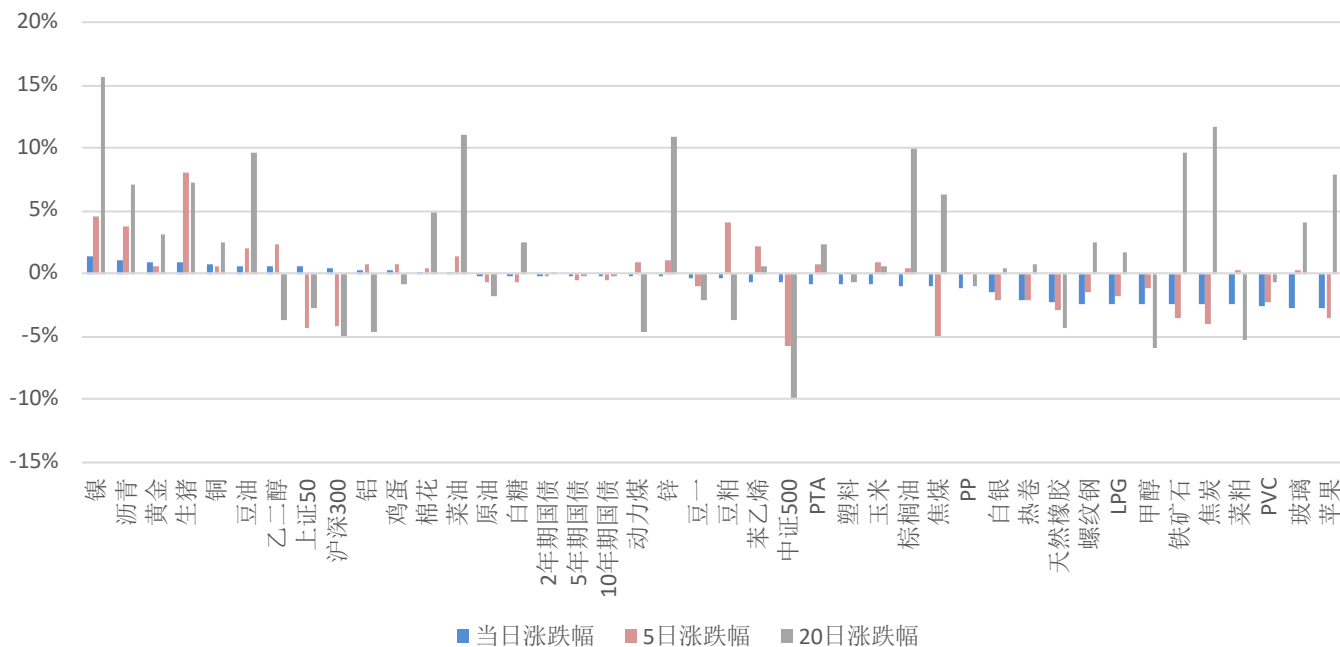
图 6：板块当日存量资金增长率



资料来源：WIND、恒泰期货

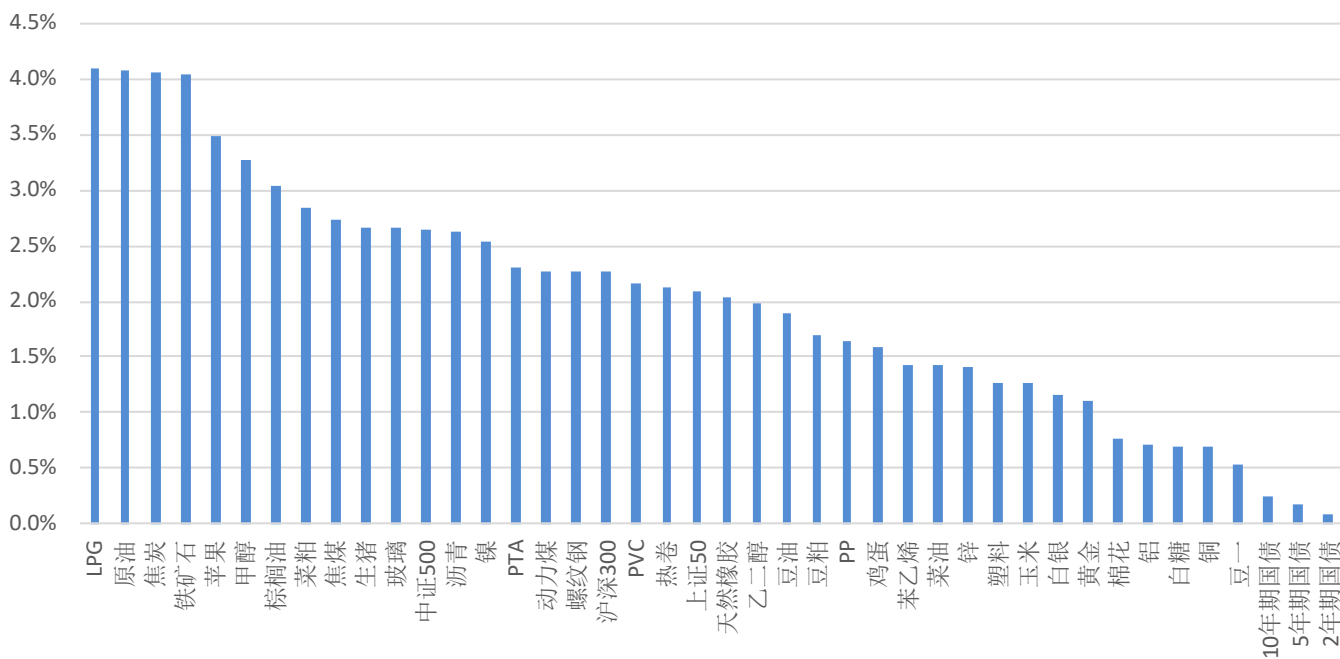
二、主要品种涨跌幅、振幅

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

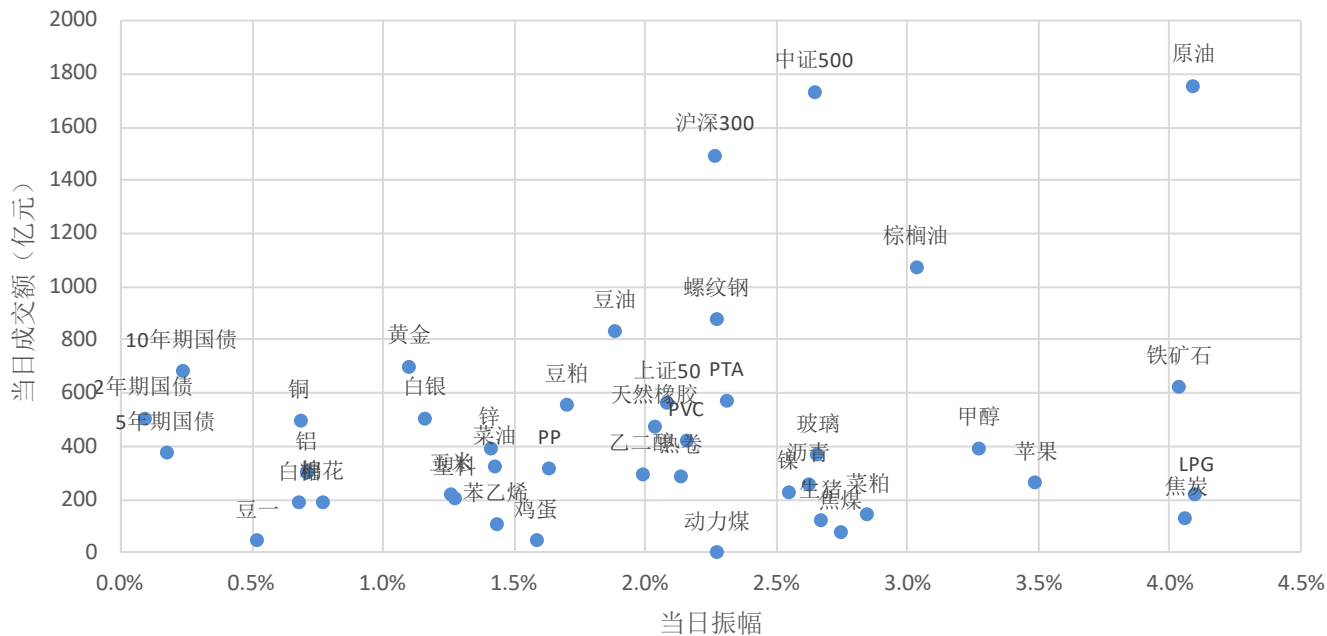
图 8：主要品种当日振幅



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	3970	4043.6	3953	4011.8	0.44%	-6525(-6.88%)	88262	86195
	上证50	IH2205.CFE	2778.4	2831	2772.6	2815.2	0.50%	-4381(-10.32%)	38072	39879
	中证500	IC2205.CFE	5693	5765.6	5614.4	5686.6	-0.75%	-646(-0.60%)	107542	83917
国债期货	5年期国债	TF2206.CFE	101.47	101.48	101.305	101.345	-0.13%	+1773(+1.85%)	97615	35651
	10年期国债	T2206.CFE	100.215	100.25	100.015	100.1	-0.15%	+3936(+2.42%)	166691	63673
	2年期国债	TS2206.CFE	101.205	101.215	101.125	101.145	-0.06%	-2286(-4.97%)	43694	24348
有色	铜	CU2205.SHF	74800	75200	74690	75010	0.73%	-3876(-3.07%)	122400	58874
	铝	AL2206.SHF	21950	21980	21825	21920	0.30%	+2462(+1.35%)	185101	172978
	锌	ZN2206.SHF	28515	28740	28340	28445	-0.26%	+63004(+84.09%)	137931	165511
	铅	PB2206.SHF	15630	15780	15630	15725	0.80%	+10782(+22.37%)	58976	54952
	镍	NI2205.SHF	235930	241800	235790	238580	1.33%	-1440(-3.07%)	45477	67395
	锡	SN2205.SHF	337660	339460	335400	336300	-0.40%	-1871(-8.21%)	20915	18039
	国际铜	BC2206.INE	66990	67340	66780	67120	0.89%	-587(-5.92%)	9322	10533
贵金属	黄金	AU2206.SHF	404.16	407.16	402.7	406.8	0.84%	+6571(+4.62%)	148913	125149
	白银	AG2206.SHF	5130	5138	5078	5098	-1.47%	+6224(+1.44%)	437389	537970
煤焦钢矿	螺纹钢	RB2210.SHF	5065	5078	4963	4964	-2.38%	-17014(-0.96%)	1749223	1591861
	热卷	HC2210.SHF	5162	5178	5068	5074	-2.12%	-5510(-0.81%)	672131	462829
	不锈钢	SS2205.SHF	19970	20365	19900	20040	0.60%	-5640(-15.28%)	31281	54229
	焦炭	J2209.DCE	3970	3971	3810	3830	-2.52%	-768(-2.74%)	27293	30480
	焦煤	JM2209.DCE	3046	3074.5	2990.5	3000.5	-1.06%	+362(+1.00%)	36708	39659
	铁矿石	I2209.DCE	904	912.5	876	881	-2.44%	+18234(+2.94%)	637898	544269
	硅铁	SF209.CZC	10972	10996	10758	10894	-0.98%	-10648(-7.39%)	133397	166601
	锰硅	SM209.CZC	8926	8956	8850	8912	-0.40%	-9565(-6.63%)	134795	116642
能源	燃料油	FU2209.SHF	4096	4139	3979	4006	-1.38%	-32785(-10.27%)	286323	986891
	原油	SC2206.INE	675.8	693.4	665.5	674	-0.01%	-97(-0.30%)	32082	233243
	低硫燃料油	LU2207.INE	5133	5256	5077	5167	1.45%	+876(+2.50%)	35882	67027
	LPG	PG2206.DCE	6244	6244	5988	6020	-2.38%	+318(+0.52%)	61807	139781
	动力煤	ZC205.CZC	811.2	830	811.2	822	-0.22%	-101(-9.27%)	989	194
化工	沥青	BU2206.SHF	3929	4028	3924	3971	1.07%	-6537(-2.09%)	306006	523313
	天然橡胶	RU2209.SHF	13270	13280	13010	13015	-2.36%	+11790(+4.92%)	251378	307004
	纸浆	SP2209.SHF	7286	7340	7252	7300	0.91%	+1722(+0.92%)	189017	256952
	20号胶	NR2206.INE	11195	11195	10935	10960	-1.62%	+1130(+2.98%)	39108	29770
	塑料	L2209.DCE	8955	8968	8854	8872	-0.92%	+10838(+4.34%)	260546	321826
	PP	PP2209.DCE	8853	8878	8733	8754	-1.12%	+8838(+3.52%)	259975	492068
	乙二醇	EG2205.DCE	4908	4979	4881	4952	0.53%	-41816(-29.11%)	101855	263805
	苯乙烯	EB2205.DCE	9750	9890	9750	9790	-0.73%	-16673(-34.86%)	31156	84534
	PTA	TA209.CZC	6226	6286	6142	6168	-0.87%	-34642(-3.56%)	939652	1401196
	短纤	PF206.CZC	7984	8048	7852	7872	-1.77%	-3169(-3.15%)	97528	120204
	甲醇	MA209.CZC	2937	2966	2870	2872	-2.41%	+30010(+3.81%)	818383	1113141
	尿素	UR209.CZC	2825	2838	2802	2818	0.68%	+3447(+3.55%)	100551	59198
	纯碱	SA209.CZC	3096	3136	3053	3106	0.23%	+29981(+5.24%)	602175	1047562
非金属建材	纤维板	FB2205.DCE	1310	1325	1301	1323	1.85%	-284(-11.01%)	2295	5384
	PVC	V2209.DCE	8988	9009	8813	8815	-2.53%	+224650(+259.40%)	311255	614558
	玻璃	FG209.CZC	2062	2068	2013	2016	-2.70%	+5833(+0.93%)	632393	864891

油脂油料	豆粕	M2209. DCE	4102	4139	4069	4075	-0.39%	-18141(-1.29%)	1386512	1019950
	豆油	Y2209. DCE	11016	11166	10958	11072	0.58%	+11872(+2.74%)	444427	629370
	豆一	A2207. DCE	6123	6153	6121	6129	-0.36%	-3621(-3.21%)	109121	52075
	豆二	B2205. DCE	5322	5369	5288	5298	-0.62%	-2606(-12.90%)	17603	30295
	棕榈油	P2209. DCE	11148	11364	11024	11078	-0.97%	-706(-0.24%)	298582	866278
	菜油	OI209. CZC	13440	13612	13420	13468	0.01%	+451(+0.27%)	169608	197960
	菜粕	RM209. CZC	3855	3855	3745	3749	-2.52%	-21405(-6.59%)	303233	235177
	花生	PK210. CZC	9250	9260	9022	9024	-2.76%	+6890(+8.61%)	86886	94669
谷物	玉米	C2209. DCE	3005	3019	2981	2985	-0.93%	-351(-0.03%)	1220843	520642
	粳米	RR2206. DCE	3428	3430	3419	3430	0.18%	-423(-4.36%)	9282	4158
农副产品	玉米淀粉	CS2207. DCE	3450	3455	3412	3421	-0.12%	-6582(-3.04%)	209631	142690
	生猪	LH2209. DCE	17730	18080	17605	18030	0.84%	+2399(+4.95%)	50828	30225
	鸡蛋	JD2209. DCE	4803	4832	4756	4817	0.29%	+2609(+2.98%)	90235	76910
	苹果	AP210. CZC	8741	8784	8480	8507	-2.82%	-427(-0.28%)	152742	269945
	红枣	CJ209. CZC	12395	12560	12220	12285	-0.12%	-1739(-5.11%)	32293	23425
软商品	白糖	SR209. CZC	6007	6047	6006	6012	-0.07%	-11001(-2.64%)	406475	230765
	棉花	CF209. CZC	21405	21545	21380	21455	0.12%	+7890(+2.67%)	303909	116776
	棉纱	CY205. CZC	27315	27510	27260	27365	0.07%	-345(-18.10%)	1561	1051

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