

2022年04月25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)	沪深300 2000	中证500 1897	棕榈油 1810	原油 1677	螺纹钢 1431
持仓额 (亿元)	中证500 542	沪深300 333	铜 155	螺纹钢 138	铁矿石 122
成交额变化	粳米 228.11%	铝 172.83%	锡 172.52%	动力煤 -23.54%	2年期国债 -30.99%
持仓额变化	锡 13.55%	粳米 12.71%	沪深300 6.58%	焦炭 -13.91%	纸浆 -16.54%
涨跌幅	生猪 3.25%	粳米 0.70%	鸡蛋 0.52%	玻璃 -8.04%	铁矿石 -10.73%
振幅	铁矿石 10.27%	镍 8.92%	棕榈油 8.12%	纯碱 7.86%	玻璃 7.64%
板块成交额 (亿元)	化工 4798	油脂油料 4624	股指期货 4607	煤焦钢矿 3482	有色 3398
板块持仓额 (亿元)	股指期货 990	煤焦钢矿 402	化工 373	有色 334	油脂油料 304
板块成交额 变化	有色 107.30%	软商品 82.60%	油脂油料 52.20%	能源 -4.16%	国债期货 -9.02%
板块持仓额 变化	股指期货 0.80%	贵金属 -2.58%	国债期货 -2.77%	煤焦钢矿 -6.85%	能源 -9.10%

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，交易应重点关注棕榈油、铁矿石、原油、中证500和豆油等品种。

### 相关研究

《大宗商品基差与利润跟踪日报》

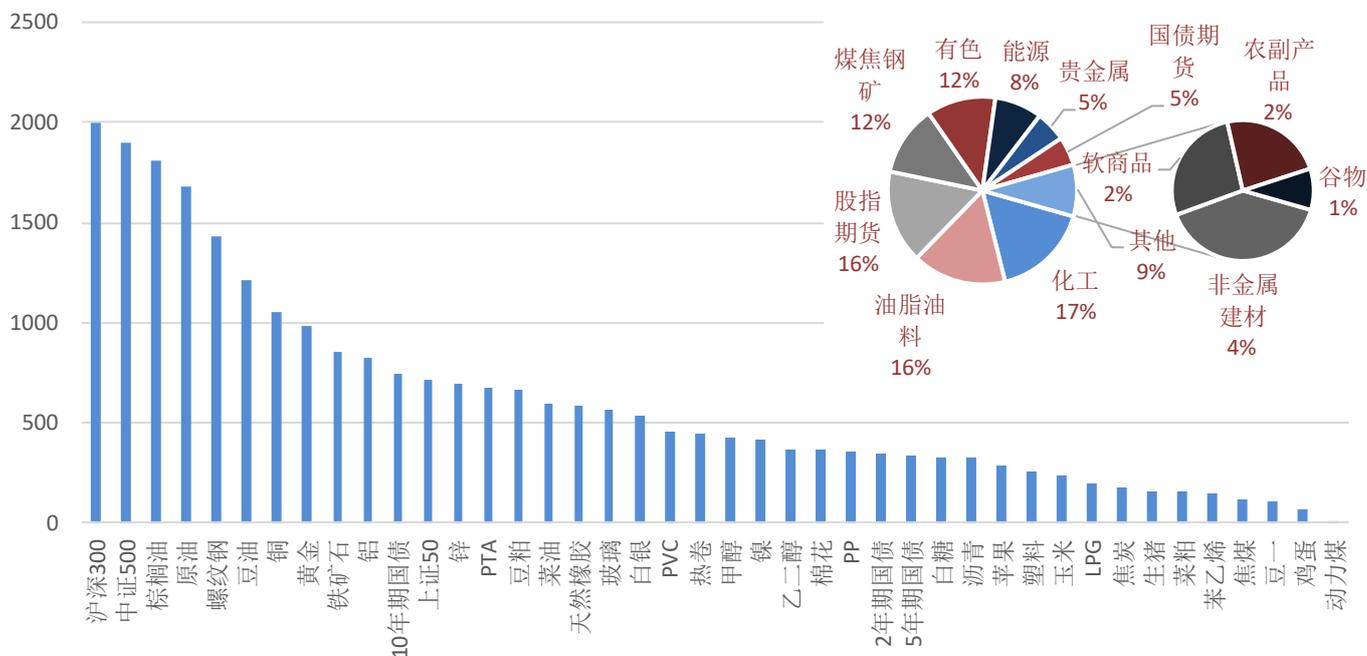
《期货合约价差跟踪》

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）

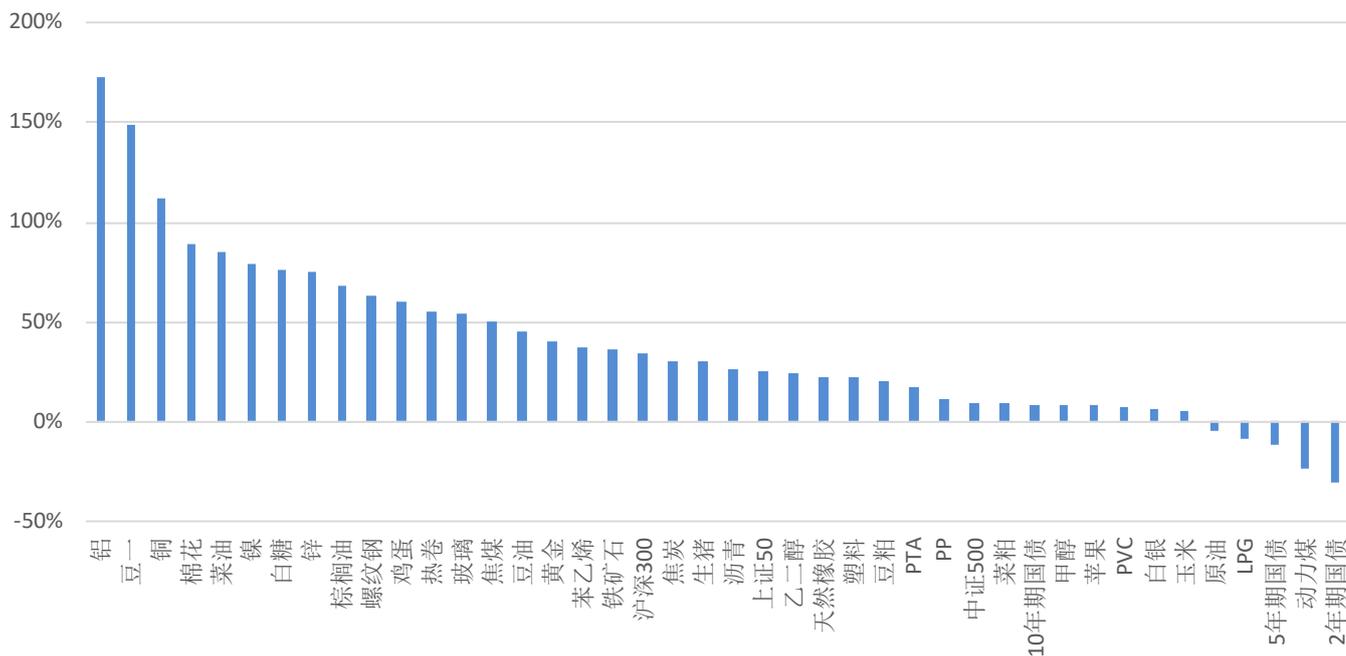
一、主要品种和板块的当日成交额和资金存量

图 1：主要品种和板块当日成交额（亿元）



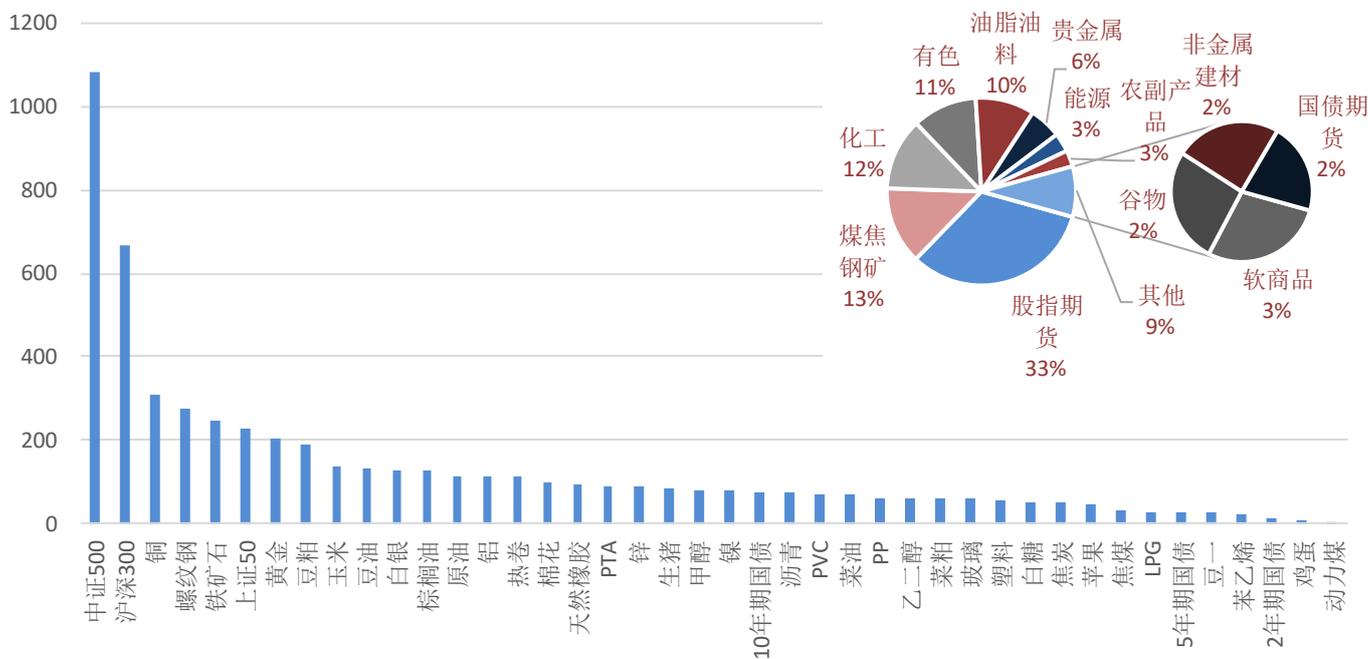
资料来源：WIND、恒泰期货

图 2：主要品种当日成交额增长率



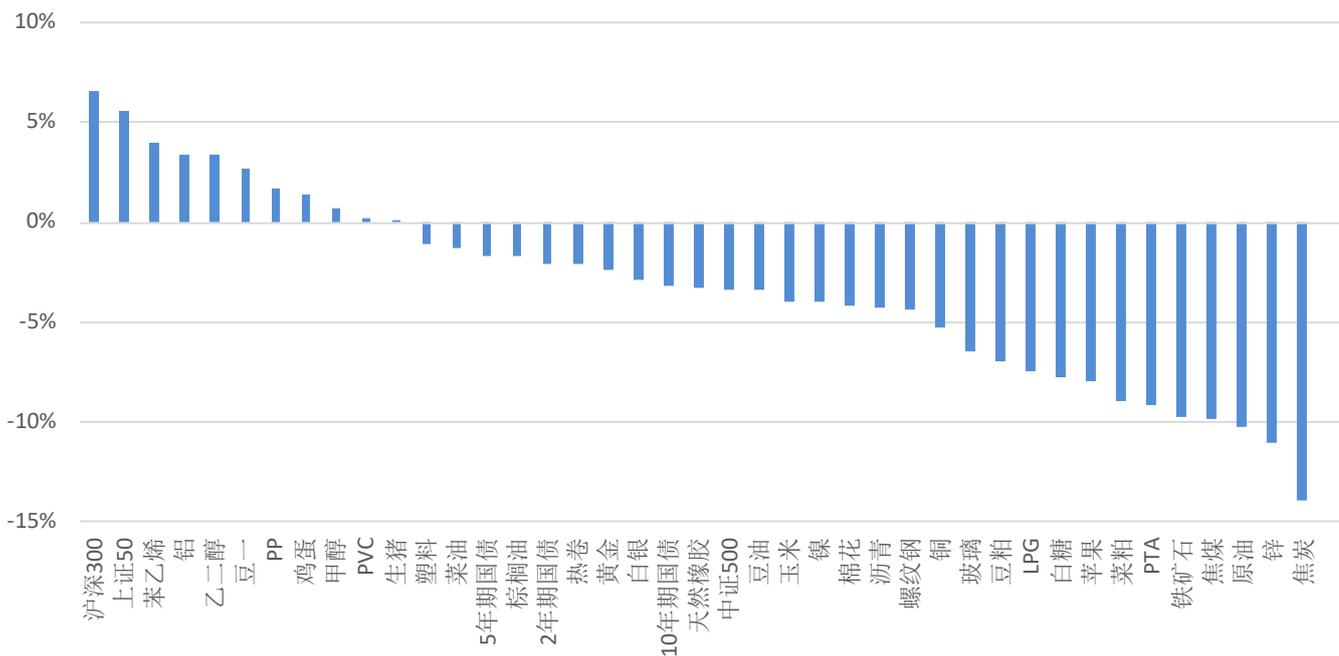
资料来源：WIND、恒泰期货

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

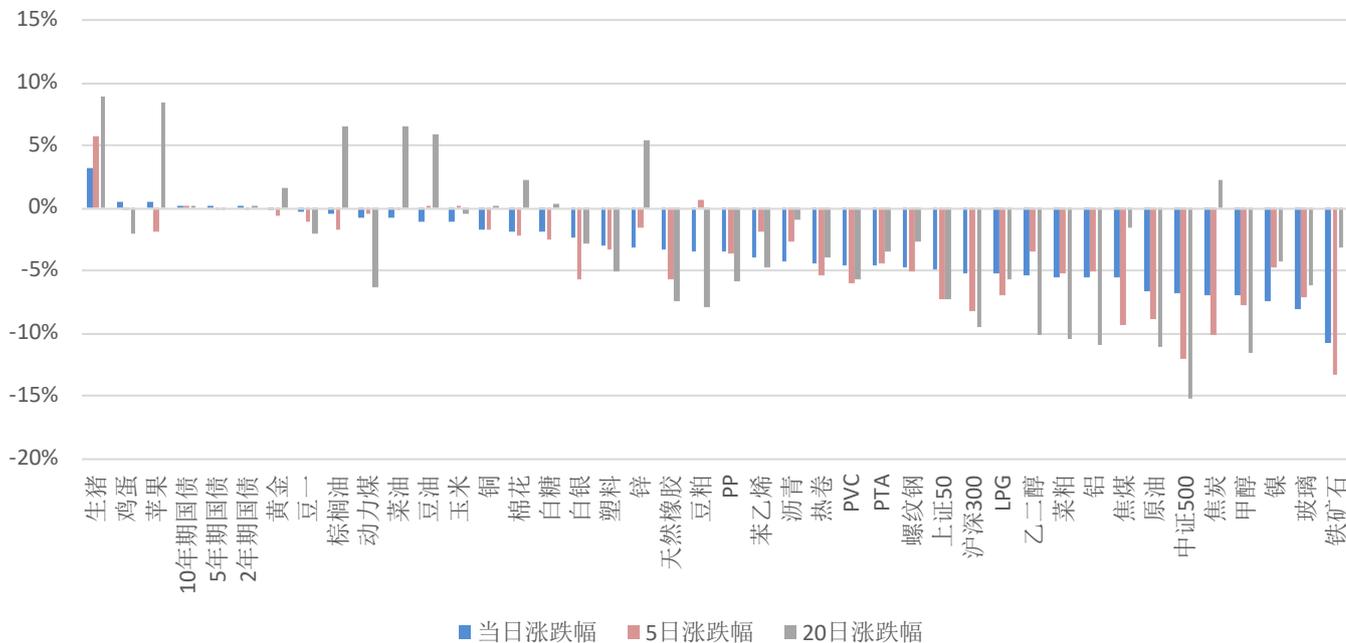
图 6：板块当日存量资金增长率



资料来源：WIND、恒泰期货

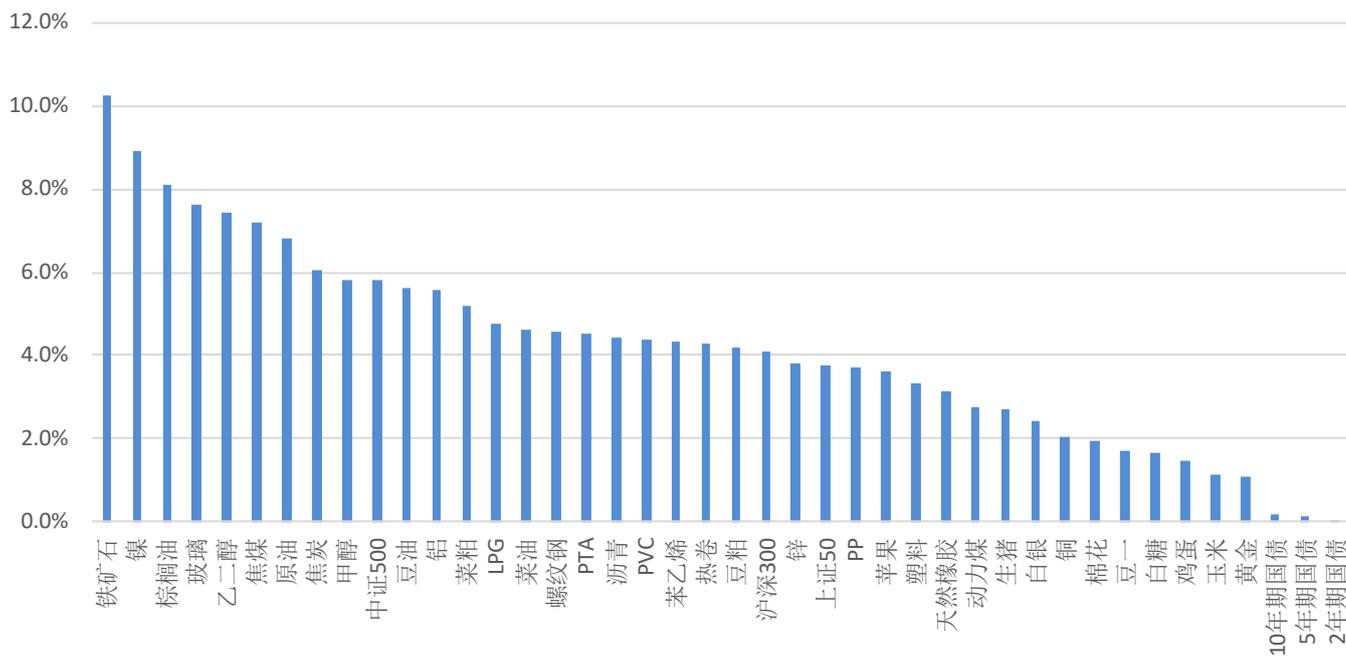
## 二、主要品种涨跌幅、振幅

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

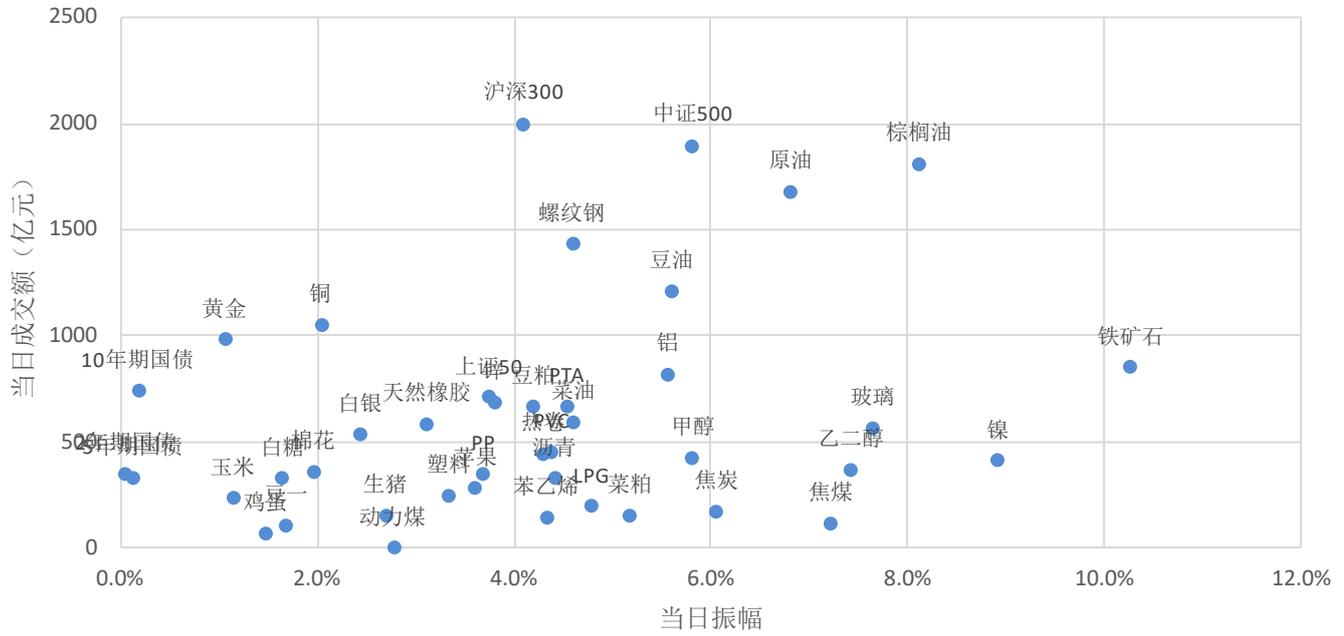
图 8：主要品种当日振幅



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	3933.4	3964.4	3800	3809.8	-5.19%	+13371(+15.15%)	101633	113887
	上证50	IH2205.CFE	2752.6	2781	2675.6	2679.2	-4.92%	+7907(+20.77%)	45979	53887
	中证500	IC2205.CFE	5561.8	5616.8	5286	5316.8	-6.79%	+7190(+6.69%)	114732	101696
国债期货	5年期国债	TF2206.CFE	101.41	101.51	101.38	101.455	0.11%	-2204(-2.26%)	95411	30773
	10年期国债	T2206.CFE	100.18	100.355	100.18	100.33	0.25%	-7344(-4.41%)	159347	66516
	2年期国债	TS2206.CFE	101.175	101.21	101.16	101.195	0.06%	-1276(-2.92%)	42418	16181
有色	铜	CU2205.SHF	74900	75190	73660	73660	-1.68%	-24735(-20.21%)	97665	107455
	铝	AL2206.SHF	21880	21880	20660	20700	-5.48%	+24881(+13.44%)	209982	500370
	锌	ZN2206.SHF	28560	28720	27640	27650	-3.20%	-8745(-6.34%)	129186	327407
	铅	PB2206.SHF	15800	15830	15580	15650	-0.45%	+1225(+2.08%)	60201	68495
	镍	NI2205.SHF	240000	240190	218900	221030	-7.47%	-3914(-8.61%)	41563	120963
	锡	SN2205.SHF	333500	335430	323080	326330	-3.15%	+1109(+5.30%)	22024	38948
	国际铜	BC2206.INE	67170	67420	65550	65650	-2.10%	-793(-8.51%)	8529	15853
贵金属	黄金	AU2206.SHF	405.66	407.78	403.48	404.42	-0.08%	-8804(-5.91%)	140109	181631
	白银	AG2206.SHF	5066	5094	4970	4985	-2.31%	-13860(-3.17%)	423529	567717
煤焦钢矿	螺纹钢	RB2210.SHF	4960	4991	4763	4778	-4.73%	-29(-0.00%)	1749194	2661872
	热卷	HC2210.SHF	5070	5091	4873	4889	-4.46%	+22361(+3.33%)	694492	759890
	不锈钢	SS2205.SHF	20140	20140	19020	19060	-5.34%	-5779(-18.47%)	25502	51943
	焦炭	J2209.DCE	3820	3835	3603	3617	-6.98%	-769(-2.82%)	26524	39197
	焦煤	JM2209.DCE	2979.5	3023.5	2807	2860	-5.58%	+443(+1.21%)	37151	61055
	铁矿石	I2209.DCE	877.5	883	792.5	794.5	-10.73%	-24601(-3.86%)	613297	826438
	硅铁	SF209.CZC	10600	10600	10080	10122	-6.97%	-8564(-6.42%)	124833	251297
	锰硅	SM209.CZC	8790	8792	8468	8472	-4.79%	-3547(-2.63%)	131248	255054
能源	燃料油	FU2209.SHF	4016	4086	3868	3873	-4.65%	-7931(-2.77%)	278392	995448
	原油	SC2206.INE	676	677	631.1	635.2	-6.71%	-1205(-3.76%)	30877	225190
	低硫燃料油	LU2207.INE	5180	5204	4938	4968	-3.61%	-1563(-4.36%)	34319	70074
	LPG	PG2206.DCE	6030	6049	5761	5799	-5.26%	-475(-0.77%)	61332	140726
	动力煤	ZC205.CZC	804.2	825	802.2	815	-0.75%	-75(-7.58%)	914	135
化工	沥青	BU2206.SHF	3971	3985	3810	3812	-4.22%	-24502(-8.01%)	281504	614029
	天然橡胶	RU2209.SHF	13015	13060	12655	12665	-3.36%	-2728(-1.09%)	248650	381415
	纸浆	SP2209.SHF	7320	7328	6850	6874	-5.76%	-33991(-17.98%)	155026	433146
	20号胶	NR2206.INE	11000	11020	10700	10710	-2.64%	-1041(-2.66%)	38067	35569
	塑料	L2209.DCE	8888	8899	8603	8644	-2.93%	+13931(+5.35%)	274477	435171
	PP	PP2209.DCE	8730	8778	8455	8492	-3.48%	+39108(+15.04%)	299083	607833
	乙二醇	EG2205.DCE	4972	5005	4637	4672	-5.37%	-35112(-34.47%)	66743	235080
	苯乙烯	EB2206.DCE	9755	9800	9376	9413	-3.97%	+115913(+372.04%)	147069	238696
	PTA	TA209.CZC	6180	6202	5922	5930	-4.54%	-77733(-8.27%)	861919	1662825
	短纤	PF206.CZC	7872	7940	7616	7634	-3.83%	-5062(-5.19%)	92466	131189
	甲醇	MA209.CZC	2857	2881	2714	2714	-7.02%	+95159(+11.63%)	913542	1289256
	尿素	UR209.CZC	2798	2874	2771	2790	-0.92%	+1465(+1.46%)	102016	151944
	纯碱	SA209.CZC	3104	3117	2873	2893	-6.77%	-45359(-7.53%)	556816	1557415
非金属建材	纤维板	FB2205.DCE	1326	1369	1310	1318	0.42%	-314(-13.68%)	1981	8685
	PVC	V2209.DCE	8828	8875	8489	8500	-4.54%	+37229(+11.96%)	348484	739185
	玻璃	FG209.CZC	2005	2029	1875	1875	-8.04%	-5037(-0.80%)	627356	1390904

油脂油料	豆粕	M2209. DCE	4100	4118	3947	3956	-3.44%	-70663(-5.10%)	1315849	1301465
	豆油	Y2209. DCE	11360	11556	10936	10942	-1.08%	-23595(-5.31%)	420832	904360
	豆一	A2207. DCE	6129	6192	6089	6120	-0.28%	+3294(+3.02%)	112415	125316
	豆二	B2205. DCE	5408	5446	5189	5192	-2.59%	-4589(-26.07%)	13014	41465
	棕榈油	P2209. DCE	11500	12008	11108	11136	-0.45%	-9576(-3.21%)	289006	1391734
	菜油	OI209. CZC	13750	14010	13390	13410	-0.77%	-4136(-2.44%)	165472	374315
	菜粕	RM209. CZC	3767	3785	3591	3597	-5.47%	-21569(-7.11%)	281664	249376
	花生	PK210. CZC	9010	9110	8970	9030	-1.03%	-1107(-1.27%)	85779	85109
谷物	玉米	C2209. DCE	3000	3000	2966	2967	-1.10%	-13105(-1.07%)	1207738	532304
	粳米	RR2206. DCE	3434	3474	3426	3447	0.70%	+840(+9.05%)	10122	16168
农副产品	玉米淀粉	CS2207. DCE	3421	3440	3364	3372	-1.86%	-8400(-4.01%)	201231	157125
	生猪	LH2209. DCE	18500	18680	18195	18430	3.25%	+227(+0.45%)	51055	35802
	鸡蛋	JD2209. DCE	4835	4876	4805	4825	0.52%	+2652(+2.94%)	92887	113470
	苹果	AP210. CZC	8470	8722	8415	8642	0.43%	-9970(-6.53%)	142772	286162
	红枣	CJ209. CZC	12240	12560	11975	12100	-2.34%	-1055(-3.27%)	31238	22623
软商品	白糖	SR209. CZC	5990	5993	5894	5909	-1.96%	-26277(-6.46%)	380198	408460
	棉花	CF209. CZC	21450	21500	21080	21085	-1.82%	-5037(-1.66%)	298872	251034
	棉纱	CY205. CZC	27435	27470	26650	26650	-2.79%	-79(-5.06%)	1482	1787

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