

2022 年 04 月 26 日

恒泰期货研究所

量化统计日报

【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)	中证500 2033	沪深300 1922	原油 1573	棕榈油 1140	螺纹钢 964
持仓额 (亿元)	中证500 530	沪深300 317	铜 149	螺纹钢 135	铁矿石 116
成交额变化	尿素 45.99%	动力煤 37.92%	低硫燃料油 31.15%	硅铁 -44.56%	锰硅 -53.07%
持仓额变化	甲醇 29.16%	尿素 19.91%	苹果 8.35%	燃料油 -11.26%	豆二 -14.42%
涨跌幅	苹果 5.83%	尿素 4.49%	普麦 3.81%	乙二醇 -4.91%	玻璃 -5.37%
振幅	沥青 6.40%	苹果 6.39%	焦煤 6.33%	铁矿石 5.48%	强麦 5.22%
板块成交额 (亿元)	股指期货 4650	化工 4165	油脂油料 2992	有色 2613	煤焦钢矿 2374
板块持仓额 (亿元)	股指期货 955	煤焦钢矿 385	化工 381	有色 318	油脂油料 297
板块成交额 变化	股指期货 0.94%	农副产品 -1.04%	能源 -5.94%	软商品 -35.15%	油脂油料 -35.30%
板块持仓额 变化	化工 2.10%	谷物 1.00%	农副产品 0.99%	有色 -4.65%	能源 -9.61%

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，交易应重点关注中证 500、棕榈油、原油、铁矿石和沥青等品种。

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、

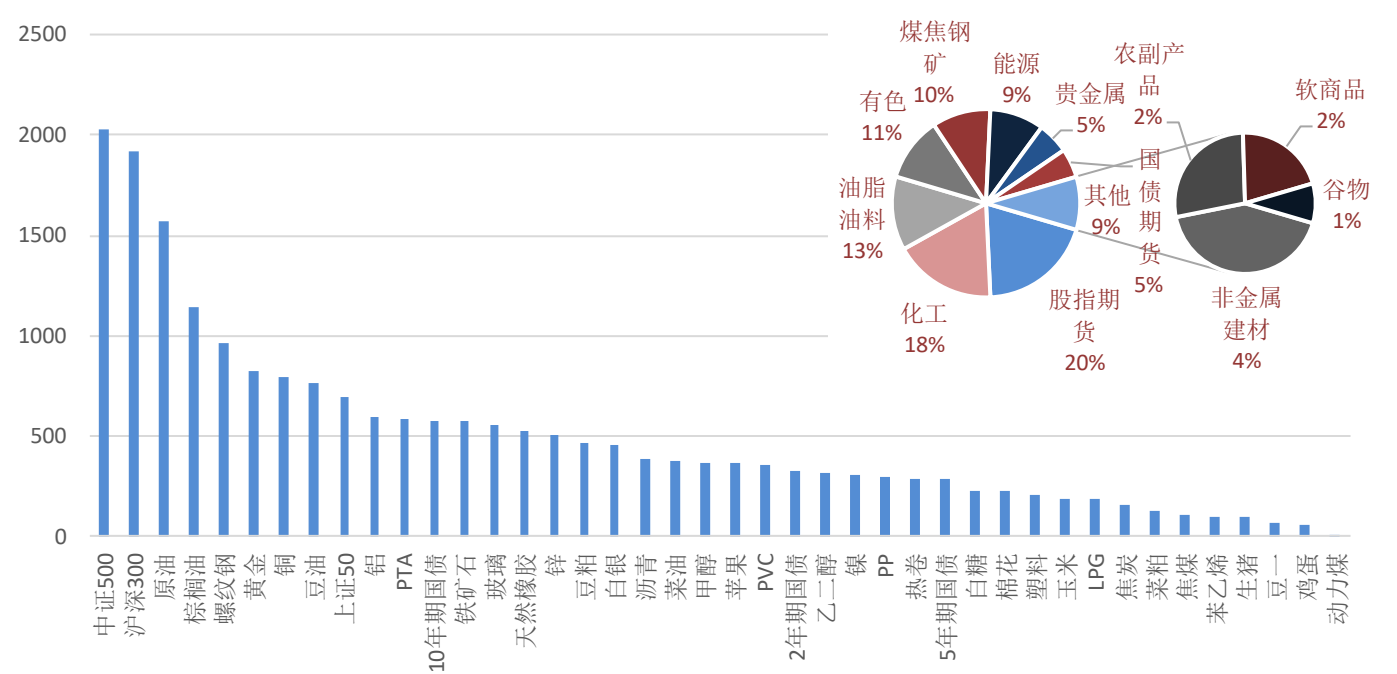
主要品种当日振幅（图 8）
- 8、

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）

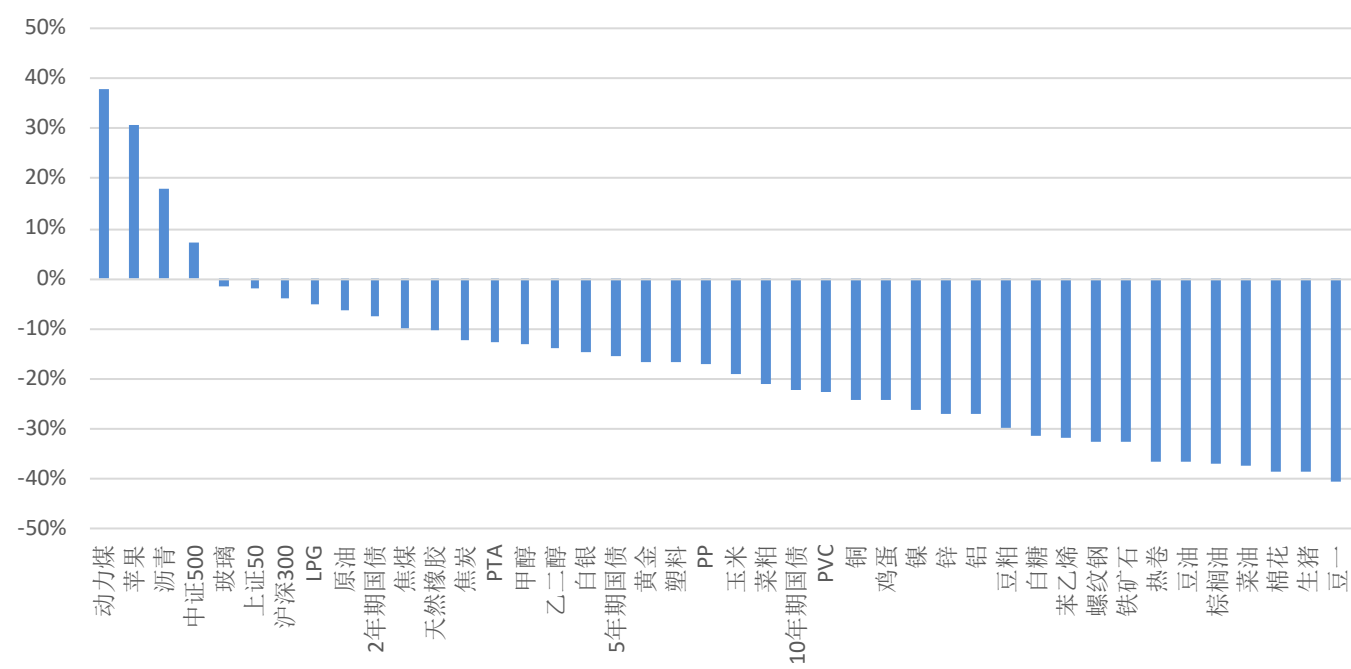
一、主要品种和板块的当日成交额和资金存量

图 1：主要品种和板块当日成交额（亿元）



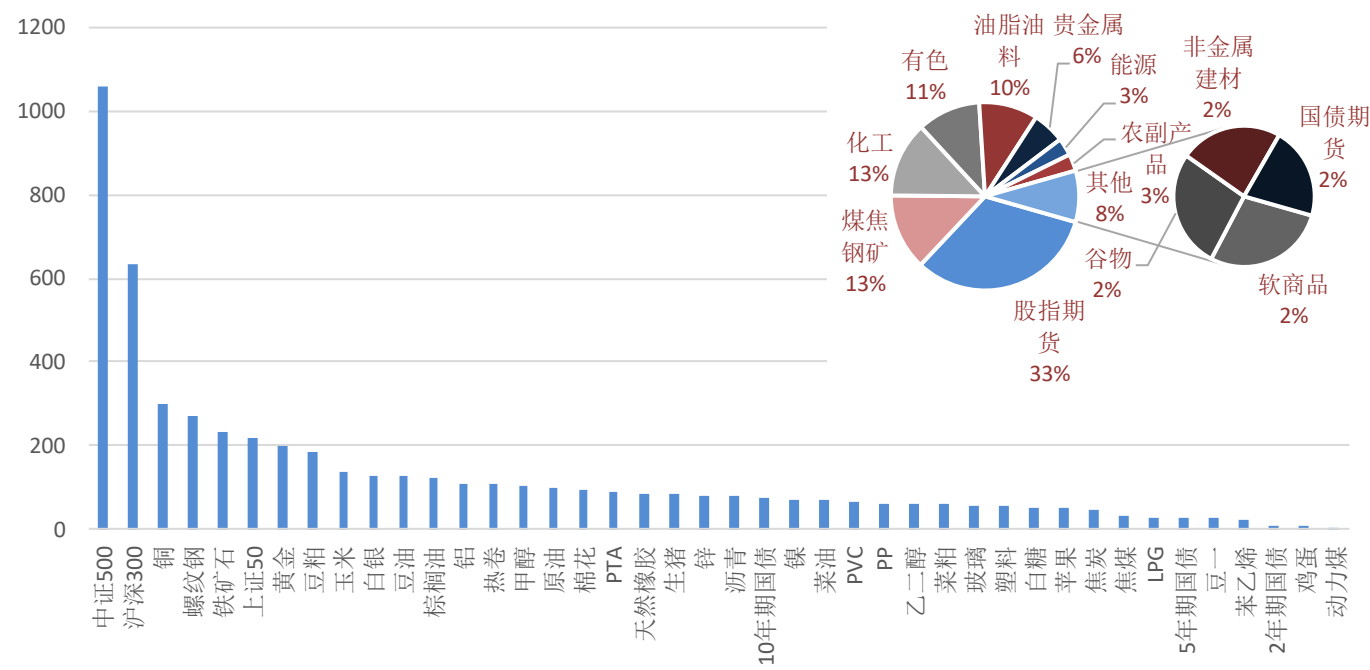
资料来源：WIND、恒泰期货

图 2：主要品种当日成交额增长率



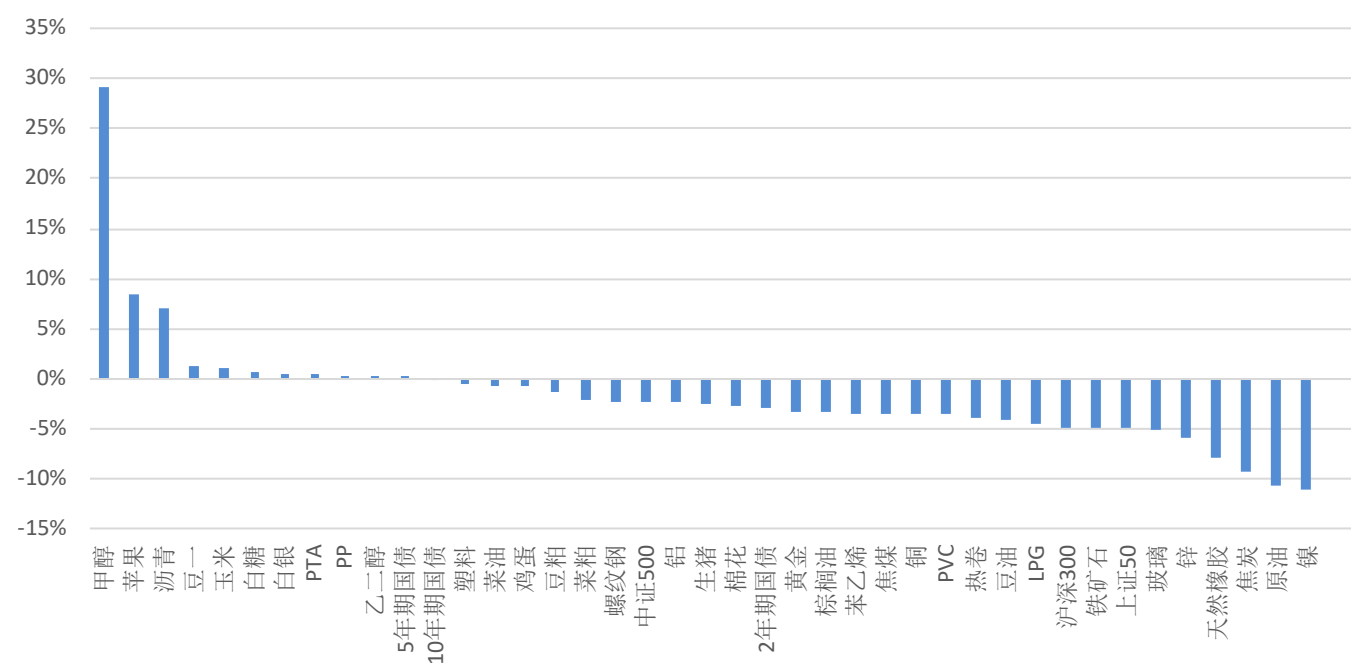
资料来源：WIND、恒泰期货

图 3：主要品种和板块的当日存量资金（亿元）



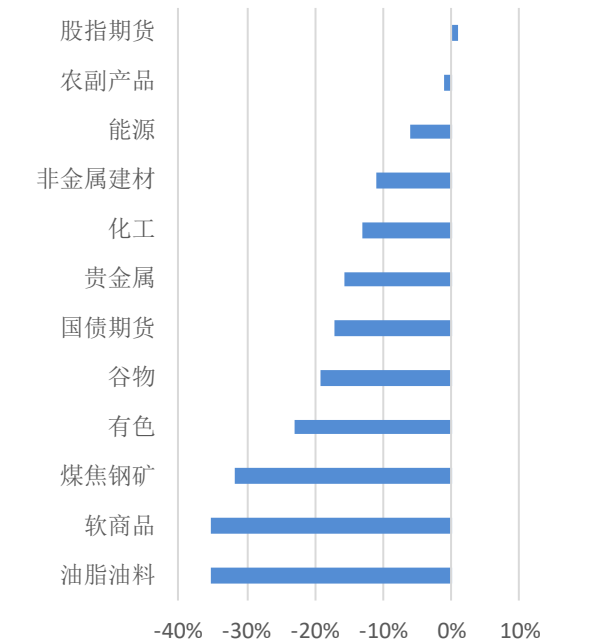
资料来源：WIND、恒泰期货

图 4：主要品种当日存量资金增长率



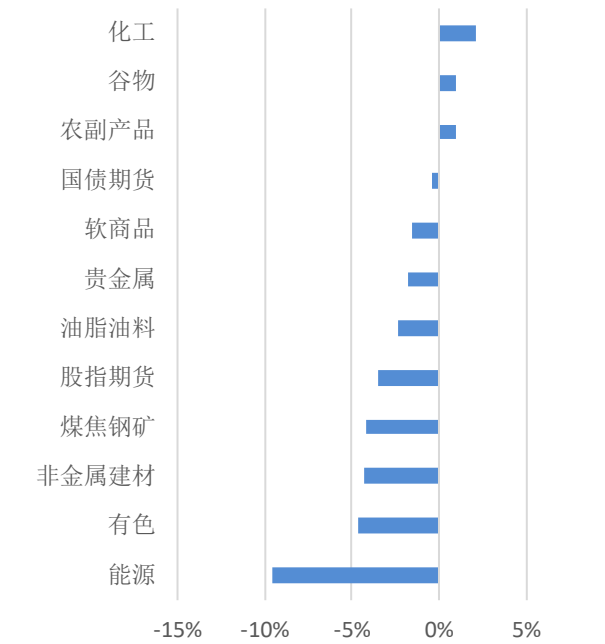
资料来源：WIND、恒泰期货

图 5：板块当日成交额增长率



资料来源：WIND、恒泰期货

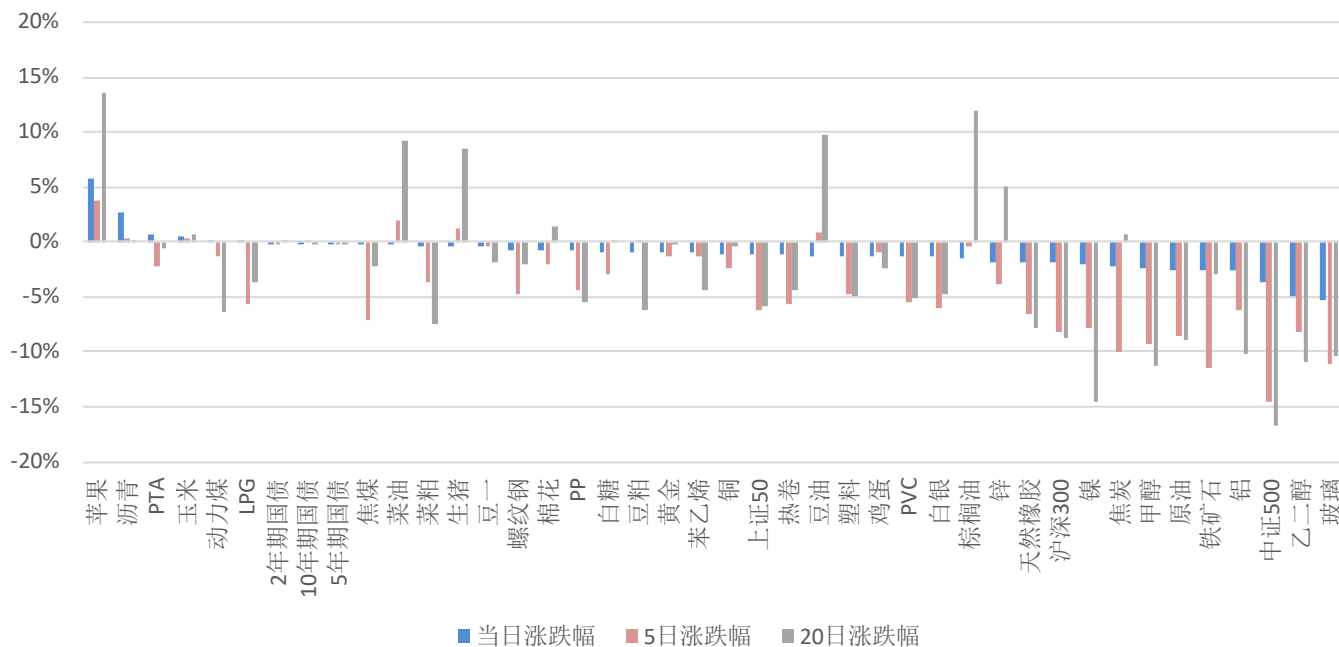
图 6：板块当日存量资金增长率



资料来源：WIND、恒泰期货

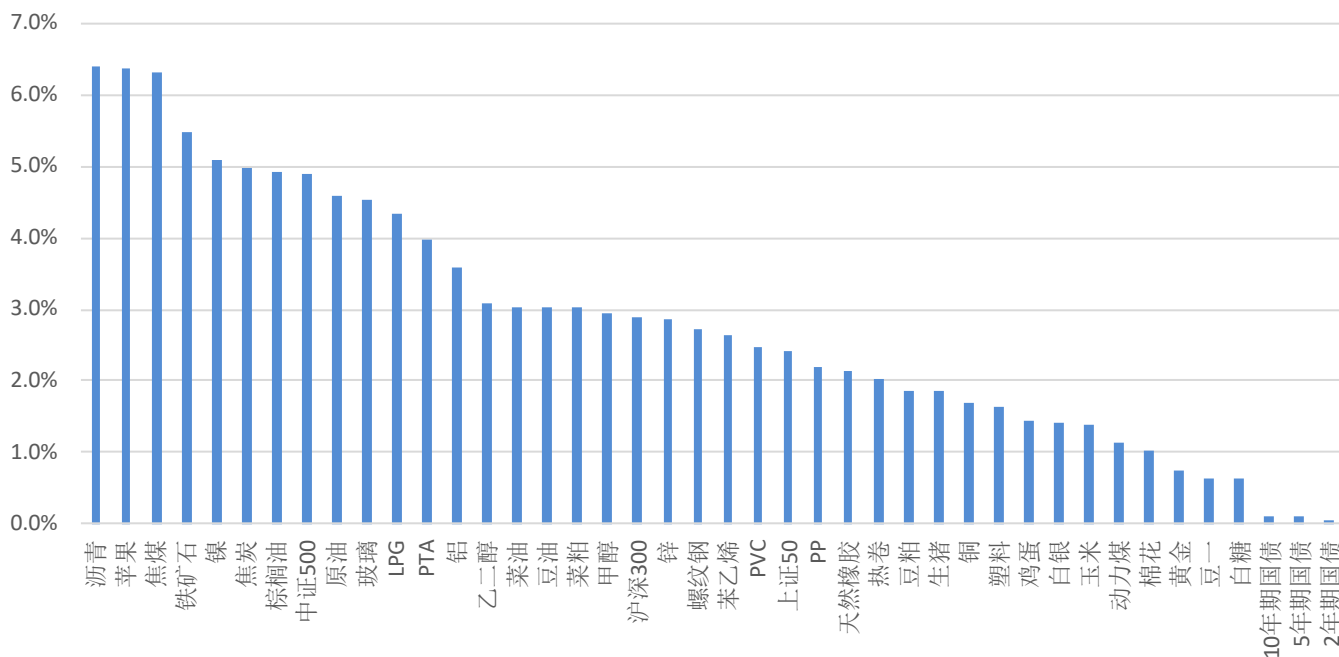
二、主要品种涨跌幅、振幅

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

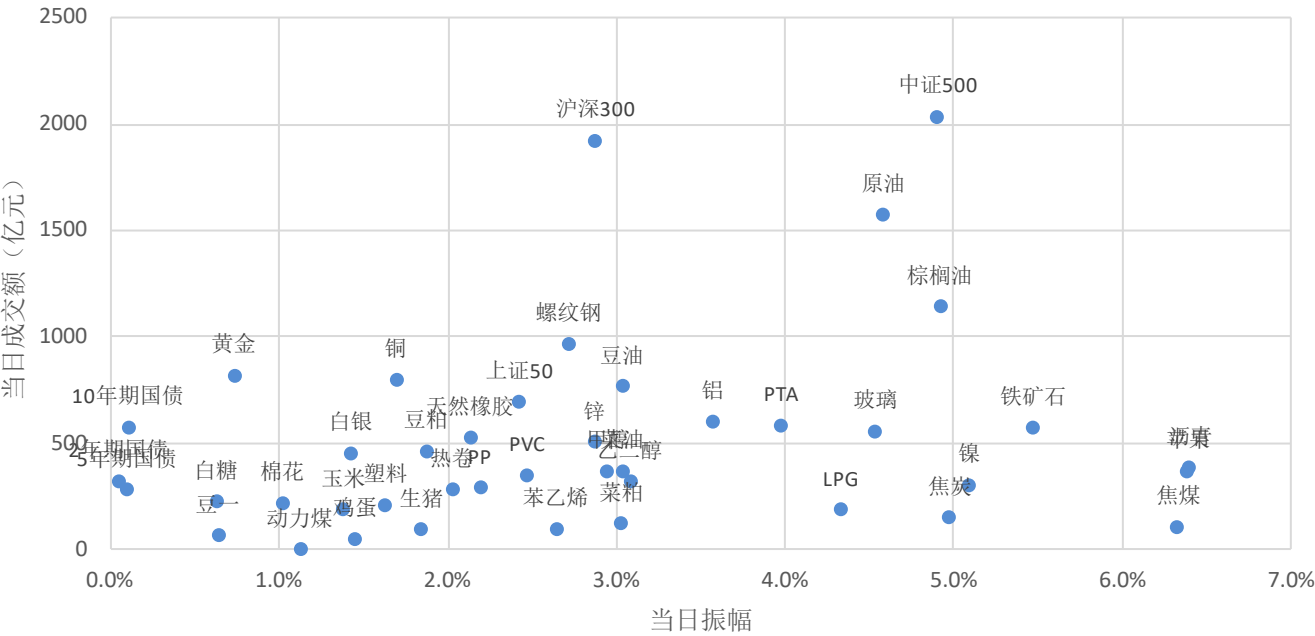
图 8：主要品种当日振幅



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	3832	3881	3771.4	3782	-1.81%	-4478(-4.41%)	97155	114509
	上证50	IH2205.CFE	2689	2735	2670	2681.2	-1.08%	-4046(-8.80%)	41933	52584
	中证500	IC2205.CFE	5338.2	5412	5151.2	5170.8	-3.74%	-100(-0.09%)	114632	110257
国债期货	5年期国债	TF2206.CFE	101.47	101.475	101.375	101.41	-0.02%	-410(-0.43%)	95001	25726
	10年期国债	T2206.CFE	100.325	100.33	100.225	100.275	-0.01%	-3618(-2.27%)	155729	49363
	2年期国债	TS2206.CFE	101.19	101.21	101.16	101.18	-0.01%	-1593(-3.76%)	40825	15080
有色	铜	CU2206.SHF	73170	73750	72500	73260	-1.05%	+51194(+52.42%)	148859	113019
	铝	AL2206.SHF	20600	21035	20295	20715	-2.59%	+1177(+0.56%)	211159	395818
	锌	ZN2206.SHF	27450	27870	27075	27580	-1.76%	-2317(-1.79%)	126869	255720
	铅	PB2206.SHF	15685	15685	15550	15575	-0.89%	-4394(-7.30%)	55807	56247
	镍	NI2205.SHF	219000	223780	212520	222450	-1.98%	-11280(-27.14%)	30283	78372
	锡	SN2205.SHF	322990	335800	320200	333710	0.93%	-5672(-25.75%)	16352	28866
	国际铜	BC2206.INE	65290	65780	64710	65330	-1.51%	-2787(-32.68%)	5742	17638
贵金属	黄金	AU2206.SHF	399.88	402.56	399.6	401.3	-0.96%	-7515(-5.36%)	132594	153998
	白银	AG2206.SHF	4949	5013	4942	4971	-1.35%	-8787(-2.07%)	414742	465545
煤焦钢矿	螺纹钢	RB2210.SHF	4800	4877	4747	4829	-0.70%	-7661(-0.44%)	1741533	1832418
	热卷	HC2210.SHF	4891	4952	4853	4907	-1.17%	-12408(-1.79%)	682084	486975
	不锈钢	SS2206.SHF	19105	19450	18720	19225	-1.44%	+37227(+145.98%)	62729	89271
	焦炭	J2209.DCE	3617	3717	3537	3634	-2.23%	-558(-2.10%)	25966	37895
	焦煤	JM2209.DCE	2860	2972	2791	2911	-0.17%	+751(+2.02%)	37902	58402
	铁矿石	I2209.DCE	794.5	826.5	783	809	-2.53%	-15601(-2.54%)	597696	568258
	硅铁	SF209.CZC	10130	10352	10130	10206	-1.56%	-16979(-13.60%)	107854	137072
	锰硅	SM209.CZC	8502	8594	8472	8502	-1.07%	+862(+0.66%)	132110	111248
能源	燃料油	FU2209.SHF	3863	3982	3806	3918	-1.33%	-16395(-5.89%)	261997	910509
	原油	SC2206.INE	630	648.1	619	642.1	-2.49%	-3568(-11.56%)	27309	216816
	低硫燃料油	LU2207.INE	4925	5069	4864	4995	-1.13%	-8687(-25.31%)	25632	78863
	LPG	PG2206.DCE	5767	5986	5735	5906	0.15%	+1429(+2.33%)	62761	137246
	动力煤	ZC205.CZC	817.8	820	810.8	815	0.22%	-185(-20.24%)	729	233
化工	沥青	BU2206.SHF	3808	4024	3780	3992	2.70%	+11958(+4.25%)	293462	701695
	天然橡胶	RU2209.SHF	12670	12780	12510	12635	-1.79%	-4079(-1.64%)	244571	335634
	纸浆	SP2209.SHF	6844	6900	6716	6812	-3.21%	-1164(-0.75%)	153862	309273
	20号胶	NR2206.INE	10710	10810	10610	10710	-1.24%	-6351(-16.68%)	31716	34589
	塑料	L2209.DCE	8600	8724	8583	8625	-1.26%	+4383(+1.60%)	278860	344515
	PP	PP2209.DCE	8490	8633	8447	8528	-0.83%	+16584(+5.54%)	315667	503765
	乙二醇	EG2209.DCE	4782	4812	4668	4682	-4.91%	+225526(+337.90%)	292269	453276
	苯乙烯	EB2206.DCE	9400	9583	9334	9471	-0.97%	-740(-0.50%)	146329	177846
	PTA	TA209.CZC	5922	6118	5882	6078	0.76%	+30714(+3.56%)	892633	1504095
	短纤	PF206.CZC	7650	7818	7612	7766	0.15%	-7797(-8.43%)	84669	113512
	甲醇	MA209.CZC	2698	2763	2683	2722	-2.33%	-85725(-9.38%)	827817	1098979
	尿素	UR209.CZC	2823	2938	2805	2934	4.49%	+27799(+27.25%)	129815	216504
	纯碱	SA209.CZC	2881	2951	2825	2884	-3.77%	+7873(+1.41%)	564689	1250075
非金属建材	纤维板	FB2205.DCE	1318	1349.5	1312	1342	0.75%	-332(-16.76%)	1649	7030
	PVC	V2209.DCE	8499	8672	8462	8562	-1.34%	-7902(-2.27%)	340582	644866
	玻璃	FG209.CZC	1875	1889	1804	1834	-5.37%	+2432(+0.39%)	629788	1451827

油脂油料	豆粕	M2209. DCE	3950	4019	3945	3983	-0.92%	-3820(-0.29%)	1312029	921077
	豆油	Y2209. DCE	10830	11138	10806	11130	-1.21%	+3150(+0.75%)	423982	608576
	豆一	A2207. DCE	6120	6133	6094	6123	-0.44%	+1035(+0.92%)	113450	78740
	豆二	B2205. DCE	5147	5213	5121	5188	-2.46%	-5433(-41.75%)	7581	23264
	棕榈油	P2209. DCE	11000	11436	10888	11400	-1.49%	+7254(+2.51%)	296260	924623
	菜油	OI209. CZC	13251	13657	13250	13617	-0.29%	+5488(+3.32%)	170960	232242
	菜粕	RM209. CZC	3597	3702	3593	3667	-0.38%	-3349(-1.19%)	278315	185903
	花生	PK210. CZC	9030	9150	9028	9120	0.73%	-1349(-1.57%)	84430	73781
谷物	玉米	C2209. DCE	2968	3009	2968	2994	0.44%	+20832(+1.72%)	1228570	458734
	粳米	RR2206. DCE	3442	3467	3430	3438	-0.26%	-317(-3.13%)	9805	12834
农副产品	玉米淀粉	CS2207. DCE	3372	3426	3370	3413	0.35%	-2953(-1.47%)	198278	133999
	生猪	LH2209. DCE	18460	18475	18135	18330	-0.41%	+80(+0.16%)	51135	22579
	鸡蛋	JD2209. DCE	4836	4847	4777	4780	-1.30%	+489(+0.53%)	93376	90635
	苹果	AP210. CZC	8652	9129	8577	9110	5.83%	+18575(+13.01%)	161347	381350
	红枣	CJ209. CZC	12135	12515	12135	12410	0.94%	+1101(+3.52%)	32339	20688
软商品	白糖	SR209. CZC	5890	5913	5876	5889	-0.88%	+4167(+1.10%)	384365	261112
	棉花	CF209. CZC	21085	21210	20995	21130	-0.77%	-3265(-1.09%)	295607	154143
	棉纱	CY205. CZC	26525	26870	26500	26635	-1.77%	-56(-3.78%)	1426	858

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：

htqhwx88

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