

IH、IF 资金流入，IC 流出

股指期货流动性情况：

2021年8月31日，沪深300期货(IF)成交1842.05亿元，较上一交易日增加10.33%；持仓金额3012.23亿元，较上一交易日增加2.88%；成交持仓比为0.61。中证500期货(IC)成交1205.9亿元，较上一交易日减少4.78%；持仓金额3755.21亿元，较上一交易日减少1.42%；成交持仓比为0.32。上证50(IH)成交708.96亿元，较上一交易日增加13.83%；持仓金额1008.03亿元，较上一交易日增加6.99%；成交持仓比为0.7。

国债期货流动性情况：

2021年8月31日，2年期债(TS)成交186.59亿元，较上一交易日减少50.48%；持仓金额482.71亿元，较上一交易日增加3.43%；成交持仓比为0.39。5年期债(1F)成交200.5亿元，较上一交易日减少50.87%；持仓金额596.88亿元，较上一交易日增加1.48%；成交持仓比为0.34。10年期债(1T)成交612.64亿元，较上一交易日减少20.19%；持仓金额1468.05亿元，较上一交易日减少0.04%；成交持仓比为0.42。

投资咨询业务资格：

证监许可【2011】1289号

研究院 量化组

研究员

陈辰

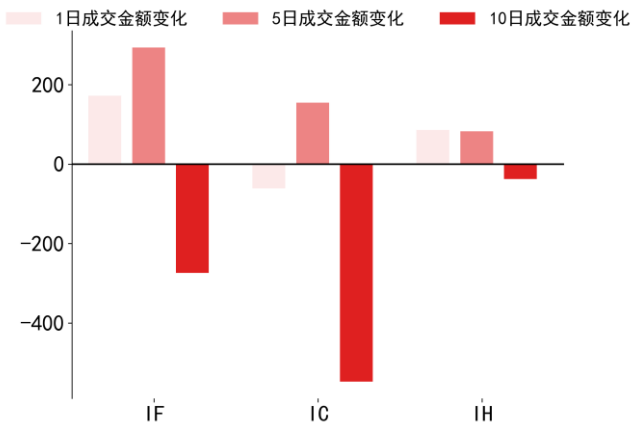
☎ 0755-23887993

✉ chenchen@htfc.com

从业资格号：F3024056

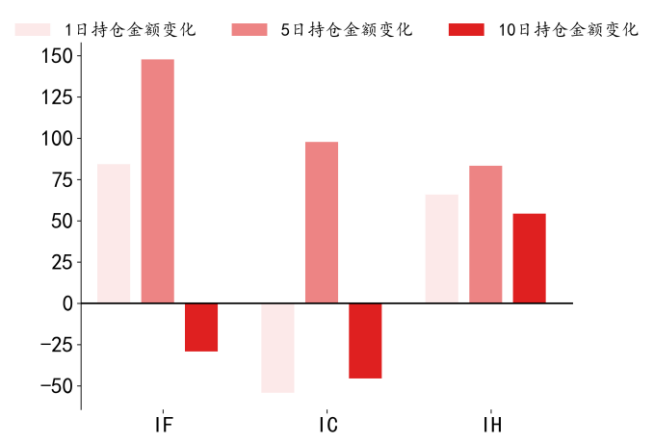
投资咨询号：Z0014257

图1: 股指期货成交金额变化 单位:亿元



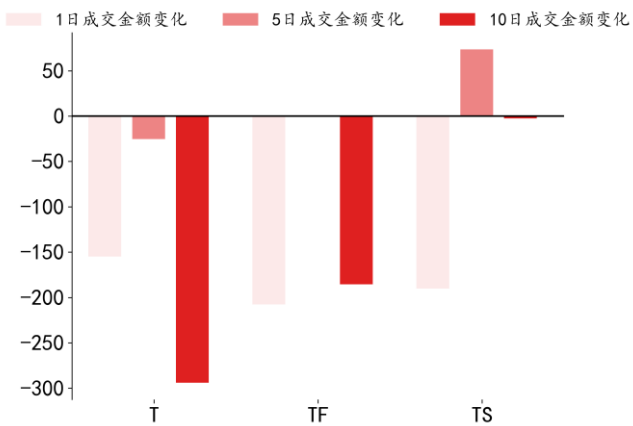
数据来源: 天软 华泰期货研究院

图2: 股指期货持仓金额变化 单位:亿元



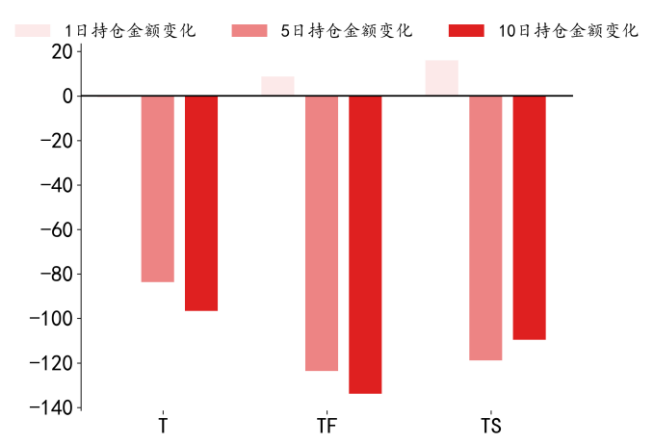
数据来源: 天软 华泰期货研究院

图3: 国债期货成交金额变化 单位:亿元



数据来源: 天软 华泰期货研究院

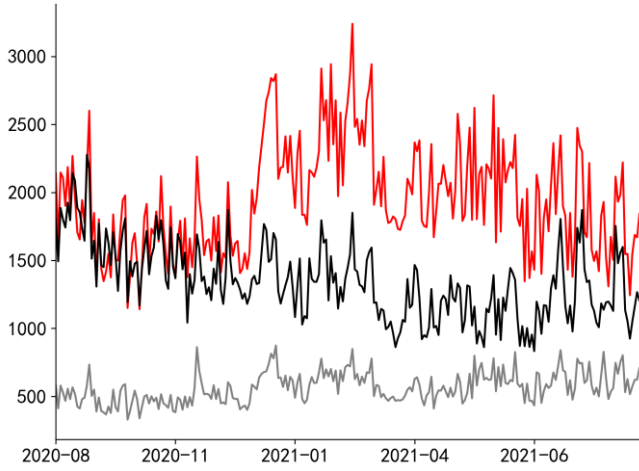
图4: 国债期货持仓金额变化 单位:亿元



数据来源: 天软 华泰期货研究院

图5: 股指期货成交金额 单位: 亿元

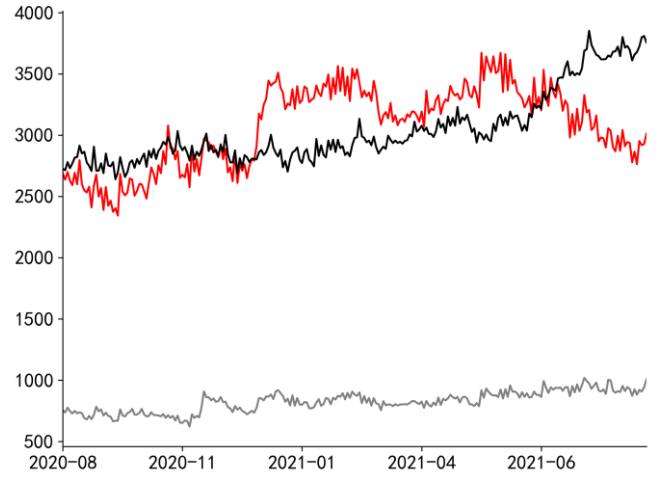
— IF成交金额 — IC成交金额 — IH成交金额



数据来源: 天软 华泰期货研究院

图6: 股指期货持仓金额 单位: 亿元

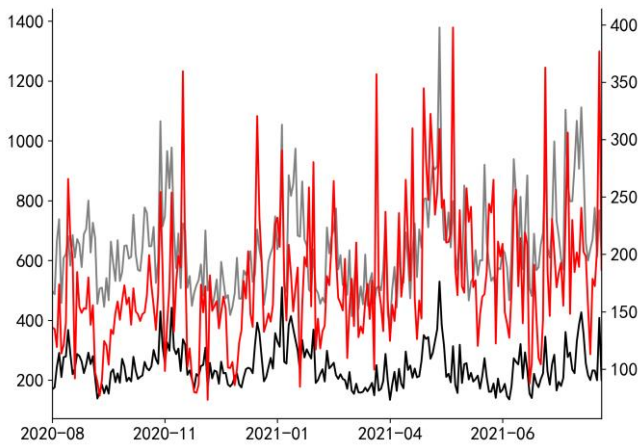
— IF持仓金额 — IC持仓金额 — IH持仓金额



数据来源: 天软 华泰期货研究院

图7: 国债期货成交金额 单位: 亿元

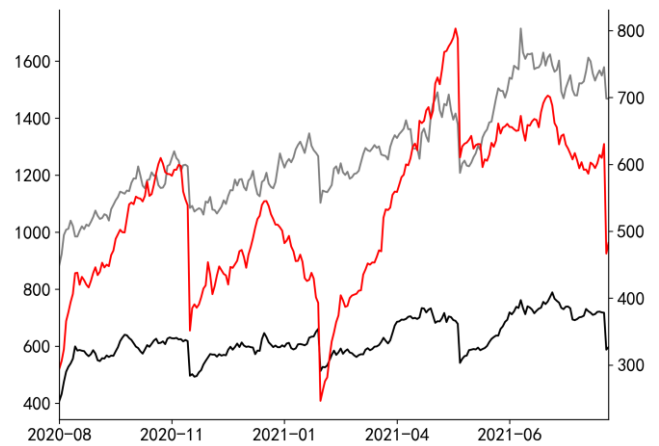
— T成交金额 — TF成交金额 — TS成交金额 (右轴)



数据来源: 天软 华泰期货研究院

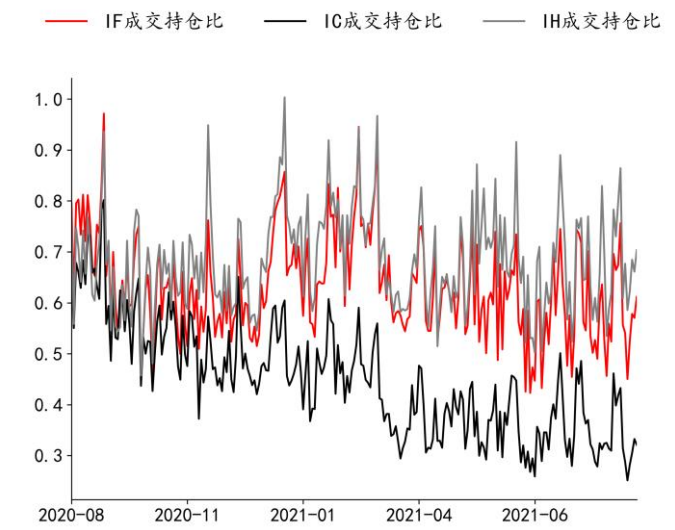
图8: 国债期货持仓金额 单位: 亿元

— T持仓金额 — TF持仓金额 — TS持仓金额 (右轴)



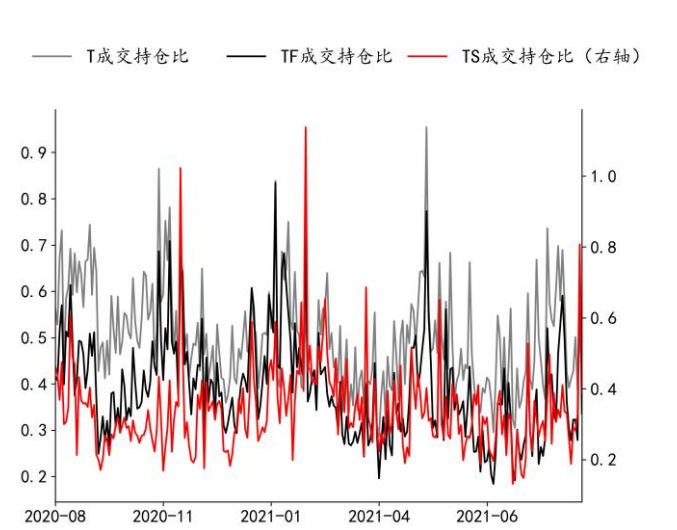
数据来源: 天软 华泰期货研究院

图9： 股指期货成交持仓比 单位：无



数据来源：天软 华泰期货研究院

图10： 国债期货成交持仓比 单位：无



数据来源：天软 华泰期货研究院

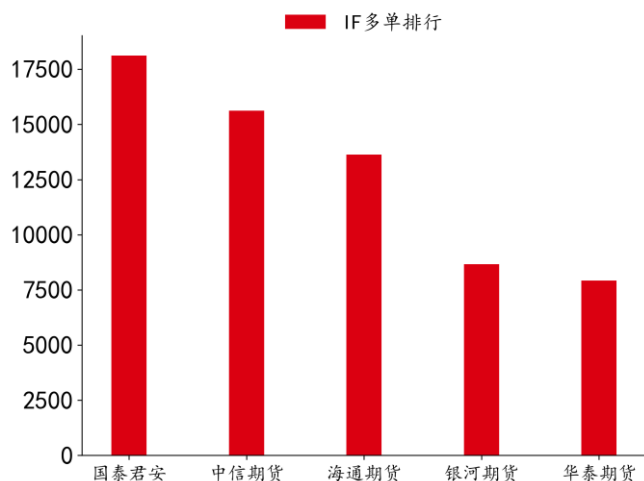
表格 1： 金融期货持仓排行

品种	合计	多单量	多单占比(%)	空单量	空单占比(%)	净多单	净空单
IF	前五名合计	63955.0	42.45	86722.0	57.55	0.0	22767.0
IF	前十名合计	91438.0	43.92	116743.0	56.08	0.0	25305.0
IF	前二十名合计	123773.0	45.46	148490.0	54.54	0.0	24717.0
IC	前五名合计	79730.0	39.68	121188.0	60.32	0.0	41458.0
IC	前十名合计	122975.0	42.6	165667.0	57.4	0.0	42692.0
IC	前二十名合计	165936.0	44.73	205056.0	55.27	0.0	39120.0
IH	前五名合计	30302.0	40.65	44248.0	59.35	0.0	13946.0
IH	前十名合计	45490.0	43.06	60162.0	56.94	0.0	14672.0
IH	前二十名合计	65564.0	46.06	76785.0	53.94	0.0	11221.0
TS	前五名合计	9789.0	45.07	11929.0	54.93	0.0	2140.0

TS	前十名合计	14196.0	44.66	17592.0	55.34	0.0	3396.0
TS	前二十名合计	18264.0	44.98	22337.0	55.02	0.0	4073.0
TF	前五名合计	22972.0	46.42	26518.0	53.58	0.0	3546.0
TF	前十名合计	35953.0	47.94	39050.0	52.06	0.0	3097.0
TF	前二十名合计	46892.0	47.46	51919.0	52.54	0.0	5027.0
T	前五名合计	61475.0	50.52	60212.0	49.48	1263.0	0.0
T	前十名合计	85114.0	49.23	87785.0	50.77	0.0	2671.0
T	前二十名合计	109345.0	48.47	116242.0	51.53	0.0	6897.0

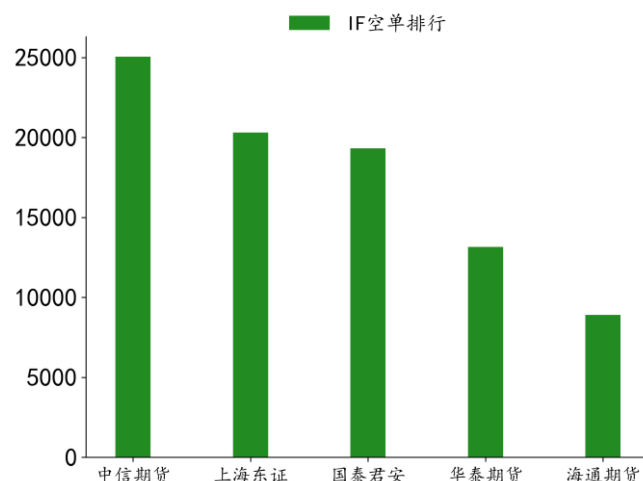
数据来源: Wind 华泰期货研究院

图11: IF 多单持仓排行 单位: 手



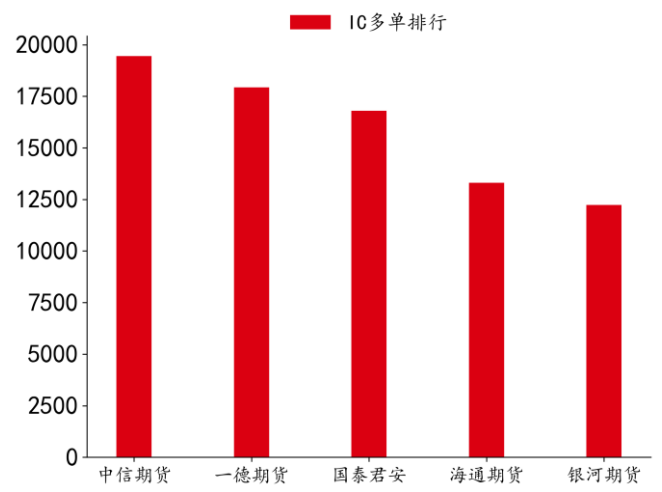
数据来源: Wind 华泰期货研究院

图12: IF 空单持仓排行 单位: 手



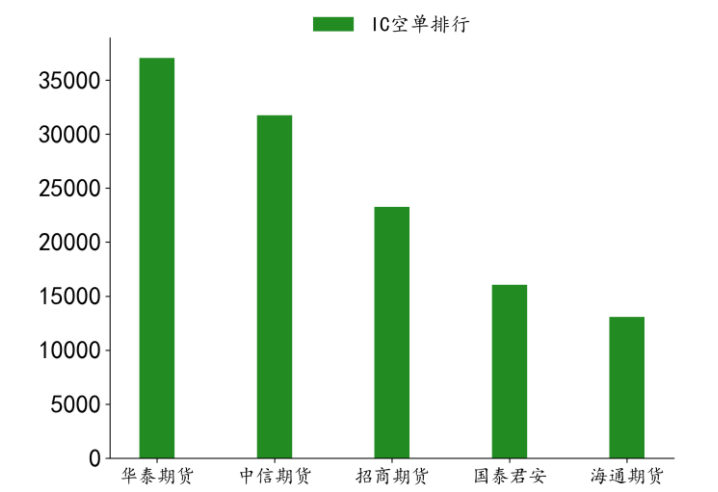
数据来源: Wind 华泰期货研究院

图13: IC 多单持仓排行 单位:手



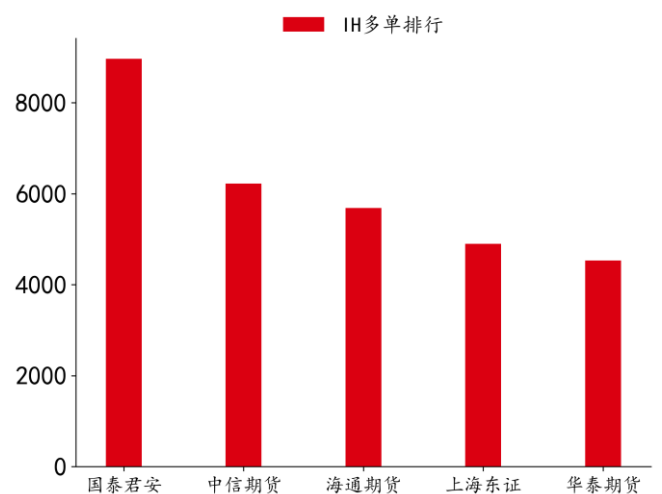
数据来源: Wind 华泰期货研究院

图14: IC 空单持仓排行 单位:手



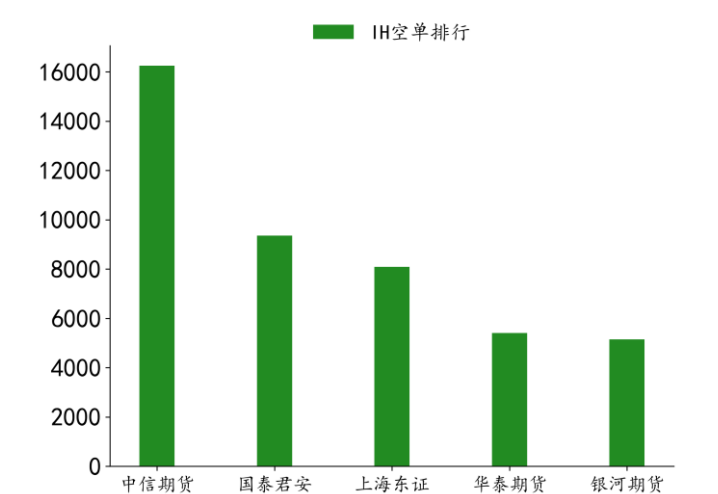
数据来源: Wind 华泰期货研究院

图15: IH 多单持仓排行 单位:手



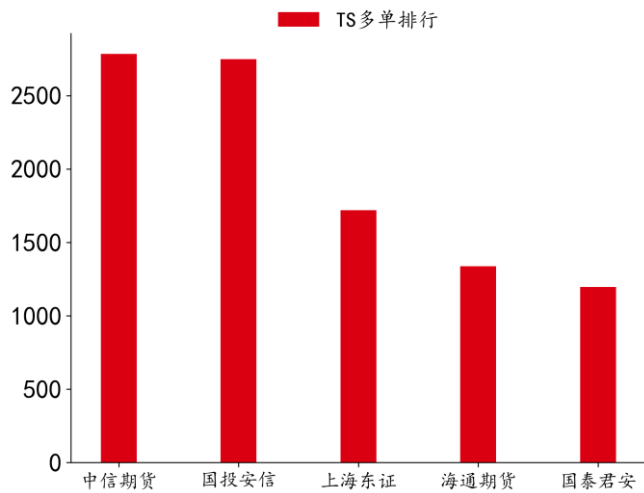
数据来源: Wind 华泰期货研究院

图16: IH 空单持仓排行 单位:手



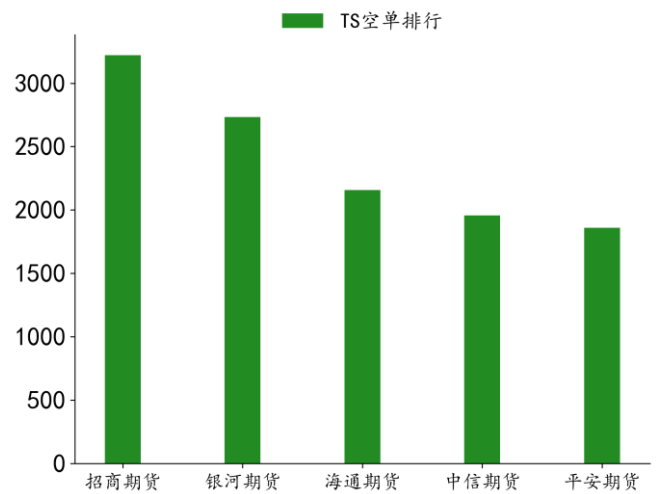
数据来源: Wind 华泰期货研究院

图17: TS 多单持仓排行 单位:手



数据来源: Wind 华泰期货研究院

图18: TS 空单持仓排行 单位:手



数据来源: Wind 华泰期货研究院

图19: TF 多单持仓排行 单位:手

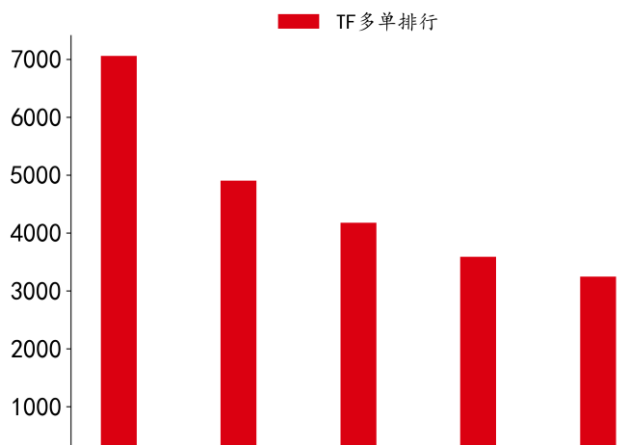
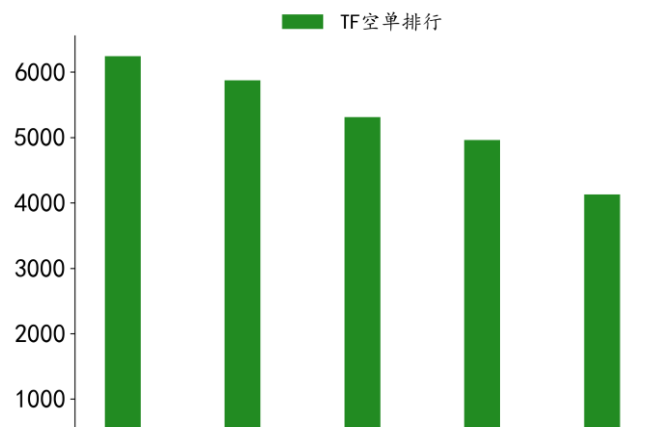


图20: TF 空单持仓排行 单位:手



预览已结束, 完整报告链接和二维码如下:

https://www.yunbaogao.cn/report/index/report?reportId=1_26002



云报告
https://www.yunbaogao.cn

云报告
https://www.yunbaogao.cn

云报告
https://www.yunbaogao.cn