

股指期货资金流出，国债期货流向分化

股指期货流动性情况：

2021年8月23日，沪深300期货(IF)成交1546.45亿元，较上一交易日减少30.35%；持仓金额2778.6亿元，较上一交易日减少5.35%；成交持仓比为0.56。中证500期货(IC)成交1135.01亿元，较上一交易日减少29.02%；持仓金额3609.51亿元，较上一交易日减少2.34%；成交持仓比为0.31。上证50(IH)成交530.92亿元，较上一交易日减少33.82%；持仓金额872.05亿元，较上一交易日减少6.05%；成交持仓比为0.61。

国债期货流动性情况：

2021年8月23日，2年期债(TS)成交154.15亿元，较上一交易日减少22.2%；持仓金额594.42亿元，较上一交易日减少0.92%；成交持仓比为0.26。5年期债(TF)成交216.8亿元，较上一交易日减少15.41%；持仓金额712.67亿元，较上一交易日增加0.38%；成交持仓比为0.3。10年期债(T)成交599.97亿元，较上一交易日减少9.36%；持仓金额1531.63亿元，较上一交易日减少1.58%；成交持仓比为0.39。

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

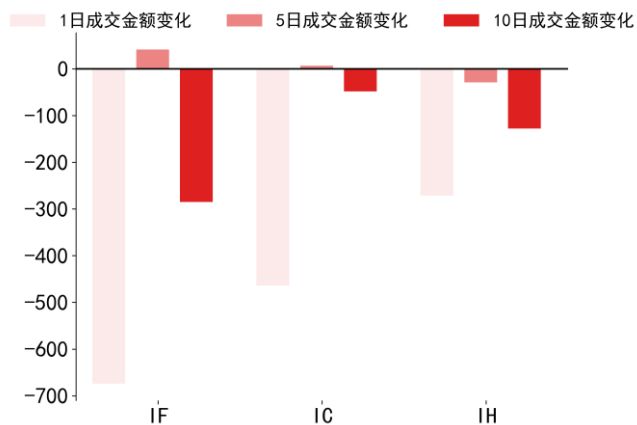
☎ 0755-23887993

✉ chenchen@htfc.com

从业资格号：F3024056

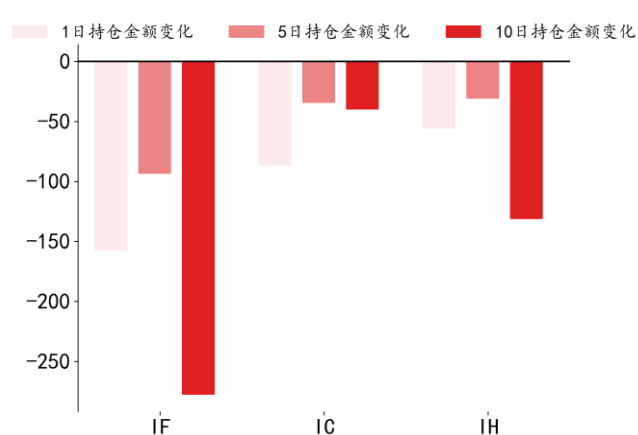
投资咨询号：Z0014257

图1: 股指期货成交金额变化 单位:亿元



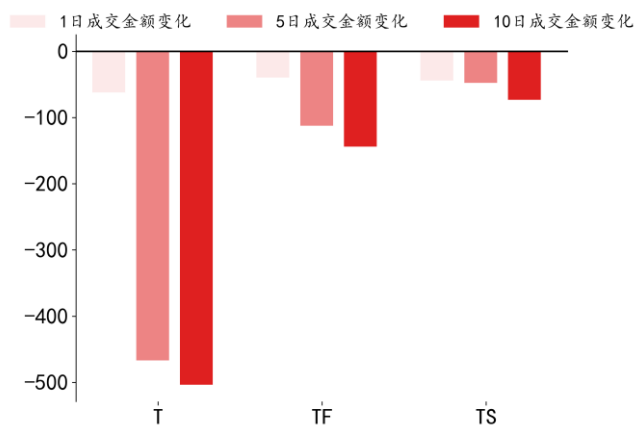
数据来源: 天软 华泰期货研究院

图2: 股指期货持仓金额变化 单位:亿元



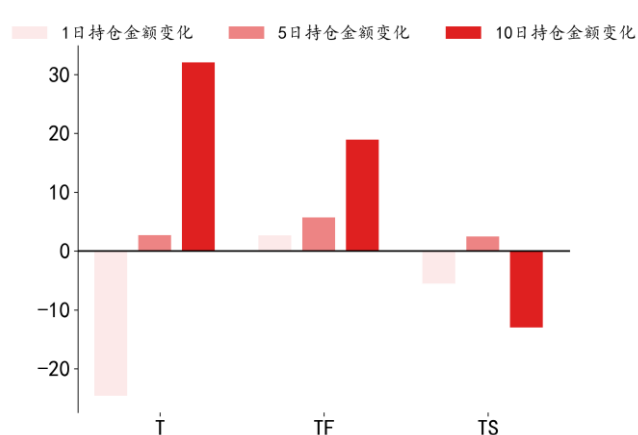
数据来源: 天软 华泰期货研究院

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

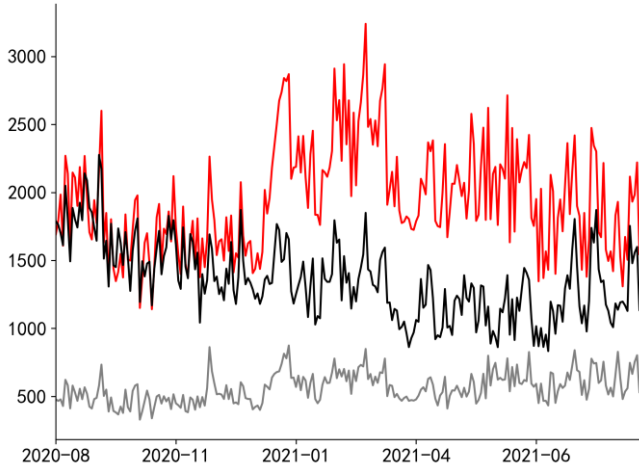
图4: 国债期货持仓金额变化 单位:亿元



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

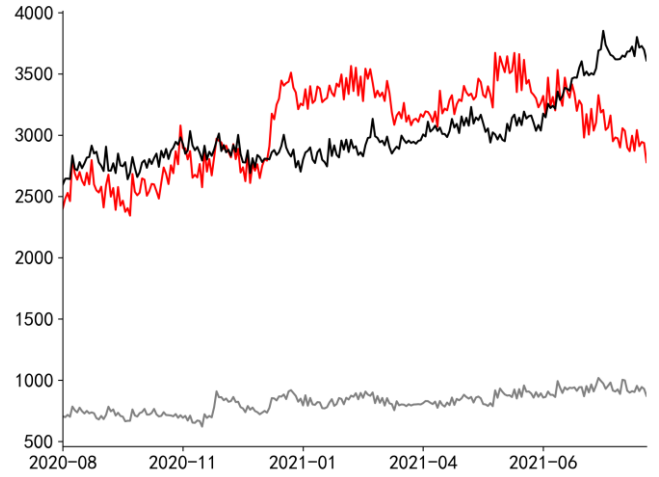
IF成交金额 IC成交金额 IH成交金额



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

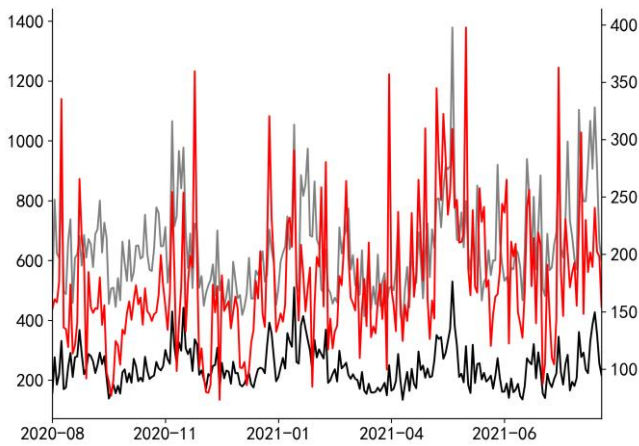
IF持仓金额 IC持仓金额 IH持仓金额



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

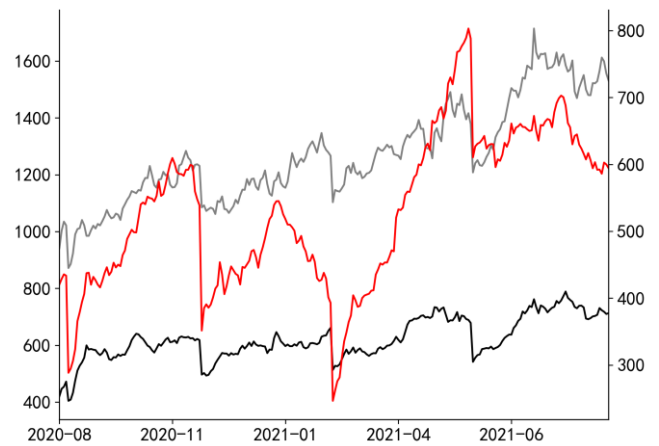
T成交金额 TF成交金额 TS成交金额 (右轴)



数据来源: 天软 华泰期货研究院

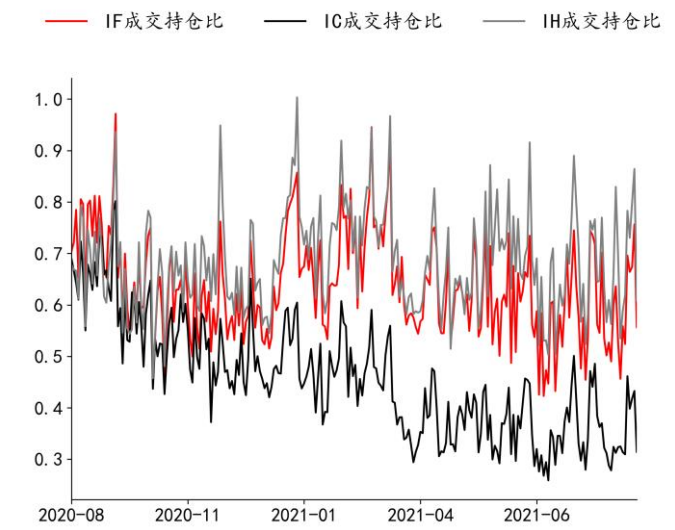
图8: 国债期货持仓金额 单位: 亿元

T持仓金额 TF持仓金额 TS持仓金额 (右轴)



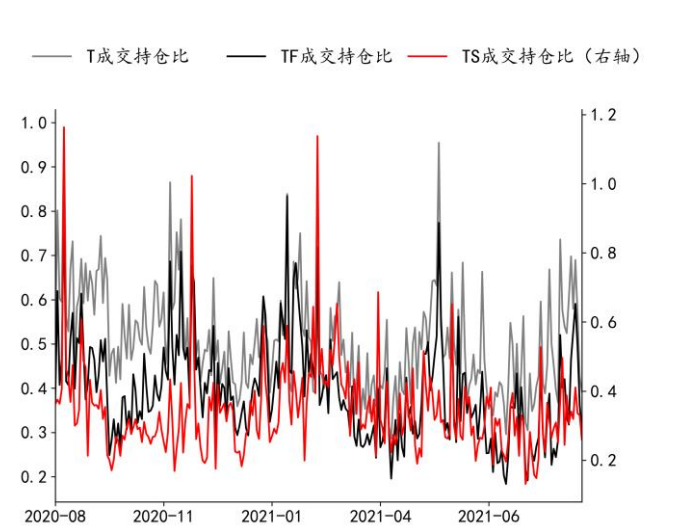
数据来源: 天软 华泰期货研究院

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

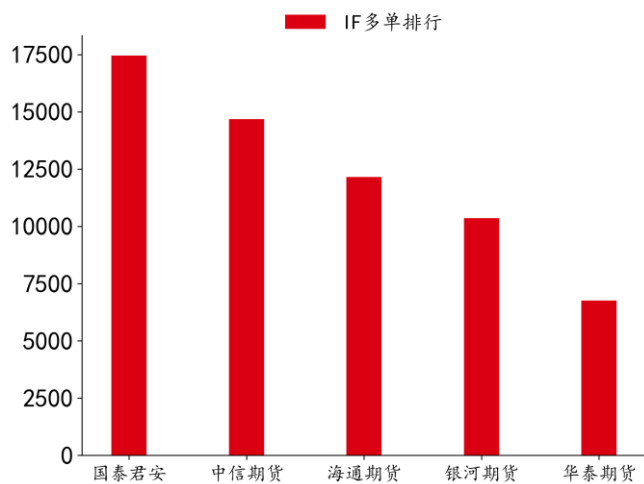
表格 1: 金融期货持仓排行

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	61407.0	43.58	79514.0	56.42	0.0	18107.0
IF	前十名合计	84076.0	43.75	108078.0	56.25	0.0	24002.0
IF	前二十名合计	113918.0	44.62	141363.0	55.38	0.0	27445.0
IC	前五名合计	82315.0	39.79	124547.0	60.21	0.0	42232.0
IC	前十名合计	127585.0	43.11	168376.0	56.89	0.0	40791.0
IC	前二十名合计	170203.0	45.01	207905.0	54.99	0.0	37702.0
IH	前五名合计	26078.0	39.82	39405.0	60.18	0.0	13327.0
IH	前十名合计	39188.0	42.11	53862.0	57.89	0.0	14674.0
IH	前二十名合计	56576.0	45.19	68617.0	54.81	0.0	12041.0
TS	前五名合计	12805.0	45.21	15521.0	54.79	0.0	2716.0

TS	前十名合计	19212.0	46.53	22081.0	53.47	0.0	2869.0
TS	前二十名合计	24676.0	47.04	27776.0	52.96	0.0	3100.0
TF	前五名合计	30554.0	50.04	30502.0	49.96	52.0	0.0
TF	前十名合计	47191.0	48.52	50061.0	51.48	0.0	2870.0
TF	前二十名合计	59484.0	47.97	64506.0	52.03	0.0	5022.0
T	前五名合计	64801.0	51.21	61727.0	48.79	3074.0	0.0
T	前十名合计	91177.0	50.03	91050.0	49.97	127.0	0.0
T	前二十名合计	114635.0	47.62	126080.0	52.38	0.0	11445.0

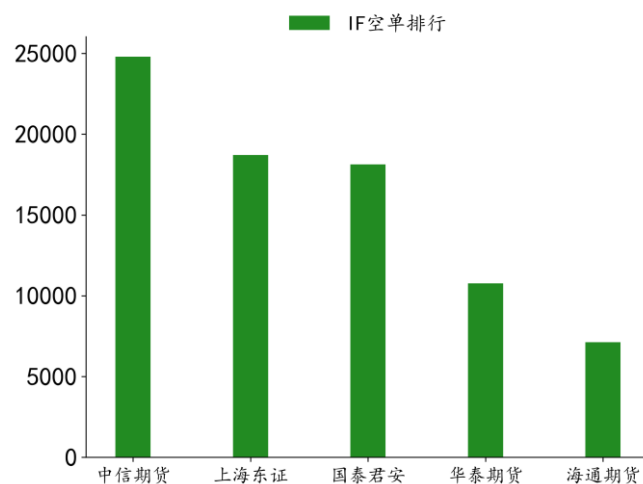
数据来源: Wind 华泰期货研究院

图11: IF 多单持仓排行 单位: 手



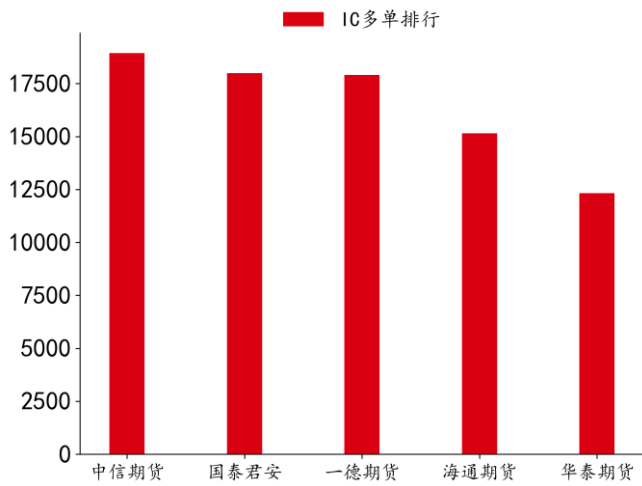
数据来源: Wind 华泰期货研究院

图12: IF 空单持仓排行 单位: 手



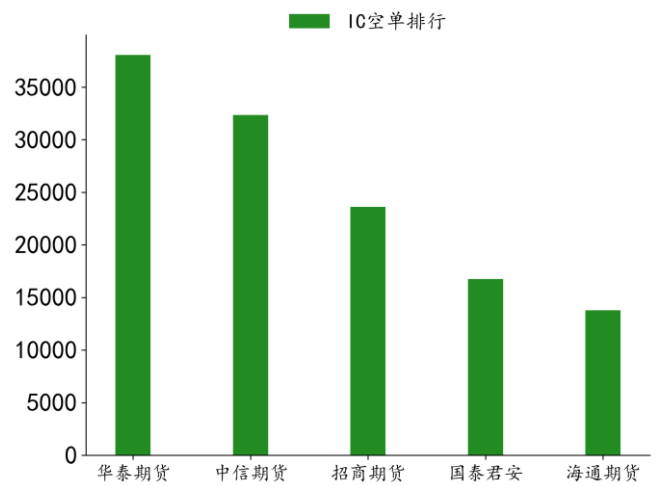
数据来源: Wind 华泰期货研究院

图13: IC 多单持仓排行 单位:手



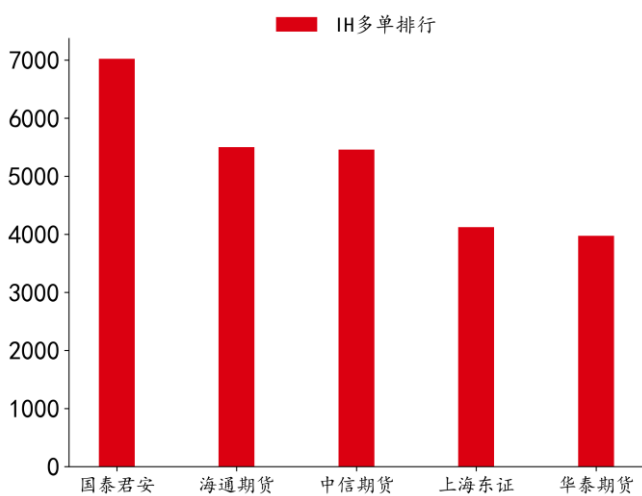
数据来源: Wind 华泰期货研究院

图14: IC 空单持仓排行 单位:手



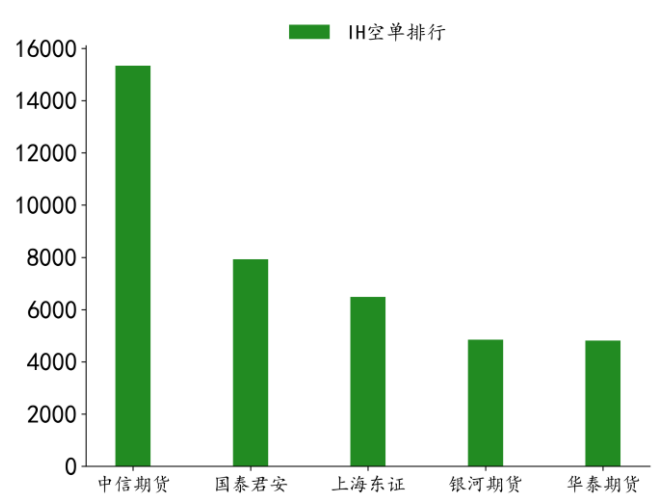
数据来源: Wind 华泰期货研究院

图15: IH 多单持仓排行 单位:手



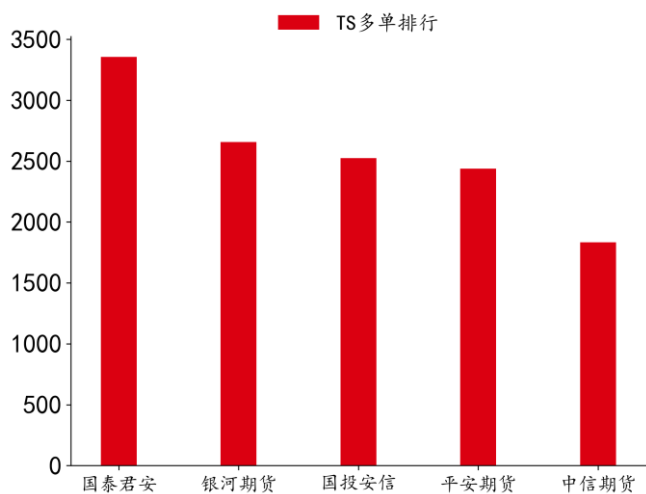
数据来源: Wind 华泰期货研究院

图16: IH 空单持仓排行 单位:手



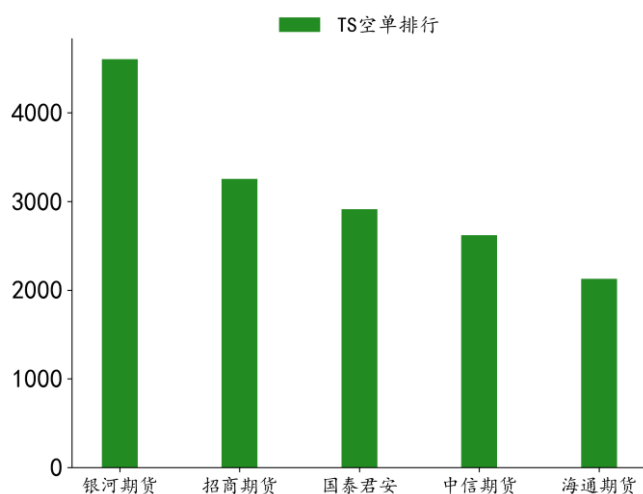
数据来源: Wind 华泰期货研究院

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

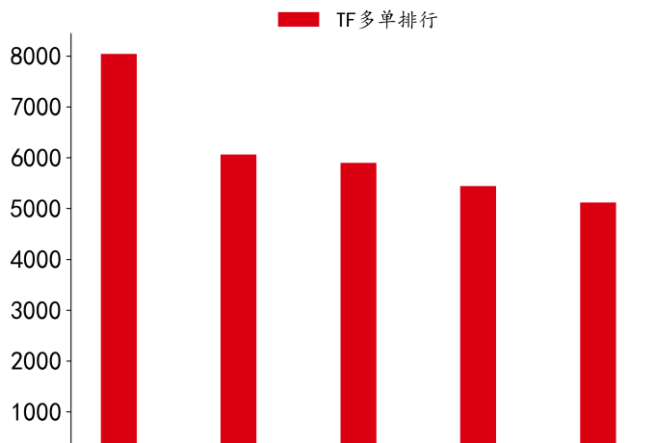
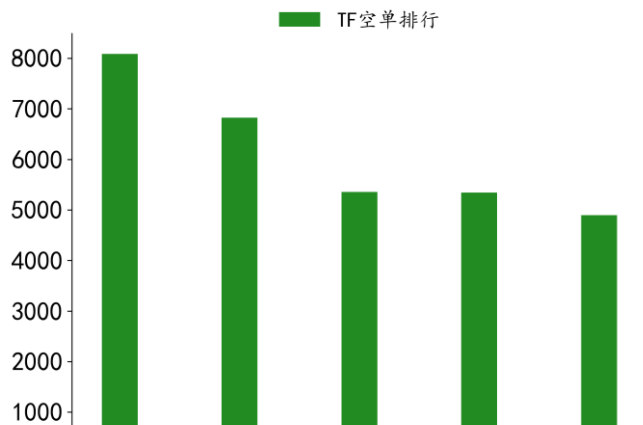


图20: TF 空单持仓排行 单位:手



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_26590



云报告
https://www.yunbaogao.cn

云报告
https://www.yunbaogao.cn

云报告
https://www.yunbaogao.cn