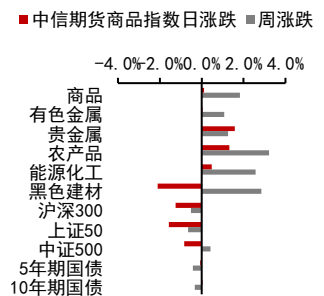


中央一号文件发布，今年抓好重要农产品供给

投资咨询业务资格：
证监许可【2012】669号

报告要点

中共中央、国务院发布《关于做好2022年全面推进乡村振兴重点工作的意见》。中央一号文件把“全力抓好粮食生产和重要农产品供给”放在首要位置，提出“稳定全年粮食播种面积和产量、大力实施大豆和油料产能提升工程、保障“菜篮子”产品供给、合理保障农民种粮收益、统筹做好重要农产品调控”五大类措施。预计今年粮食播种面积和产量保持稳定，大豆和油料产能会有所提升。一号文件还提出大力推进种源等农业关键核心技术攻关，预计未来几年种子行业会有较大发展。



摘要：

资产表现及资金变化：

国内商品涨跌幅前五：燃油 5.17%、沥青 5.04%、LPG 4.83%、原油 4.66%、低硫燃油 3.49%；动煤-3.48%、铁矿-3.13%、硅铁-2.45%、尿素-2.36%、玻璃-2.25%

沉淀资金流入流出前五(亿元)：原油 4.69、豆粕 3.27、沪金 2.91、豆油 2.86、沪镍 2.58；沪铜-3.59、铁矿-2.57、螺纹-1.53、连豆-0.84、纯碱-0.77

板块沉淀资金流入流出(亿元)：有色金属 15.40、能源化工 11.23、农产品 6.95、贵金属 5.02、黑色建材-5.84

重要新闻及经济数据：

2月22日，中共中央、国务院发布《关于做好2022年全面推进乡村振兴重点工作的意见》。

发改委、能源局印发《“十四五”新型储能发展实施方案》。

美国2月Markit制造业PMI初值57.5，预期56，前值55.5。

风险提示：我国房地产下滑、美联储收紧货币

宏观研究团队

研究员：

张革

从业资格号：F3004355

投资咨询号：Z0010982

刘道钰

021-80401723

liudaoyu@citicsf.com

从业资格号：F3061482

投资咨询号：Z0016422

一、重要新闻及经济数据

2月22日，中共中央、国务院发布《关于做好2022年全面推进乡村振兴重点工作的意见》，提出要全力抓好粮食生产和重要农产品供给，包括稳定全年粮食播种面积和产量、大力实施大豆和油料产能提升工程、保障“菜篮子”产品供给、合理保障农民种粮收益、统筹做好重要农产品调控。要强化现代农业基础支撑，包括落实“长牙齿”的耕地保护硬措施、全面完成高标准农田建设阶段性任务、大力推进种源等农业关键核心技术攻关、提升农机装备研发应用水平、加快发展设施农业、有效防范应对农业重大灾害。

发改委、能源局印发《“十四五”新型储能发展实施方案》提出，到2025年，新型储能由商业化初期步入规模化发展阶段，具备大规模商业化应用条件，电化学储能技术性能进一步提升，系统成本降低30%以上；新型储能技术创新能力显著提高，核心技术装备自主可控水平大幅提升；推动多元化技术开发，开展钠离子电池等研究。

美国2月Markit制造业PMI初值57.5，预期56，前值55.5。

图表1：重要经济数据及事件

日期	北京时间	国家/地区	数据/事件	前值	预期	今值
2022/2/22	22:45	美国	2月Markit制造业PMI:季调	55.5	56	57.5
2022/2/23	18:00	欧盟	1月欧元区:CPI:环比(%)	0.4	—	0.3
2022/2/23	18:00	欧盟	1月欧元区:CPI:同比(%)	5	5	5.1
2022/2/23	18:00	欧盟	1月欧元区:核心CPI:环比(%)	0.4	0.4	-0.8
2022/2/23	18:00	欧盟	1月欧元区:核心CPI:同比(%)	2.6	2.6	2.3

资料来源：Wind 中信期货研究部

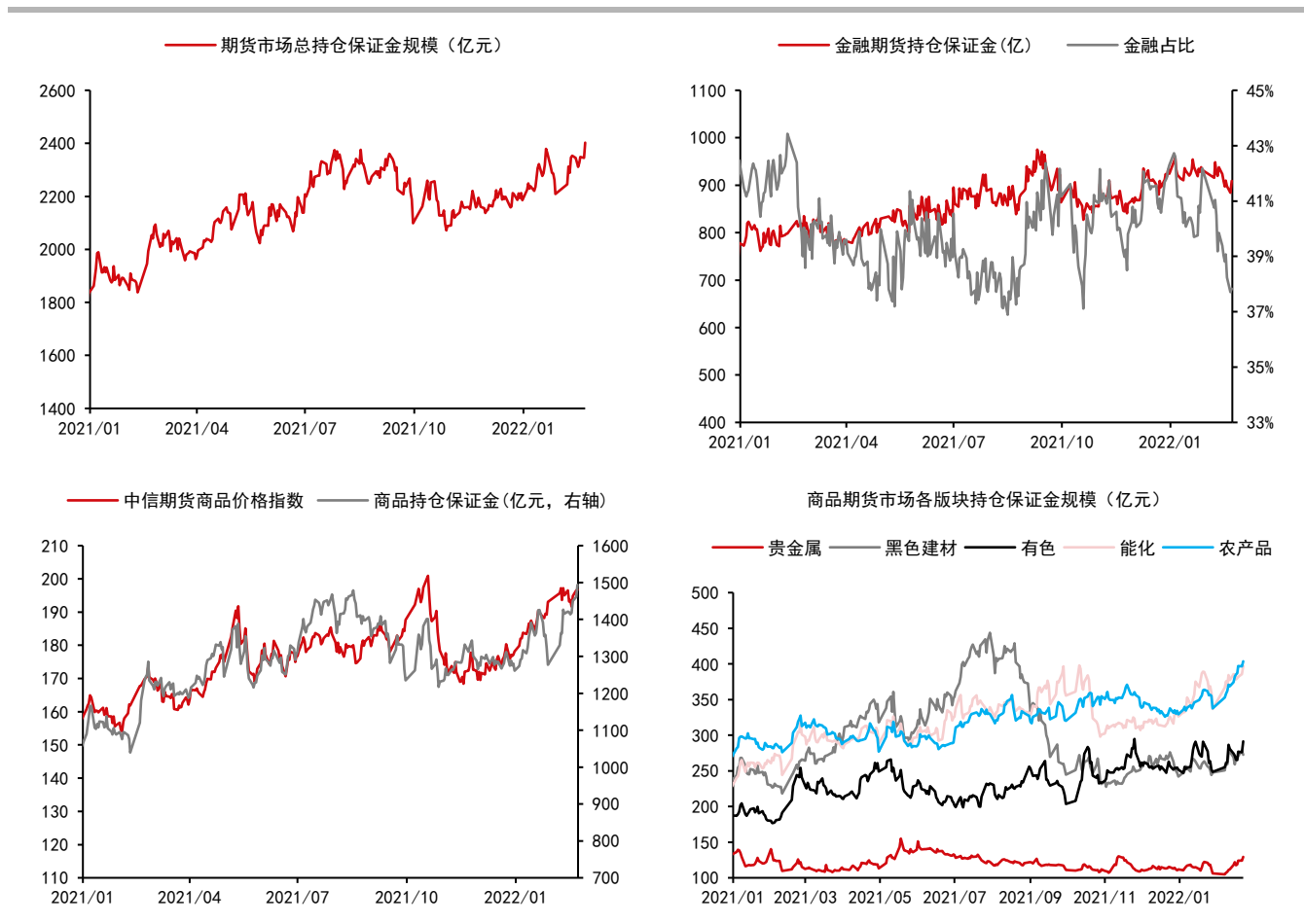
二、期货市场数据跟踪

图表2：国内期货市场板块数据跟踪

板块	1日涨跌幅	5日涨跌幅	1日沉淀资金变化(亿)	5日沉淀资金变化(亿)	沉淀资金(亿)
合计			57.23	73.59	2402.45
金融			24.47	-0.39	908.82
商品			32.76	73.98	1493.64
贵金属	1.58%	1.27%	5.02	7.25	129.24
黑色建材	-2.10%	3.21%	-5.84	21.41	272.49
有色金属	0.04%	2.57%	15.40	11.56	291.33
能源化工	0.48%	2.84%	11.23	13.64	396.90
农产品	1.32%	1.08%	6.95	20.11	403.68

资料来源：Wind 中信期货研究部

图表3：国内期货市场板块数据跟踪



资料来源：Wind 中信期货研究部

说明：保证金按收盘价、交易所保证金标准、单边持仓计算

图表4：国内商品期货品种1日表现（按价格涨跌幅排序）

品种	1日涨跌幅	振幅	活跃度	5日涨跌幅
燃油	5.17%	5.52%	1.05	1.21%
沥青	5.04%	5.55%	0.85	1.50%
LPG	4.83%	4.71%	1.86	3.38%
原油	4.66%	4.28%	2.45	3.10%
低硫燃油	3.49%	3.56%	0.87	-0.36%
TA	3.16%	3.59%	0.79	-2.50%
菜粕	2.43%	2.74%	0.91	4.95%
豆二	2.22%	2.51%	1.79	5.64%
棕榈	2.19%	2.91%	1.03	5.14%
沪银	2.06%	2.44%	0.84	1.22%
豆粕	1.66%	1.77%	0.66	4.54%
沪铝	1.50%	2.32%	1.24	1.17%
苯乙烯	1.49%	2.32%	1.40	-0.11%
沪金	1.23%	1.19%	0.63	1.37%
淀粉	1.01%	1.64%	0.79	1.08%
玉米	0.79%	2.01%	0.52	0.63%
菜油	0.76%	1.29%	1.36	3.78%
沪铅	0.74%	0.82%	1.09	1.08%
纸浆	0.72%	1.47%	0.67	1.97%
郑糖	0.51%	0.86%	0.64	0.03%
沪镍	0.47%	1.85%	1.33	4.38%
苹果	0.47%	2.82%	0.82	2.07%
豆油	0.37%	1.90%	0.93	2.48%
沪锡	0.36%	1.75%	1.22	1.70%
甲醇	0.30%	2.71%	0.75	0.57%
粳米	0.18%	0.26%	0.30	-0.27%
不锈钢	0.18%	2.10%	1.46	0.43%
PP	0.11%	1.50%	1.02	-1.79%
连豆	0.10%	1.67%	1.07	-1.76%
郑棉	0.09%	0.72%	0.44	-0.65%
乙二醇	0.08%	1.82%	0.72	-4.77%
沪锌	0.06%	0.89%	0.93	-1.13%
鸡蛋	-0.02%	0.49%	0.29	-0.08%
棉纱	-0.07%	0.48%	0.39	-1.41%
塑料	-0.12%	1.57%	0.92	-2.98%
沪铜	-0.55%	0.47%	0.43	0.02%
锰硅	-0.71%	1.82%	0.44	3.60%
PVC	-0.73%	2.41%	1.49	-2.22%
红枣	-0.88%	2.62%	0.23	-3.05%
焦炭	-0.96%	3.03%	0.98	6.95%
20号胶	-1.67%	2.66%	0.89	-0.10%
纯碱	-1.74%	3.21%	2.00	-0.06%
沪胶	-1.99%	2.69%	0.88	-2.47%
焦煤	-2.02%	4.07%	1.18	7.42%
热卷	-2.16%	2.99%	0.56	0.05%
螺纹	-2.24%	3.24%	0.71	0.07%
玻璃	-2.25%	3.89%	1.38	-7.54%
尿素	-2.36%	4.48%	0.75	-2.46%
硅铁	-2.45%	3.90%	1.43	3.93%
铁矿	-3.13%	5.13%	0.79	-2.23%
动煤	-3.48%	5.32%	0.33	4.74%

资料来源：Wind 中信期货研究部

图表5：国内商品期货沉淀资金及其变化

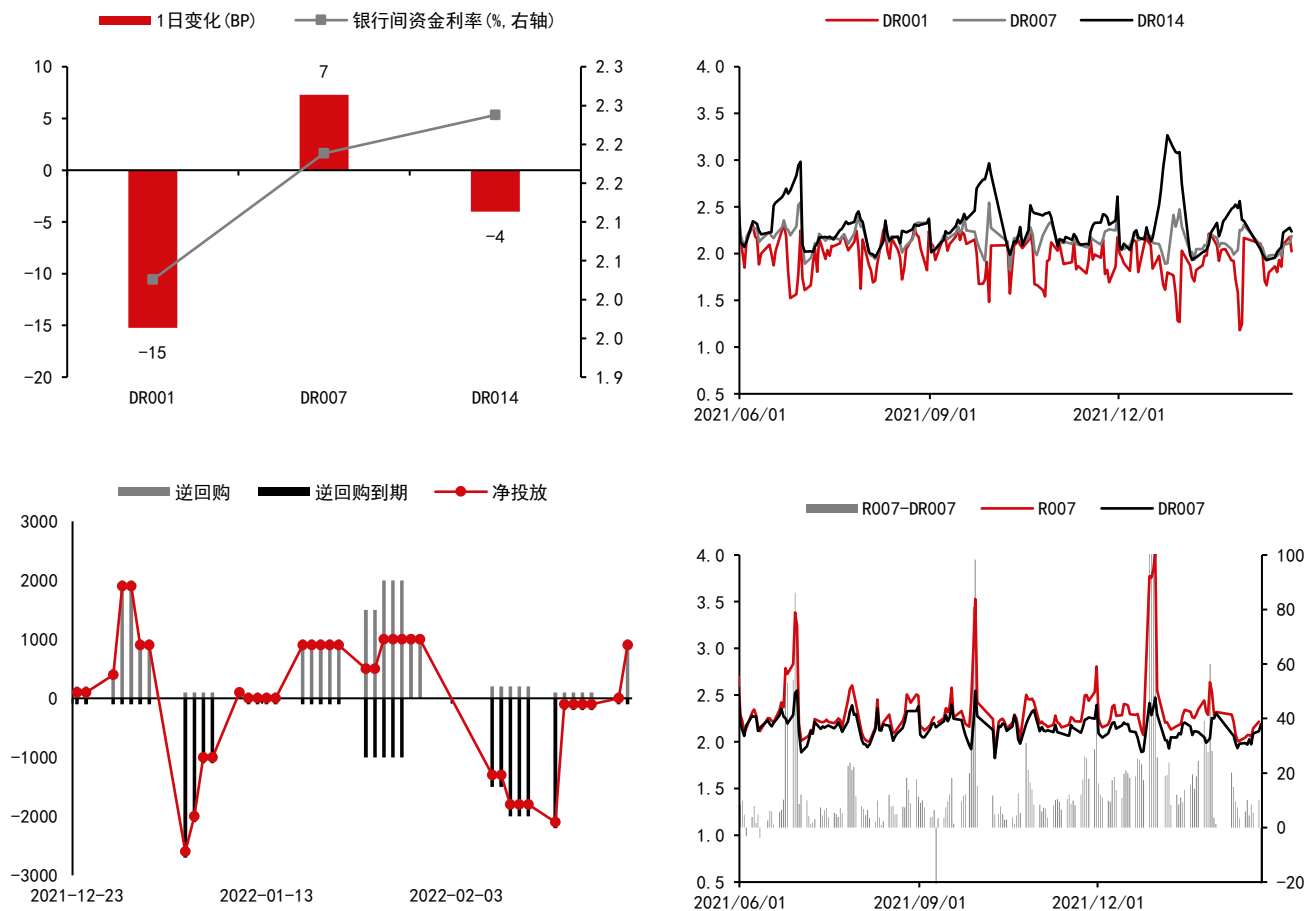
品种	1日沉淀资金变化(亿)	品种	5日沉淀资金变化(亿)	品种	沉淀资金(亿)
原油	4.69	豆粕	8.20	沪铜	121.44
豆粕	3.27	螺纹钢	7.61	螺纹钢	105.10
沪金	2.91	沪镍	7.56	豆粕	80.72
豆油	2.86	沪金	6.36	棕榈	76.05
沪镍	2.58	豆油	5.29	铁矿	75.87
沪铝	2.45	棕榈	4.17	沪金	70.71
沪银	2.11	原油	3.92	豆油	68.00
沥青	1.40	焦炭	3.45	沪银	58.53
沪胶	1.10	菜粕	3.15	沪铝	55.55
甲醇	0.91	PP	2.71	沪镍	54.09
菜粕	0.85	乙二醇	2.27	原油	50.91
塑料	0.76	焦煤	2.08	沪胶	41.89
PVC	0.71	沪铝	1.76	郑棉	38.39
TA	0.66	纸浆	1.29	热卷	34.68
LPG	0.59	玻璃	1.20	TA	33.18
苹果	0.56	淀粉	0.98	玉米	32.18
玉米	0.56	沥青	0.95	PP	31.78
燃油	0.53	沪胶	0.95	沪锌	31.12
沪铅	0.47	沪银	0.88	塑料	30.61
玻璃	0.45	硅铁	0.85	甲醇	29.84
苯乙烯	0.36	甲醇	0.72	沥青	27.79
尿素	0.34	燃油	0.72	乙二醇	27.77
PP	0.27	玉米	0.65	PVC	27.53
棕榈	0.23	苹果	0.64	郑糖	25.70
乙二醇	0.17	20号胶	0.54	沪锡	21.69
淀粉	0.15	热卷	0.53	纯碱	21.67
低硫燃油	0.05	沪铅	0.51	菜粕	19.77
鸡蛋	0.03	豆二	0.41	苹果	17.35
锰硅	0.02	纯碱	0.39	燃油	16.94
沪锡	0.01	郑糖	0.38	纸浆	16.94
棉纱	0.00	沪锡	0.36	菜油	15.77
粳米	-0.01	尿素	0.28	LPG	14.29
不锈钢	-0.01	菜油	0.17	玻璃	13.41
豆二	-0.02	塑料	0.11	焦炭	12.90
红枣	-0.04	棉纱	-0.01	苯乙烯	10.73
动煤	-0.07	动煤	-0.03	连豆	9.03
菜油	-0.07	粳米	-0.06	不锈钢	7.99
纸浆	-0.12	LPG	-0.10	淀粉	7.95
沪锌	-0.19	PVC	-0.17	焦煤	7.60
郑糖	-0.24	锰硅	-0.18	锰硅	7.59
郑棉	-0.33	红枣	-0.32	沪铅	7.44
20号胶	-0.34	郑棉	-0.35	硅铁	7.37
硅铁	-0.37	鸡蛋	-0.35	20号胶	6.73
焦煤	-0.46	低硫燃油	-0.41	鸡蛋	6.62
热卷	-0.59	苯乙烯	-0.58	低硫燃油	3.97
焦炭	-0.77	不锈钢	-0.87	尿素	3.53
纯碱	-0.77	沪锌	-0.94	红枣	3.04
连豆	-0.84	铁矿	-1.04	豆二	2.20
螺纹钢	-1.53	连豆	-1.53	动煤	0.82
铁矿	-2.57	沪铜	-1.61	粳米	0.51
沪铜	-3.59	TA	-1.99	棉纱	0.40

资料来源：Wind 中信期货研究部

说明：保证金按收盘价、交易所保证金标准、单边持仓计算

三、流动性跟踪

图表6: 银行间市场流动性跟踪



资料来源: Wind 中信期货研究部

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_37845



云报告
<https://www.yunbaogao.cn>

云报告
<https://www.yunbaogao.cn>

云报告
<https://www.yunbaogao.cn>