金融期货资金净流出

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

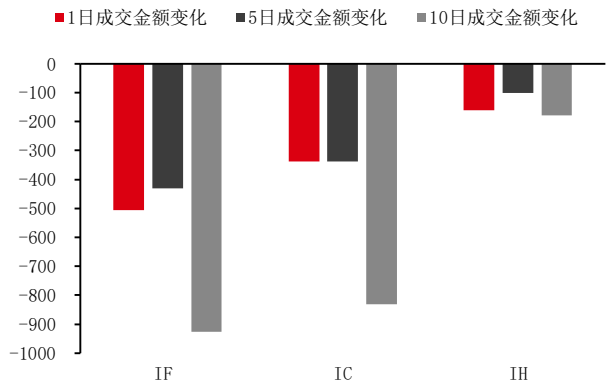
股指货流动性情况:

2020 年 9 月 23 日，沪深 300 期货(IF)成交 1342.30 亿元，较上一交易日减少 27.40%；持仓金额 2387.72 亿元，较上一交易日减少 6.94%；成交持仓比为 0.56 。中证 500 期货(IC)成交 1307.70 亿元，较上一交易日减少 20.50%；持仓金额 2688.48 亿元,较上一交易日减少 2.88%;成交持仓比为 0.49 。上证 50(IH)成交 388.34 亿元，较上一交易日减少 29.34%；持仓金额 710.25 亿元，较上一交易日减少 6.55%；成交持仓比为 0.55 。

国债期货流动性情况:

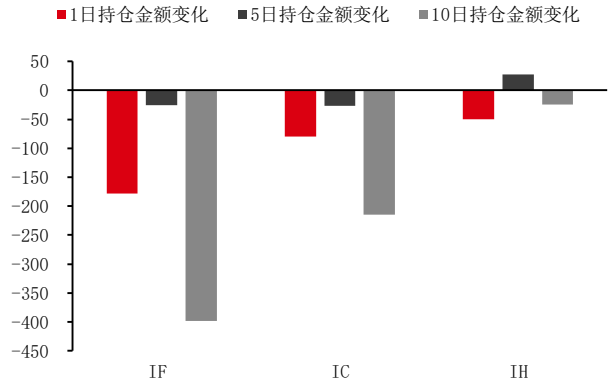
2020 年 9 月 23 日,2 年期债(TS)成交 138.59 亿元,较上一交易日减少 22.95%；持仓金额 434.46 亿元，较上一交易日减少 2.64%；成交持仓比为 0.32 。5 年期债(TF)成交 253.72 亿元，较上一交易日减少 13.13%；持仓金额 551.14 亿元，较上一交易日减少 4.06%；成交持仓比为 0.46 。10 年期债(T)成交 626.63 亿元，较上一交易日减少 21.69%；持仓金额 1058.31 亿元，较上一交易日减少 1.66%；成交持仓比为 0.59 。

图1：股指期货成交金额变化 单位:亿元



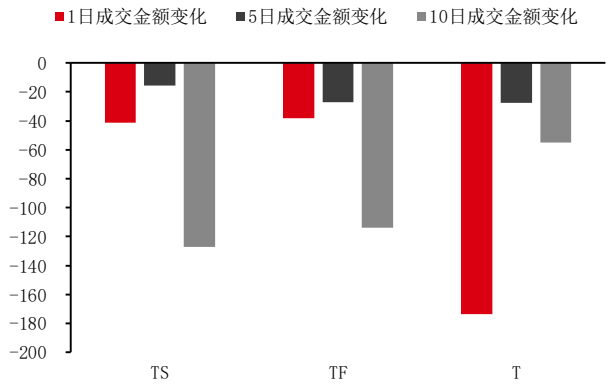
数据来源：Wind 华泰期货研究院

图2：股指期货持仓金额变化 单位：亿元



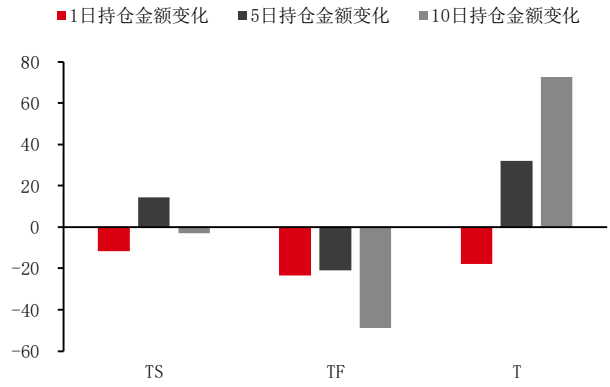
数据来源：Wind 华泰期货研究院

图3：国债期货成交金额变化 单位:亿元



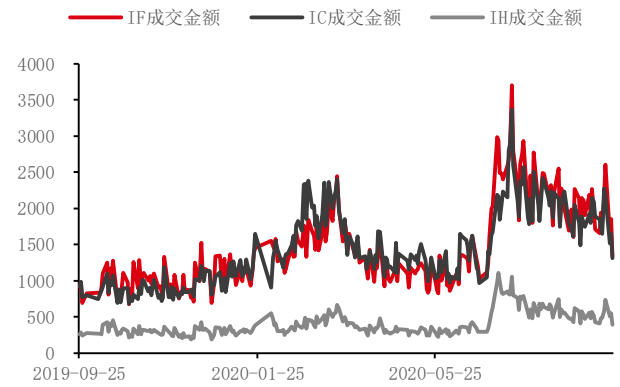
数据来源：Wind 华泰期货研究院

图4：国债期货持仓金额变化 单位：亿元



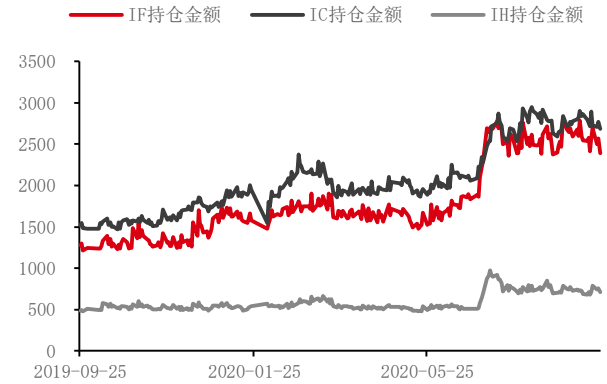
数据来源：Wind 华泰期货研究院

图5：股指期货成交金额 单位：亿元



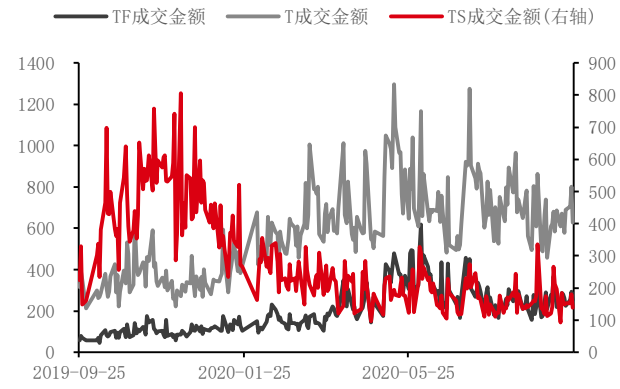
数据来源：Wind 华泰期货研究院

图6：股指期货持仓金额 单位：亿元



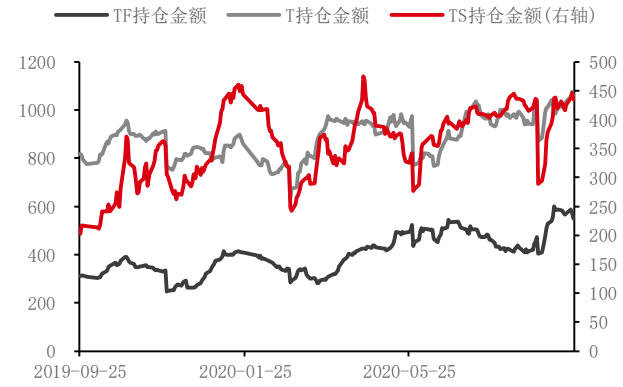
数据来源：Wind 华泰期货研究院

图7：国债期货成交金额 单位：亿元



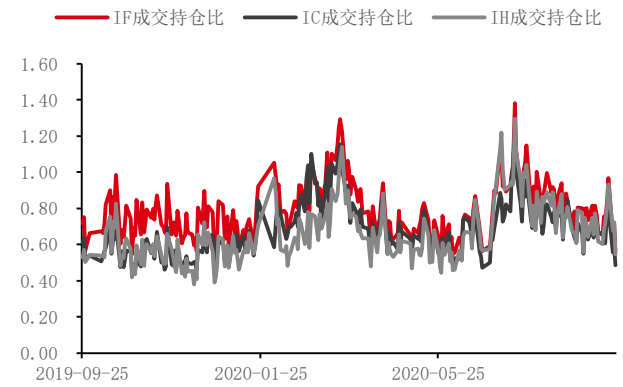
数据来源：Wind 华泰期货研究院

图8：国债期货持仓金额 单位：亿元



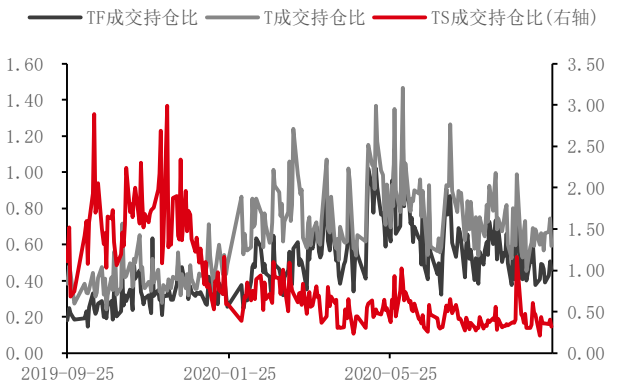
数据来源：Wind 华泰期货研究院

图9：股指期货成交持仓比 单位：无



数据来源：Wind 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：Wind 华泰期货研究院

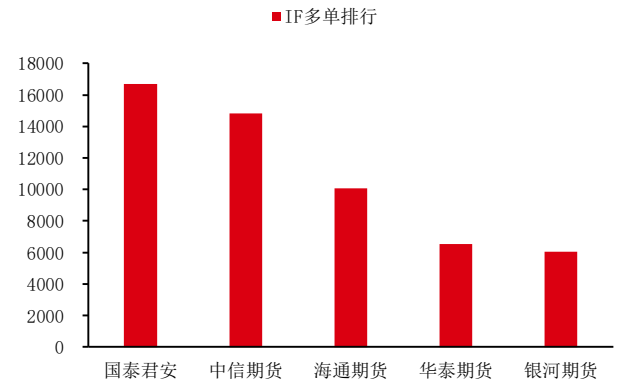
表格 1：金融期货持仓排行

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	54205	42.16	74379	57.84	0	20174
IF	前十名合计	79616	44.03	101191	55.97	0	21575
IF	前二十名合计	106193	44.77	131026	55.23	0	24833
IC	前五名合计	66659	42.68	89528	57.32	0	22869
IC	前十名合计	103420	44.53	128812	55.47	0	25392
IC	前二十名合计	138736	46.07	162426	53.93	0	23690
IH	前五名合计	20548	41.23	29290	58.77	0	8742
IH	前十名合计	30575	42.70	41036	57.30	0	10461
IH	前二十名合计	40852	44.56	50822	55.44	0	9970
TS	前五名合计	12496	48.44	13300	51.56	0	804
TS	前十名合计	16310	48.75	17143	51.25	0	833

TS	前二十名合计	19318	48.91	20179	51.09	0	861
TF	前五名合计	23844	51.93	22073	48.07	1771	0
TF	前十名合计	33886	49.61	34418	50.39	0	532
TF	前二十名合计	43984	48.10	47464	51.90	0	3480
T	前五名合计	42647	48.26	45717	51.74	0	3070
T	前十名合计	59605	46.62	68237	53.38	0	8632
T	前二十名合计	80258	47.53	88586	52.47	0	8328

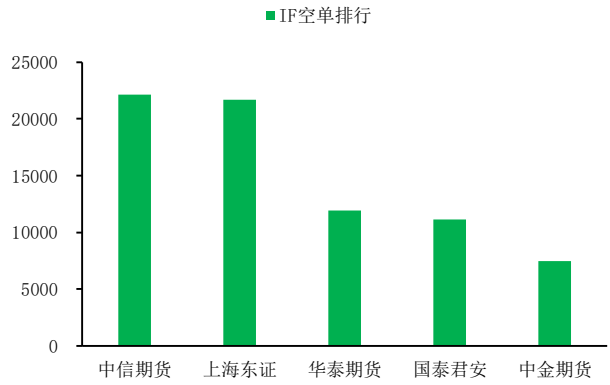
数据来源：Wind 华泰期货研究院

图11： IF 多单持仓排行 单位：手



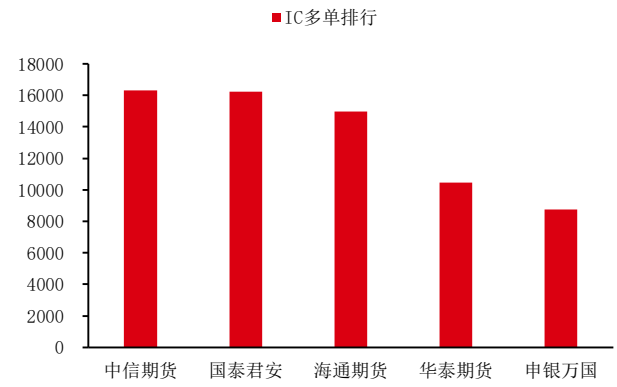
数据来源：Wind 华泰期货研究院

图12： IF 空单持仓排行 单位：手



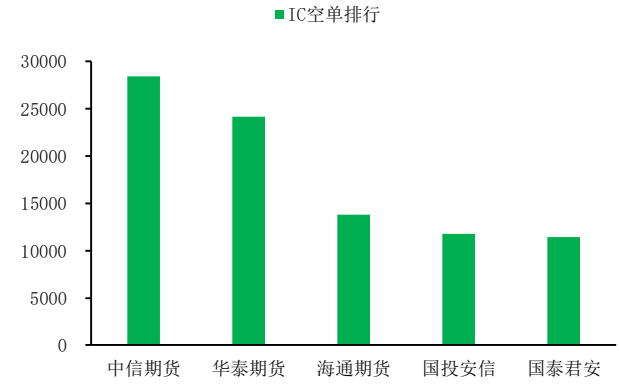
数据来源：Wind 华泰期货研究院

图13： IC 多单持仓排行 单位：手



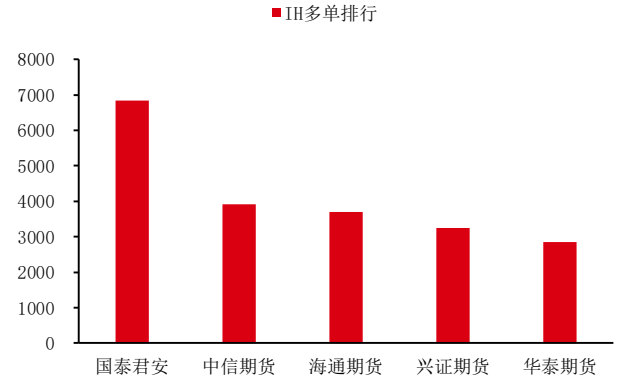
数据来源：Wind 华泰期货研究院

图14： IC 空单持仓排行 单位：手



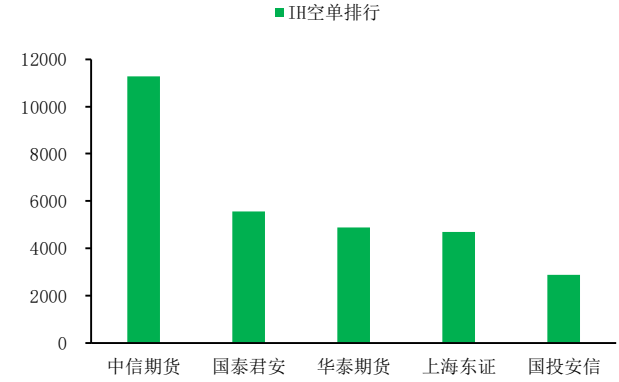
数据来源：Wind 华泰期货研究院

图15： IH 多单持仓排行 单位：手



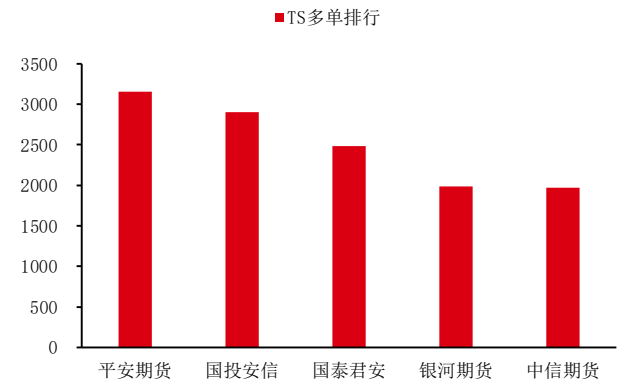
数据来源：Wind 华泰期货研究院

图16： IH 空单持仓排行 单位：手



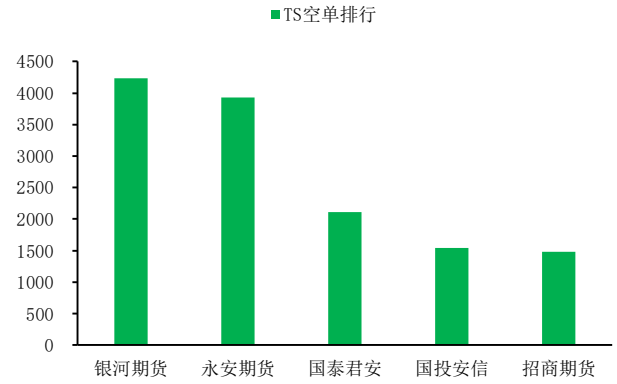
数据来源：Wind 华泰期货研究院

图17： TS 多单持仓排行 单位：手



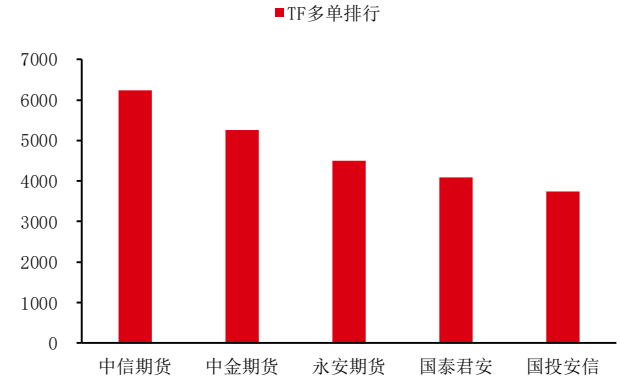
数据来源：Wind 华泰期货研究院

图18： TS 空单持仓排行 单位：手



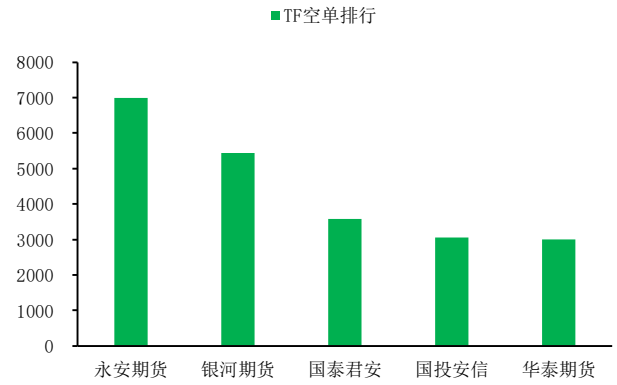
数据来源：Wind 华泰期货研究院

图19： TF 多单持仓排行 单位：手



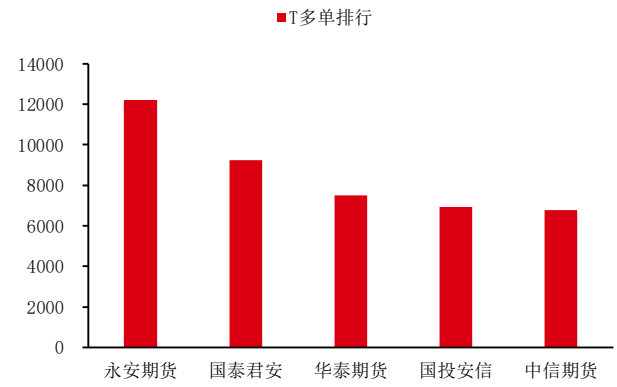
数据来源：Wind 华泰期货研究院

图20： TF 空单持仓排行 单位：手



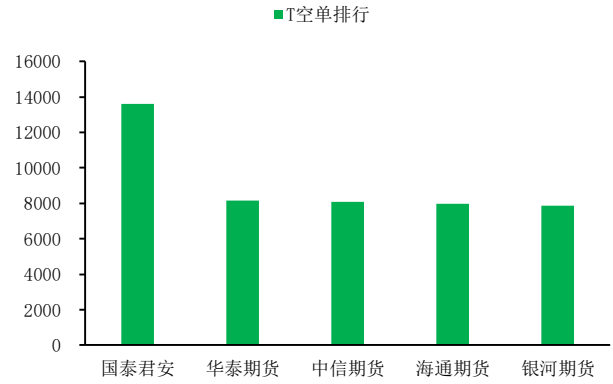
数据来源：Wind 华泰期货研究院

图21： T 多单持仓排行 单位：手



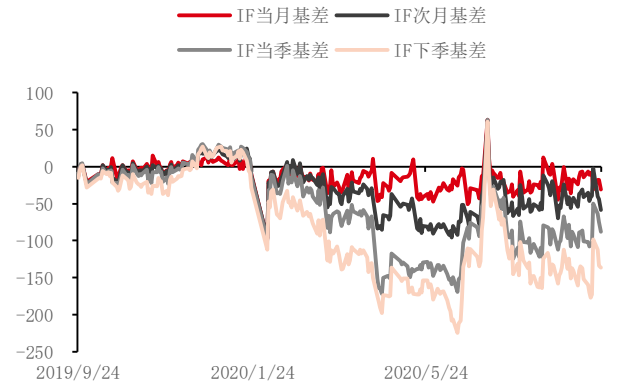
数据来源：Wind 华泰期货研究院

图22： T 空单持仓排行 单位：手



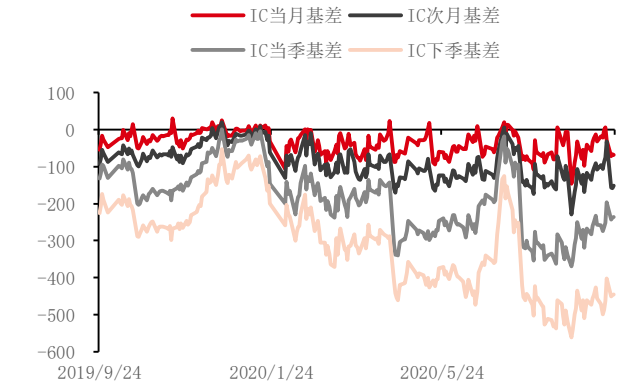
数据来源：Wind 华泰期货研究院

图23： IF 基差 单位：指数点



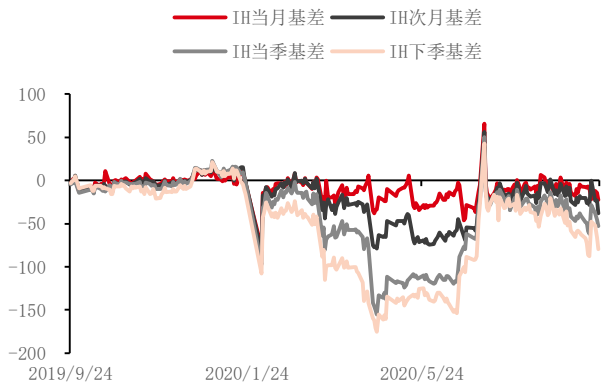
数据来源：Wind 华泰期货研究院

图24： IC 基差 单位：指数点



数据来源：Wind 华泰期货研究院

图25： IH 基差 单位：指数点



数据来源：Wind 华泰期货研究院

免责声明

本报告基于本公司认为可靠的、已公开的信息编制，但本公司对该等信息的准确性及完整性不作任何保证。本报告所载的意见、结论及预测仅反映报告发布当日的观点和判断。在不同时期，本公司可能会发出与本报告所载意见、评估及预测不一致的研究报告。本公司不保证本报告所含信息保持在最新状态。本公司对本报告所含信息可在不发出通知的情形下做出修改，投资者应当自行关注相应的更新或修改。

本公司力求报告内容客观、公正，但本报告所载的观点、结论和建议仅供参考，投资者并不能依靠本报告以取代行使独立判断。对投资者依据或者使用本报告所造成的一切后果，本公司及作者均不承担任何法律责任。

本报告版权仅为本公司所有。未经本公司书面许可，任何机构或个人不得以翻版、复制、发表、引用或再次分发他人等任何形式侵犯本公司版权。如征得本公司同意进行引用、刊发的，需在允许的范围内使用，并注明出处为“华泰期货研究院”，且不得对本报告进行任何有悖原意的引用、删节和修改。本公司保留追究相关责任的权力。所有本报告中使用的商标、服务标记及标记均为本公司的商标、服务标记及标记。

华泰期货有限公司版权所有并保留一切权利。

公司总部

地址：广东省广州市越秀区东风东路761号丽丰大厦20层

电话：400-6280-888

网址：www.htfc.com