



天然橡胶市场活跃

品种流动性情况:

2018年9月20日, 冶金焦炭减仓 437616.87 万元, 环比减少 5.24%, 位于当日全品种减仓排名首位。天然橡胶增仓 454644.88 万元, 环比增长 8.40%, 位于当日全品种增仓排名首位; 锌、鲜苹果 5 日、10 日滚动增仓最多; 冶金焦炭、PTA 5 日、10 日滚动减仓最多。成交金额上, 螺纹钢、焦炭和锌分别成交 17080350.68 万元、13283075.97 万元和 11758247.35 万元(环比:-3.11%、-12.70%、-7.45%), 位于当日成交金额排名前三名。

板块流动性情况:

本报告板块划分采用 Wind 大类商品划分标准, 共分为有色、油脂油料、软商品、农副产品、能源、煤焦钢矿、化工、贵金属、谷物和非金属建材 10 个板块。2018 年 9 月 20 日, 油脂油料板块位于增仓首位; 煤焦钢矿板块位于减仓首位。成交量上煤焦钢矿、有色和化工三个板块分别成交 4063.64 亿元、3106.56 亿元和 2715.19 亿元, 位于当日板块成交金额排名前三; 非金属建材、农副产品和谷物板块成交低迷。

华泰期货研究院 量化组

罗剑

量化研究员

☎ 0755-23887993

✉ luojian@htfc.com

从业资格号: F3029622

投资咨询号: Z0012563

联系人:

石雨婷

量化研究员

☎ 0755-23887993

✉ shiyuting@htfc.com

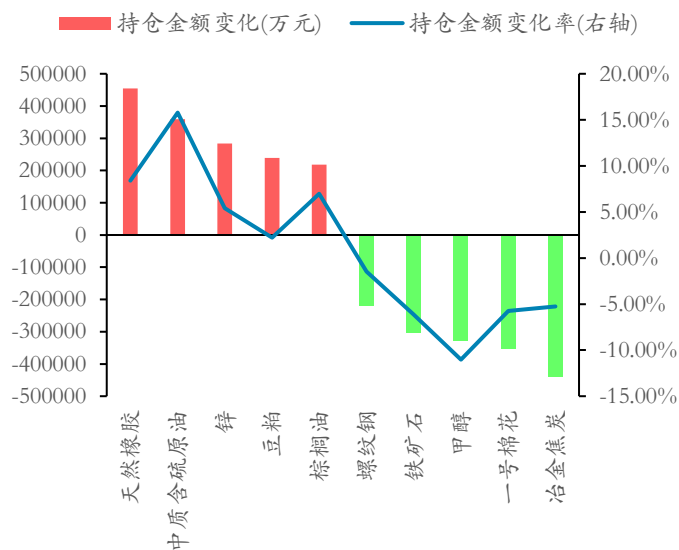
从业资格号: F3039731

目錄

图 1:	前一交易日增减仓前五名品种持仓金额变化情况	3
图 2:	前一交易日成交金额前十名品种成交情况	3
图 3:	前一交易日各板块持仓金额变化情况	3
图 4:	前一交易日各板块成交金额情况	3
图 5:	5 日滚动增减仓前五名品种持仓金额变化情况	4
图 6:	5 日滚动成交金额前十名品种成交情况	4
图 7:	5 日滚动各板块持仓金额变化情况	4
图 8:	5 日滚动各板块成交金额情况	4
图 9:	10 日滚动增减仓前五名品种持仓金额变化情况	5
图 10:	10 日滚动成交金额前十名品种成交情况	5
图 11:	10 日滚动各板块持仓金额变化情况	5
图 12:	10 日滚动各板块成交金额情况	5
图 13:	各版块持仓金额(万元)	6
图 14:	各版块成交金额(万元)	6
图 15:	中国商品期货市场持仓金额、成交金额与 Wind 商品指数	7
图 16:	有色板块持仓金额、成交金额与 Wind 有色指数	7
图 17:	油脂油料板块持仓金额、成交金额与 Wind 油脂油料指数	8
图 18:	软商品板块持仓金额、成交金额与 Wind 软商品指数	8
图 19:	农副产品板块持仓金额、成交金额与 Wind 农副产品指数	9
图 20:	谷物板块持仓金额、成交金额与 Wind 谷物指数	9
图 21:	贵金属板块持仓金额、成交金额与 Wind 贵金属指数	10
图 22:	能源板块持仓金额、成交金额与 Wind 能源指数	10
图 23:	煤焦钢矿持仓金额、成交金额与 Wind 煤焦钢矿指数	11
图 24:	非金属建材持仓金额、成交金额与 Wind 非金属建材指数	11
图 25:	化工板块持仓金额、成交金额与 Wind 化工指数	12
图 26:	有色板块月度成交金额(亿元)	12
图 27:	油脂油料板块月度成交金额(亿元)	12
图 28:	软商品板块月度成交金额(亿元)	13
图 29:	农副产品板块月度成交金额(亿元)	13
图 30:	谷物板块月度成交金额(亿元)	13
图 31:	贵金属板块月度成交金额(亿元)	13
图 32:	能源板块月度成交金额(亿元)	14
图 33:	焦煤钢矿板块月度成交金额(亿元)	14
图 34:	非金属建材板块月度成交金额(亿元)	14
图 35:	化工板块月度成交金额(亿元)	14

图1：前一交易日增减仓前五名品种持仓金额变化情况

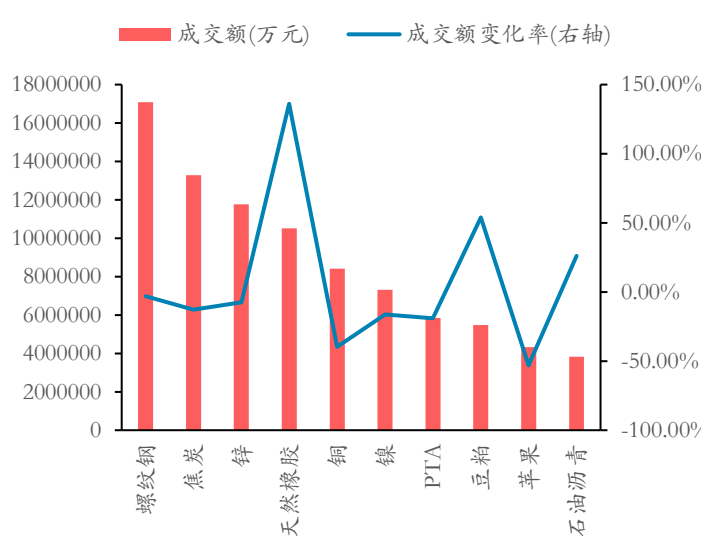
2018-09-20



数据来源：Wind 华泰期货研究院

图2：前一交易日成交金额前十名品种成交情况

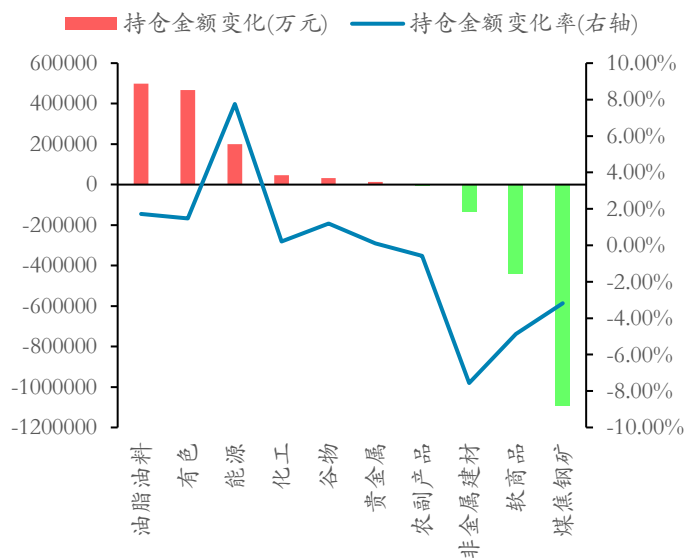
2018-09-20



数据来源：Wind 华泰期货研究院

图3：前一交易日各板块持仓金额变化情况

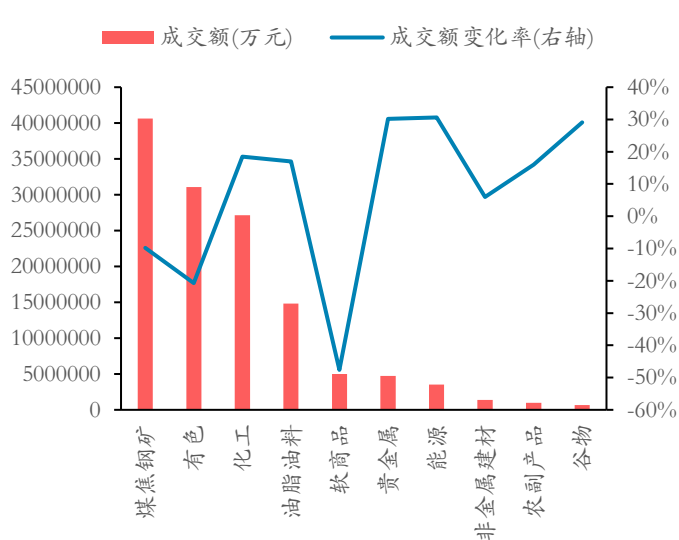
2018-09-20



数据来源：Wind 华泰期货研究院

图4：前一交易日各板块成交金额情况

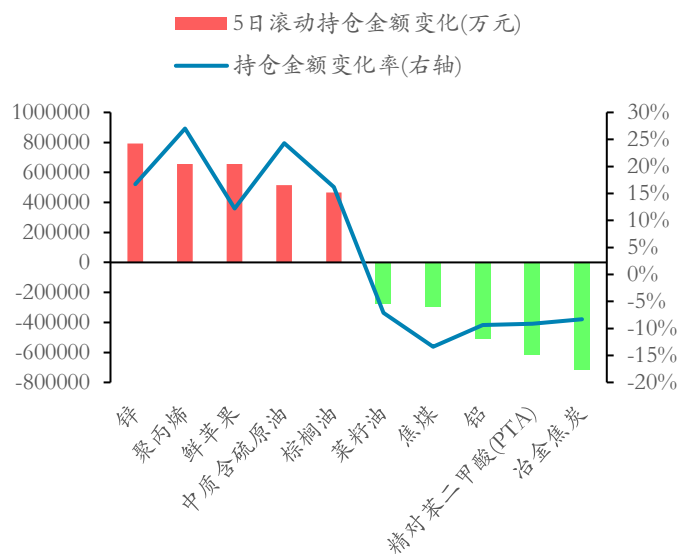
2018-09-20



数据来源：Wind 华泰期货研究院

图5：5日滚动增减仓前五名品种持仓金额变化情况

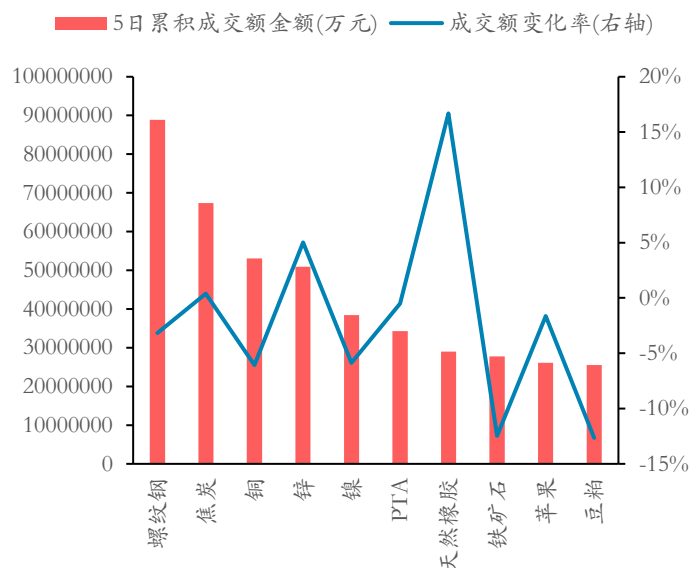
2018-09-13 至 2018-09-20



数据来源：Wind 华泰期货研究院

图6：5日滚动成交金额前十名品种成交情况

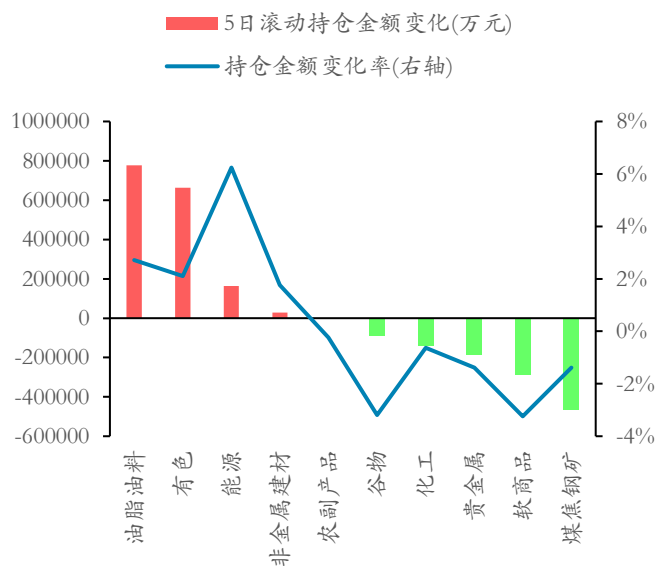
2018-09-13 至 2018-09-20



数据来源：Wind 华泰期货研究院

图7：5日滚动各板块持仓金额变化情况

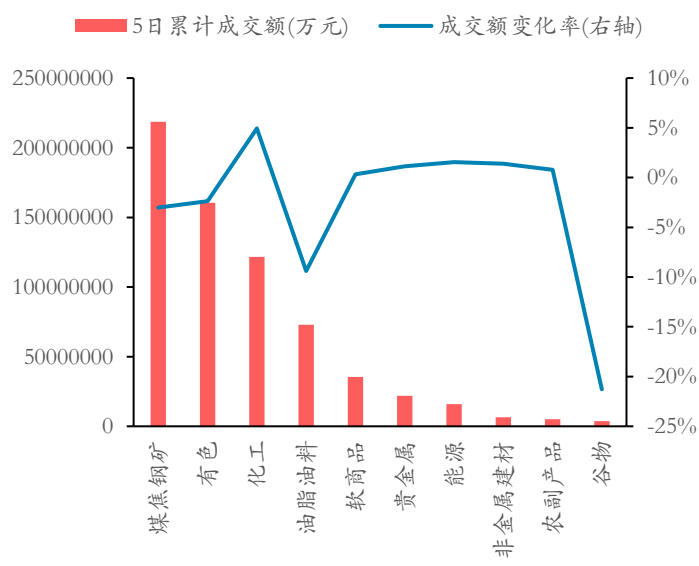
2018-09-13 至 2018-09-20



数据来源：Wind 华泰期货研究院

图8：5日滚动各板块成交金额情况

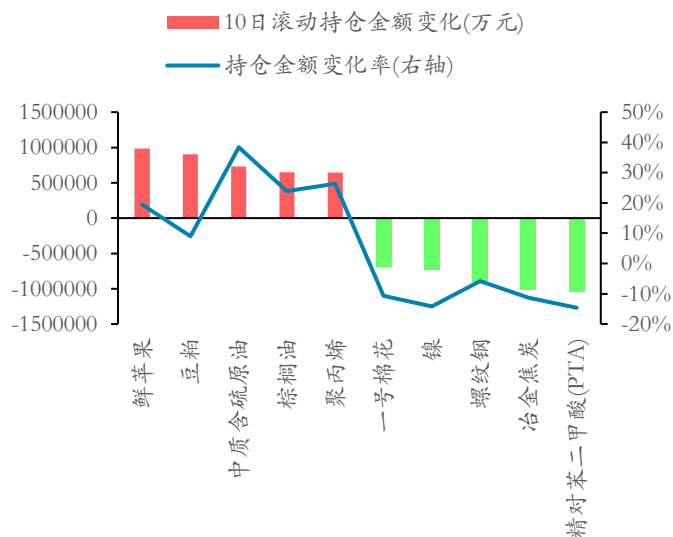
2018-09-13 至 2018-09-20



数据来源：Wind 华泰期货研究院

图9: 10日滚动增减仓前五名品种持仓金额变化情况

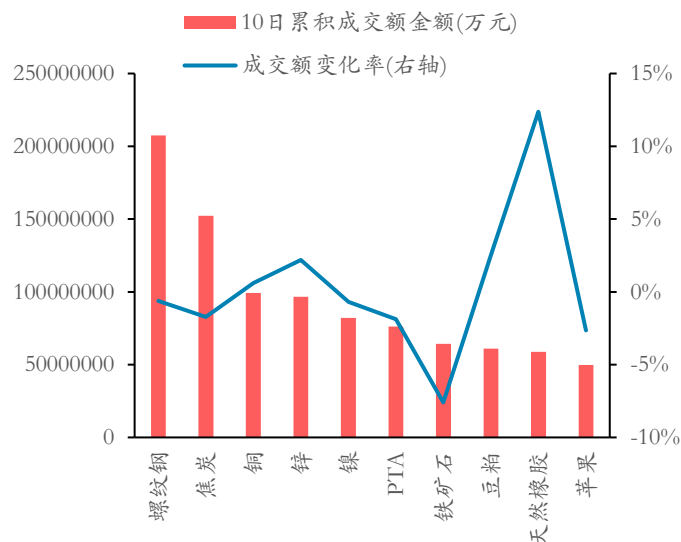
2018-09-06 至 2018-09-20



数据来源: Wind 华泰期货研究院

图10: 10日滚动成交金额前十名品种成交情况

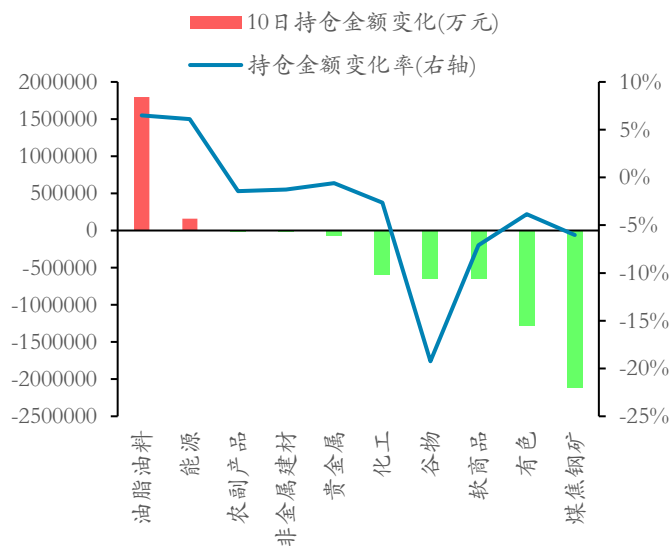
2018-09-06 至 2018-09-20



数据来源: Wind 华泰期货研究院

图11: 10日滚动各板块持仓金额变化情况

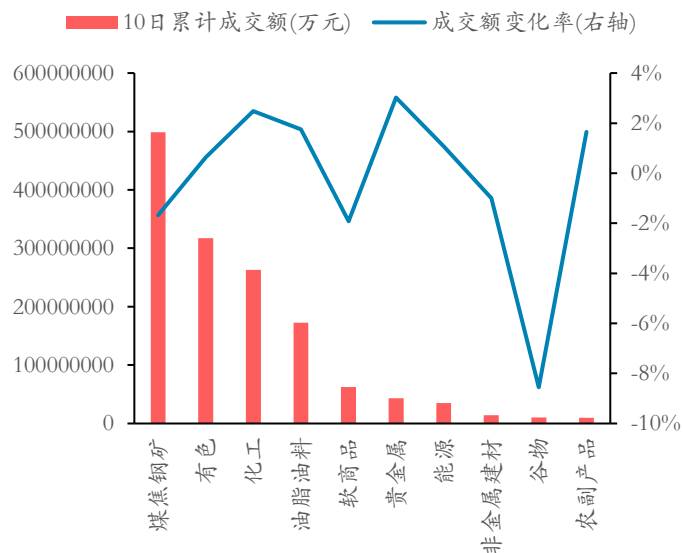
2018-09-06 至 2018-09-20



数据来源: Wind 华泰期货研究院

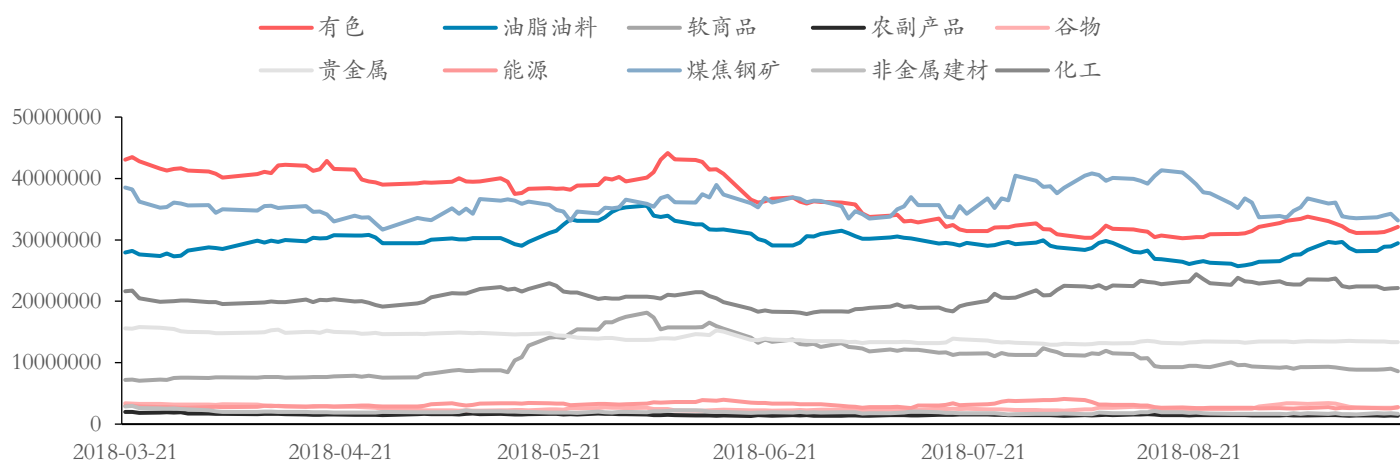
图12: 10日滚动各板块成交金额情况

2018-09-06 至 2018-09-20



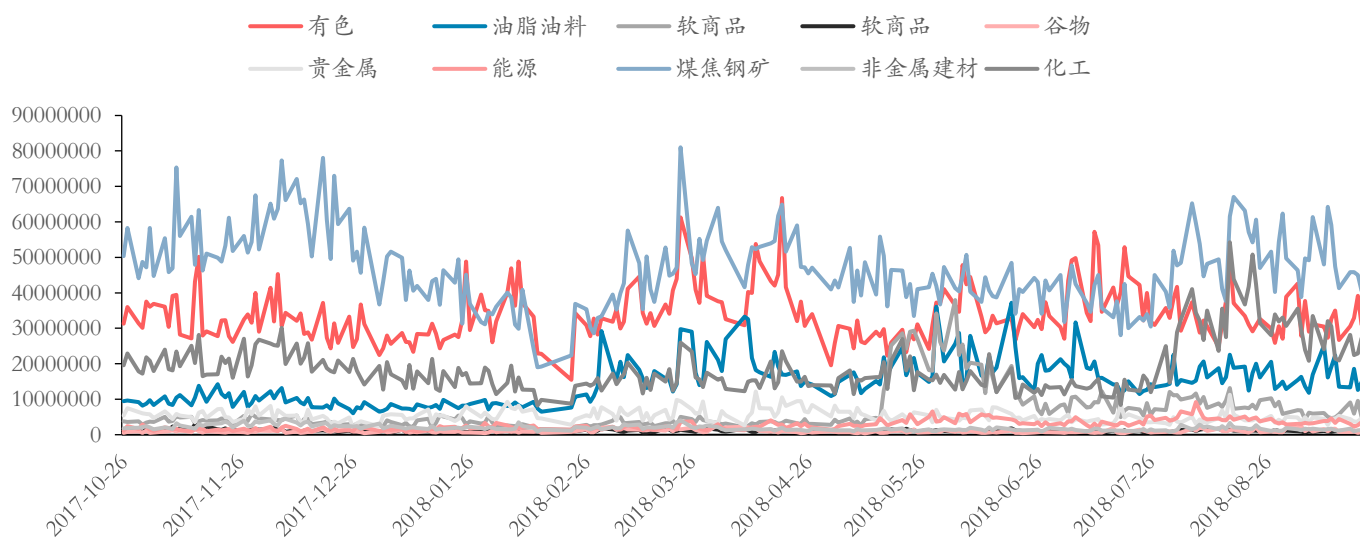
数据来源: Wind 华泰期货研究院

图13: 各版块持仓金额(万元)



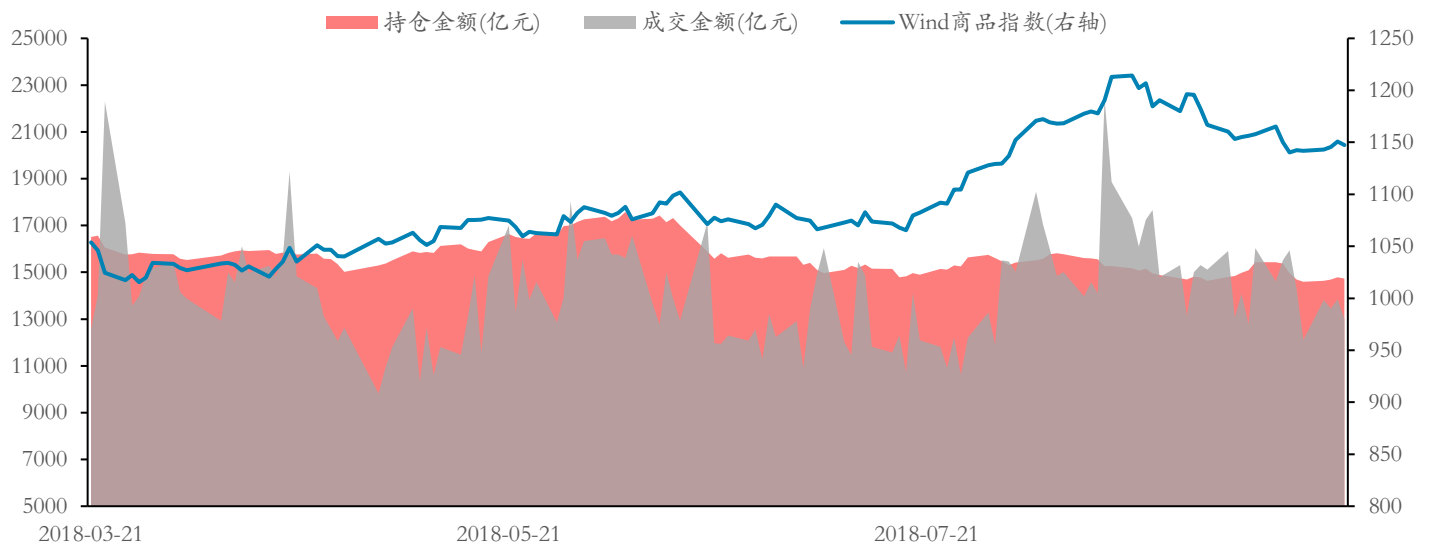
数据来源: Wind 华泰期货研究院

图14: 各版块成交金额(万元)



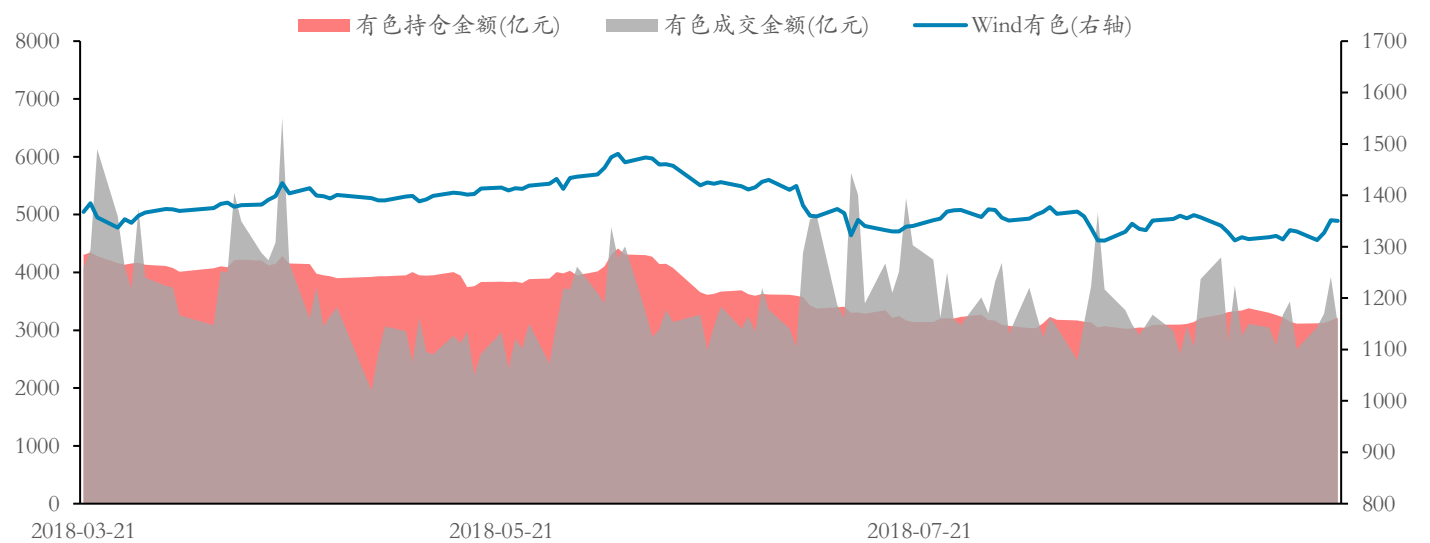
数据来源: Wind 华泰期货研究院

图15: 中国商品期货市场持仓金额、成交金额与 Wind 商品指数



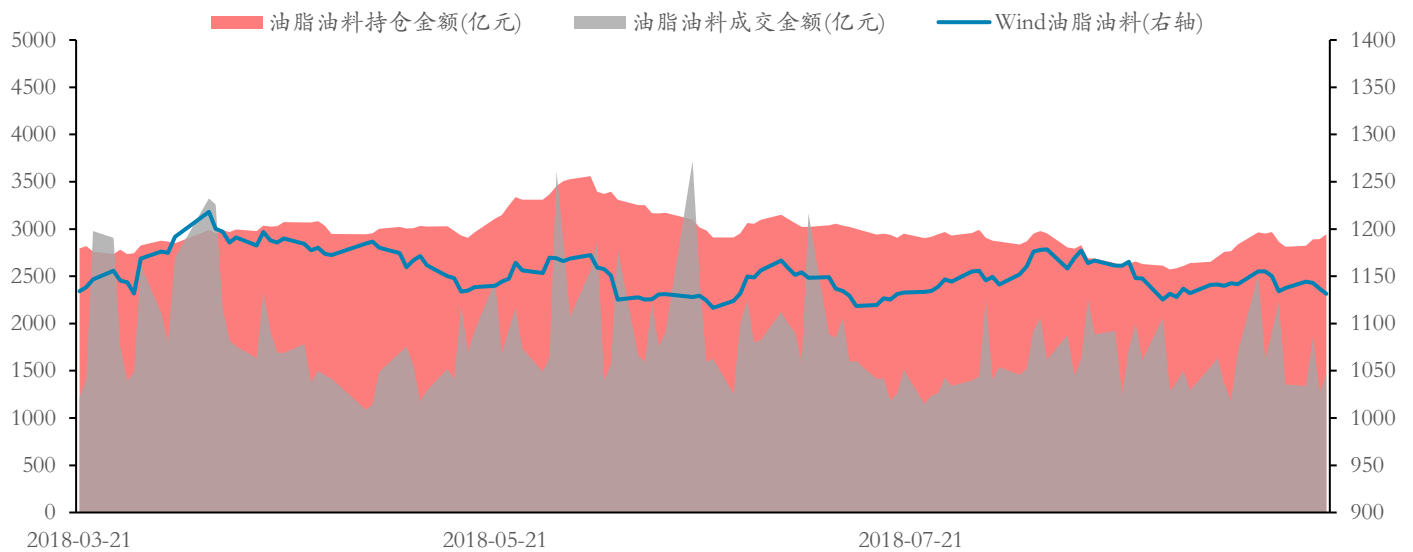
数据来源: Wind 华泰期货研究院

图16: 有色板块持仓金额、成交金额与 Wind 有色指数



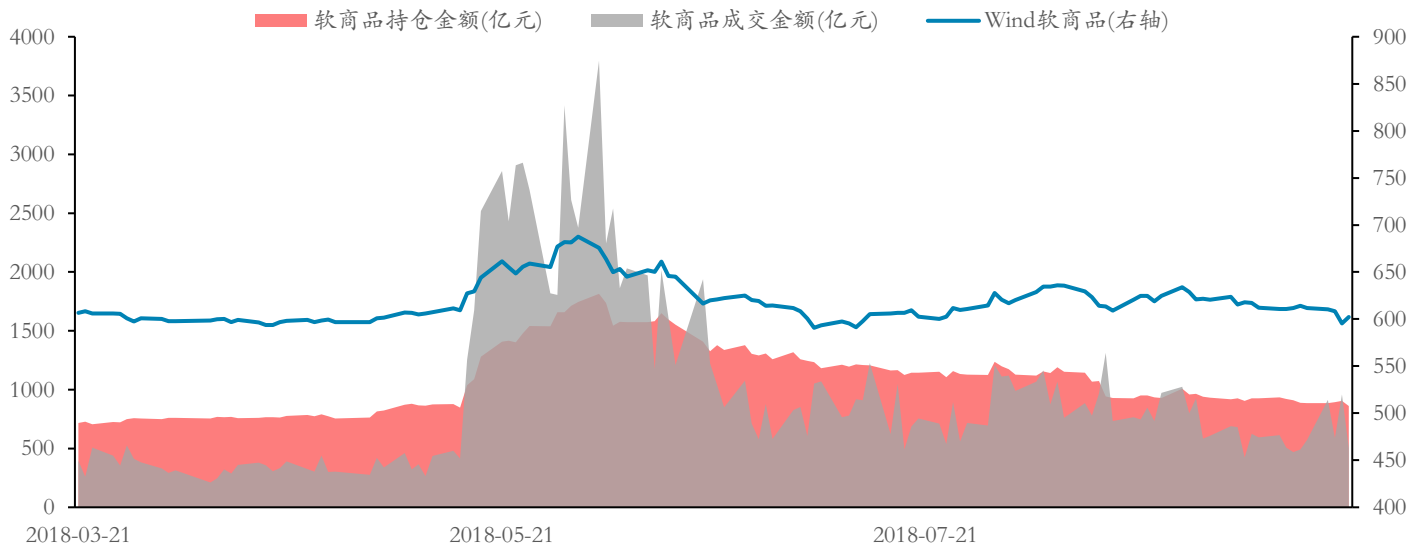
数据来源: Wind 华泰期货研究院

图17: 油脂油料板块持仓金额、成交金额与 Wind 油脂油料指数



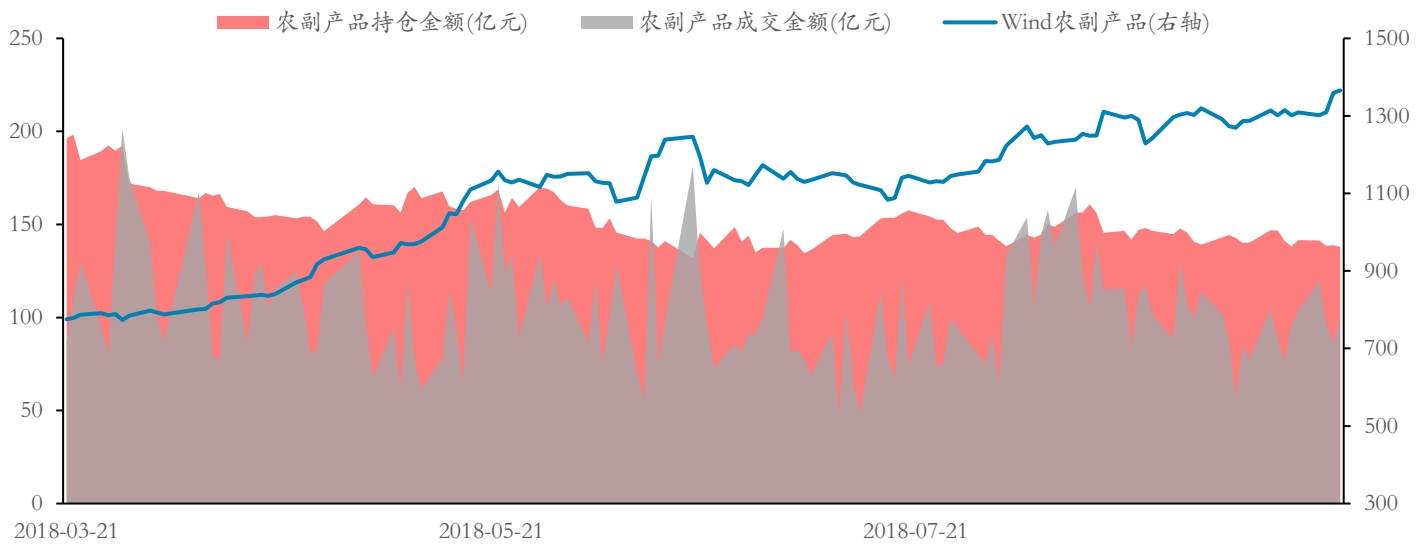
数据来源: Wind 华泰期货研究院

图18: 软商品板块持仓金额、成交金额与 Wind 软商品指数



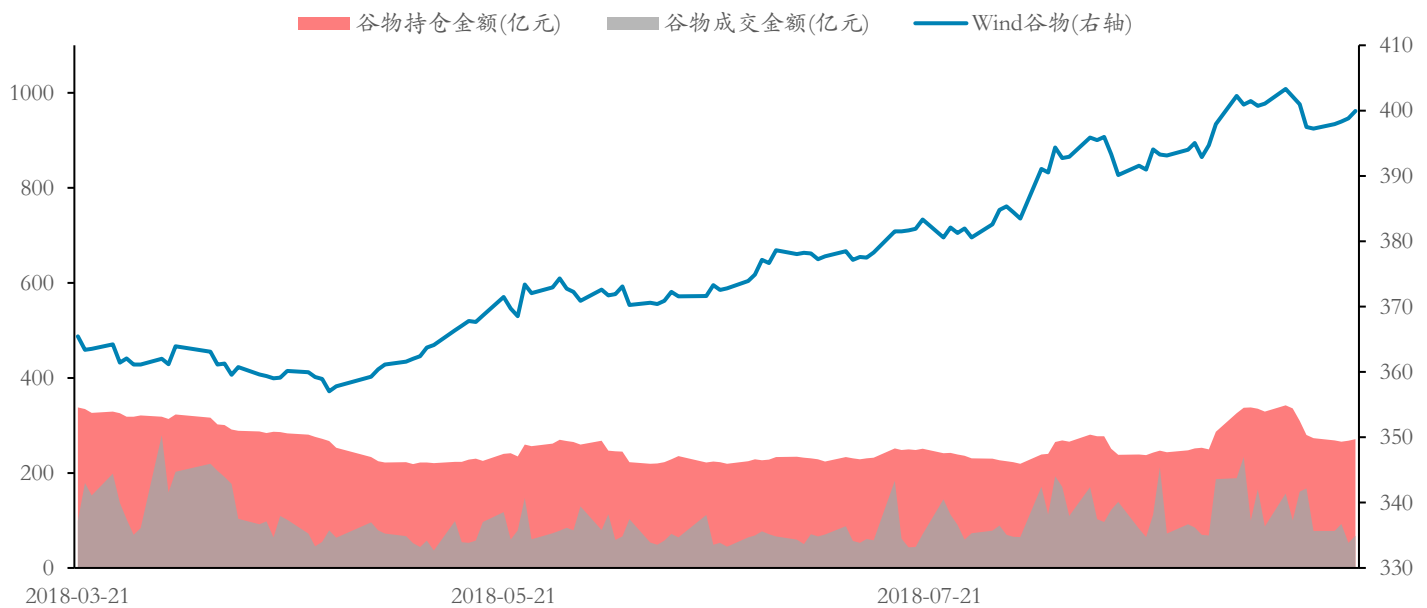
数据来源: Wind 华泰期货研究院

图19: 农副产品板块持仓金额、成交金额与 Wind 农副产品指数



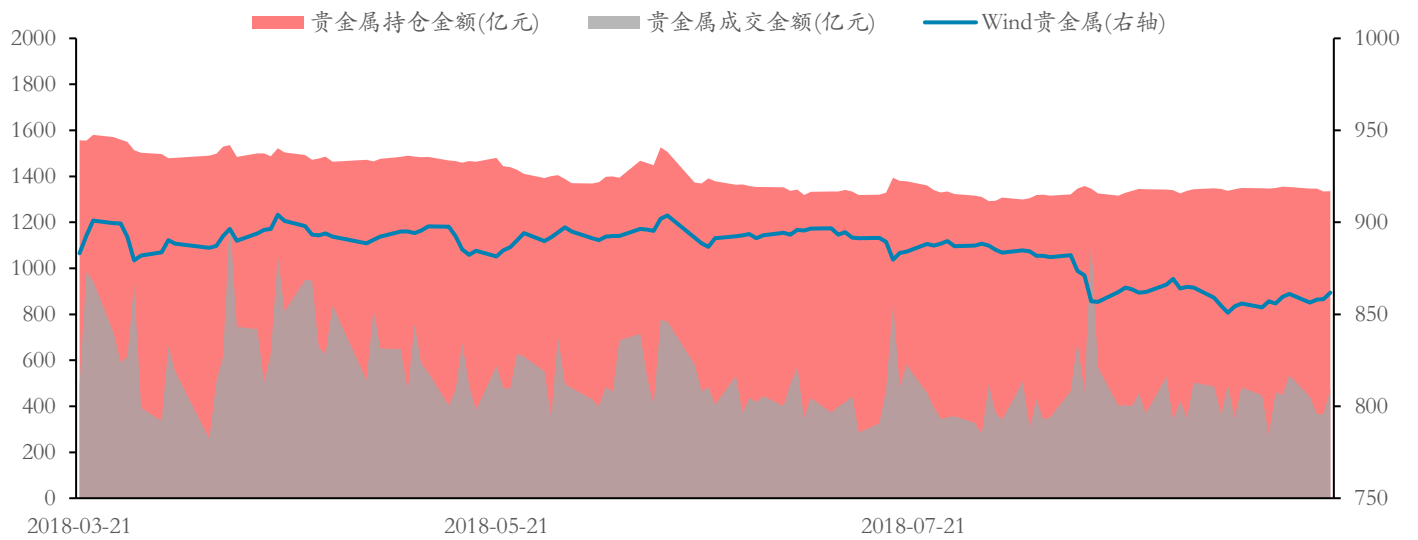
数据来源: Wind 华泰期货研究院

图20: 谷物板块持仓金额、成交金额与 Wind 谷物指数



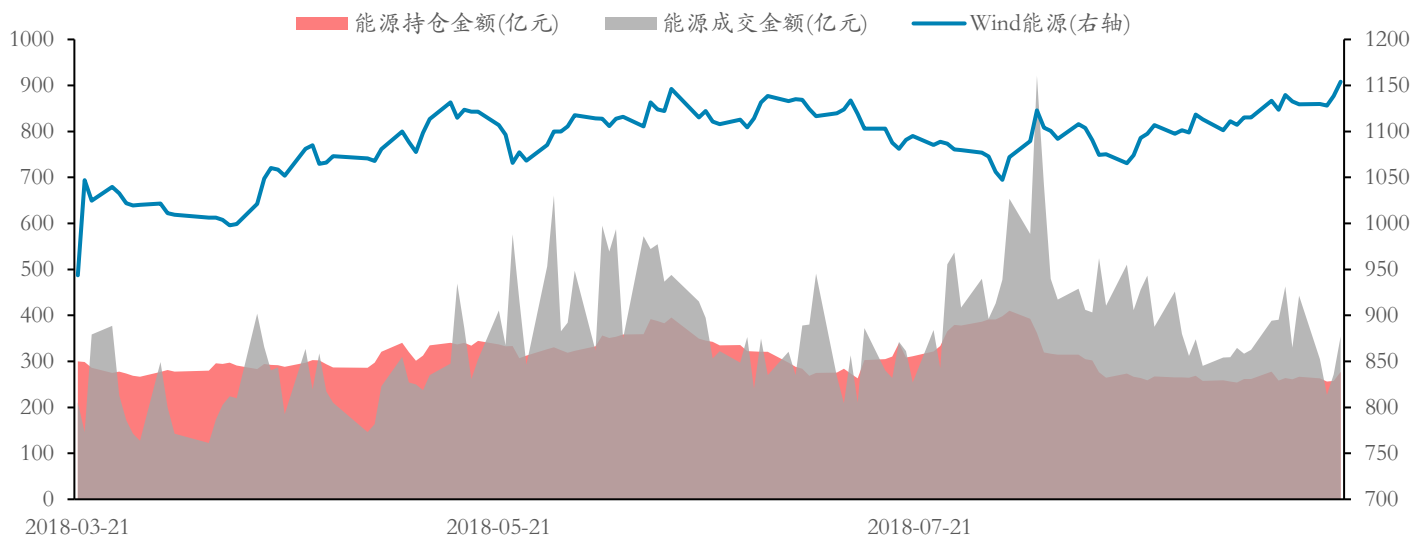
数据来源: Wind 华泰期货研究院

图21: 贵金属板块持仓金额、成交金额与 Wind 贵金属指数



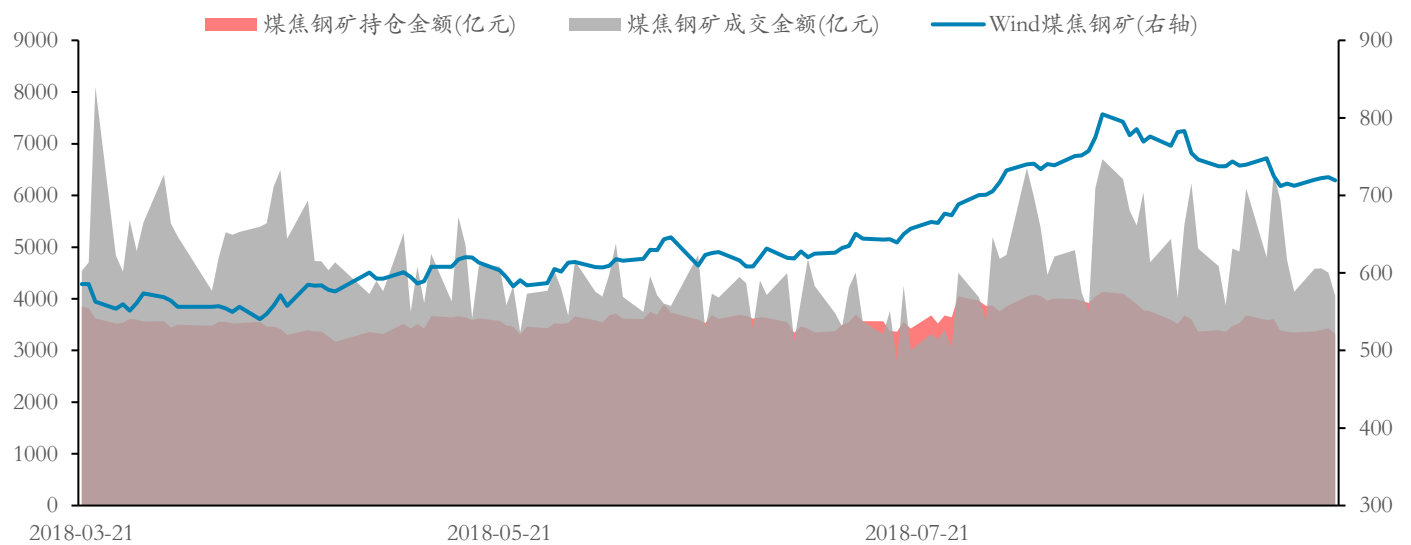
数据来源: Wind 华泰期货研究院

图22: 能源板块持仓金额、成交金额与 Wind 能源指数



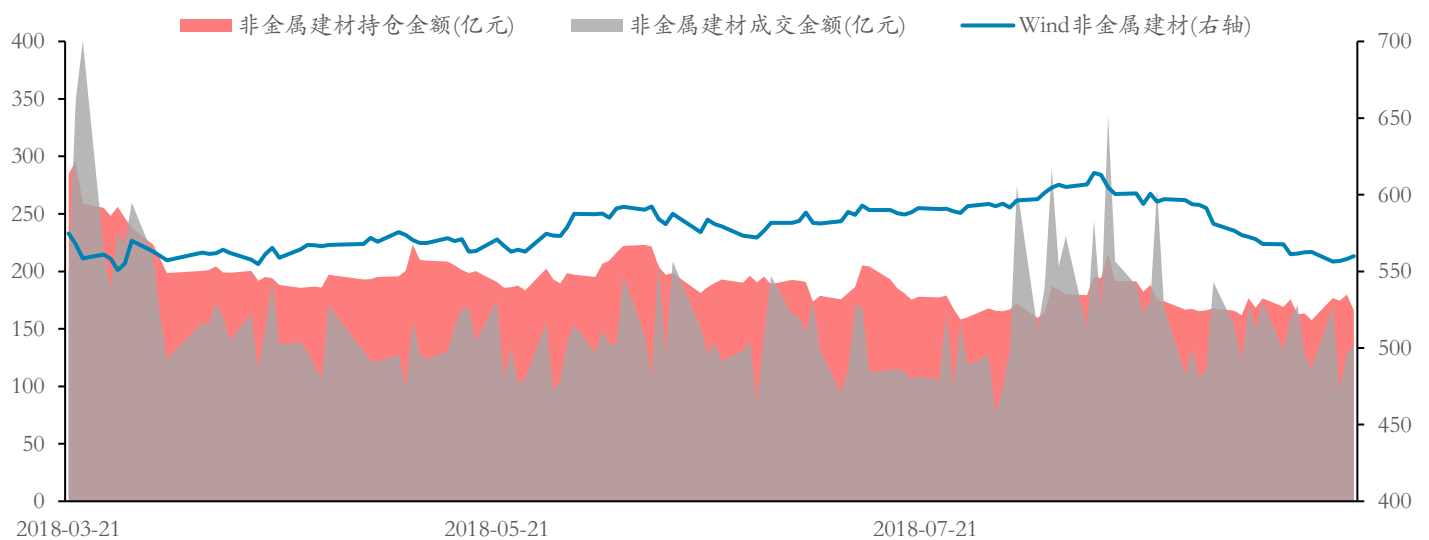
数据来源: Wind 华泰期货研究院

图23: 煤焦钢矿持仓金额、成交金额与 Wind 煤焦钢矿指数



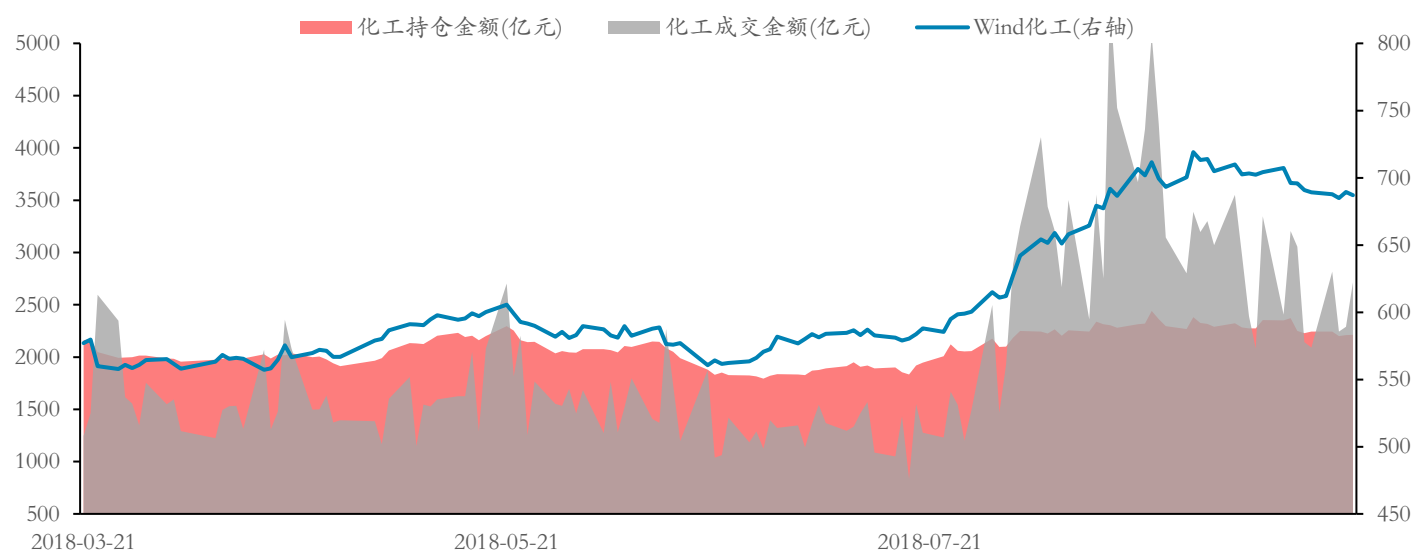
数据来源: Wind 华泰期货研究院

图24: 非金属建材持仓金额、成交金额与 Wind 非金属建材指数



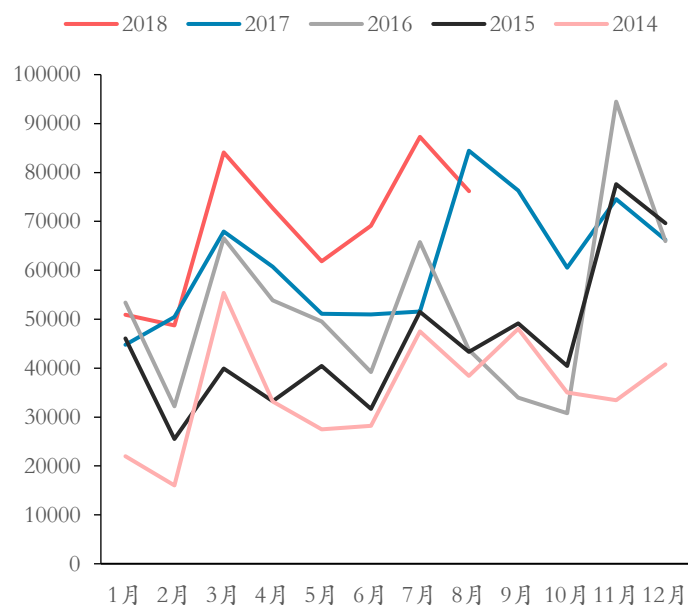
数据来源: Wind 华泰期货研究院

图25: 化工板块持仓金额、成交金额与Wind化工指数



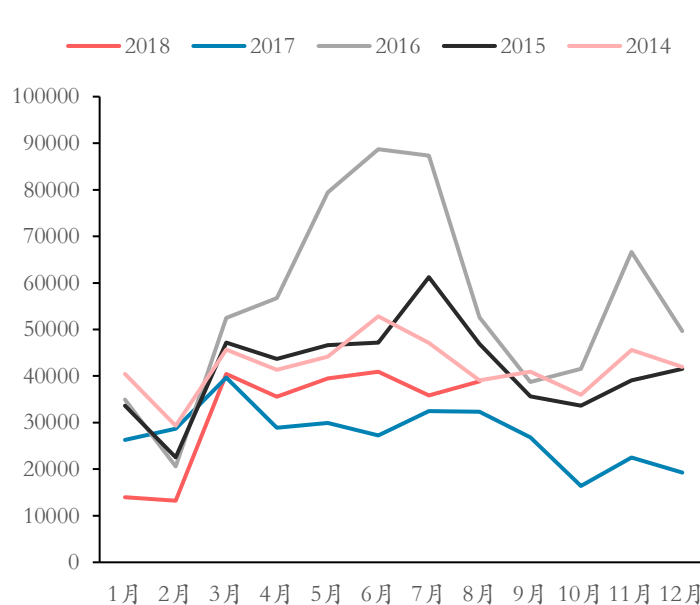
数据来源: Wind 华泰期货研究院

图26: 有色板块月度成交金额(亿元)



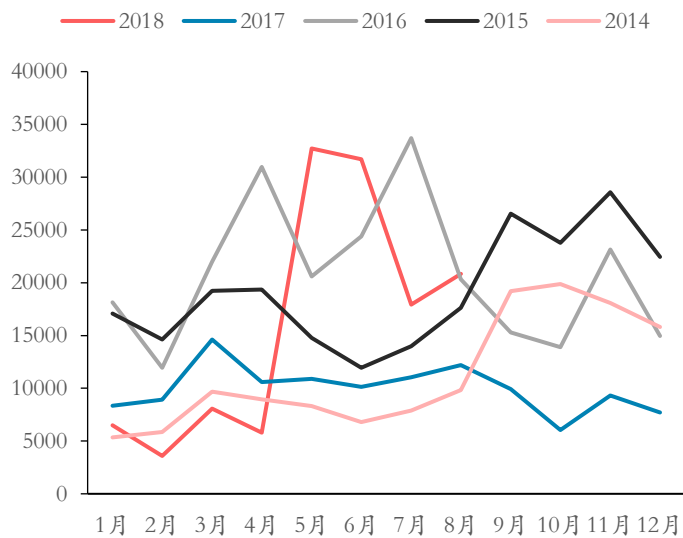
数据来源: Wind 华泰期货研究院

图27: 油脂油料板块月度成交金额(亿元)



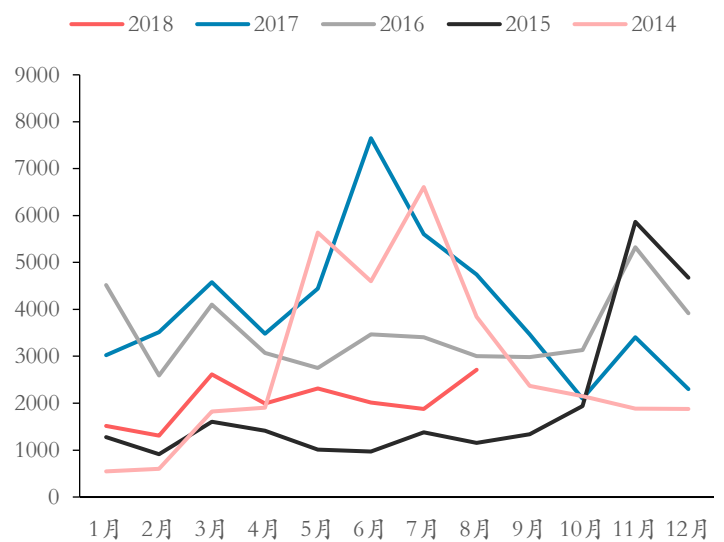
数据来源: Wind 华泰期货研究院

图28: 软商品板块月度成交金额(亿元)



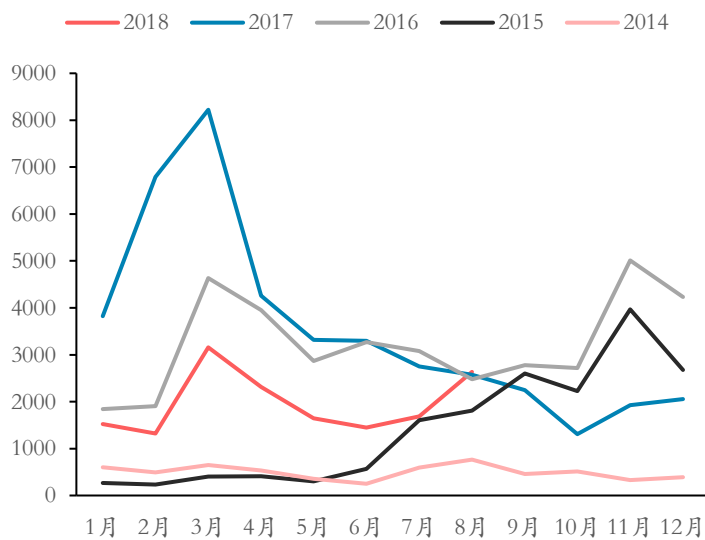
数据来源: Wind 华泰期货研究院

图29: 农副产品板块月度成交金额(亿元)



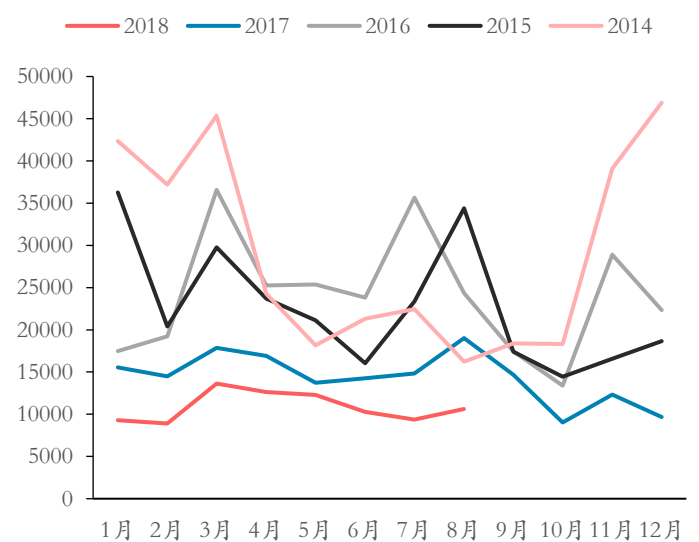
数据来源: Wind 华泰期货研究院

图30: 谷物板块月度成交金额(亿元)



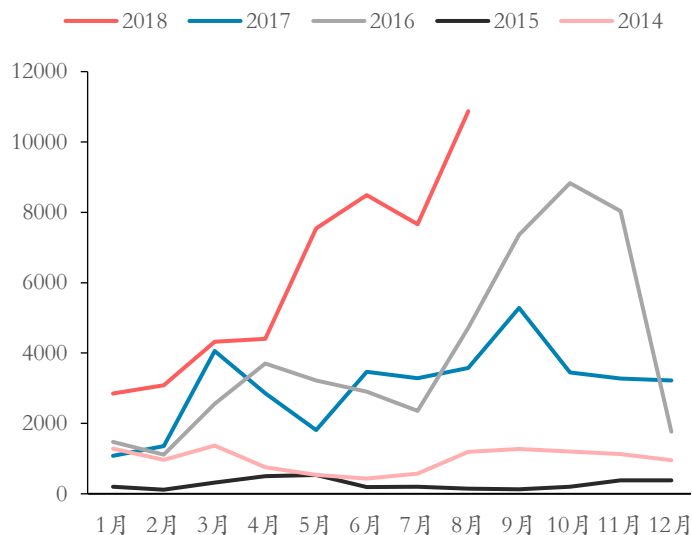
数据来源: Wind 华泰期货研究院

图31: 贵金属板块月度成交金额(亿元)



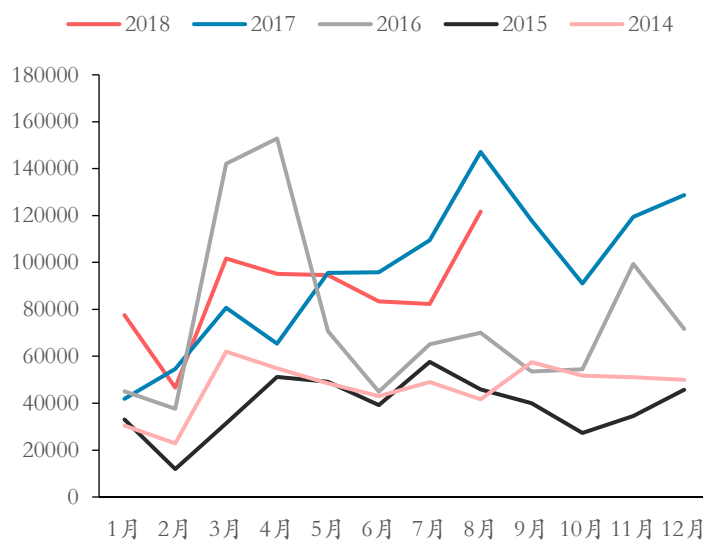
数据来源: Wind 华泰期货研究院

图32: 能源板块月度成交金额(亿元)



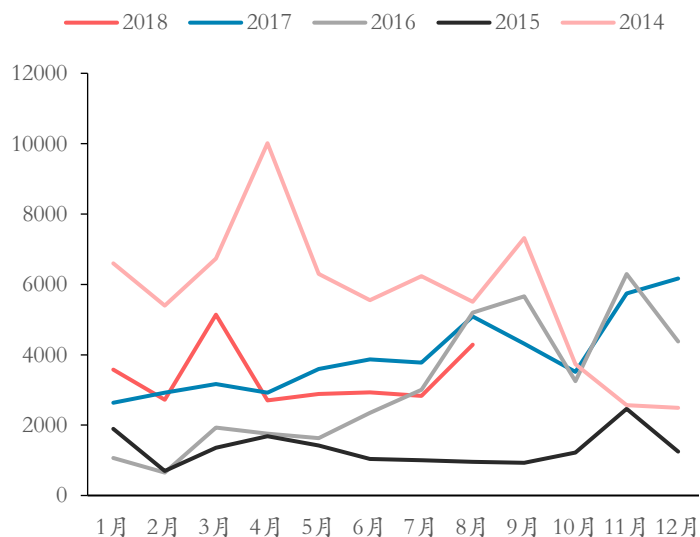
数据来源: Wind 华泰期货研究院

图33: 焦煤钢矿板块月度成交金额(亿元)



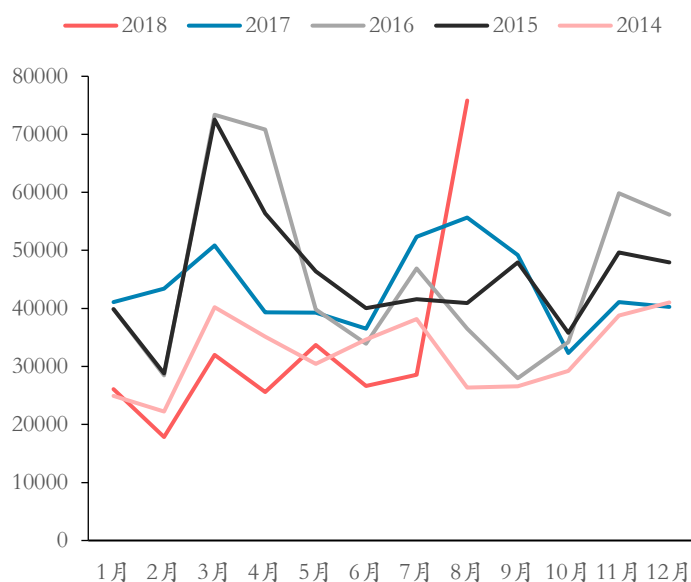
数据来源: Wind 华泰期货研究院

图34: 非金属建材板块月度成交金额(亿元)



数据来源: Wind 华泰期货研究院

图35: 化工板块月度成交金额(亿元)



数据来源: Wind 华泰期货研究院

● 免責聲明

此報告並非針對或意圖送發給或為任何就送發、發布、可得到或使用此報告而使华泰期貨有限公司違反當地的法律或法規或可致使华泰期貨有限公司受制於的法律或法規的任何地區、國家或其它管轄區域的公民或居民。除非另有顯示，否則所有此報告中的材料的版權均屬华泰期貨有限公司。未經华泰期貨有限公司事先書面授權下，不得更改或以任何方式發送、復印此報告的材料、內容或其復印本予任何其它人。所有於此報告中使用的商標、服務標記及標記均為华泰期貨有限公司的商標、服務標記及標記。

此報告所載的資料、工具及材料只提供給閣下作查照之用。此報告的內容並不構成對任何人的投資建議，而华泰期貨有限公司不會因接收人收到此報告而視他們為其客戶。

此報告所載資料的來源及觀點的出處皆被华泰期貨有限公司認為可靠，但华泰期貨有限公司不能擔保其準確性或完整性，而华泰期貨有限公司不對因使用此報告的材料而引致的損失而負任何責任。並不能依靠此報告以取代行使獨立判斷。华泰期貨有限公司可發出其它與本報告所載資料不一致及有不同結論的報告。本報告及該等報告反映編寫分析員的不同設想、見解及分析方法。為免生疑，本報告所載的觀點並不代表华泰期貨有限公司，或任何其附屬或聯營公司的立場。

此報告中所指的投資及服務可能不適合閣下，我們建議閣下如有任何疑問應諮詢獨立投資顧問。此報告並不構成投資、法律、會計或稅務建議或擔保任何投資或策略適合或切合閣下個別情況。此報告並不構成給予閣下私人諮詢建議。

华泰期貨有限公司2018版權所有並保留一切權利。

● 公司總部

地址：廣東省廣州市越秀區東風東路761號麗豐大廈20層、29層04單元

電話：400-6280-888

網址：www.htfc.com