【浙商期货研究中心】2018-04-24量化日报

**一、品种强弱提示**

1、品种收益率排名

对各品种主力合约1日、1周、1月收益率进行统计并排名，表征品种近期强弱情况。计算方法为：

1日收益率 = （今日主力合约收盘价 / 1个交易日前同一合约收盘价） - 1

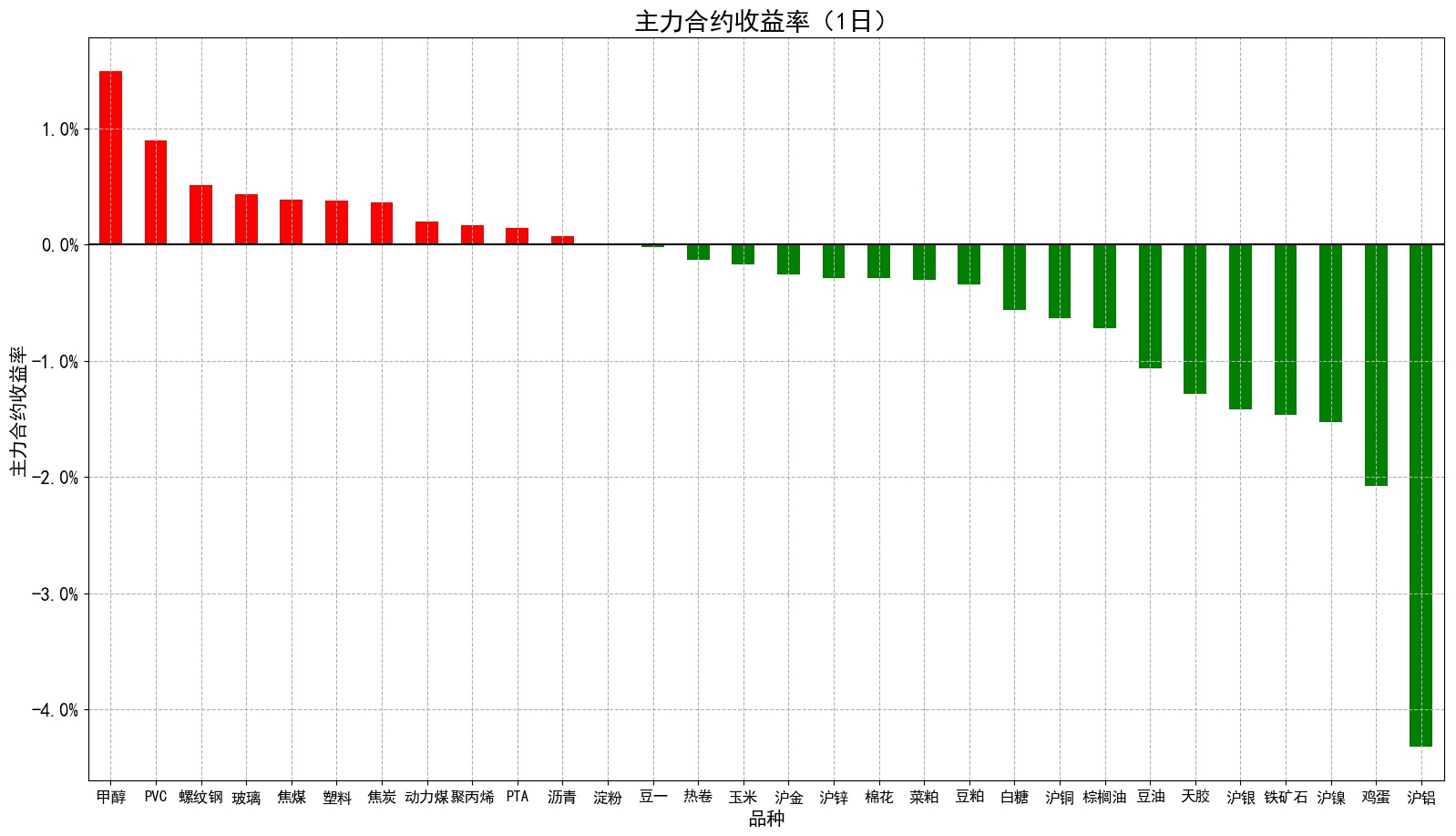
1周收益率 = （今日主力合约收盘价 / 5个交易日前同一合约收盘价） - 1

1月收益率 = （今日主力合约收盘价 / 20个交易日前同一合约收盘价） - 1

（1）1日收益排名

排名前五位的品种是:甲醇、PVC、螺纹钢、玻璃、焦煤

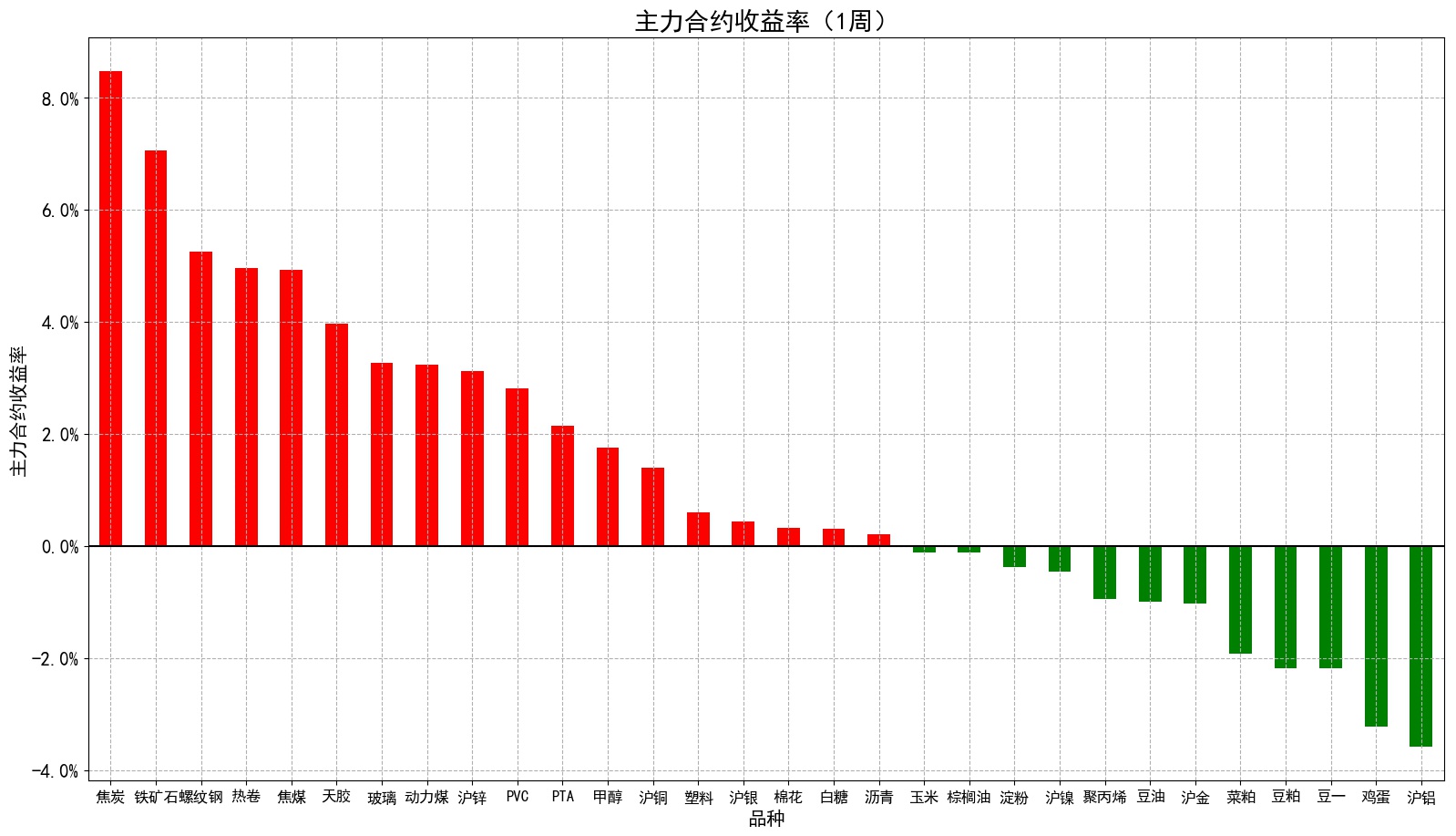
排名后五位的品种是:沪铝、鸡蛋、沪镍、铁矿石、沪银



（2）1周收益

排名前五位的品种是:焦炭、铁矿石、螺纹钢、热卷、焦煤

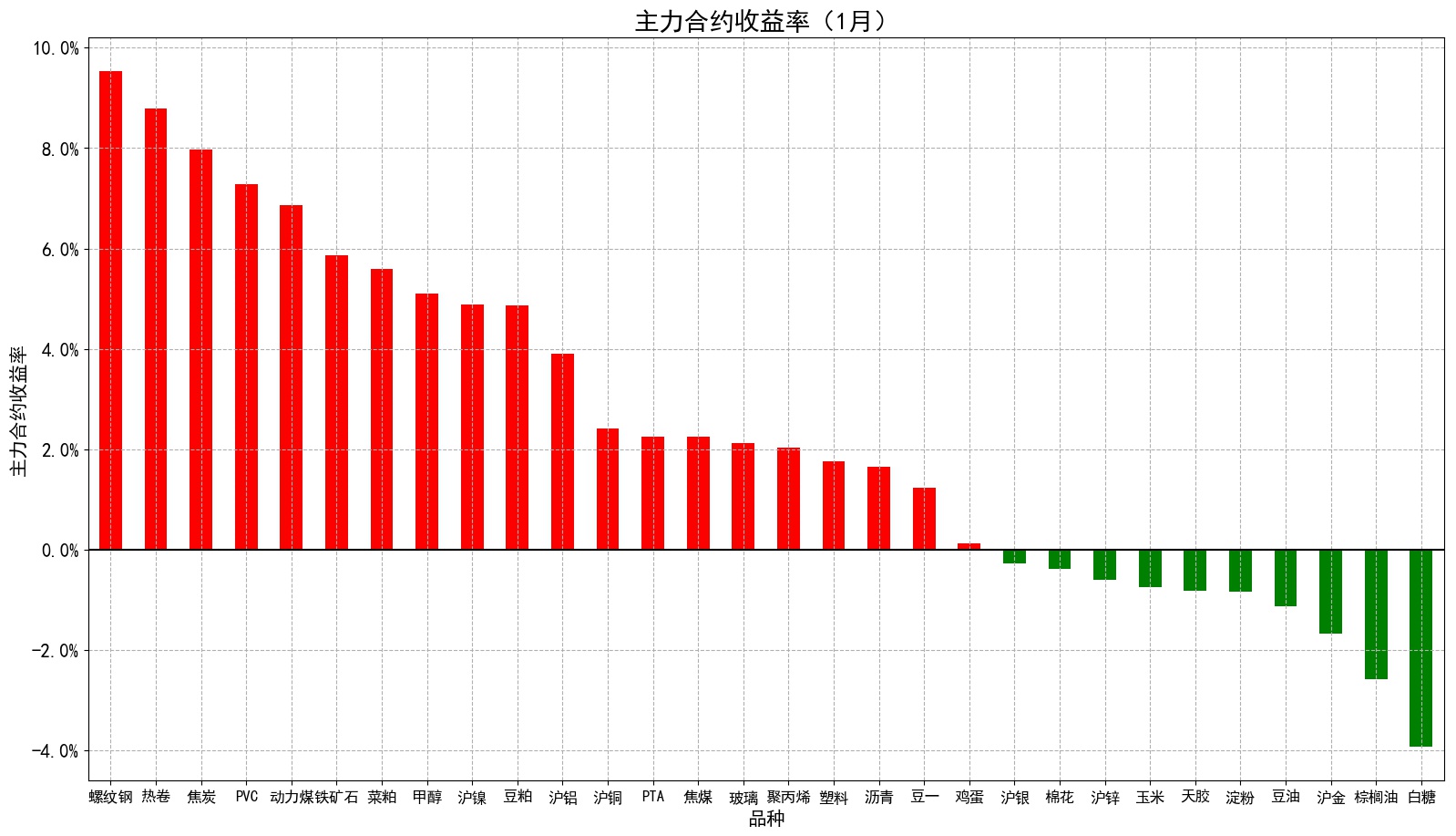
排名后五位的品种是:沪铝、鸡蛋、豆一、豆粕、菜粕



（3）1月收益

排名前五位的品种是:螺纹钢、热卷、焦炭、PVC、动力煤

排名后五位的品种是:白糖、棕榈油、沪金、豆油、淀粉



**二、品种波动性提示**

通过计算各品种平均真实波动幅度(ATR)/前一日收盘价，得到各品种当日相对振幅，表征其波动性大小。

相对振幅排名前五位的品种是:沪铝、沪镍、甲醇、天胶、焦炭

相对振幅排名后五位的品种是:淀粉、玉米、棉花、沪金、菜粕



**三、品种持仓与成交情况提示**

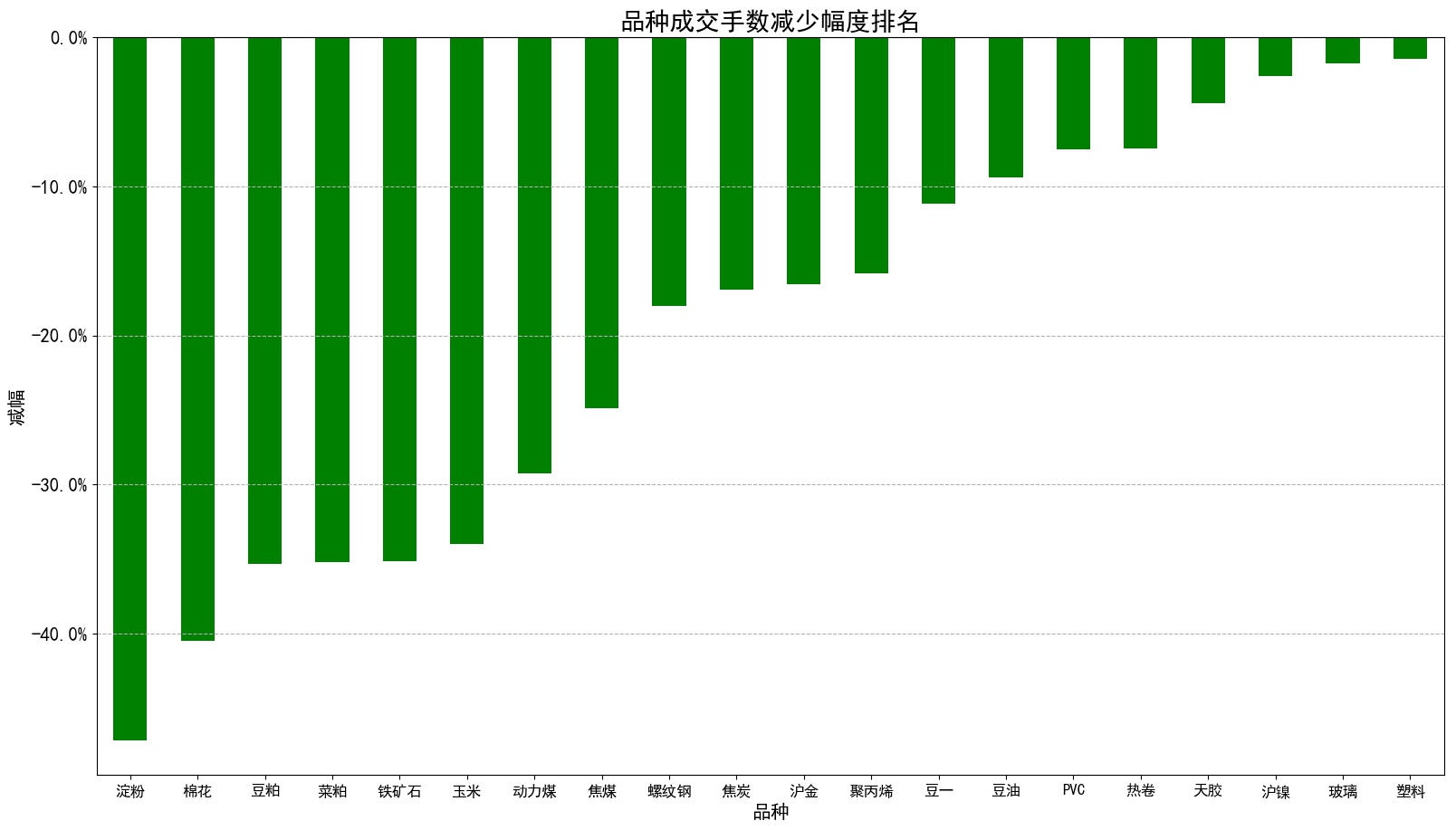
1、品种日成交量变化

通过计算各品种主力合约成交量与前一日变化比例，表征当日内各品种成交活跃度变化。

日成交手数增加幅度排名前五位的品种为:沪铝、白糖、沪银、沥青、甲醇

日成交手数降低幅度排名前五位的品种为:淀粉、棉花、豆粕、菜粕、铁矿石

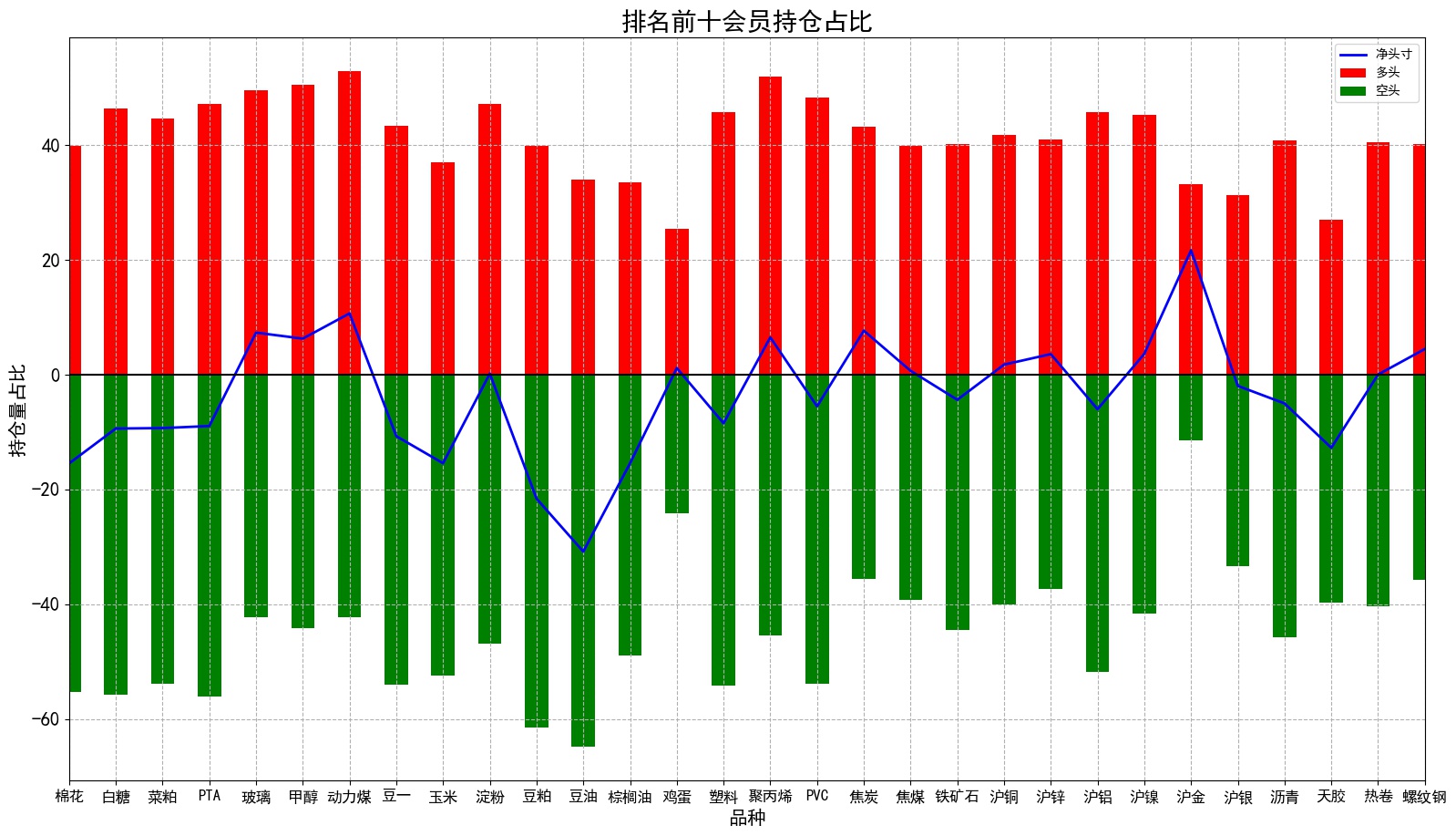




2、持仓排名前十会员持仓占比

（1）今日持仓排名前十会员持仓占比情况

通过统计各品种持仓排名表中排名前十会员的多头、空头及净头寸占合约总持仓量的比例，表征品种交易的集中程度。



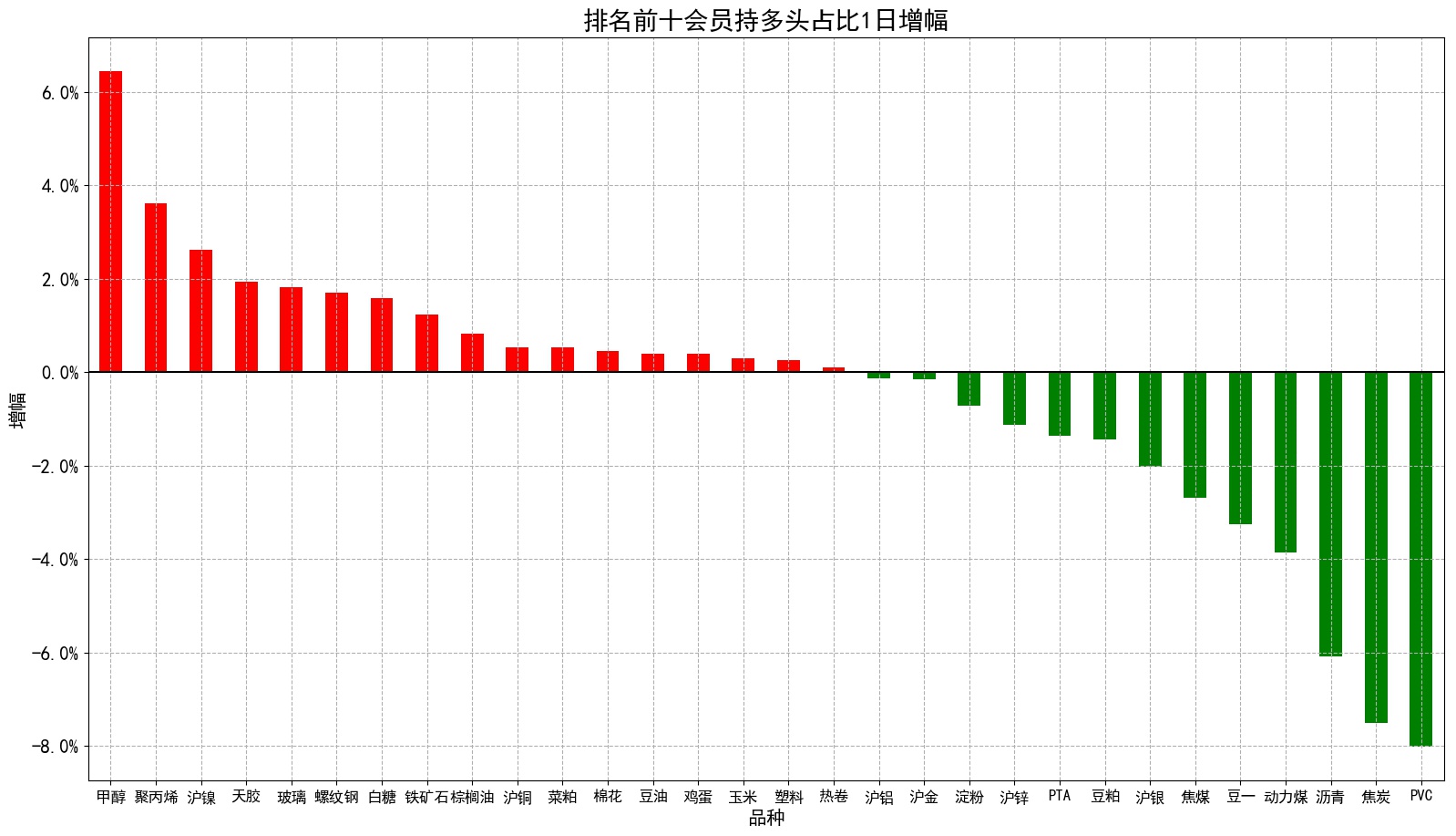
（2）近期持仓占比排名

通过计算今日持仓排名前十的多头和空头持仓占比与1交易日、5交易日和20交易日前的持仓占比变化比率，表征1日、1周、1月内主力会员在各品种上的持仓幅度变化。

1日排名前十会员多头持仓占比和空头持仓占比变化幅度如下：

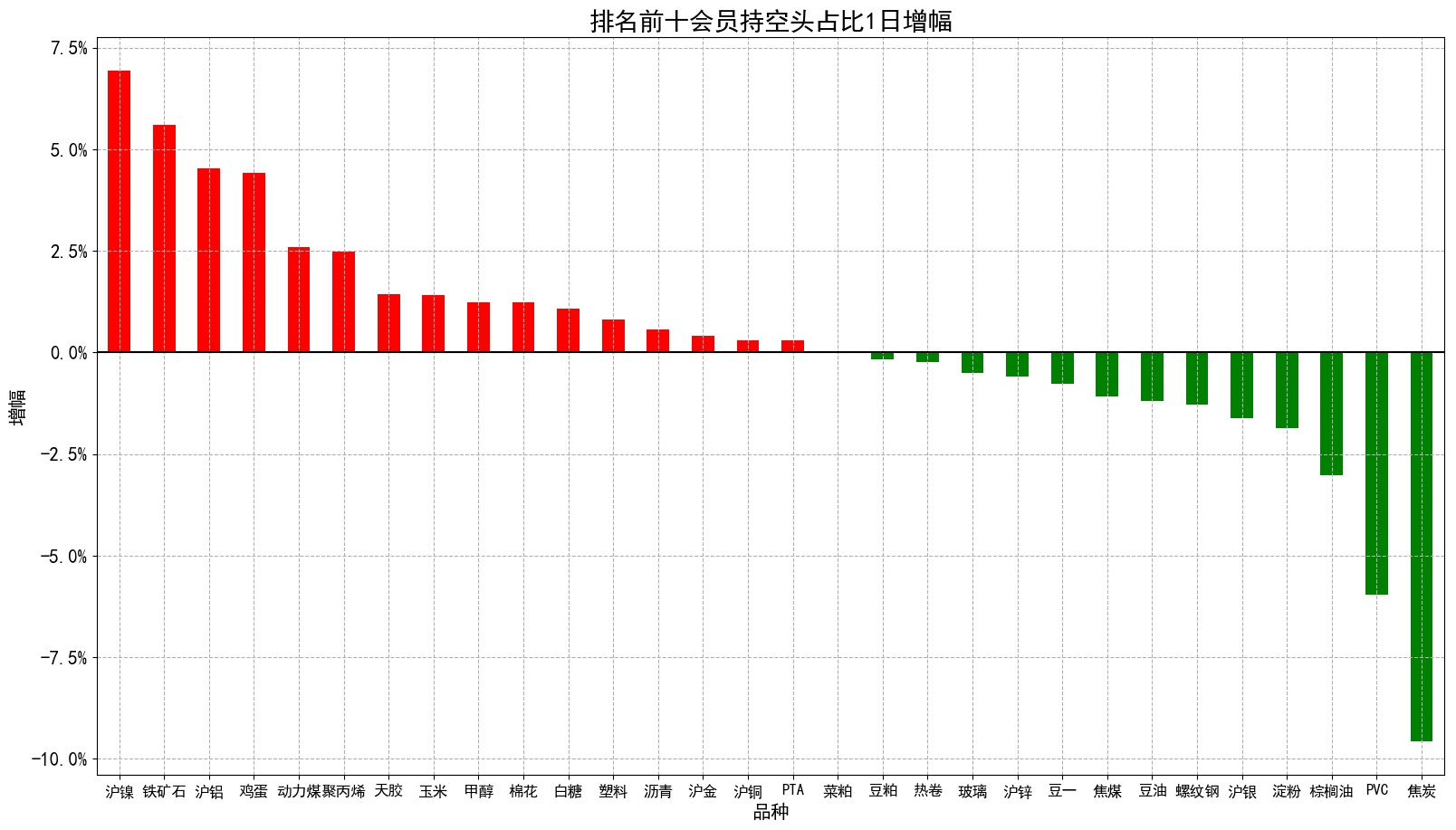
多头占比1日增幅排名前五位的品种是:甲醇、聚丙烯、沪镍、天胶、玻璃

多头占比1日降幅排名前五位的品种是:PVC、焦炭、沥青、动力煤、豆一



空头占比增幅排名前五位的品种是:沪镍、铁矿石、沪铝、鸡蛋、动力煤

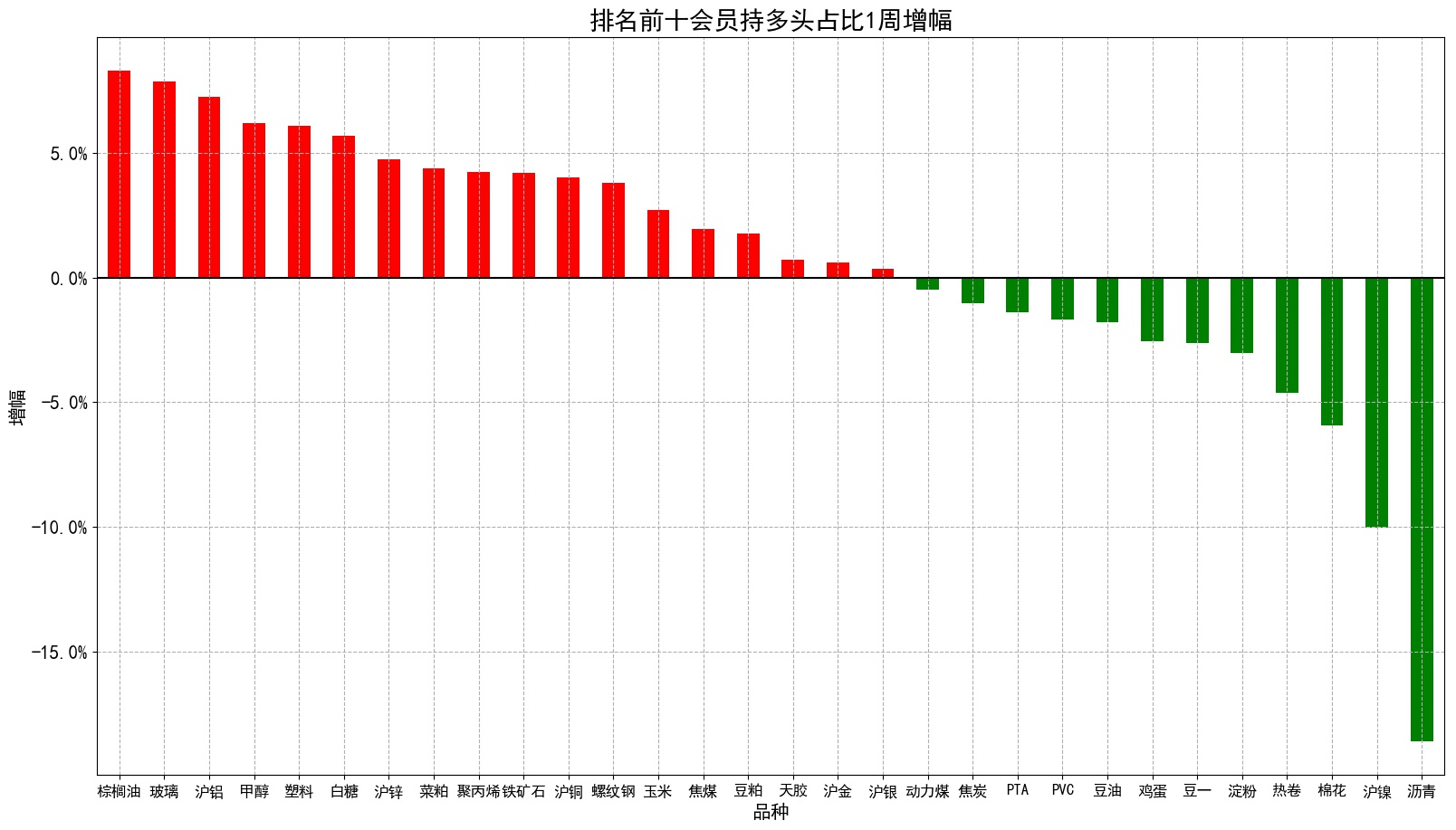
空头占比降幅排名前五位的品种是:焦炭、PVC、棕榈油、淀粉、沪银



1周排名前十会员多头持仓占比和空头持仓占比变化幅度如下：

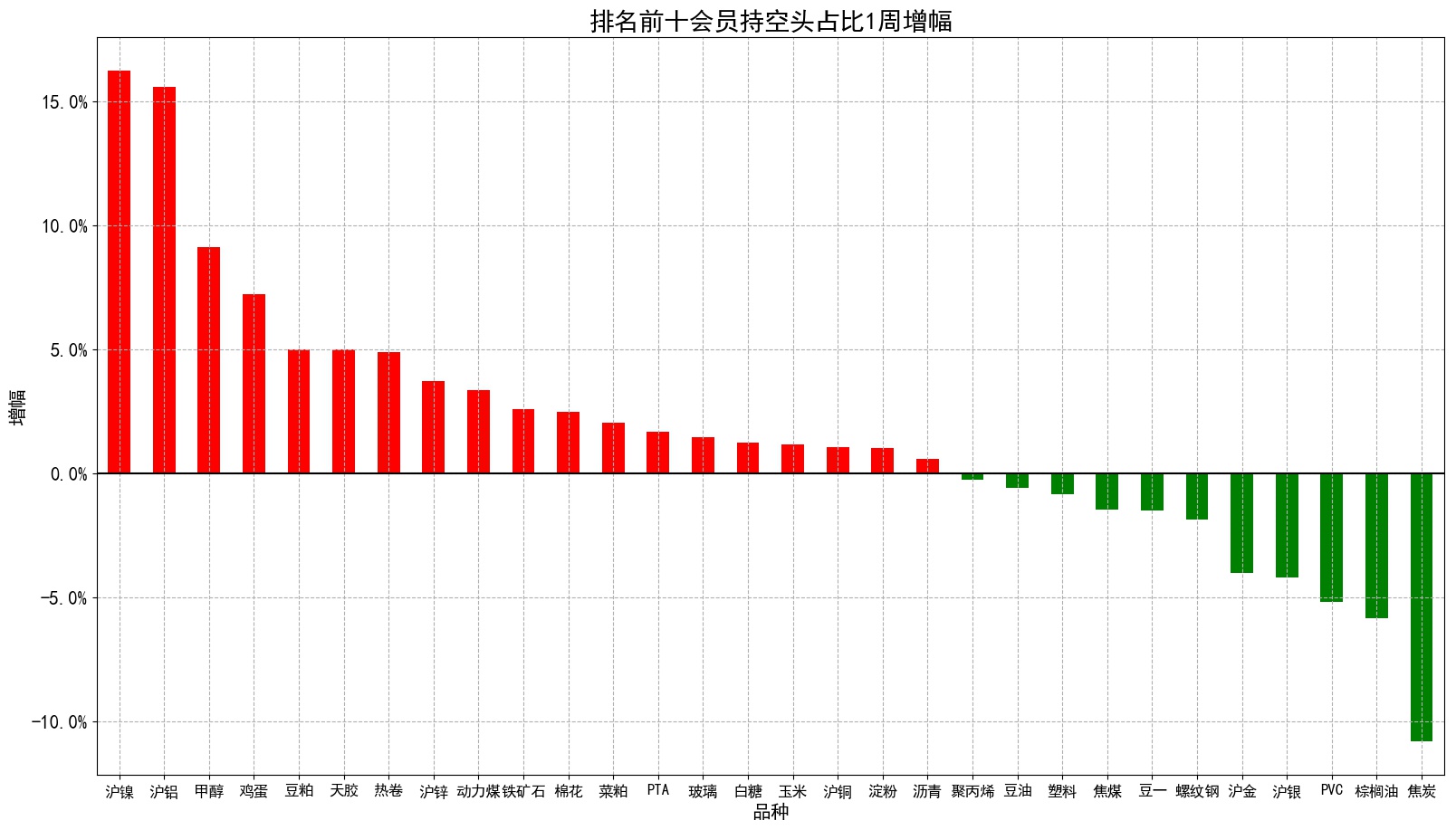
多头占比1周增幅排名前五位的品种是:棕榈油、玻璃、沪铝、甲醇、塑料

多头占比1周降幅排名前五位的品种是:沥青、沪镍、棉花、热卷、淀粉



空头占比1周增幅排名前五位的品种是:沪镍、沪铝、甲醇、鸡蛋、豆粕

空头占比1周降幅排名前五位的品种是:焦炭、棕榈油、PVC、沪银、沪金



1月排名前十会员多头持仓占比和空头持仓占比变化幅度如下：

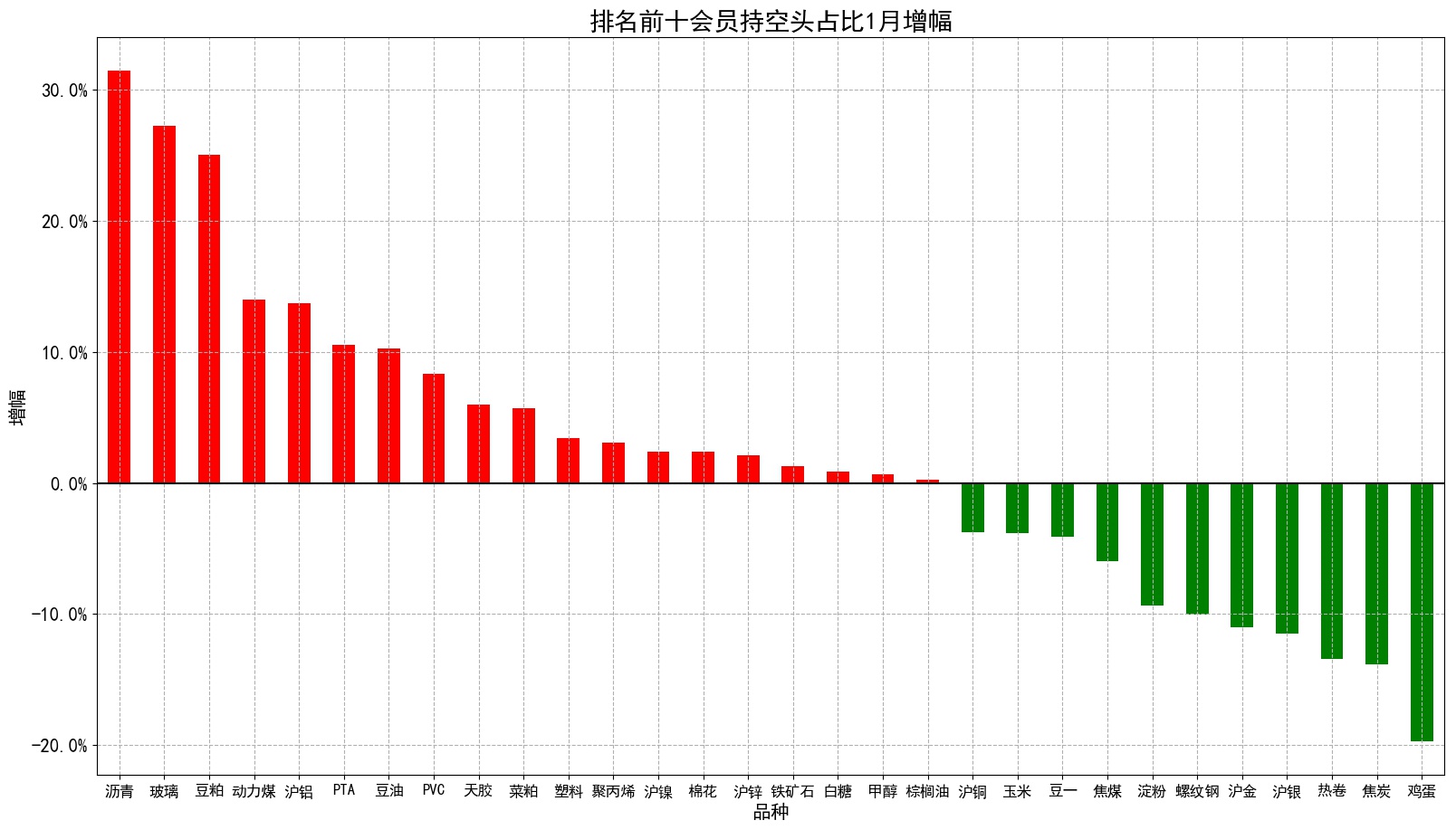
多头占比1月增幅排名前五位的品种是:豆一、螺纹钢、沪铝、聚丙烯、甲醇

多头占比1月降幅排名前五位的品种是:鸡蛋、沥青、棉花、棕榈油、PVC



空头占比1月增幅排名前五位的品种是:沥青、玻璃、豆粕、动力煤、沪铝

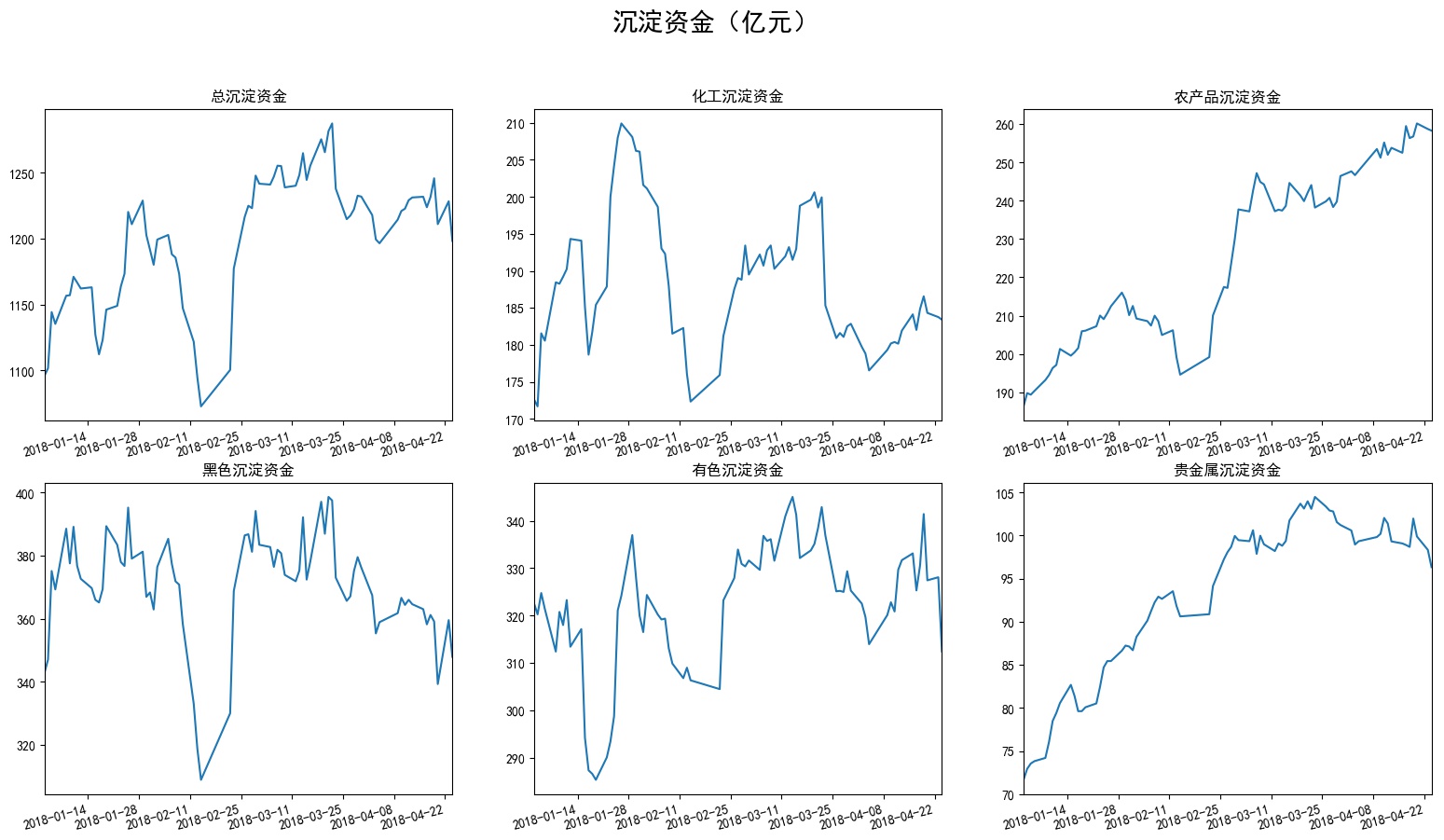
空头占比1月降幅排名前五位的品种是:鸡蛋、焦炭、热卷、沪银、沪金



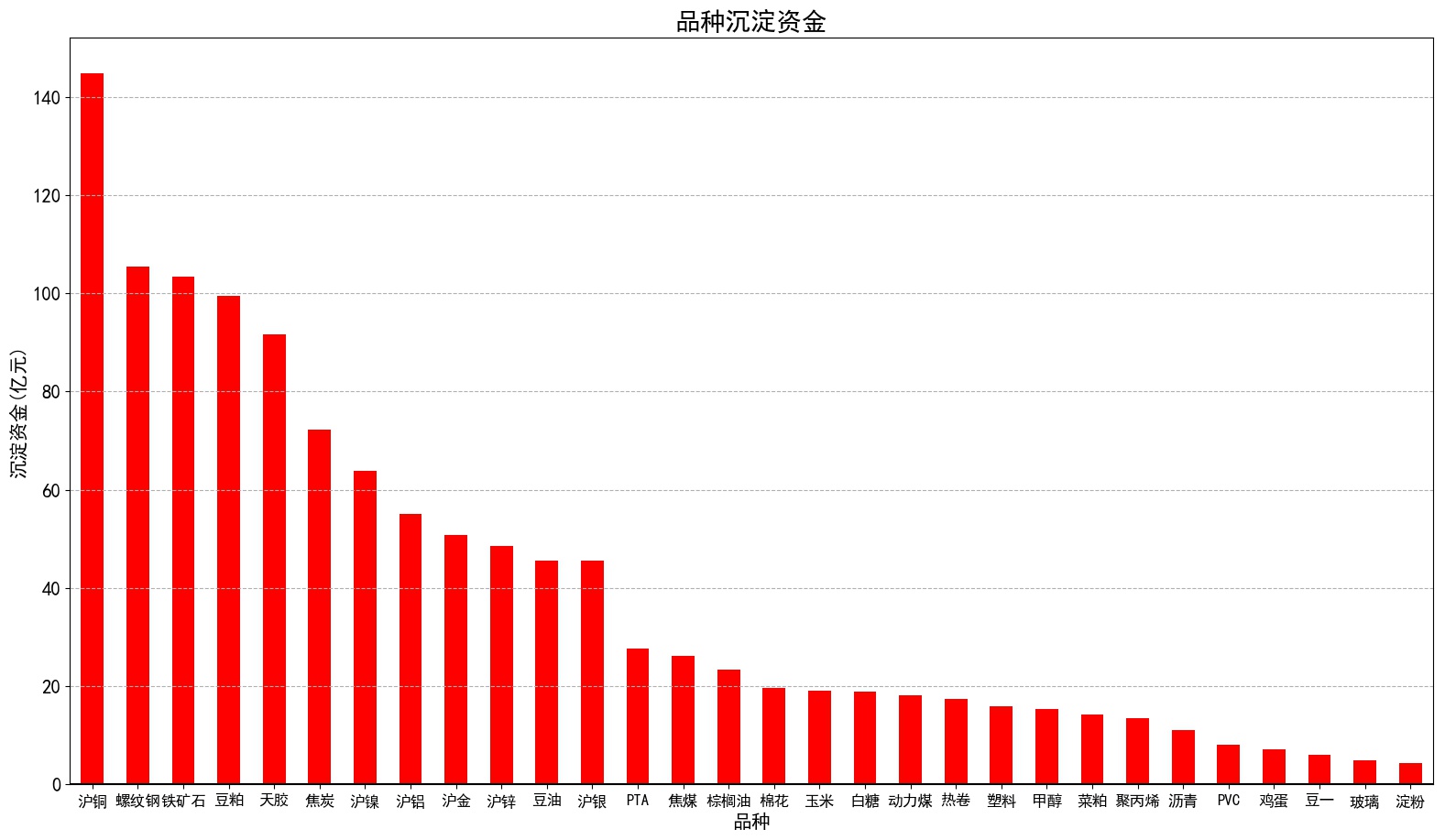
**四、品种资金提示**

1、沉淀资金

（1）各板块沉淀资金统计



（2）各品种沉淀资金统计



2、各品种资金流向

计算各品种资金流向，其中：

总资金流向 = 主动资金流向 + 被动资金流向

主动资金流向：指由持仓量变动引起的资金变动

被动资金流向：指由合约价格变动引起的资金变动

