【浙商期货研究中心】2018-04-20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

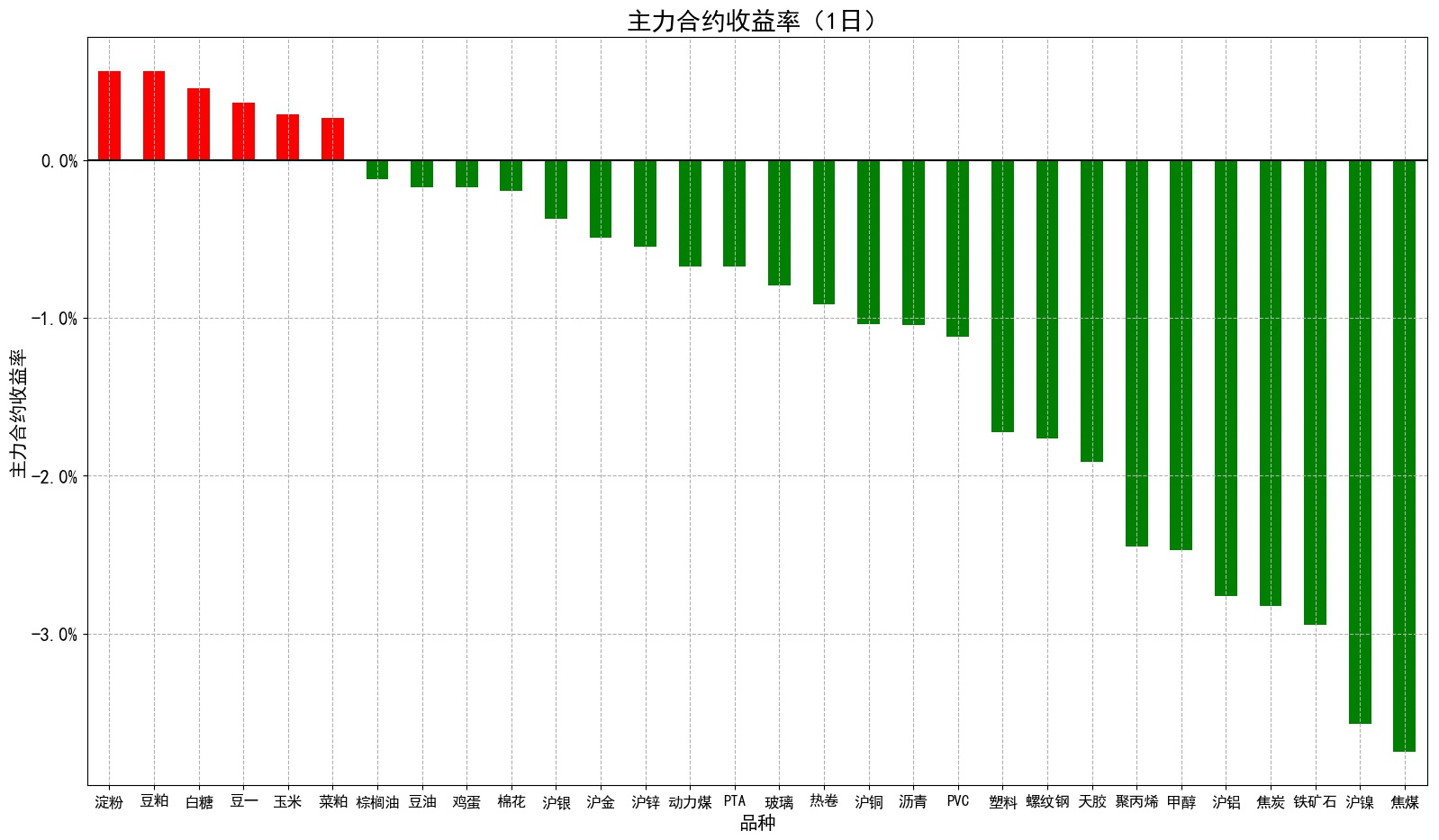
1周收益率 = （今日主力合约收盘价 / 5个交易日前同一合约收盘价） - 1

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:淀粉、豆粕、白糖、豆一、玉米

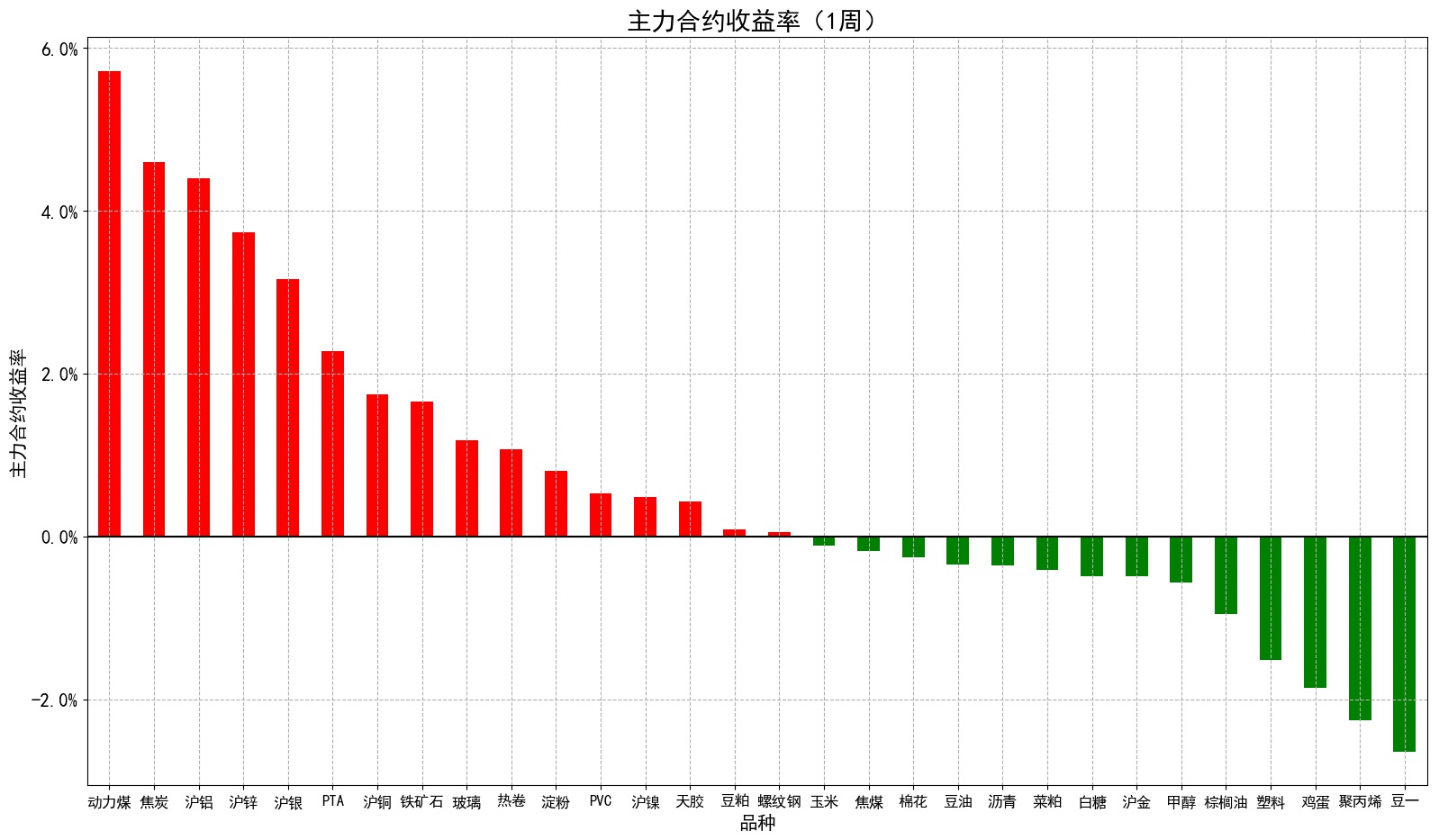
排名后五位的品种是:焦煤、沪镍、铁矿石、焦炭、沪铝



（2）1周收益

排名前五位的品种是:动力煤、焦炭、沪铝、沪锌、沪银

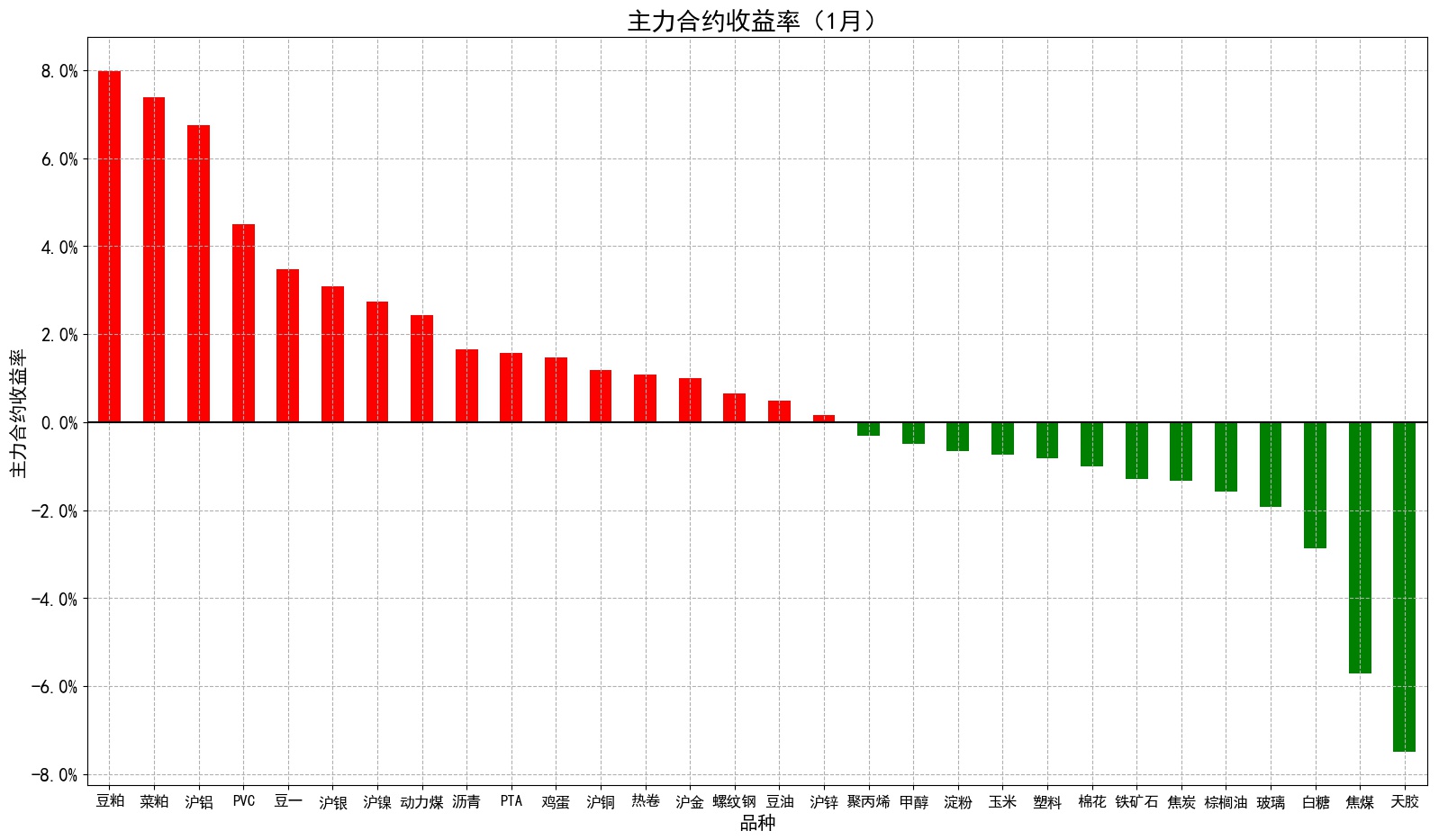
排名后五位的品种是:豆一、聚丙烯、鸡蛋、塑料、棕榈油



（3）1月收益

排名前五位的品种是:豆粕、菜粕、沪铝、PVC、豆一

排名后五位的品种是:天胶、焦煤、白糖、玻璃、棕榈油

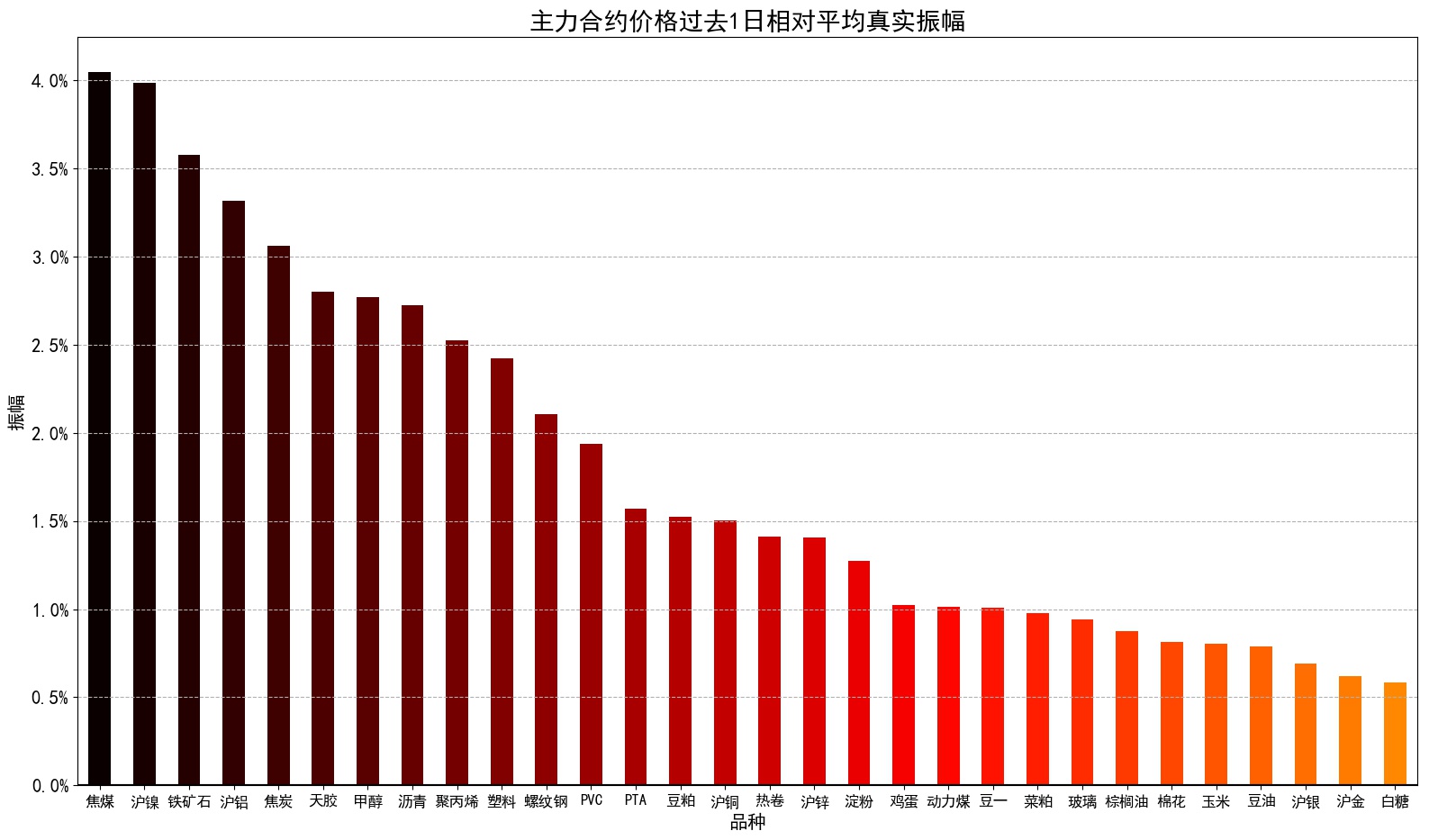


**二、品种波动性提示**

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:焦煤、沪镍、铁矿石、沪铝、焦炭

相对振幅排名后五位的品种是:白糖、沪金、沪银、豆油、玉米



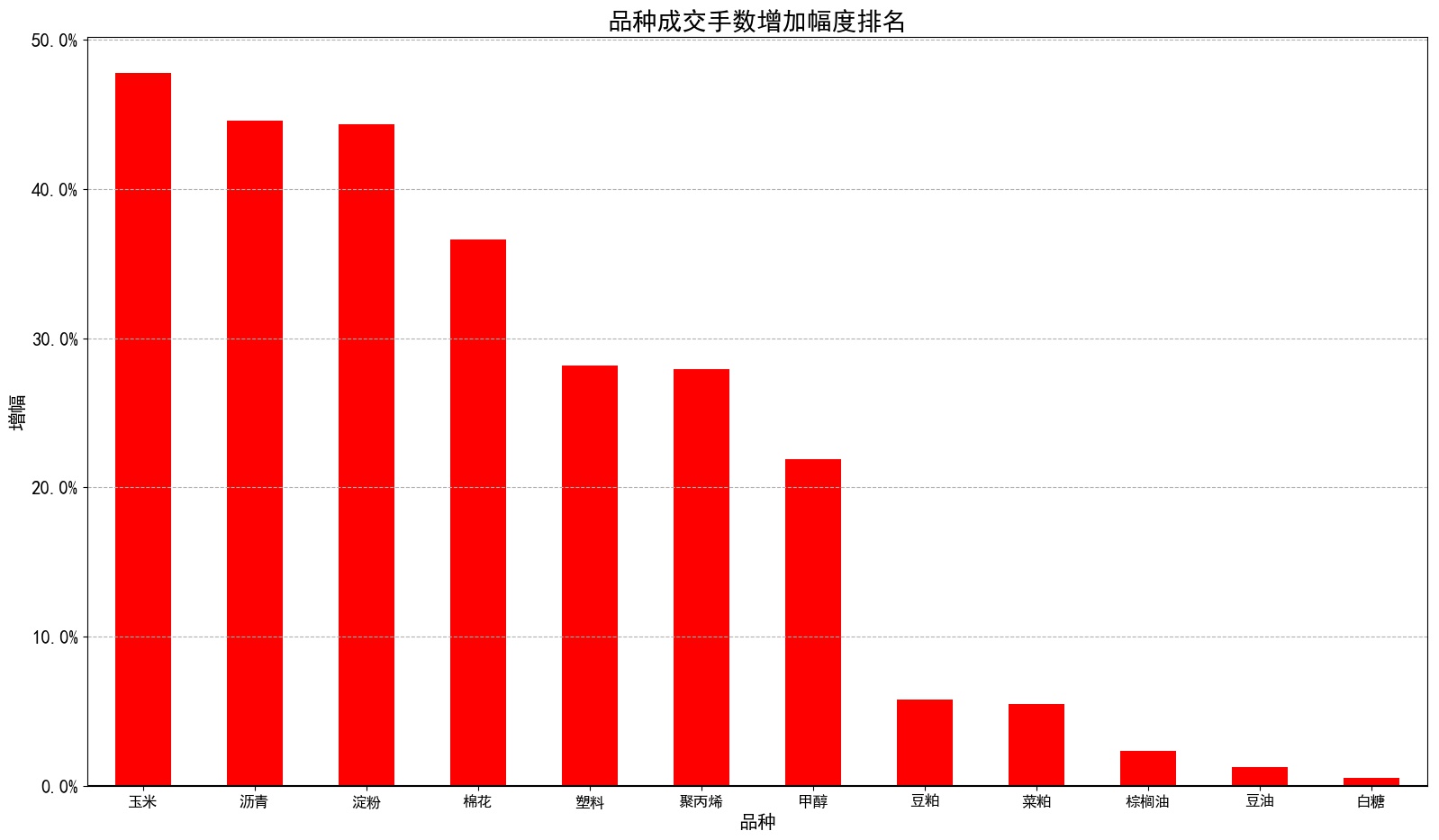
**三、品种持仓与成交情况提示**

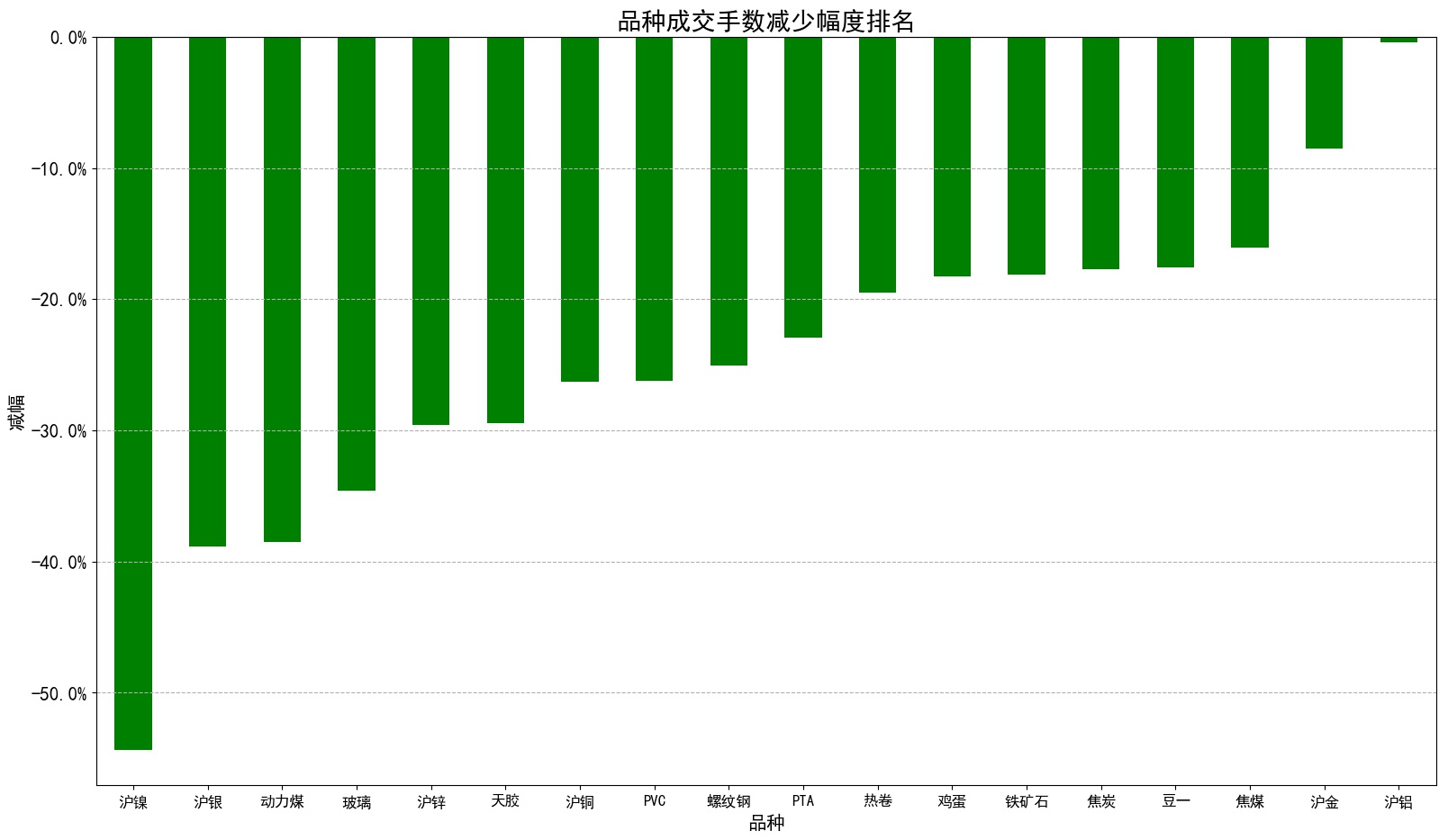
1、品种日成交量变化

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:玉米、沥青、淀粉、棉花、塑料

日成交手数降低幅度排名前五位的品种为:沪镍、沪银、动力煤、玻璃、沪锌

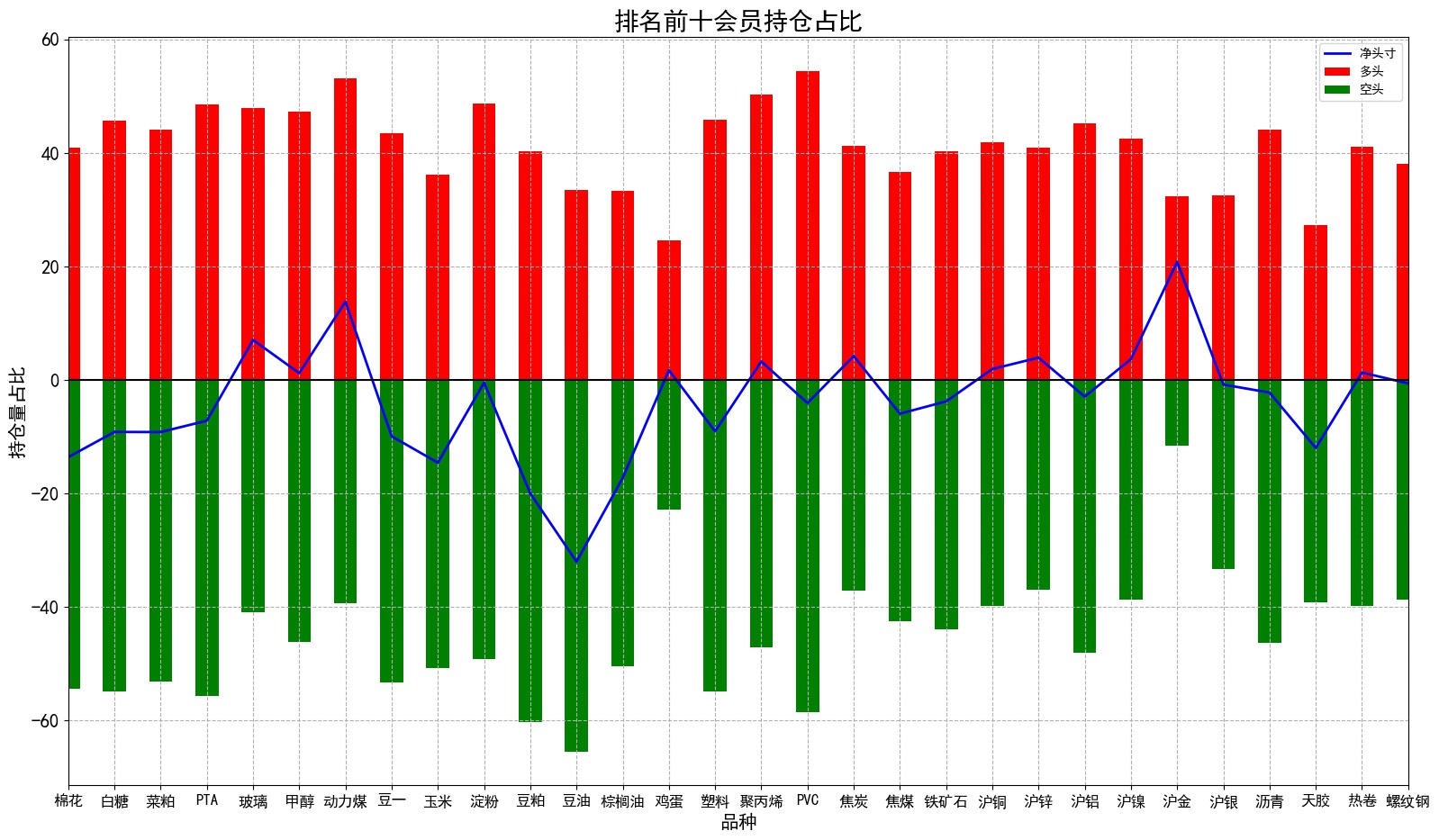




2、持仓排名前十会员持仓占比

（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。



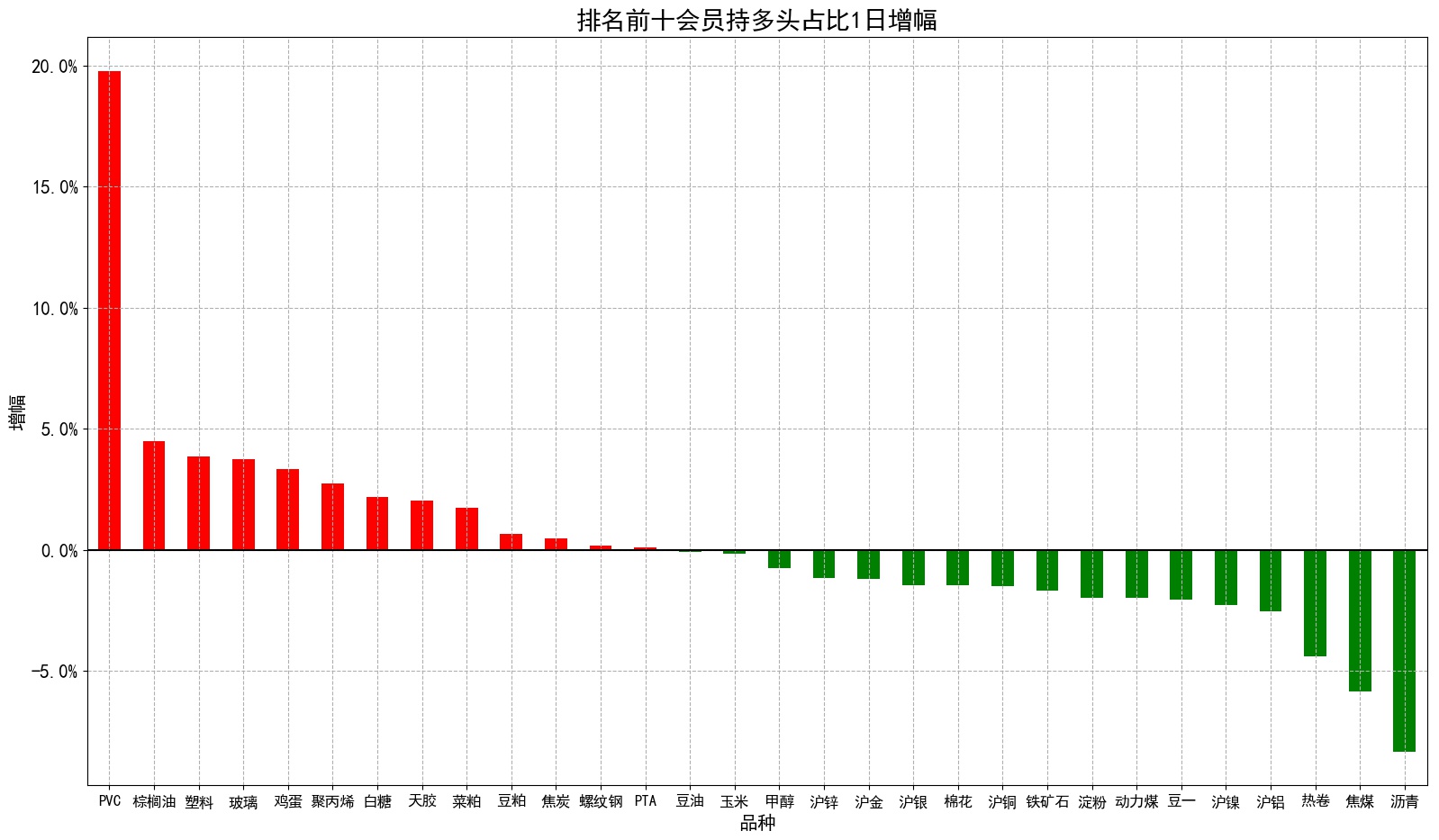
（2）近期持仓占比排名

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：

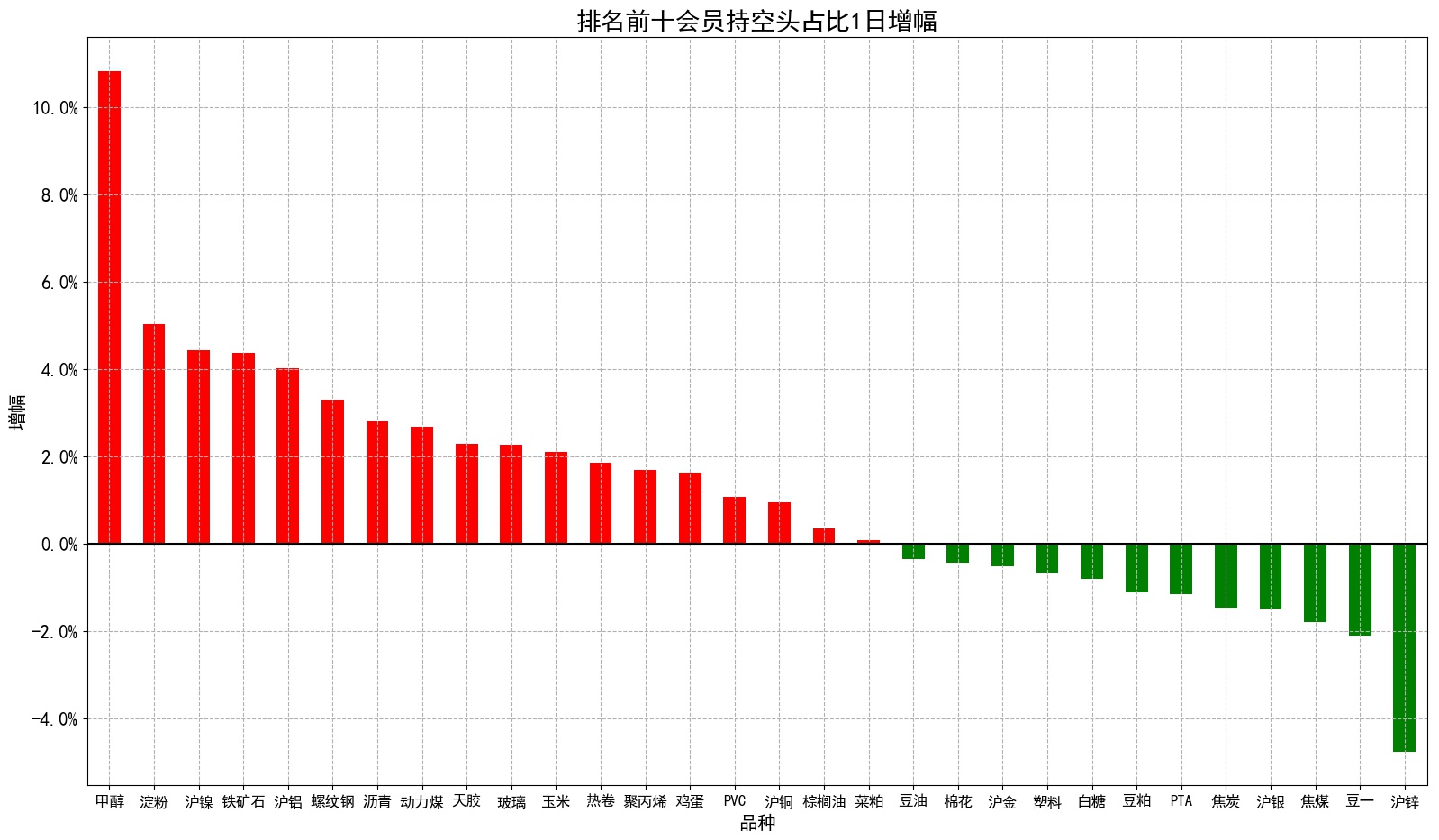
多头占比1日增幅排名前五位的品种是:PVC、棕榈油、塑料、玻璃、鸡蛋

多头占比1日降幅排名前五位的品种是:沥青、焦煤、热卷、沪铝、沪镍



空头占比增幅排名前五位的品种是:甲醇、淀粉、沪镍、铁矿石、沪铝

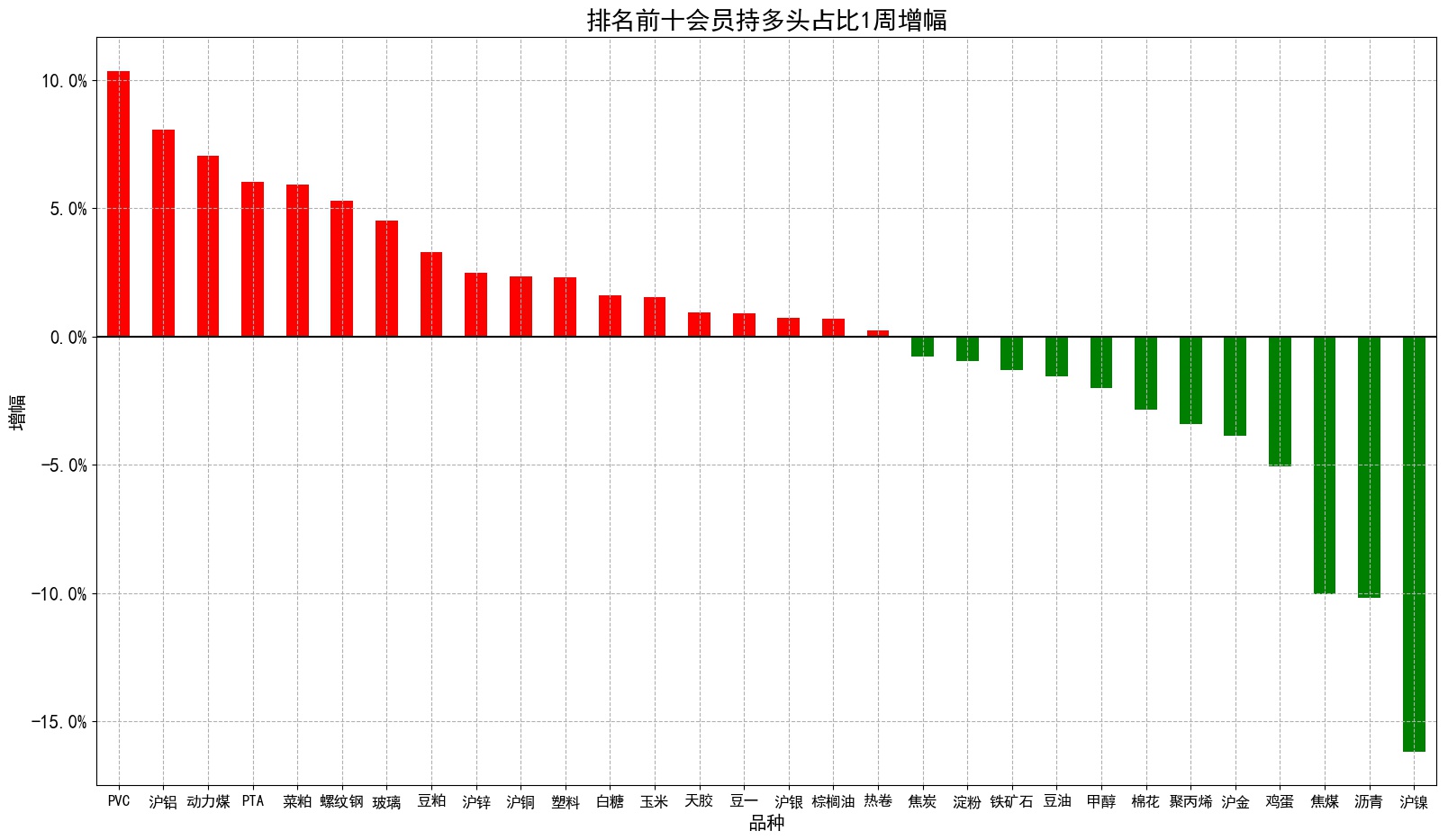
空头占比降幅排名前五位的品种是:沪锌、豆一、焦煤、沪银、焦炭



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：

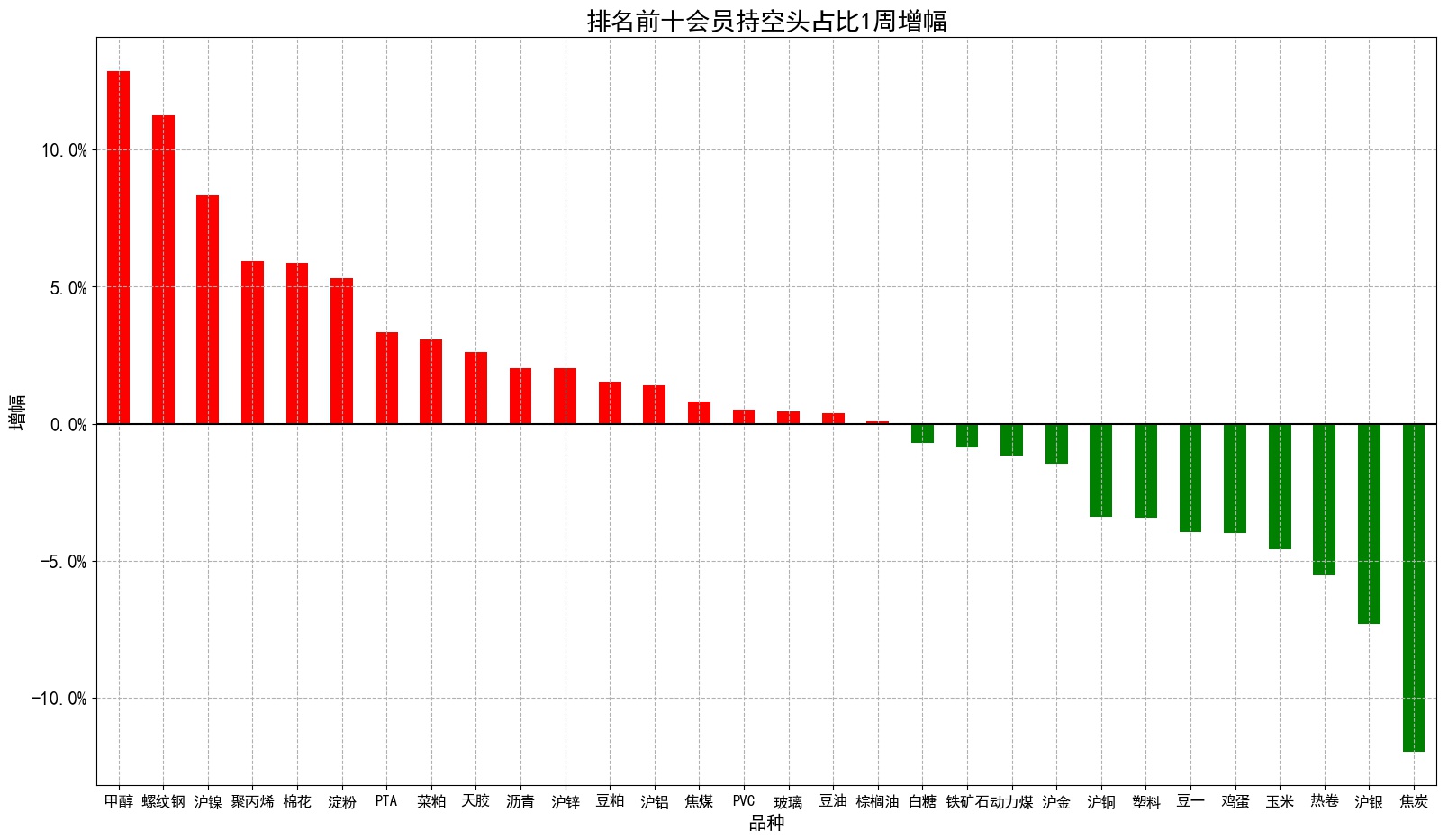
多头占比1周增幅排名前五位的品种是:PVC、沪铝、动力煤、PTA、菜粕

多头占比1周降幅排名前五位的品种是:沪镍、沥青、焦煤、鸡蛋、沪金



空头占比1周增幅排名前五位的品种是:甲醇、螺纹钢、沪镍、聚丙烯、棉花

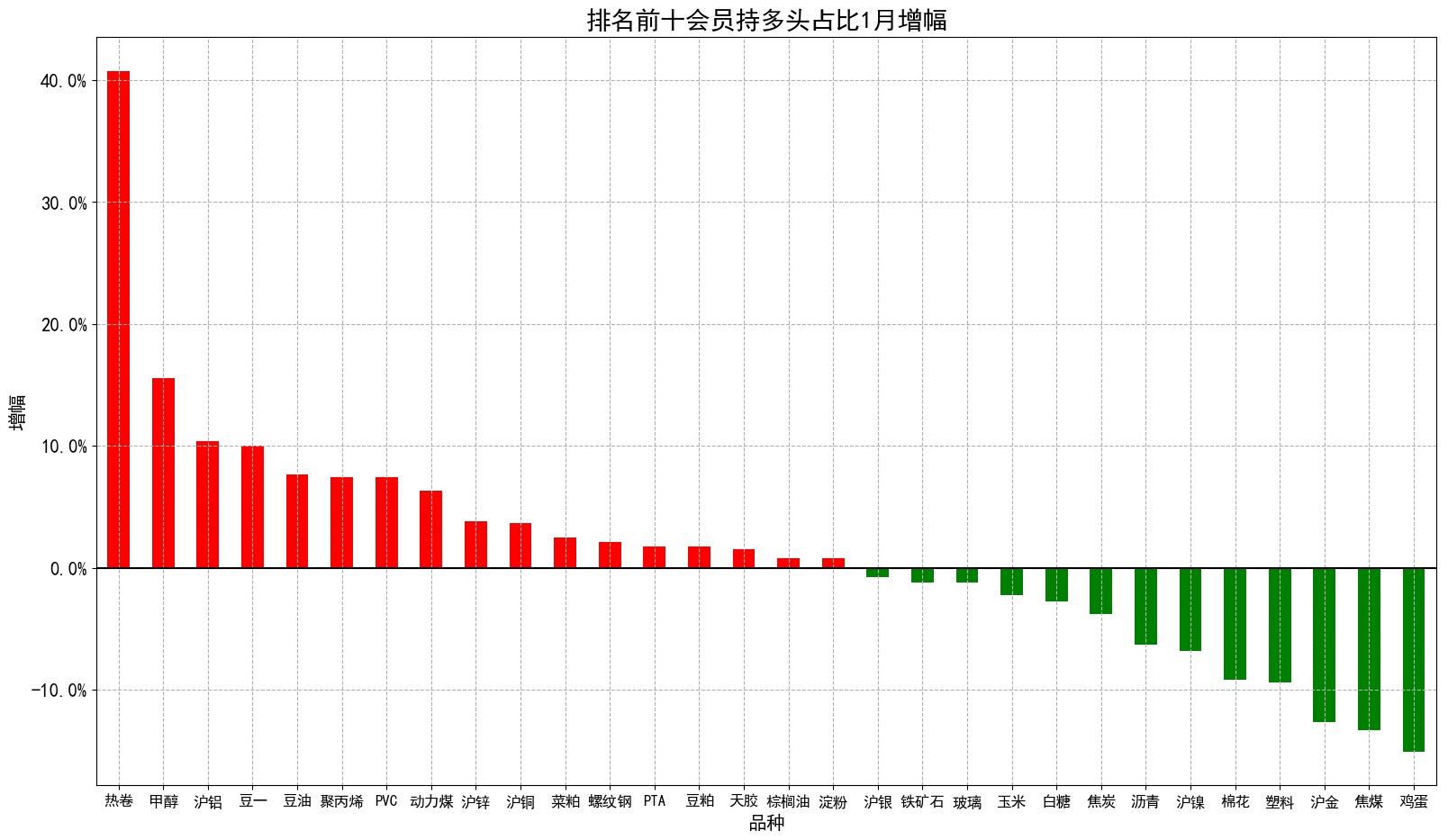
空头占比1周降幅排名前五位的品种是:焦炭、沪银、热卷、玉米、鸡蛋



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：

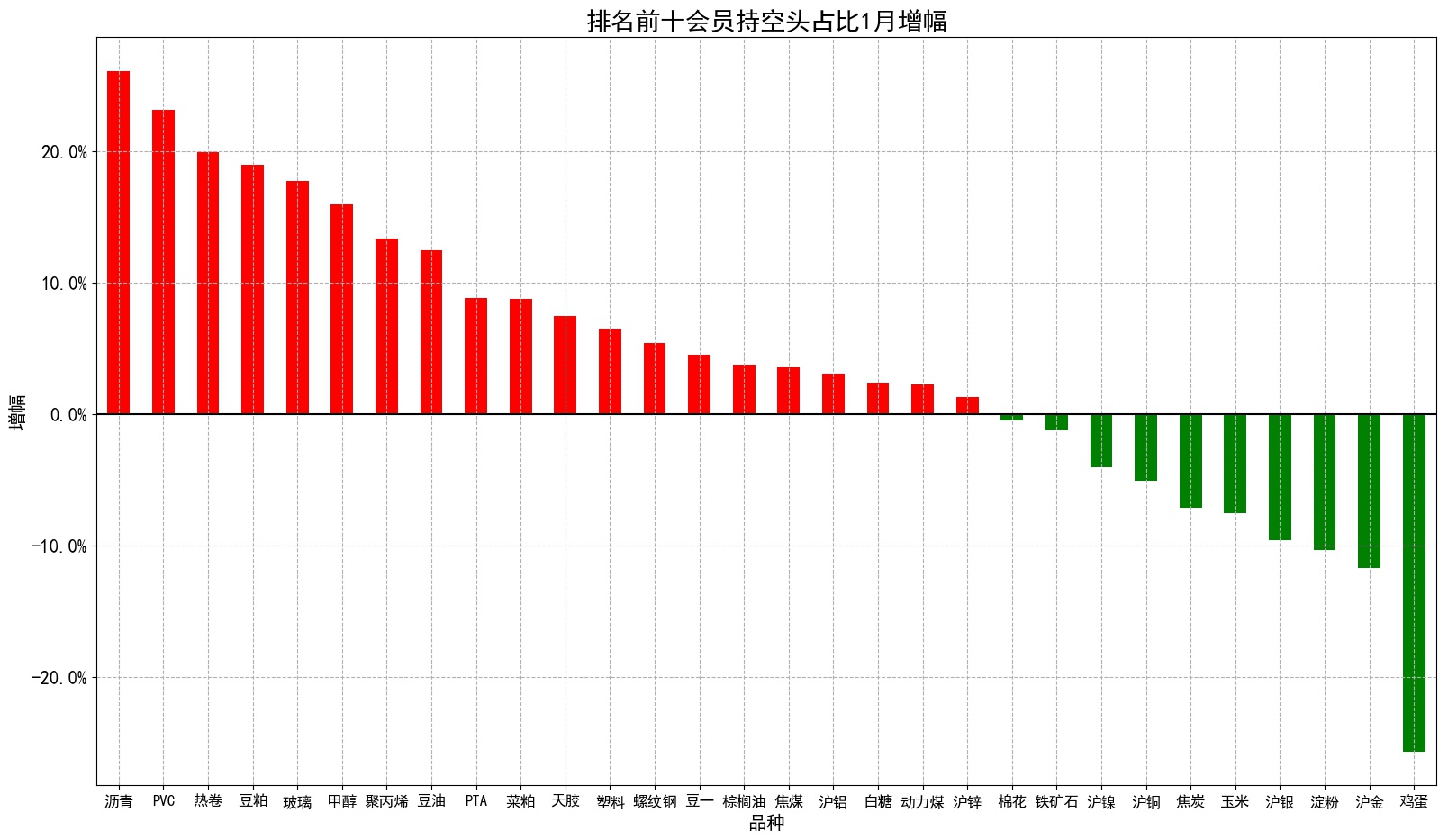
多头占比1月增幅排名前五位的品种是:热卷、甲醇、沪铝、豆一、豆油

多头占比1月降幅排名前五位的品种是:鸡蛋、焦煤、沪金、塑料、棉花



空头占比1月增幅排名前五位的品种是:沥青、PVC、热卷、豆粕、玻璃

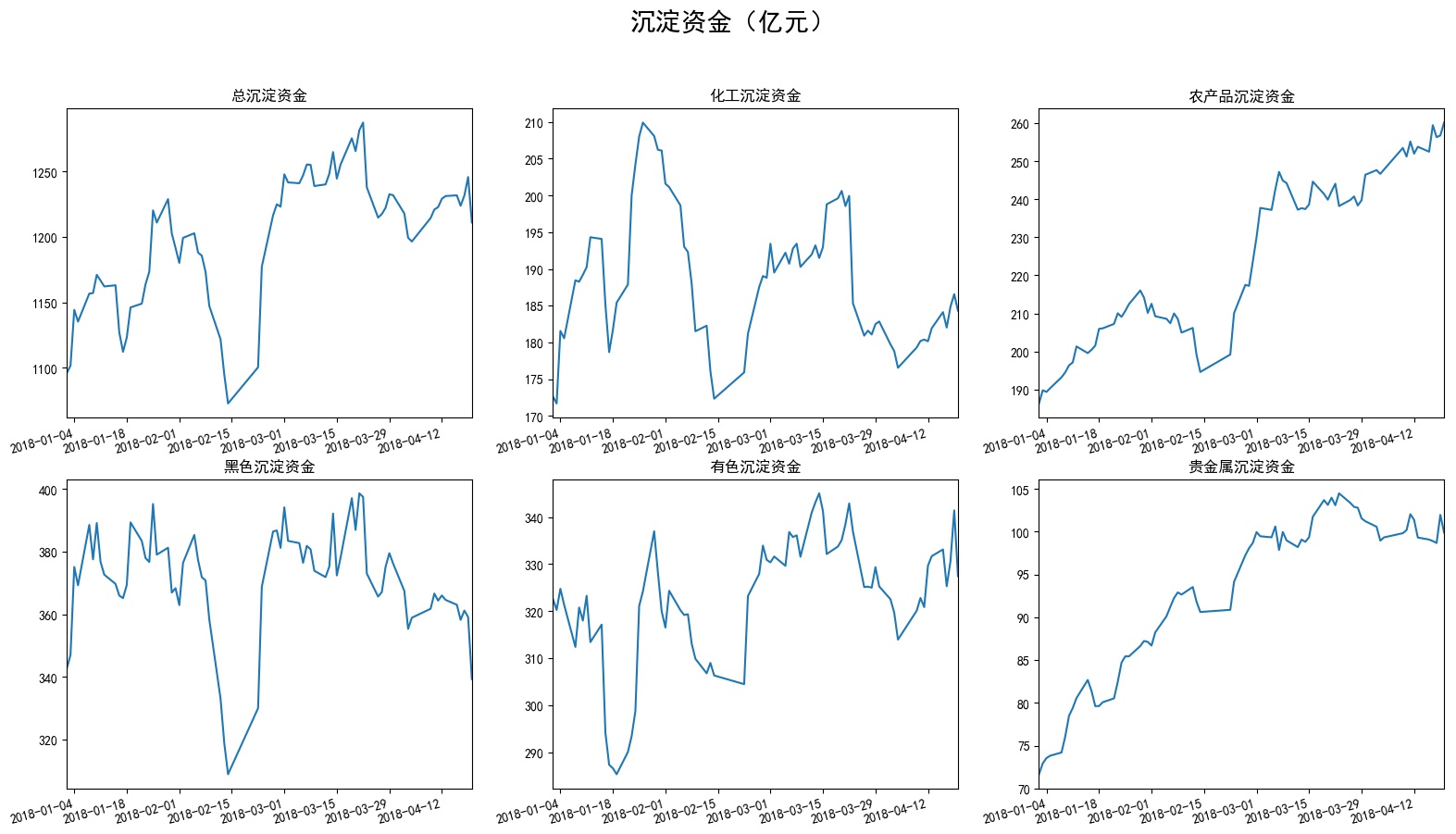
空头占比1月降幅排名前五位的品种是:鸡蛋、沪金、淀粉、沪银、玉米



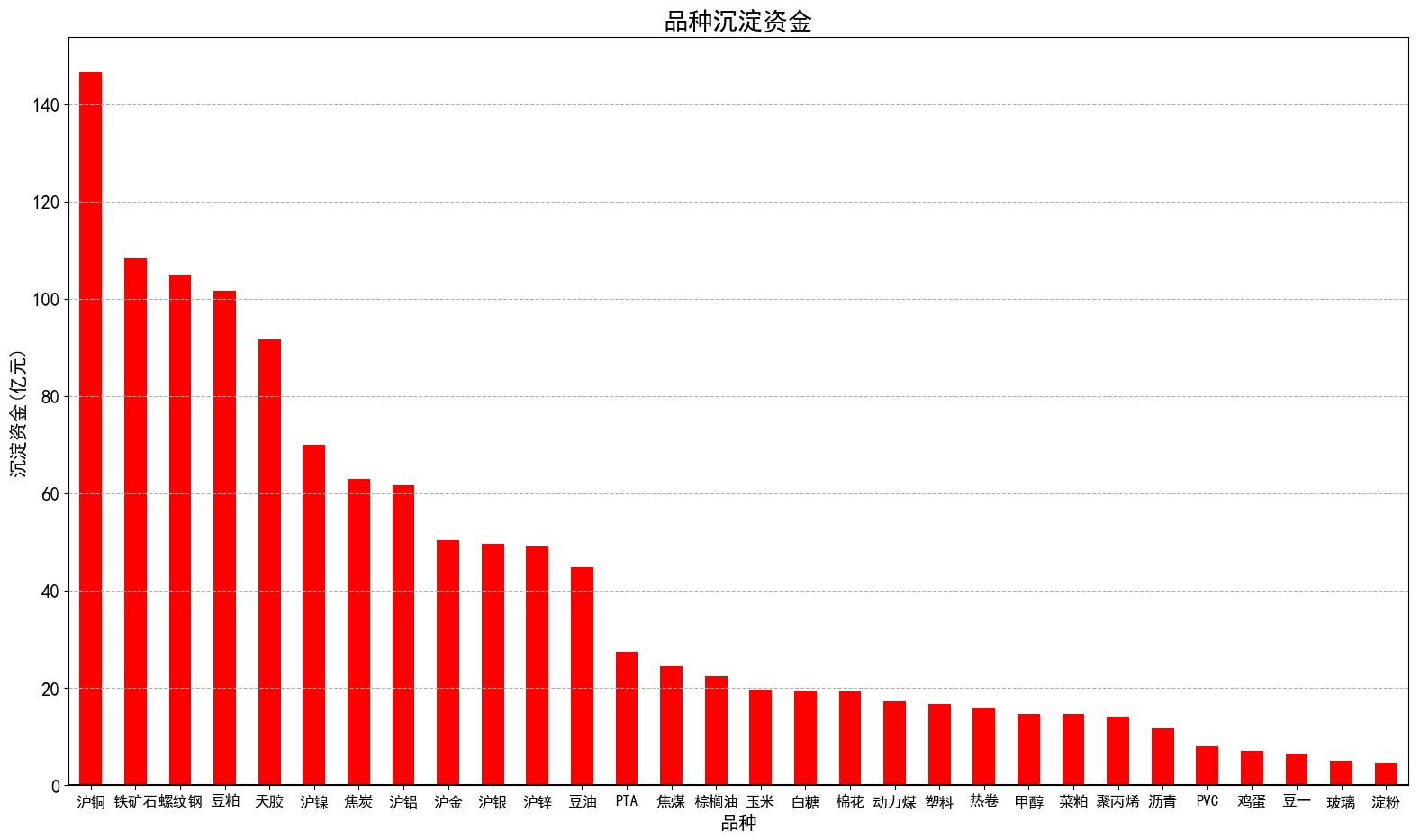
**四、品种资金提示**

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

