【浙商期货研究中心】2018-04-17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

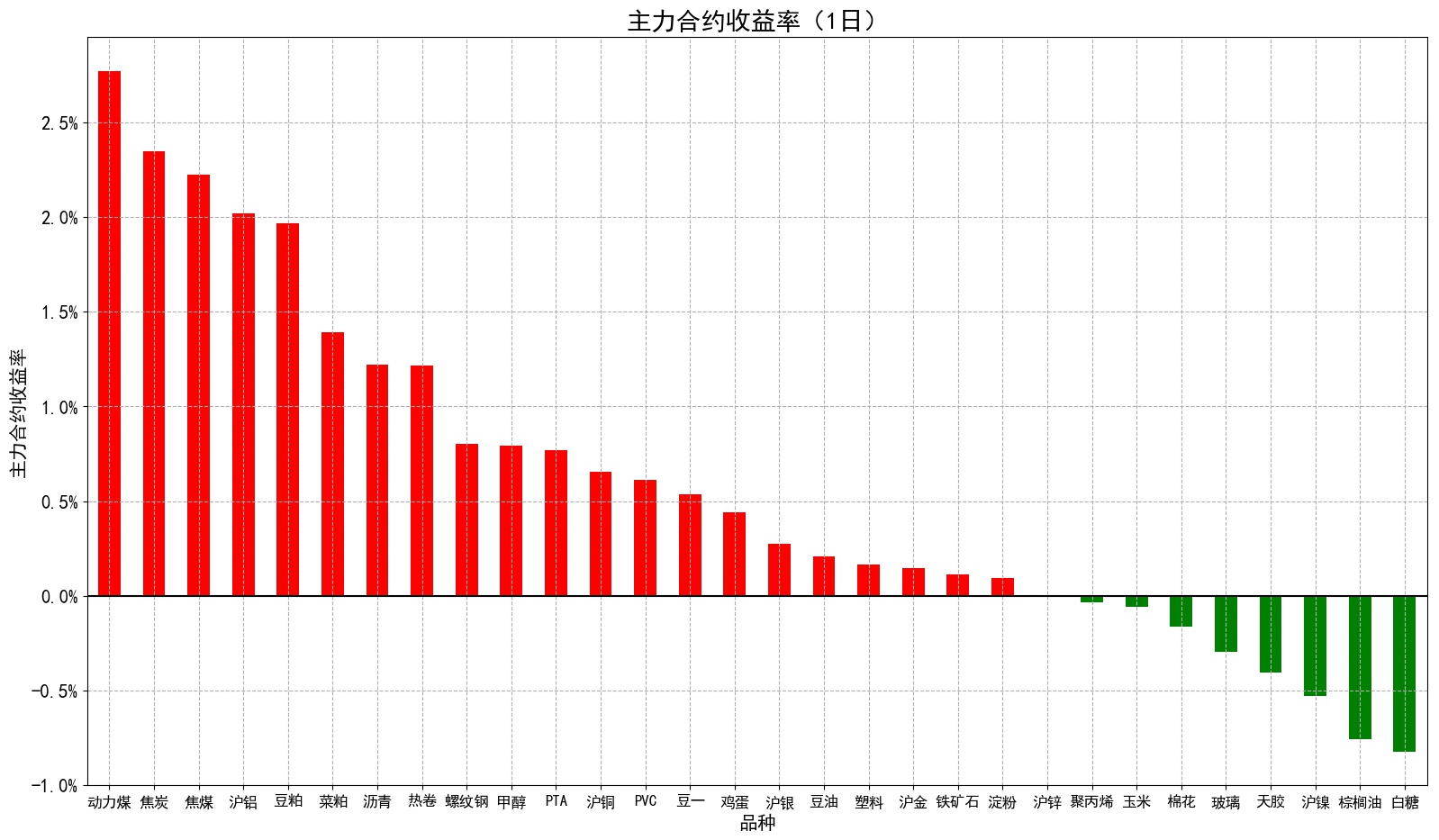
1周收益率 = （今日主力合约收盘价 / 5个交易日前同一合约收盘价） - 1

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:动力煤、焦炭、焦煤、沪铝、豆粕

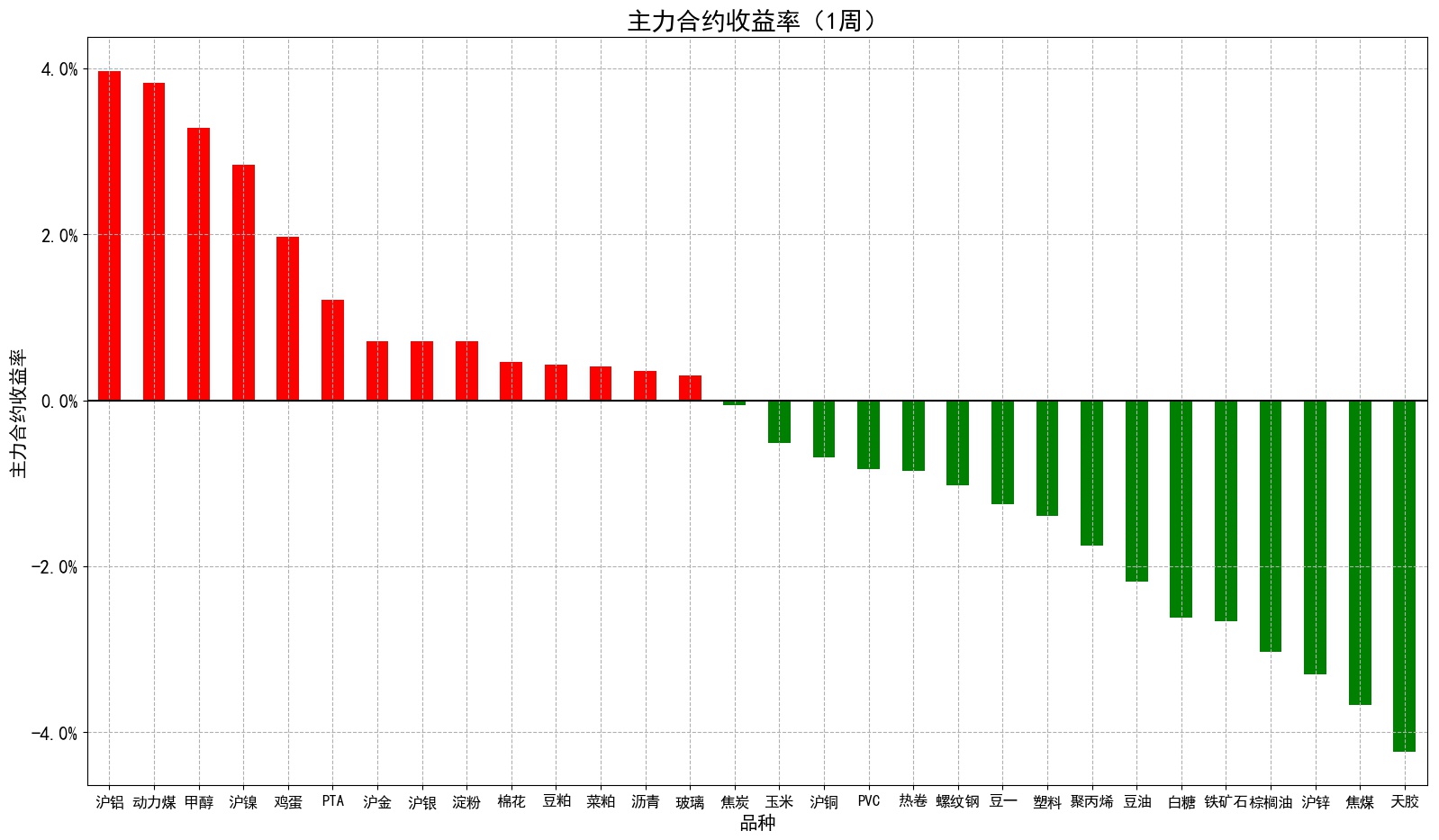
排名后五位的品种是:白糖、棕榈油、沪镍、天胶、玻璃



（2）1周收益

排名前五位的品种是:沪铝、动力煤、甲醇、沪镍、鸡蛋

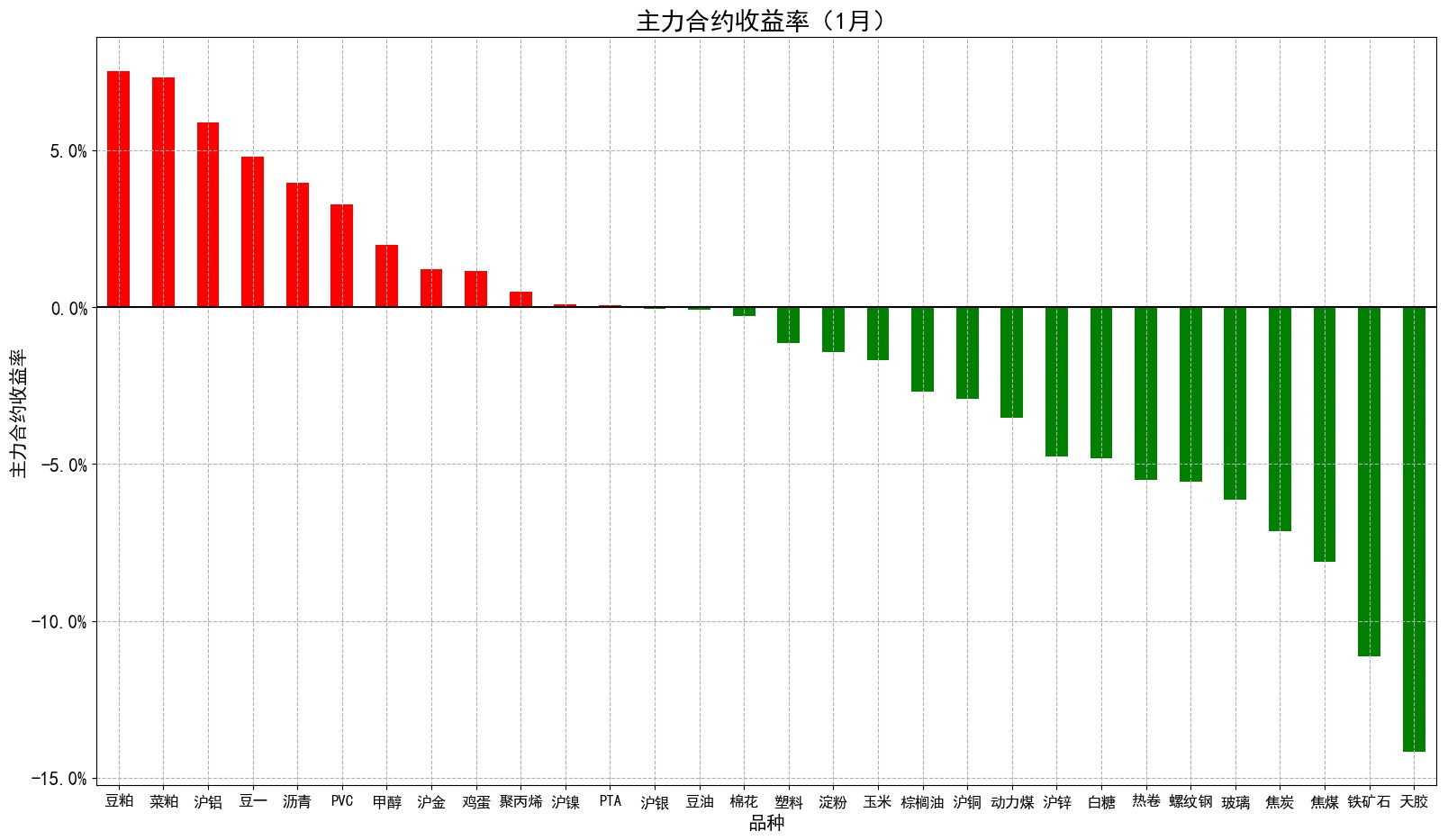
排名后五位的品种是:天胶、焦煤、沪锌、棕榈油、铁矿石



（3）1月收益

排名前五位的品种是:豆粕、菜粕、沪铝、豆一、沥青

排名后五位的品种是:天胶、铁矿石、焦煤、焦炭、玻璃

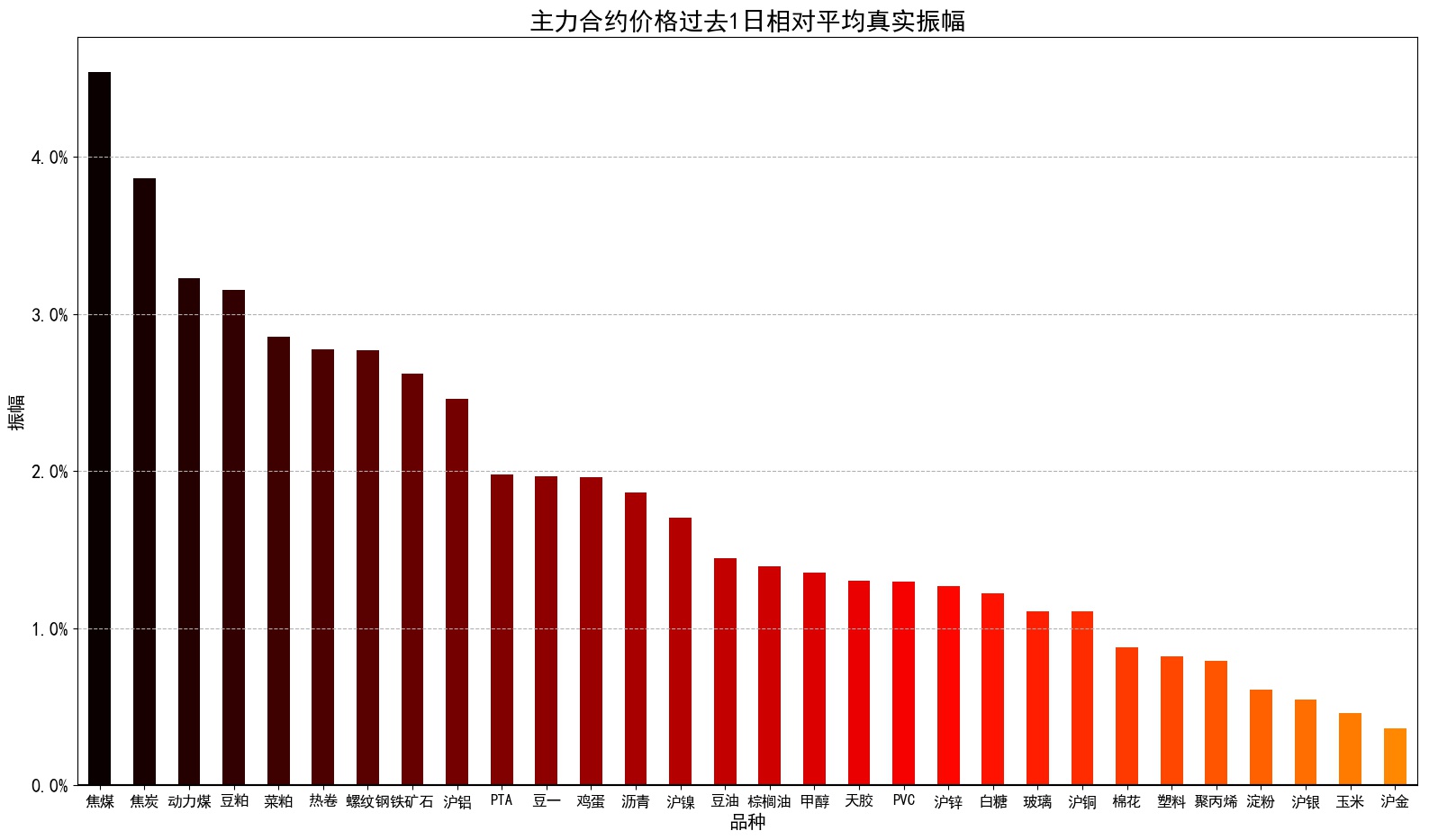


**二、品种波动性提示**

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、焦炭、动力煤、豆粕、菜粕

相对振幅排名后五位的品种是:沪金、玉米、沪银、淀粉、聚丙烯



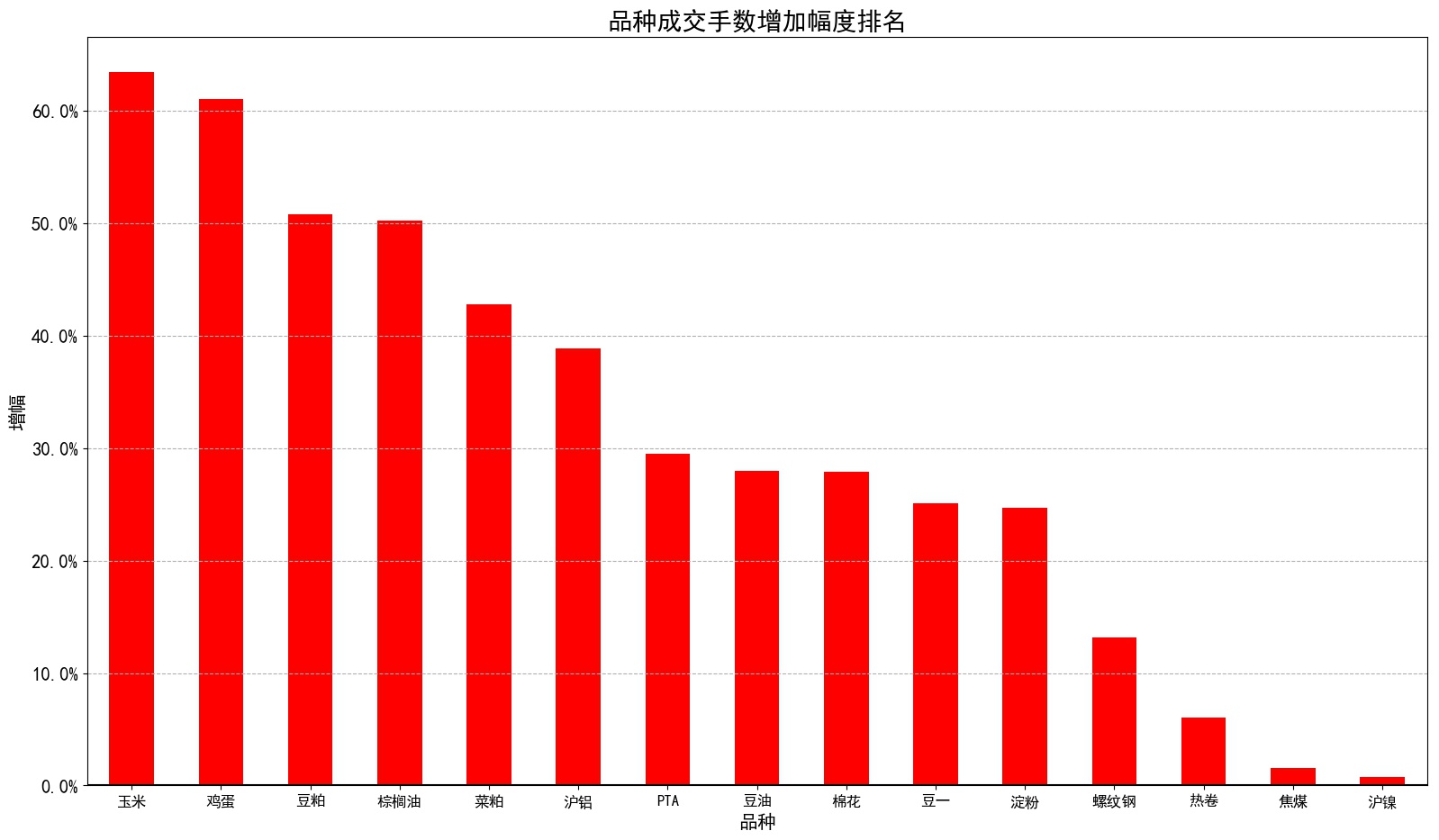
**三、品种持仓与成交情况提示**

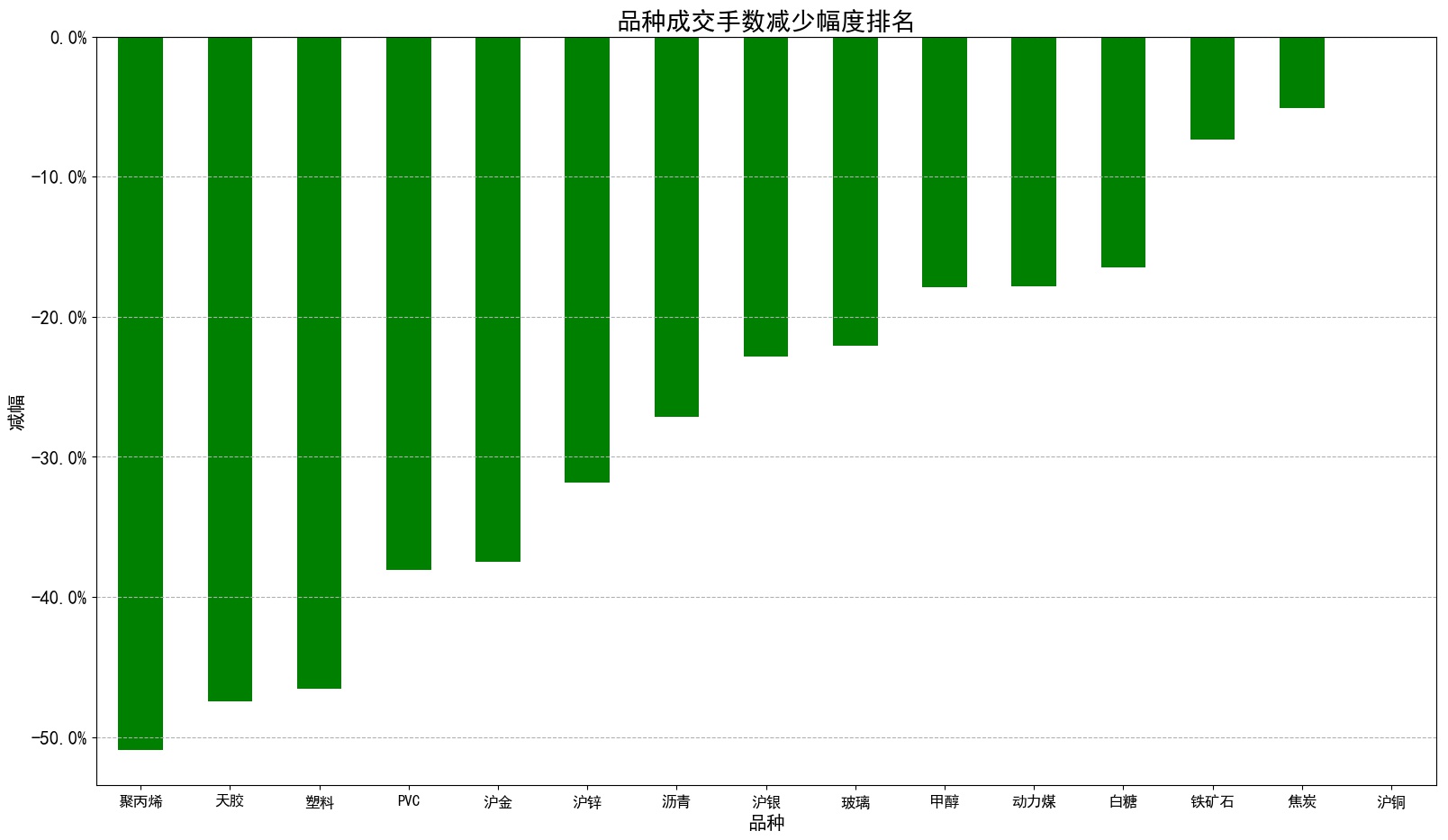
1、品种日成交量变化

通过计算各品种主力合约成交量与前一日变化比例，表征当日内各品种增仓与减仓情况。

日成交手数增加幅度排名前五位的品种为:玉米、鸡蛋、豆粕、棕榈油、菜粕

日成交手数降低幅度排名前五位的品种为:聚丙烯、天胶、塑料、PVC、沪金

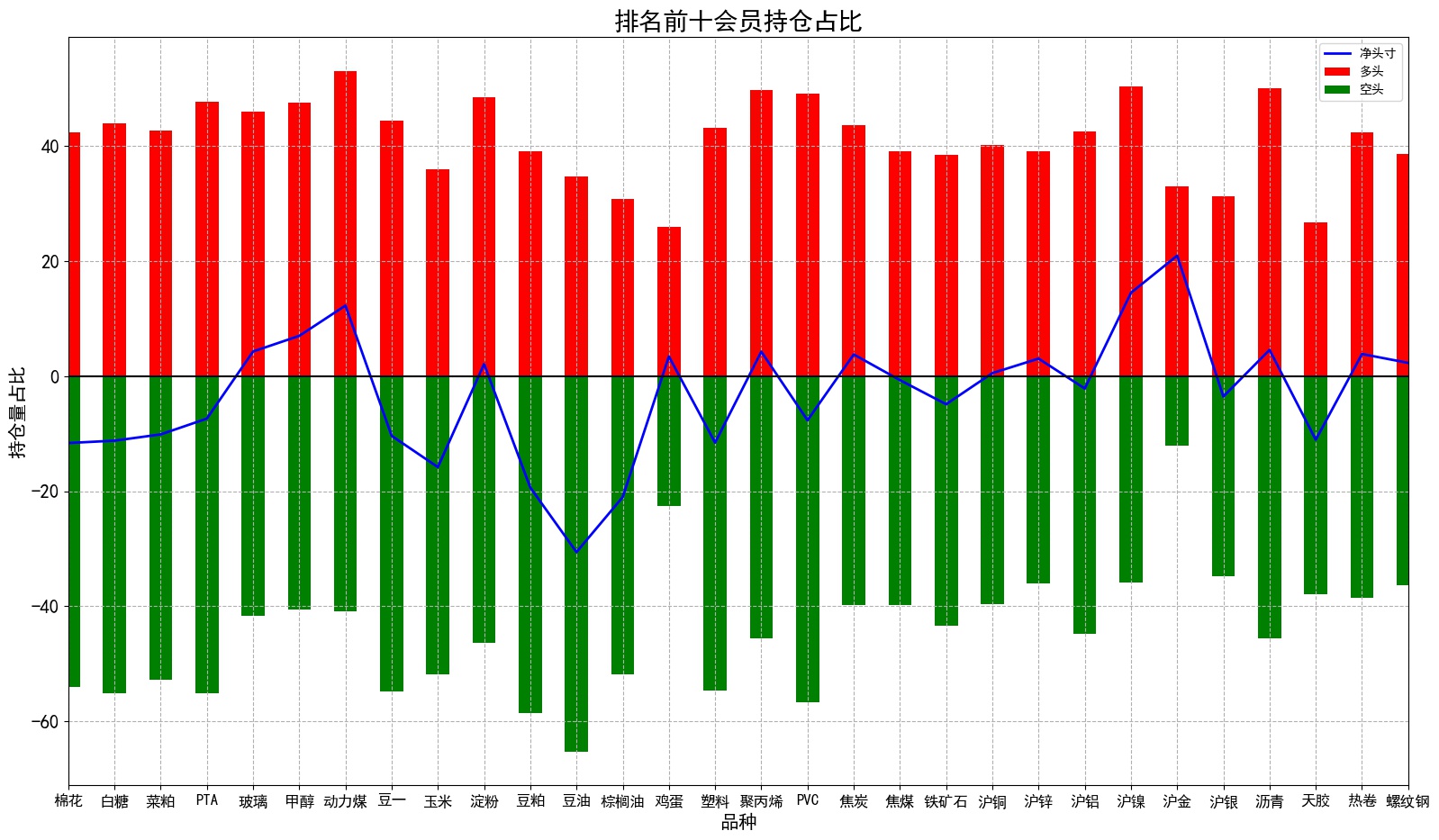




2、持仓排名前十会员持仓占比

（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。



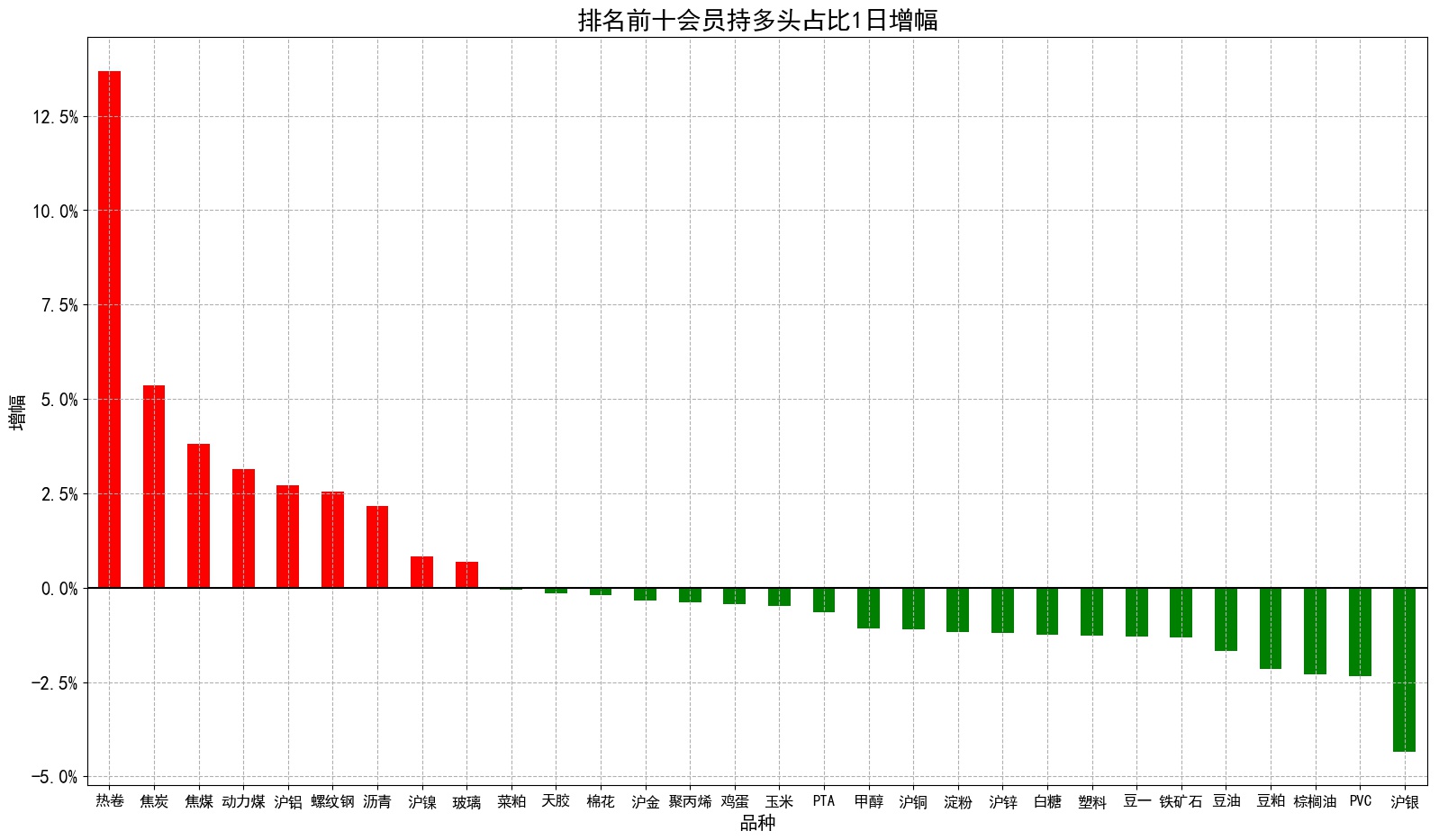
（2）近期持仓占比排名

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：

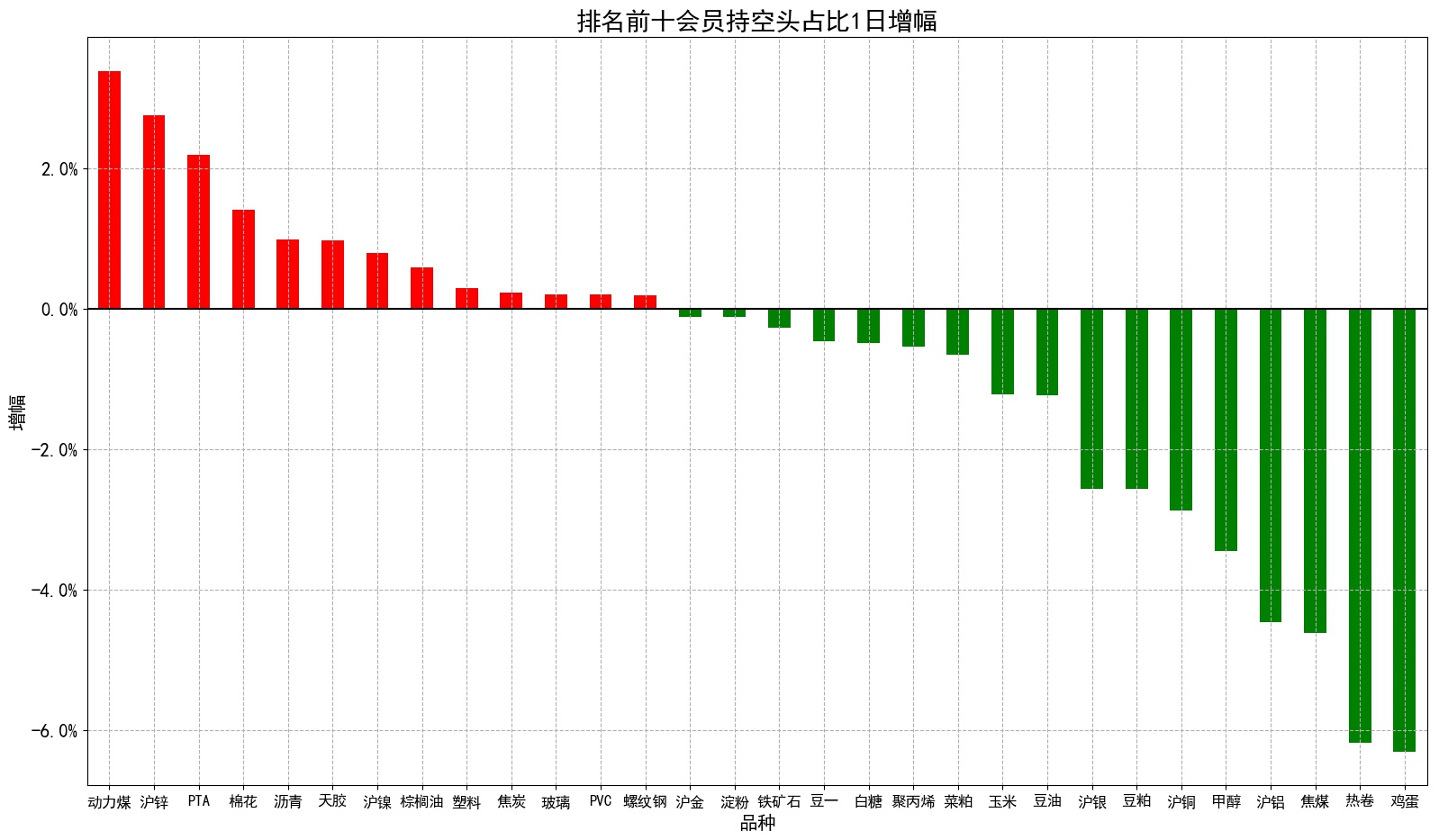
多头占比1日增幅排名前五位的品种是:热卷、焦炭、焦煤、动力煤、沪铝

多头占比1日降幅排名前五位的品种是:沪银、PVC、棕榈油、豆粕、豆油



空头占比增幅排名前五位的品种是:动力煤、沪锌、PTA、棉花、沥青

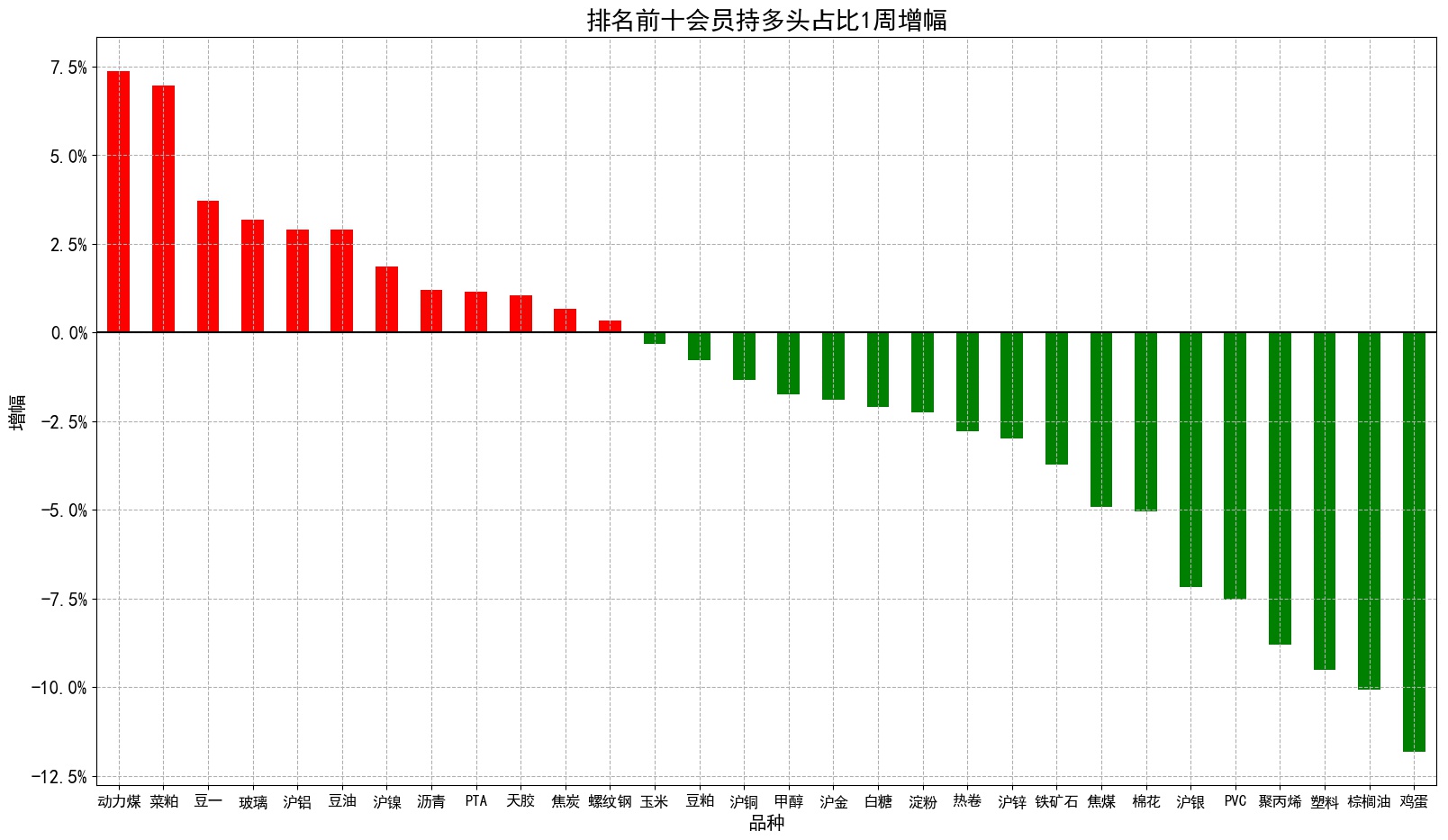
空头占比降幅排名前五位的品种是:鸡蛋、热卷、焦煤、沪铝、甲醇



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：

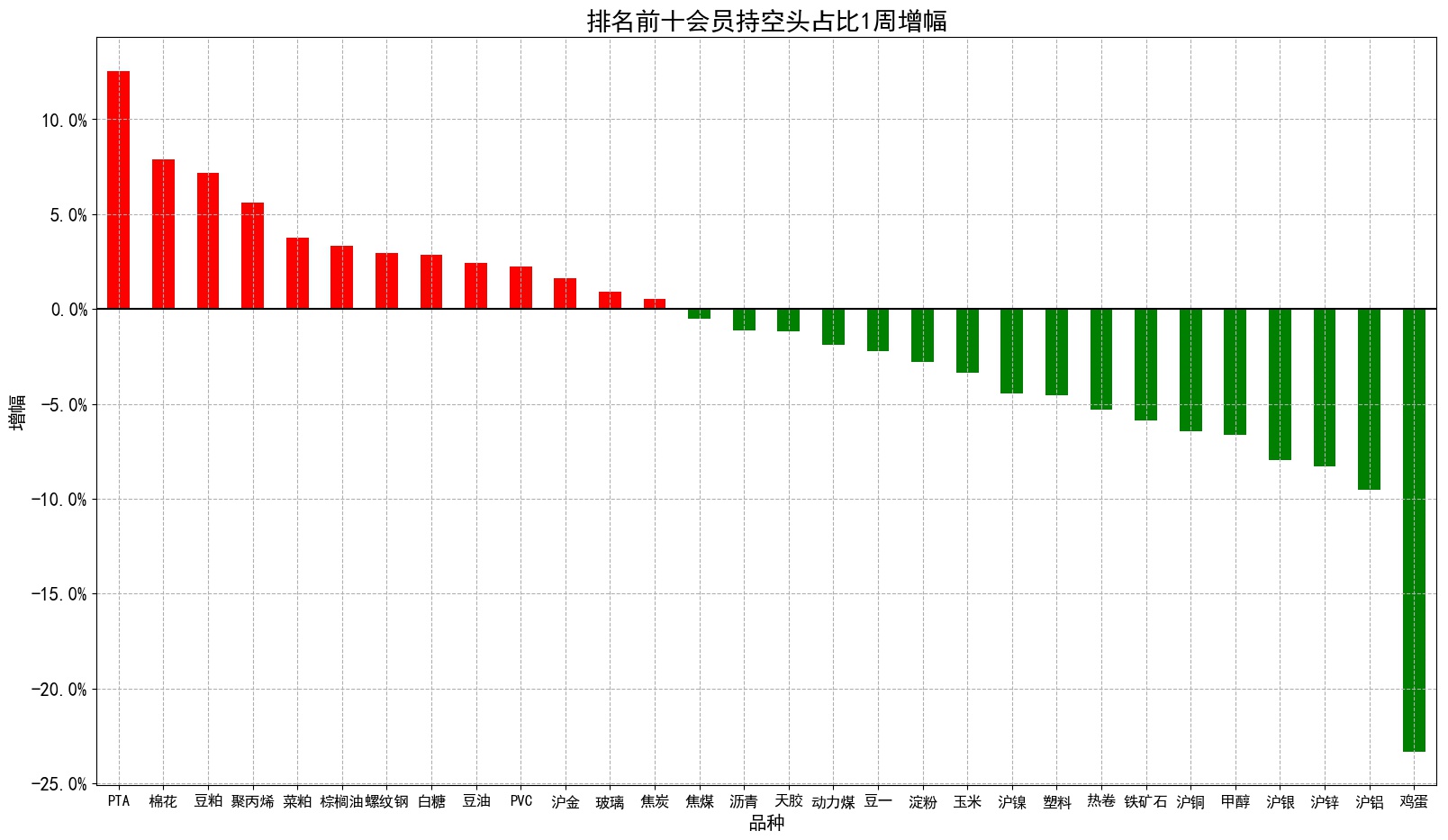
多头占比1周增幅排名前五位的品种是:动力煤、菜粕、豆一、玻璃、沪铝

多头占比1周降幅排名前五位的品种是:鸡蛋、棕榈油、塑料、聚丙烯、PVC



空头占比1周增幅排名前五位的品种是:PTA、棉花、豆粕、聚丙烯、菜粕

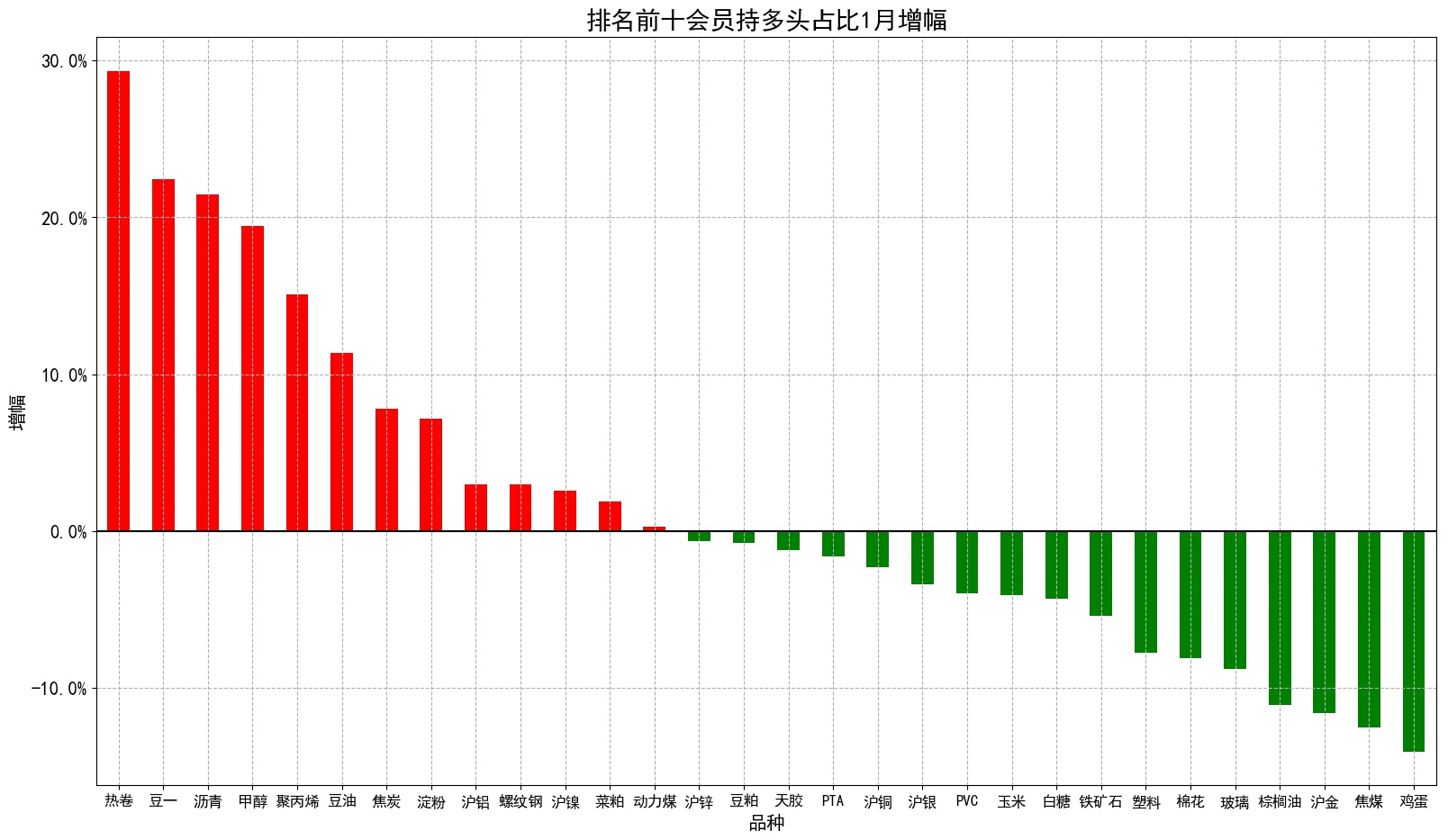
空头占比1周降幅排名前五位的品种是:鸡蛋、沪铝、沪锌、沪银、甲醇



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：

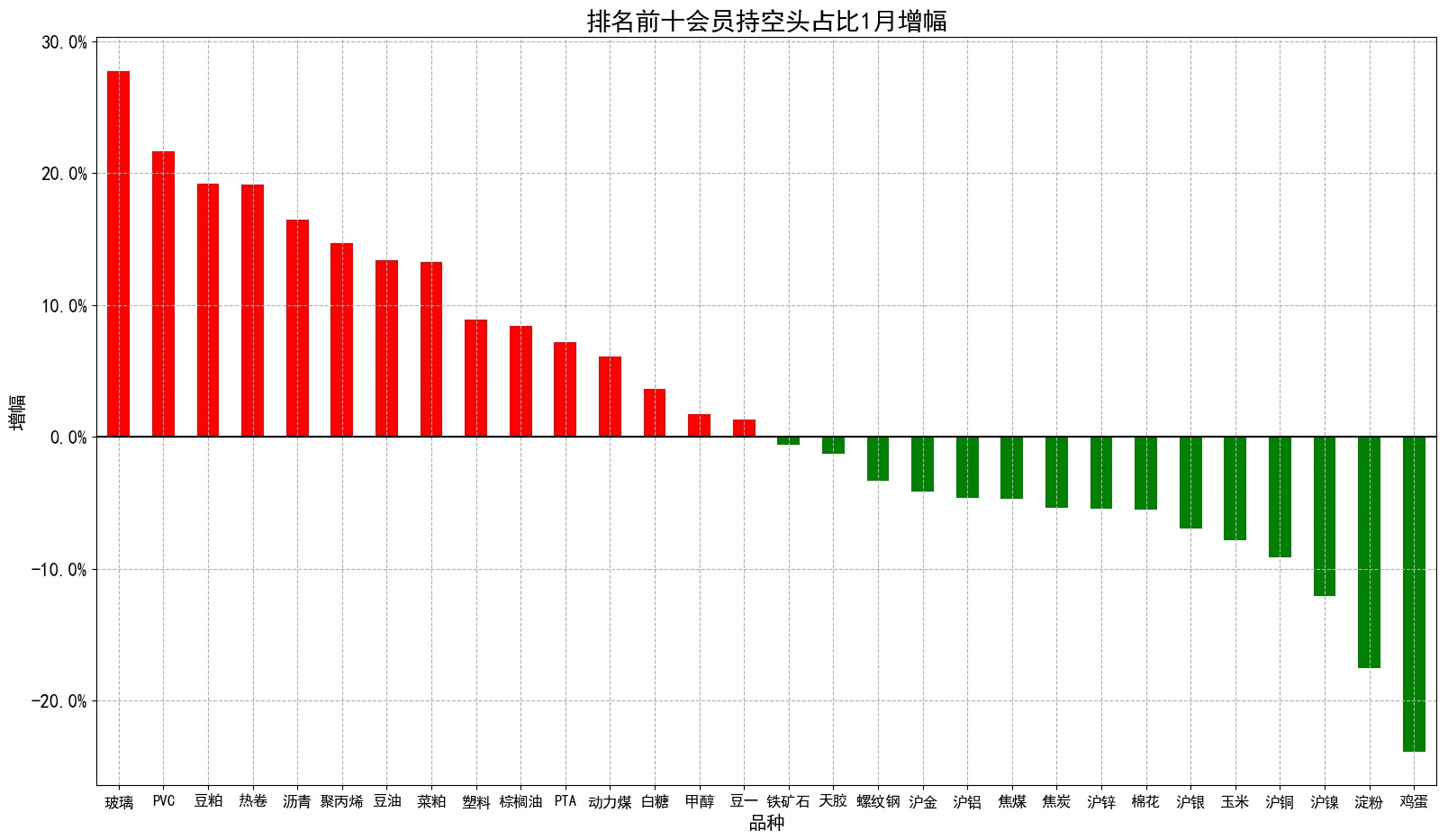
多头占比1月增幅排名前五位的品种是:热卷、豆一、沥青、甲醇、聚丙烯

多头占比1月降幅排名前五位的品种是:鸡蛋、焦煤、沪金、棕榈油、玻璃



空头占比1月增幅排名前五位的品种是:玻璃、PVC、豆粕、热卷、沥青

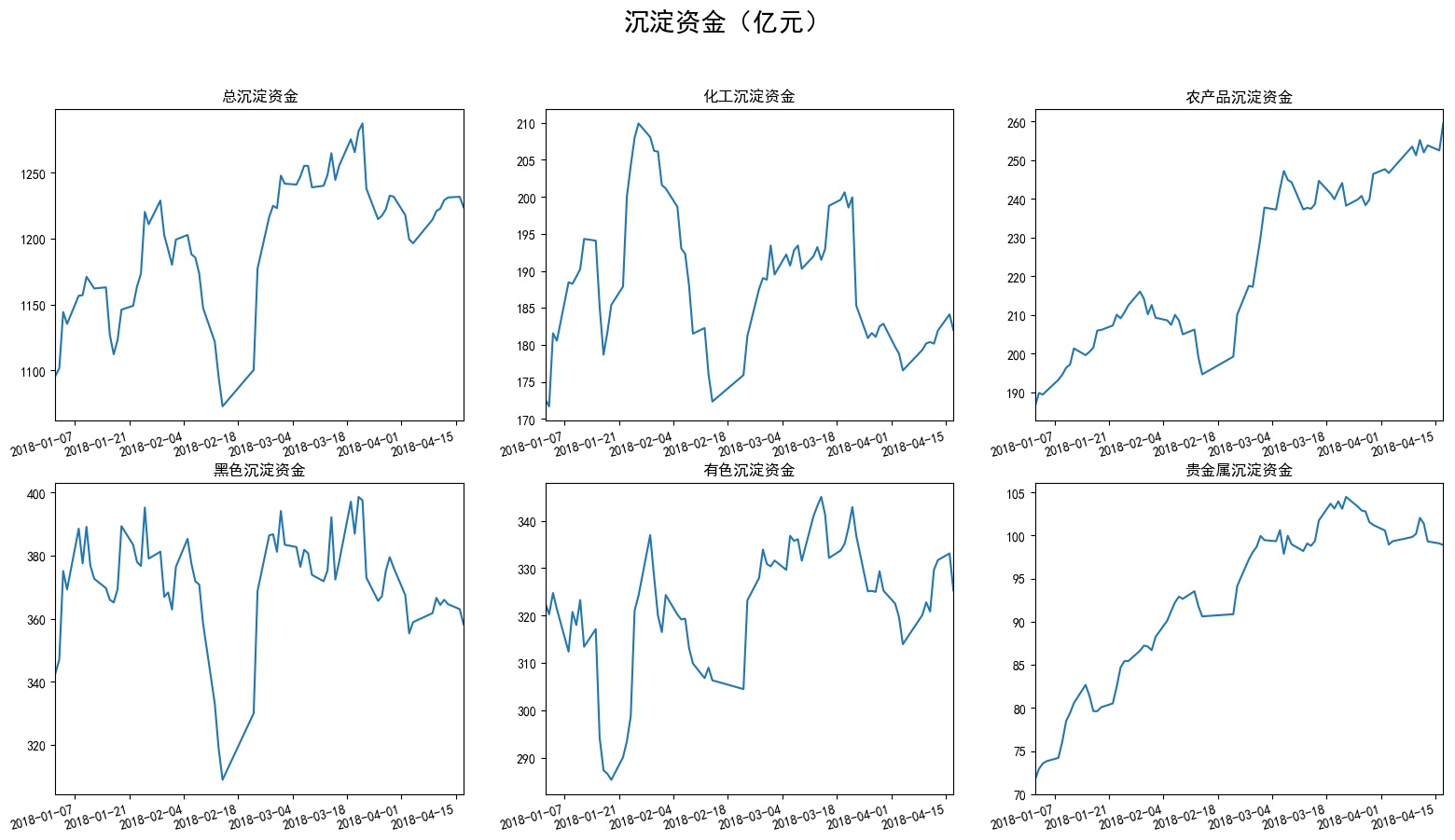
空头占比1月降幅排名前五位的品种是:鸡蛋、淀粉、沪镍、沪铜、玉米



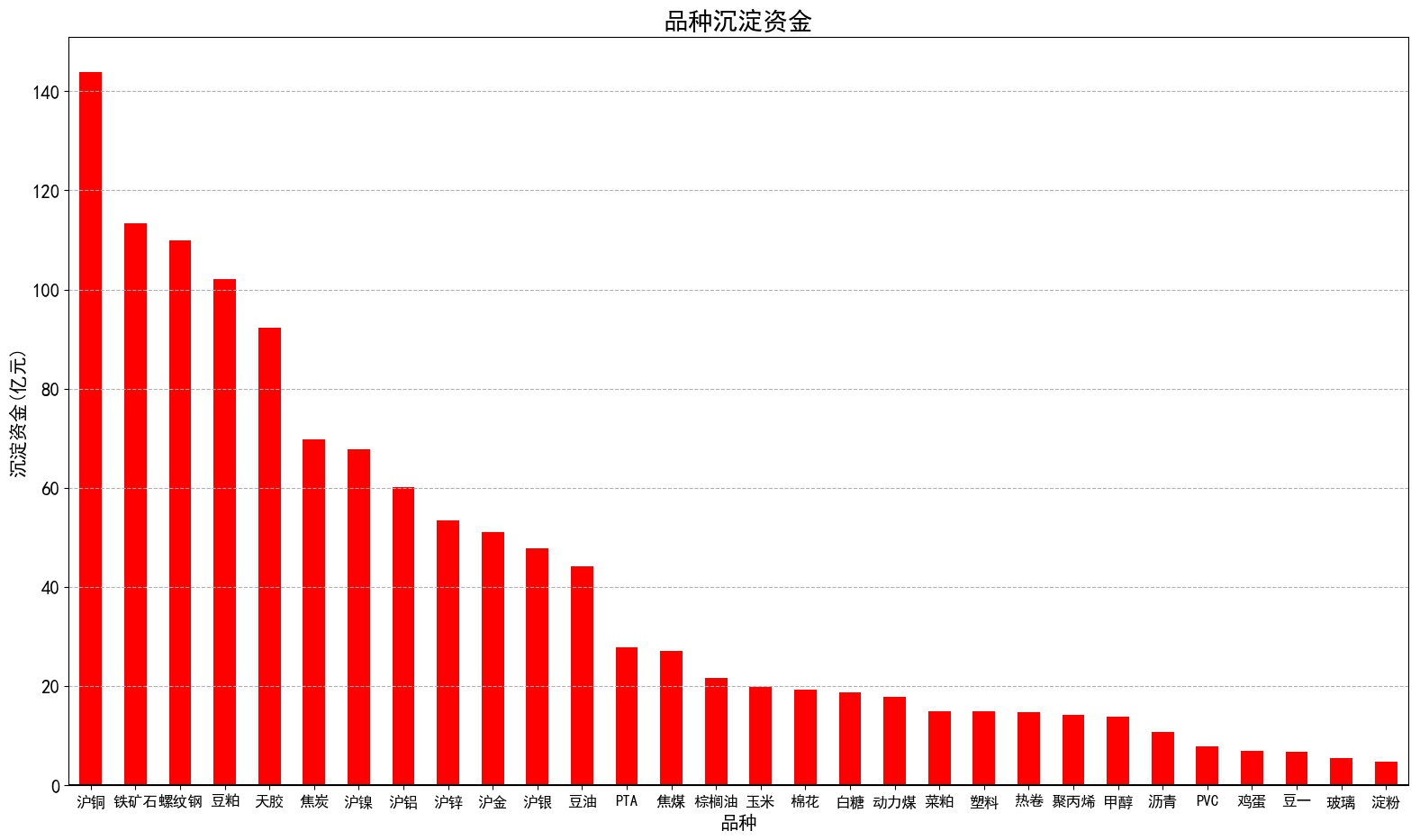
**四、品种资金提示**

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

