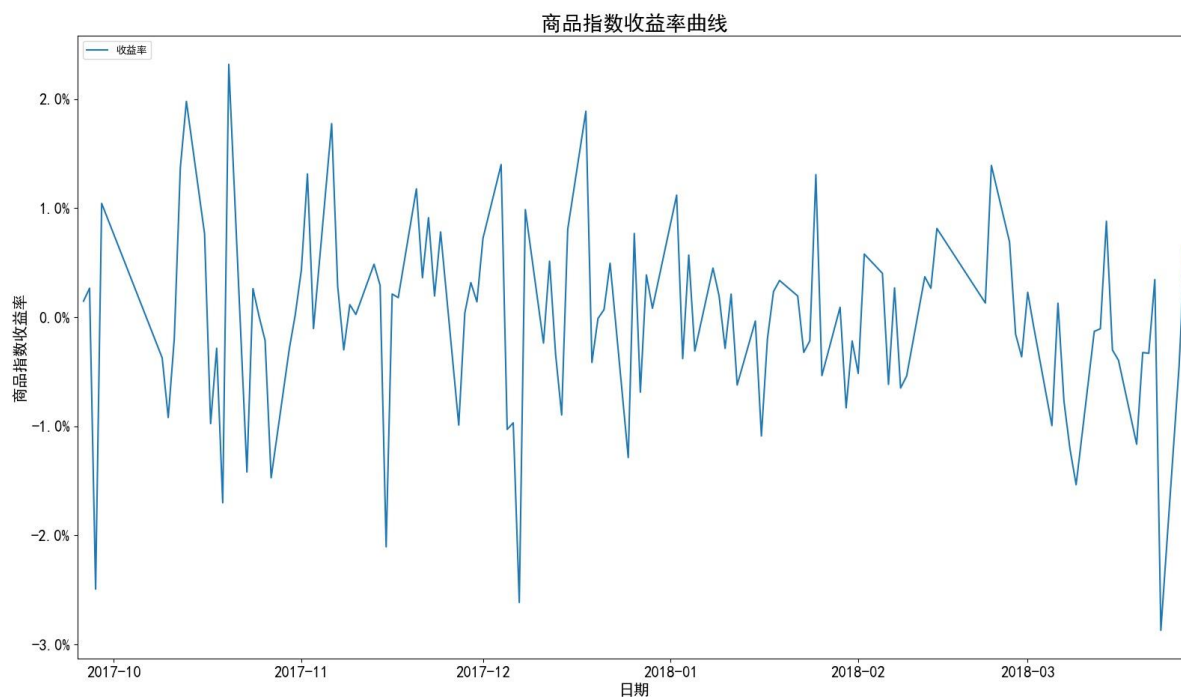
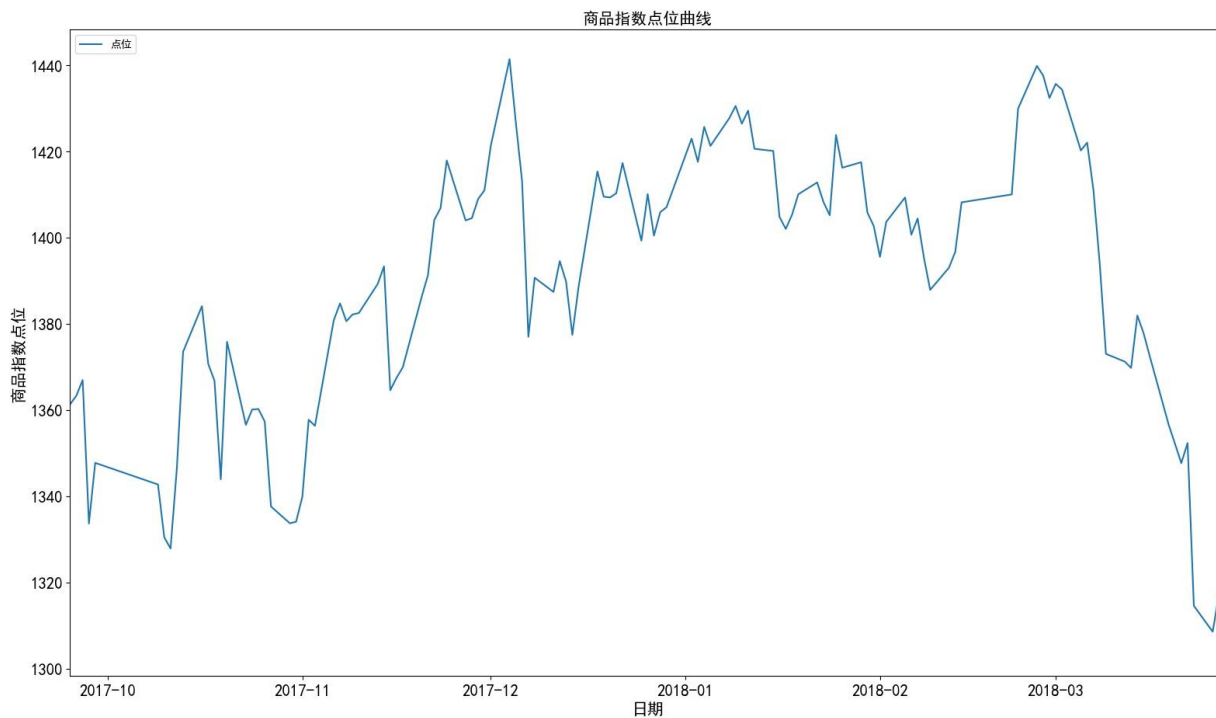


2018-03-28 量化日报

一、品种强弱提示

1、商品指数走势

通过南华商品指数半年以来的价位及收益率表征市场整体价格及收益率水平：



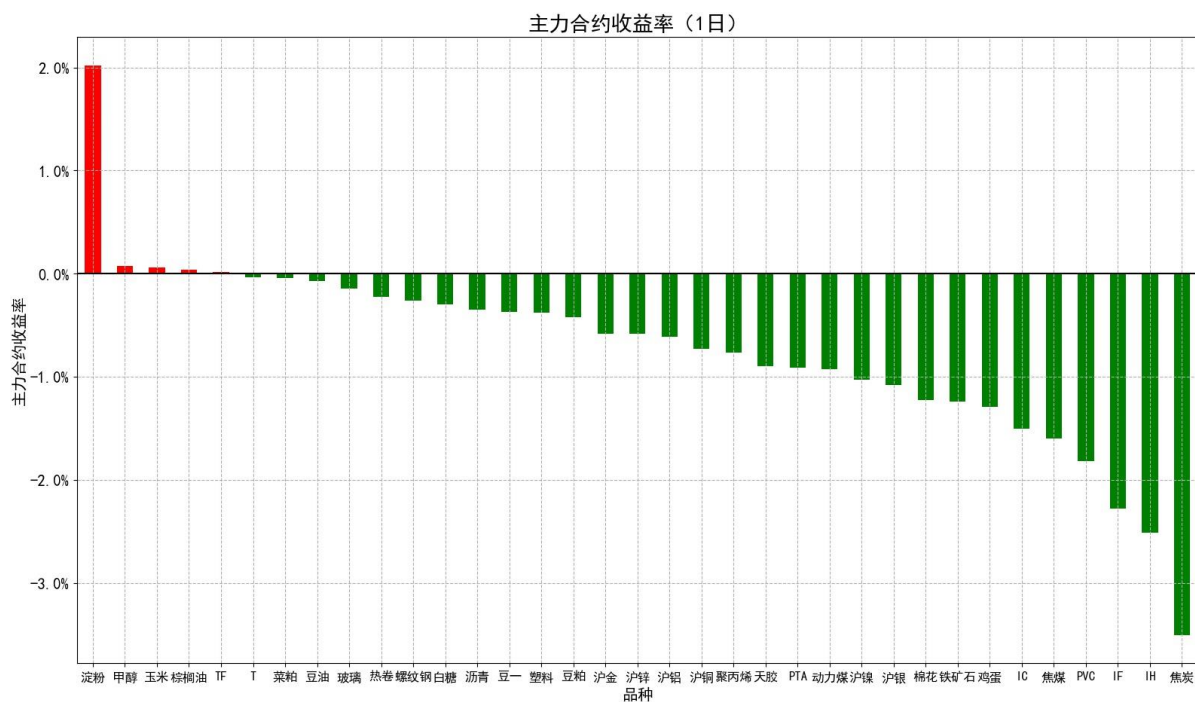
2、品种收益率排名

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。

(1) 1日收益

排名前三位的品种是：淀粉、甲醇、玉米；

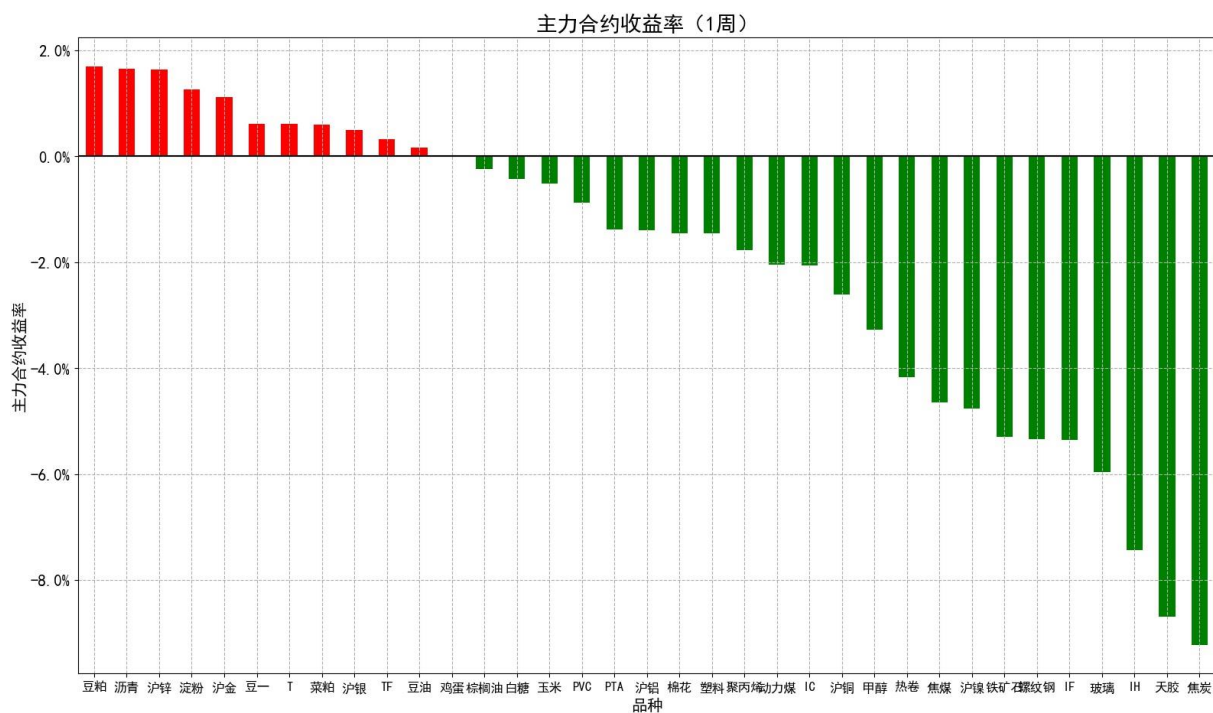
排名后三位的品种是：焦炭、IH、IF



(2) 1周收益

排名前三位的品种是：豆粕、沥青、沪锌；

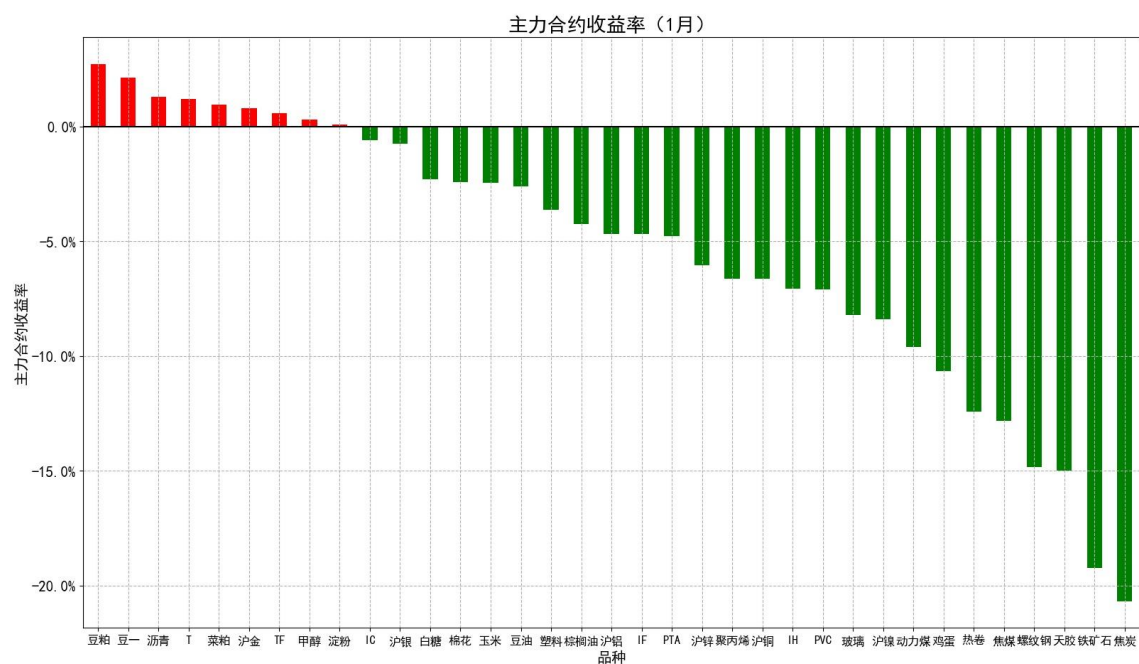
排名后三位的品种是：焦炭、天胶、玻璃



(3) 1 月收益

排名前三位的品种是：豆粕、豆一、沥青；

排名后三位的品种是：焦炭、铁矿石、天胶

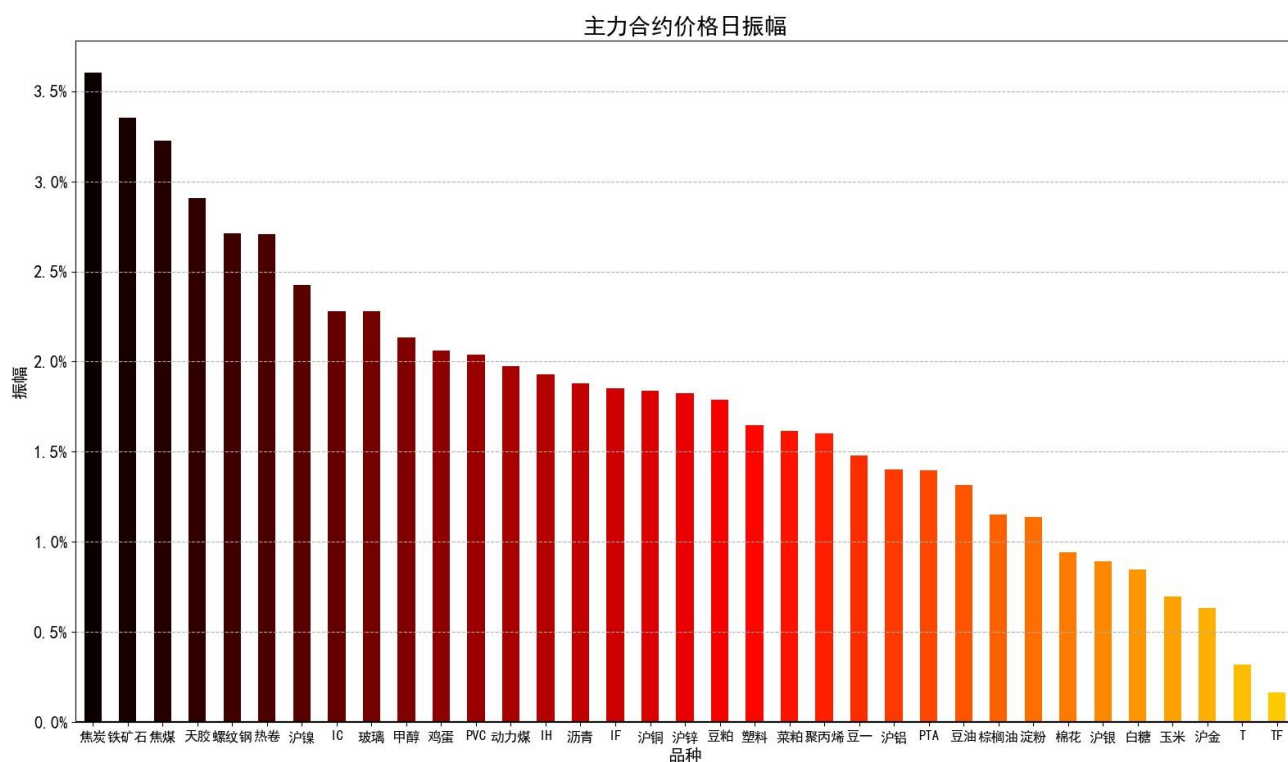


二、品种波动性提示

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。

相对振幅排名前三位的品种是：焦炭、铁矿石、焦煤

相对振幅排名后三位的品种是：TF、T、沪金



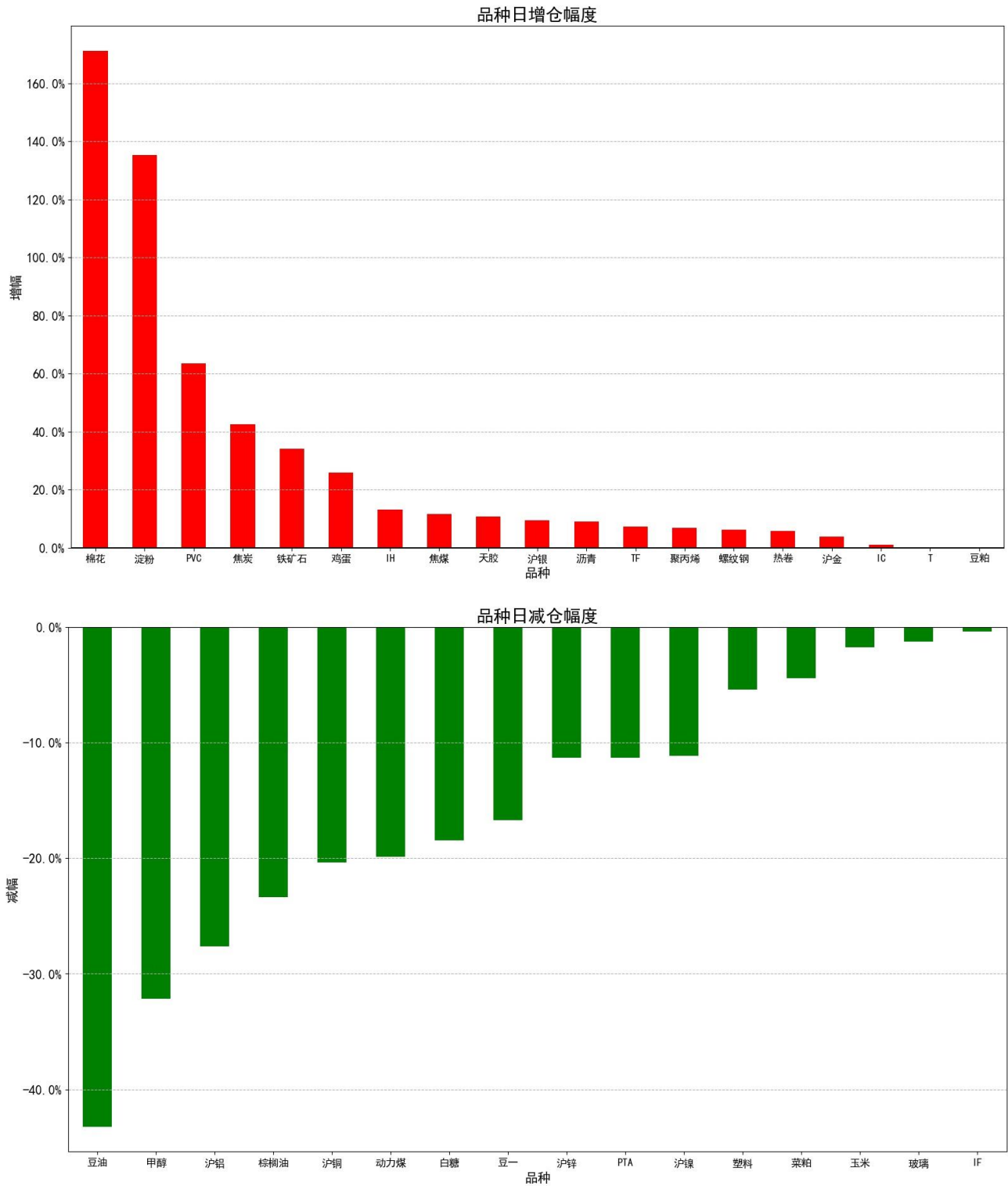
三、品种持仓与成交情况提示

1、品种日增减仓

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。

日增仓比例排名前三位的品种为：棉花、淀粉、PVC

日增仓比例排名后三位的品种为：豆油、甲醇、沪铝

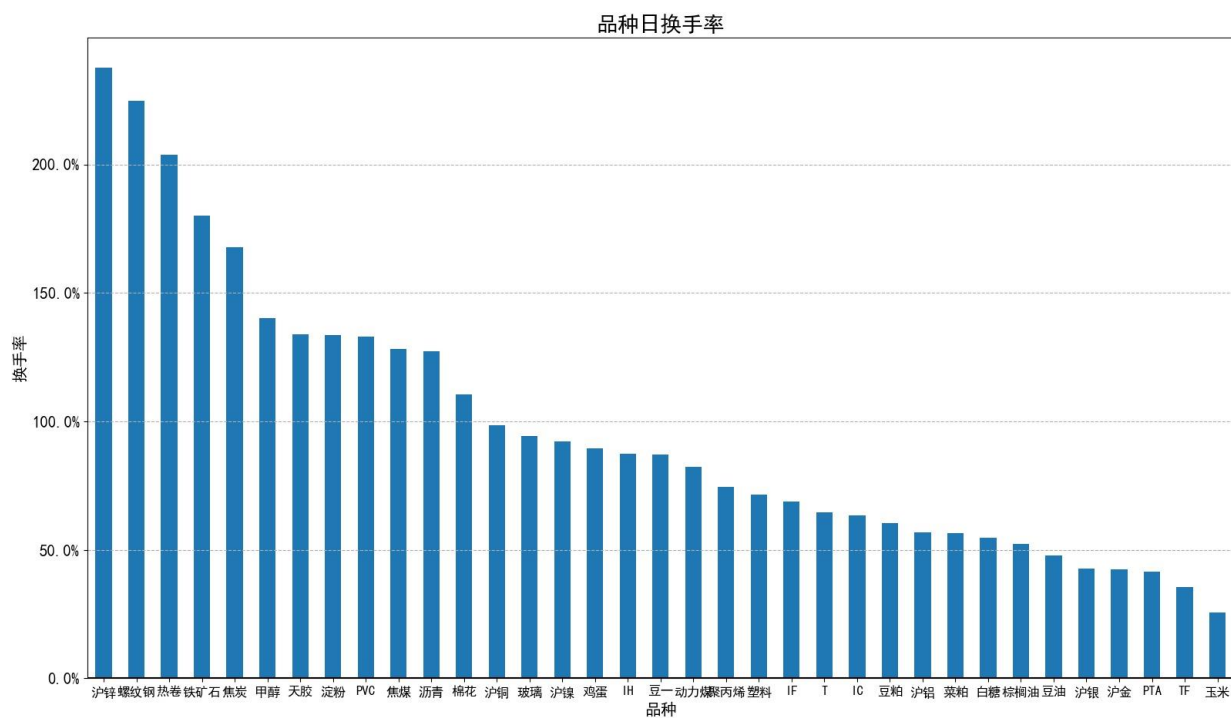


2、换手率

通过计算主力合约换手率(成交量/持仓量)，表征品种投机氛围浓重程度

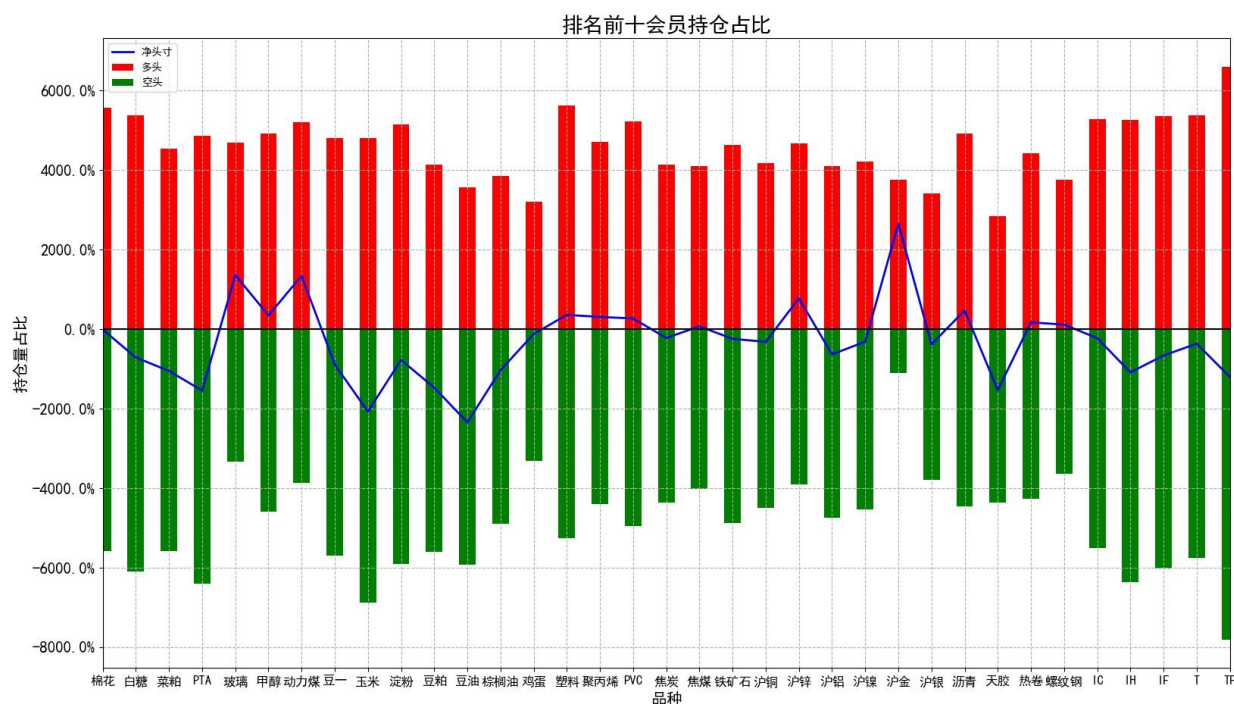
换手率排名前三位的品种为：沪锌、螺纹钢、热卷

换手率排名后三位的品种为：玉米、IF、PTA



3、持仓排名前十会员持仓占比

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。

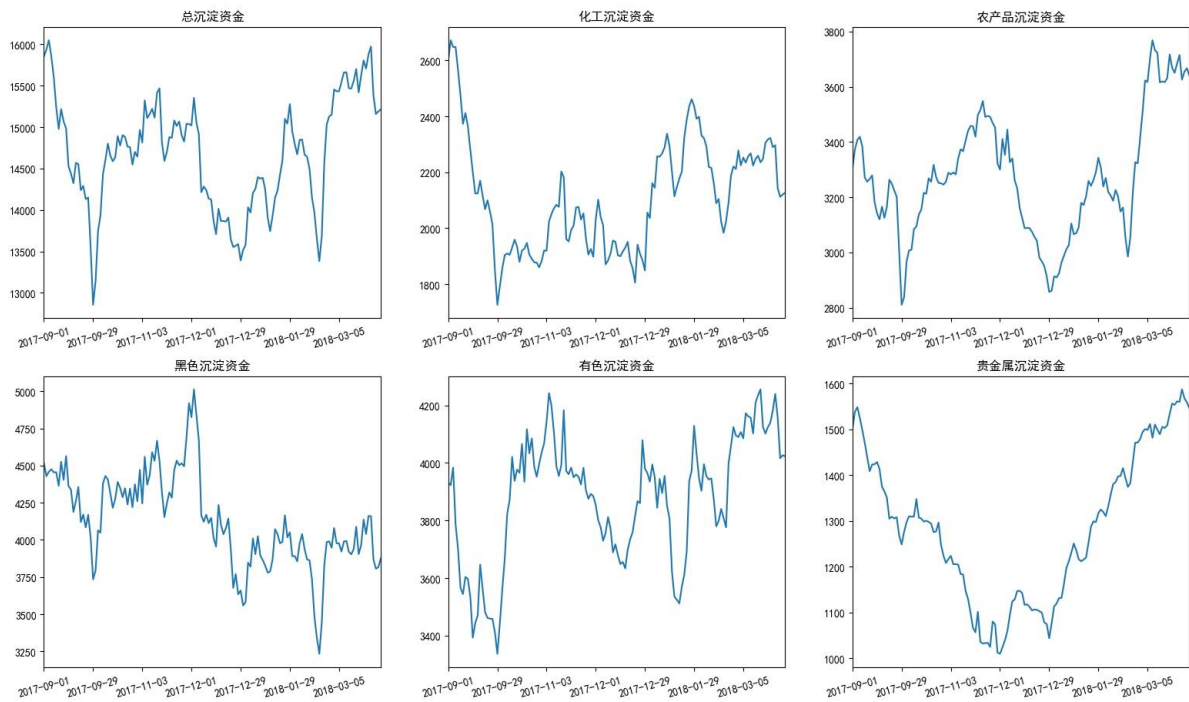


四、品种资金提示

1、沉淀资金

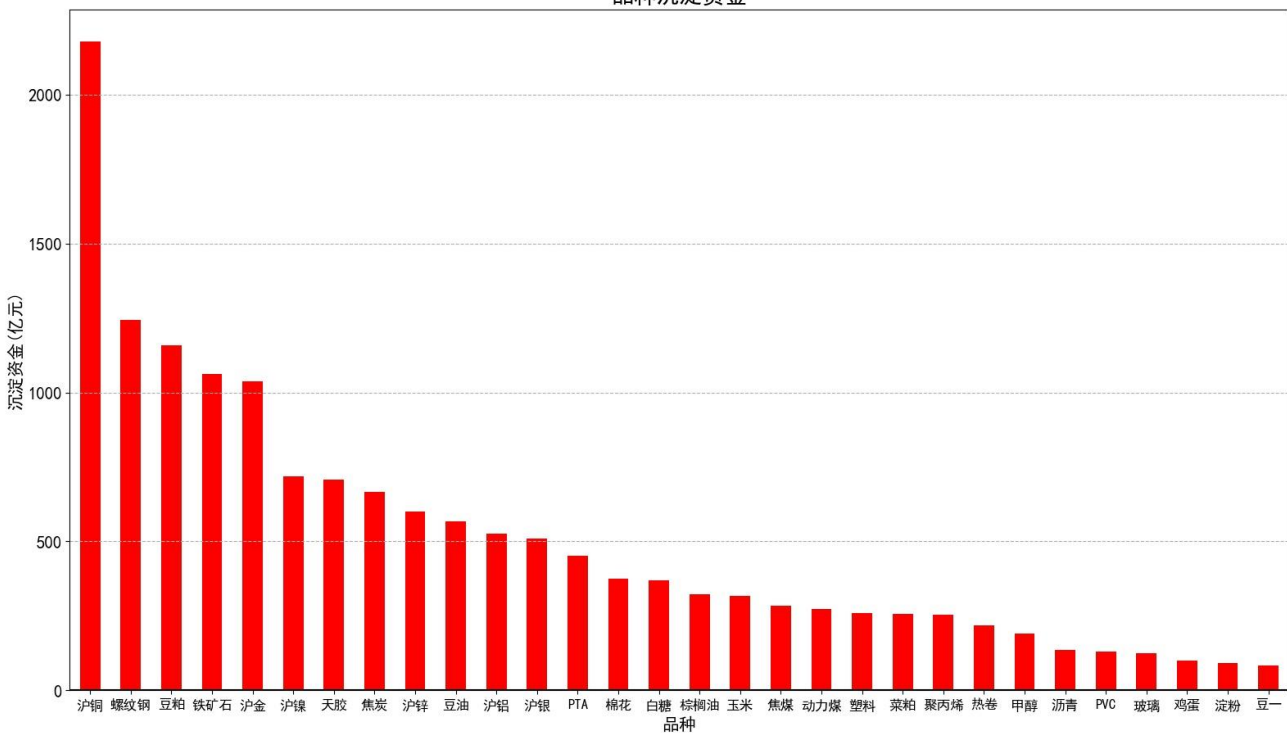
(1) 各板块沉淀资金统计

沉淀资金（亿元）



(2) 各品种沉淀资金统计

品种沉淀资金



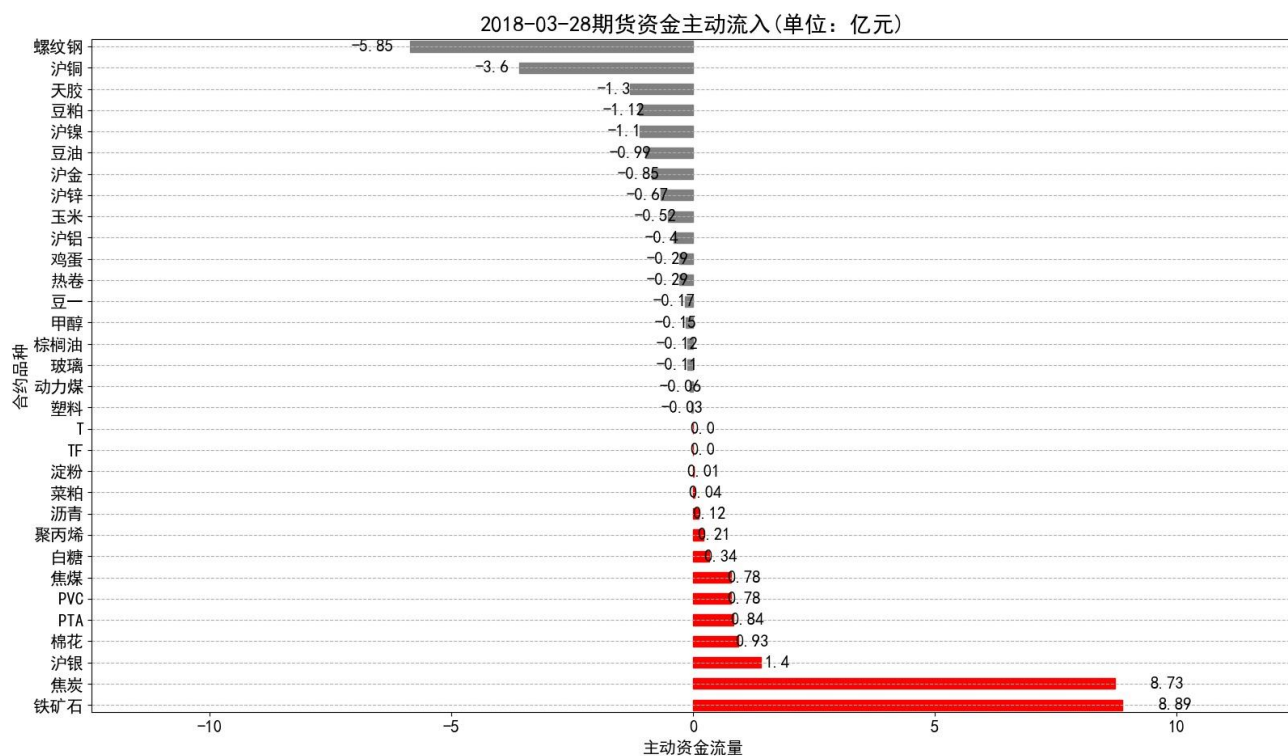
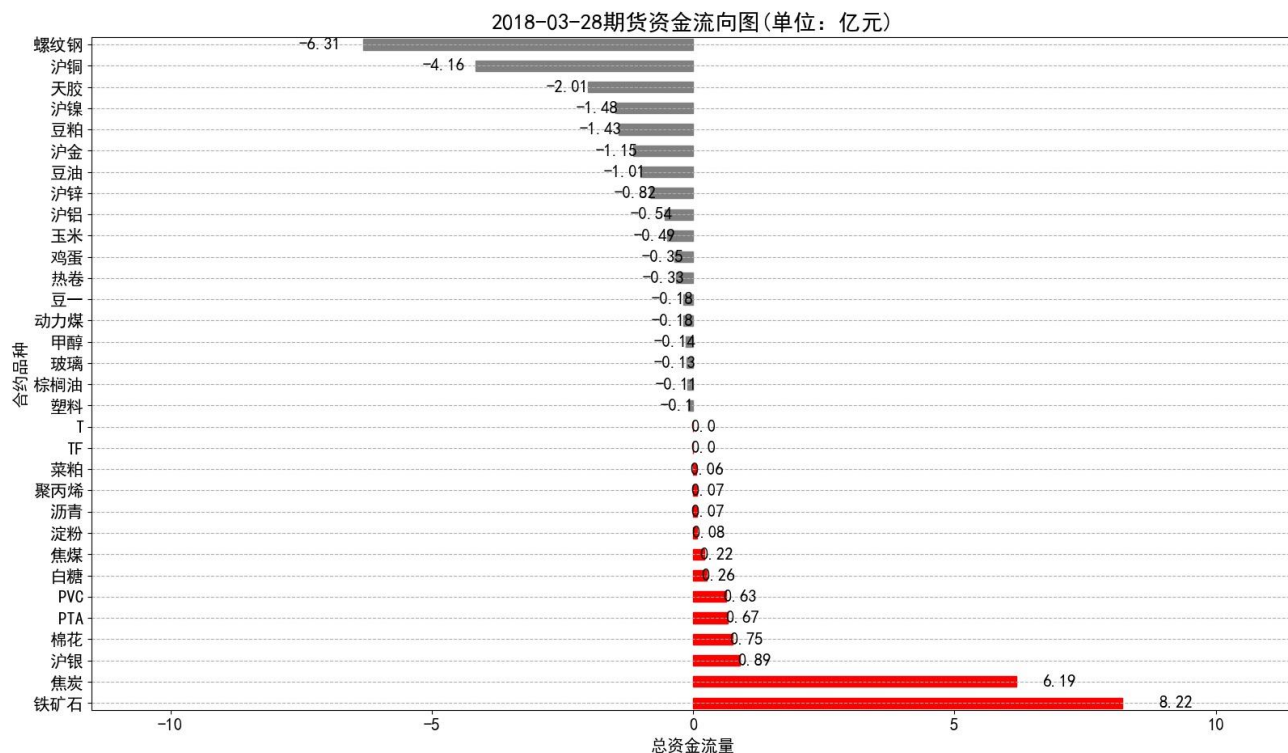
2、各品种资金流向

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



2018-03-28期货资金被动流入(单位: 亿元)

