

2018-04-12 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

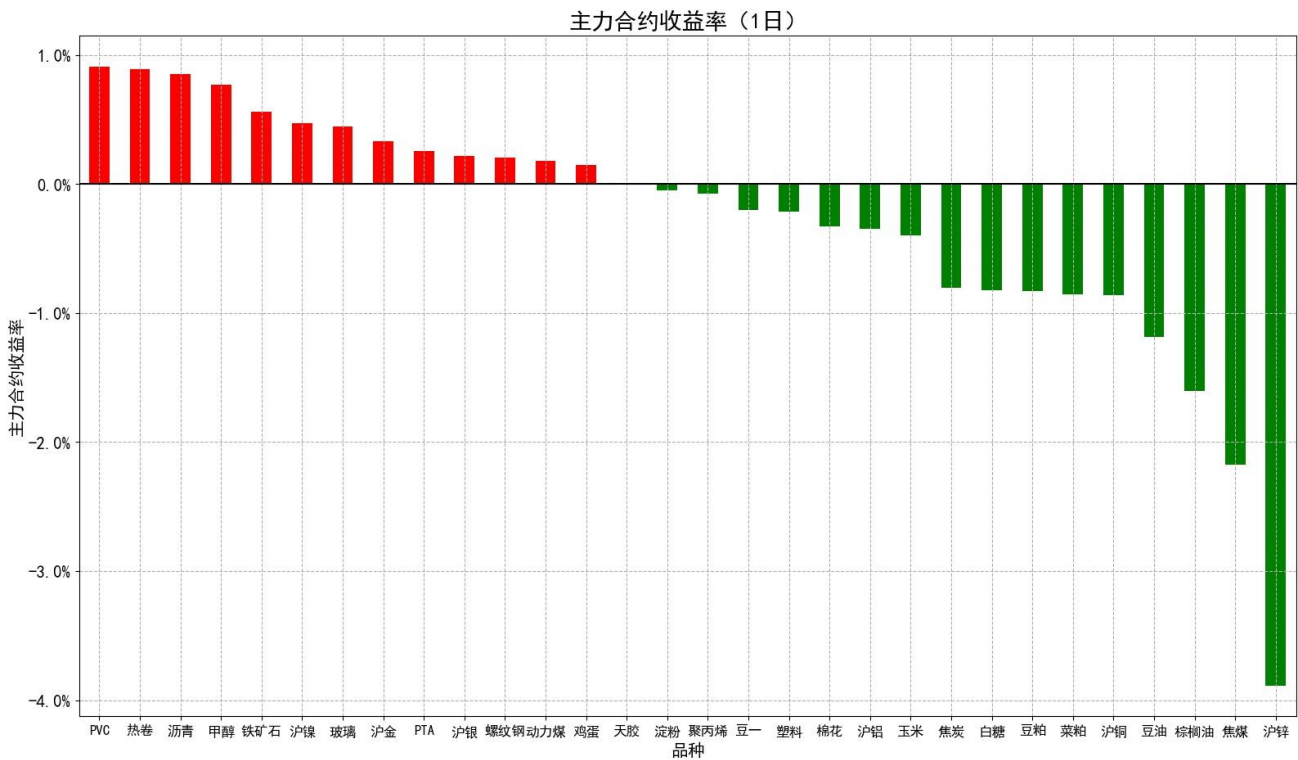
1周收益率 = (今日主力合约收盘价 / 5个交易日前同一合约收盘价) - 1

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:PVC、热卷、沥青、甲醇、铁矿石

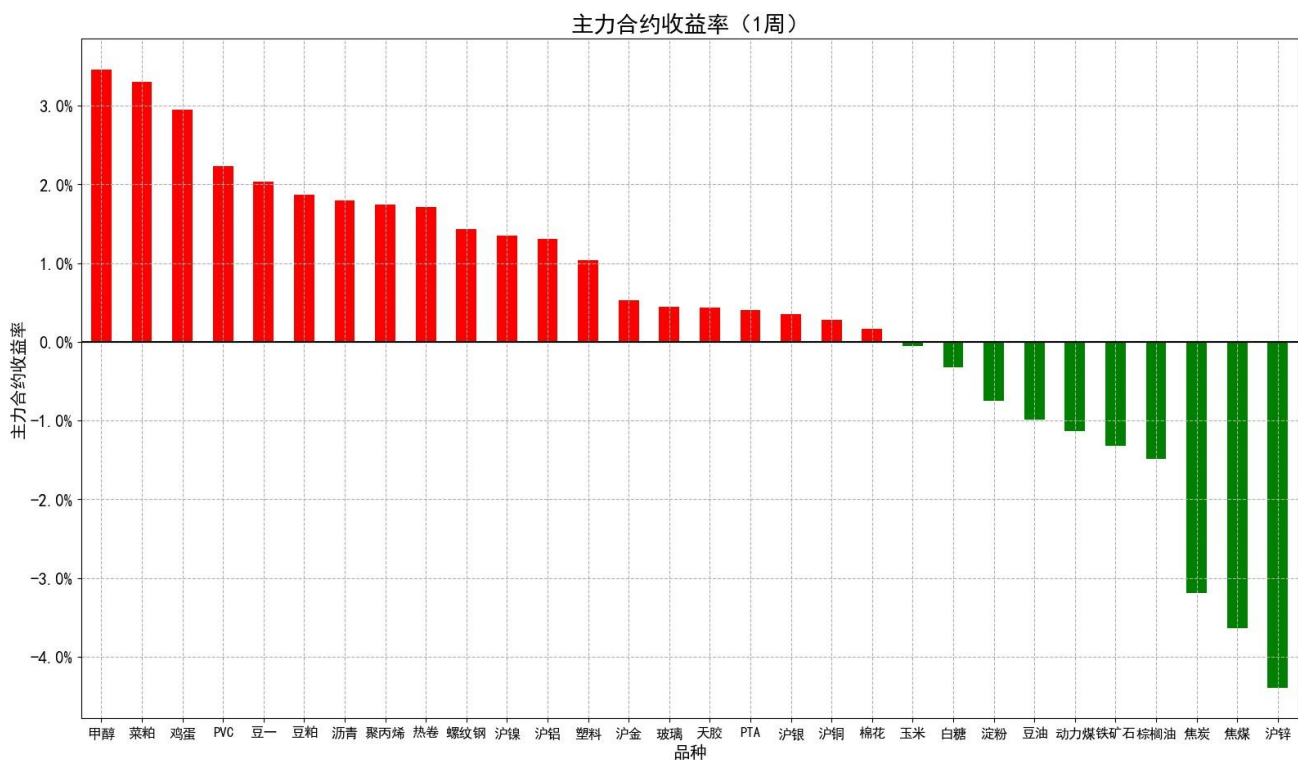
排名后五位的品种是:沪锌、焦煤、棕榈油、豆油、沪铜



(2) 1周收益

排名前五位的品种是:甲醇、菜粕、鸡蛋、PVC、豆一

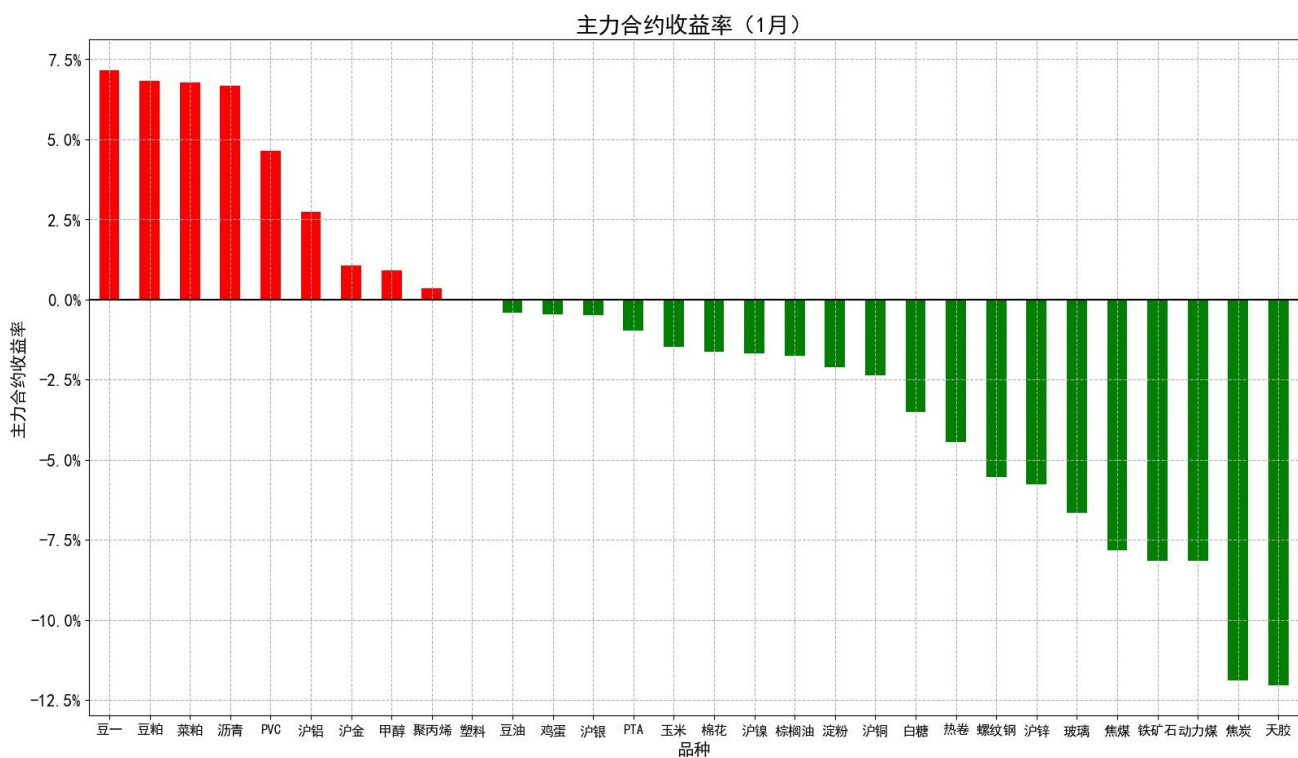
排名后五位的品种是:沪锌、焦煤、焦炭、棕榈油、铁矿石



(3) 1 月收益

排名前五位的品种是:豆一、豆粕、菜粕、沥青、PVC

排名后五位的品种是:天胶、焦炭、动力煤、铁矿石、焦煤



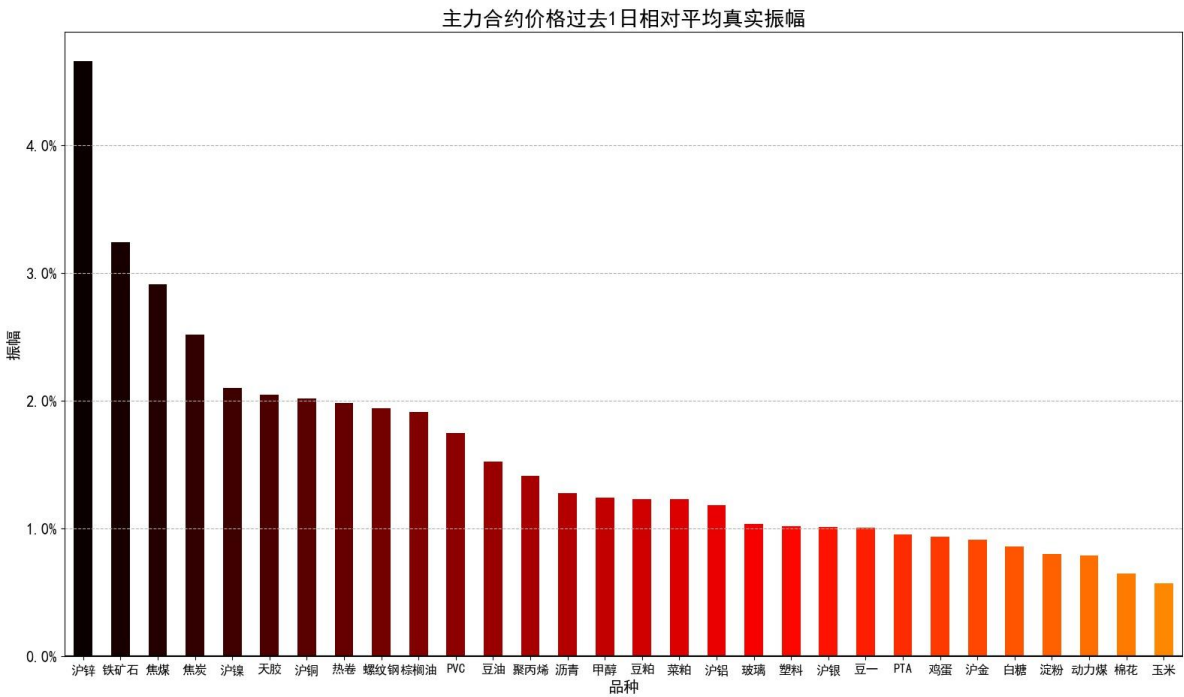
二、品种波动性提示

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:沪锌、铁矿石、焦煤、焦炭、沪镍

相对振幅排名后五位的品种是:玉米、棉花、动力煤、淀粉、白糖



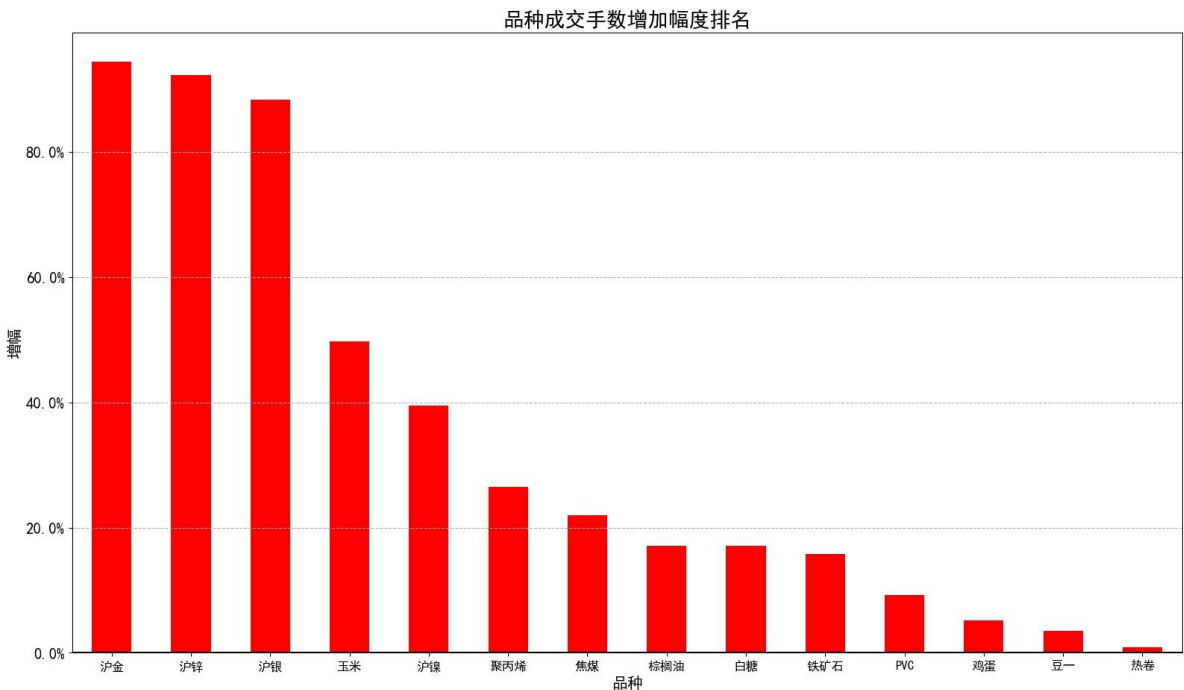
三、品种持仓与成交情况提示

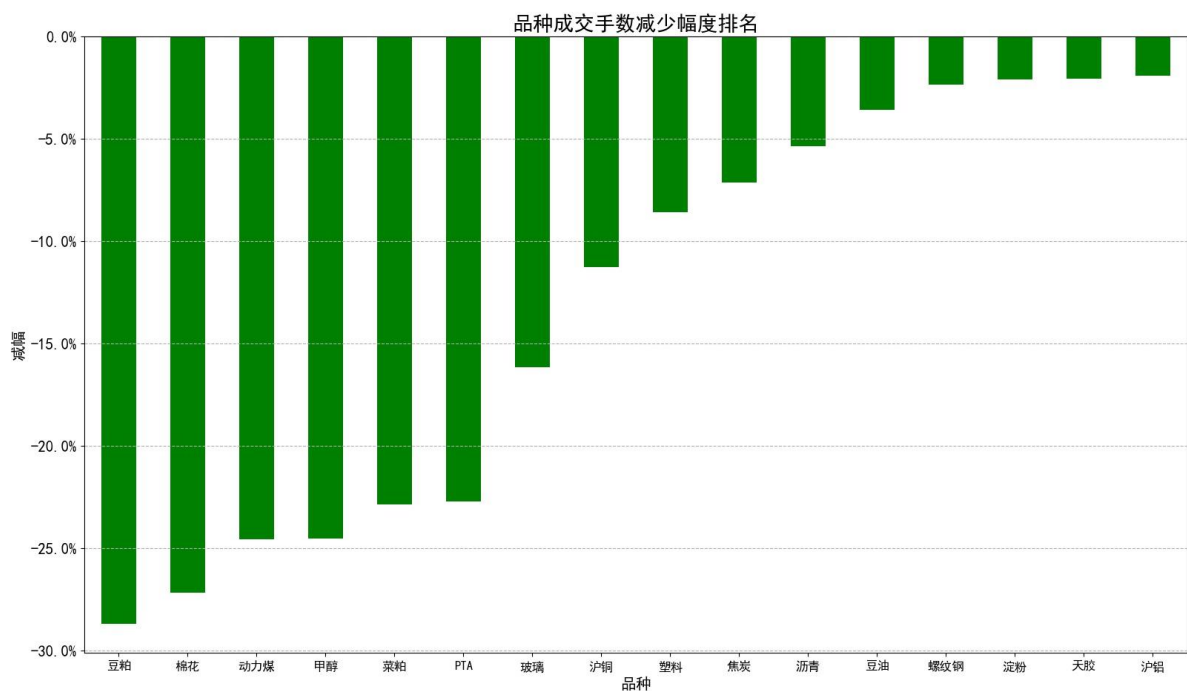
1、品种日成交量变化

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:沪金、沪锌、沪银、玉米、沪镍

日成交手数降低幅度排名前五位的品种为:豆粕、棉花、动力煤、甲醇、菜粕

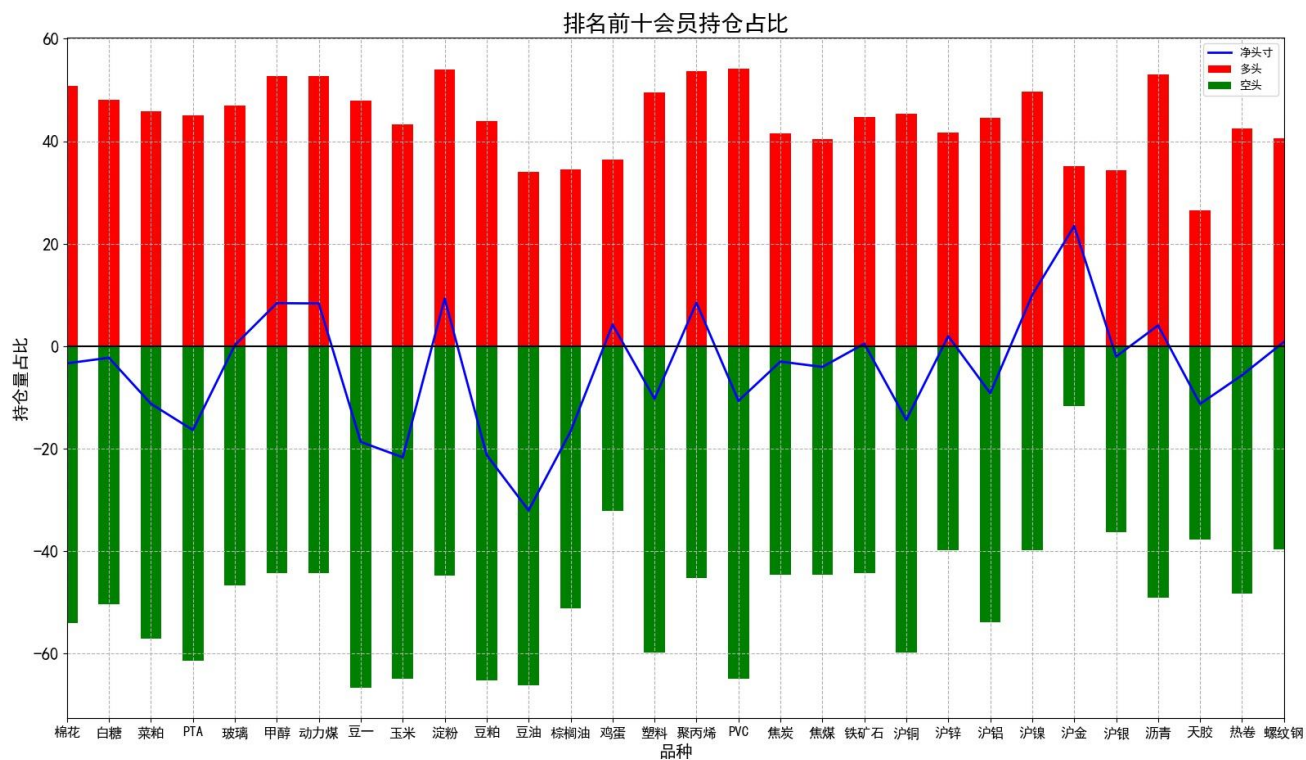




2、持仓排名前十会员持仓占比

(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

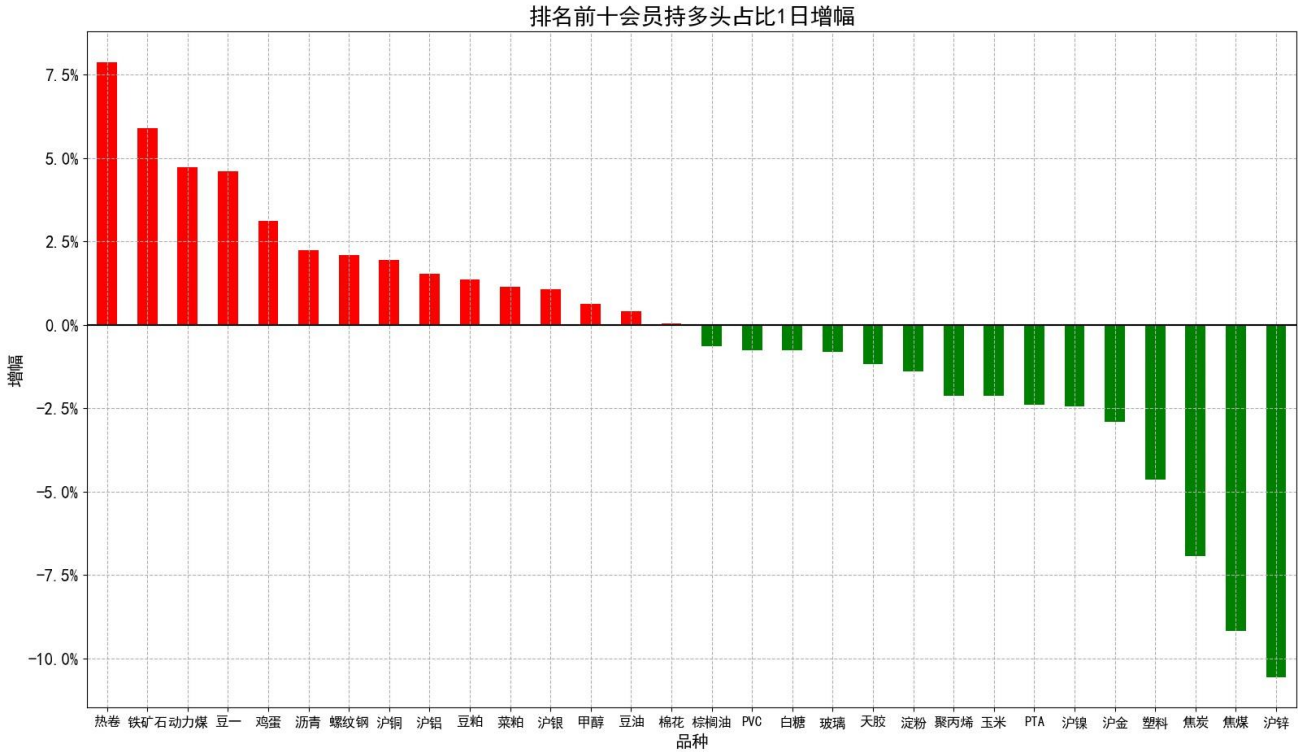
通过计算今日持仓排名前十的多头和空头持仓占比与 1 交易日、5 交易日和 20 交易日前

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：

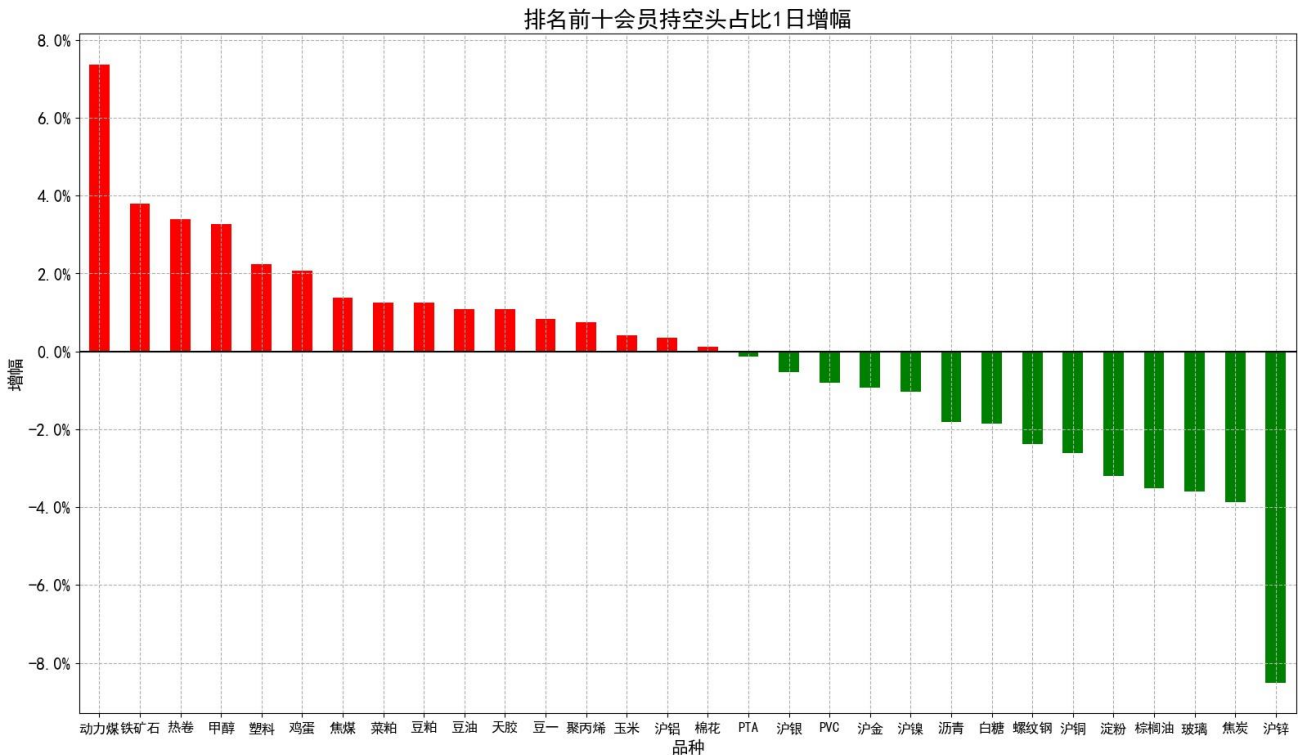
多头占比1日增幅排名前五位的品种是：热卷、铁矿石、动力煤、豆一、鸡蛋

多头占比1日降幅排名前五位的品种是：沪锌、焦煤、焦炭、塑料、沪金



空头占比增幅排名前五位的品种是：动力煤、铁矿石、热卷、甲醇、塑料

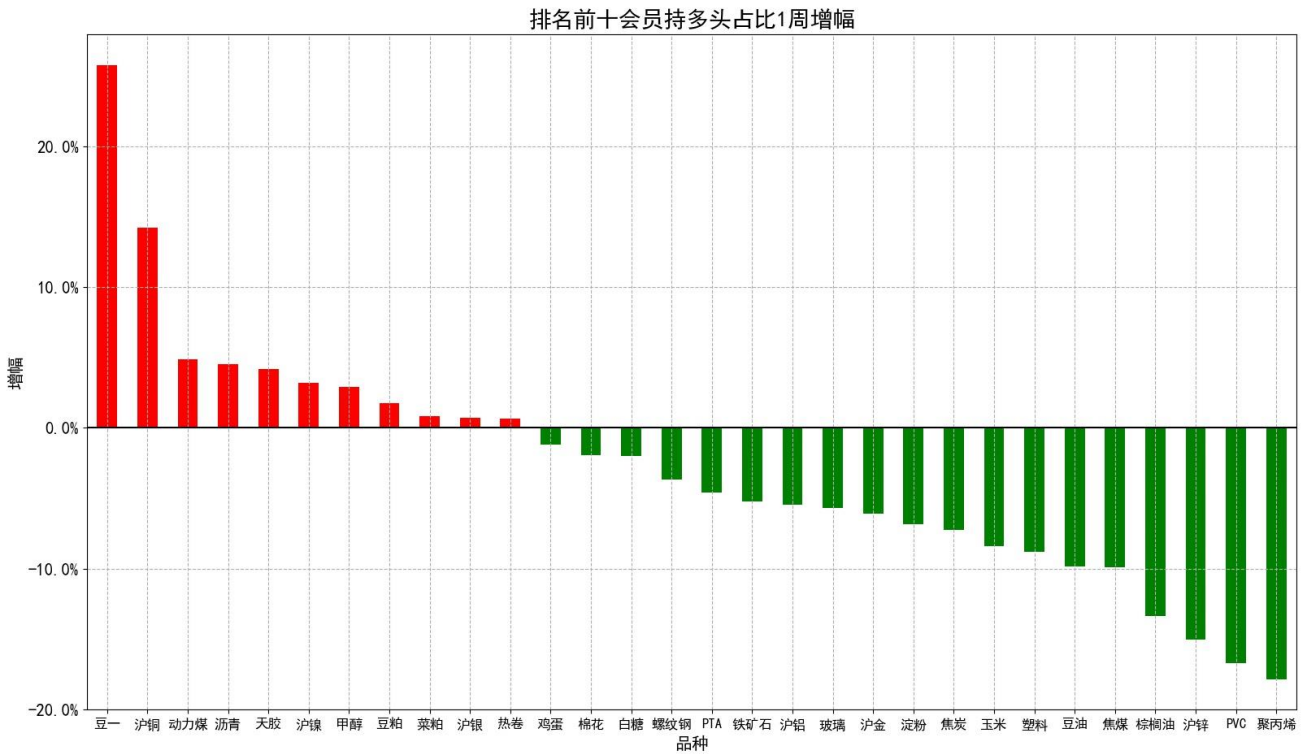
空头占比降幅排名前五位的品种是：沪锌、焦炭、玻璃、棕榈油、淀粉



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：

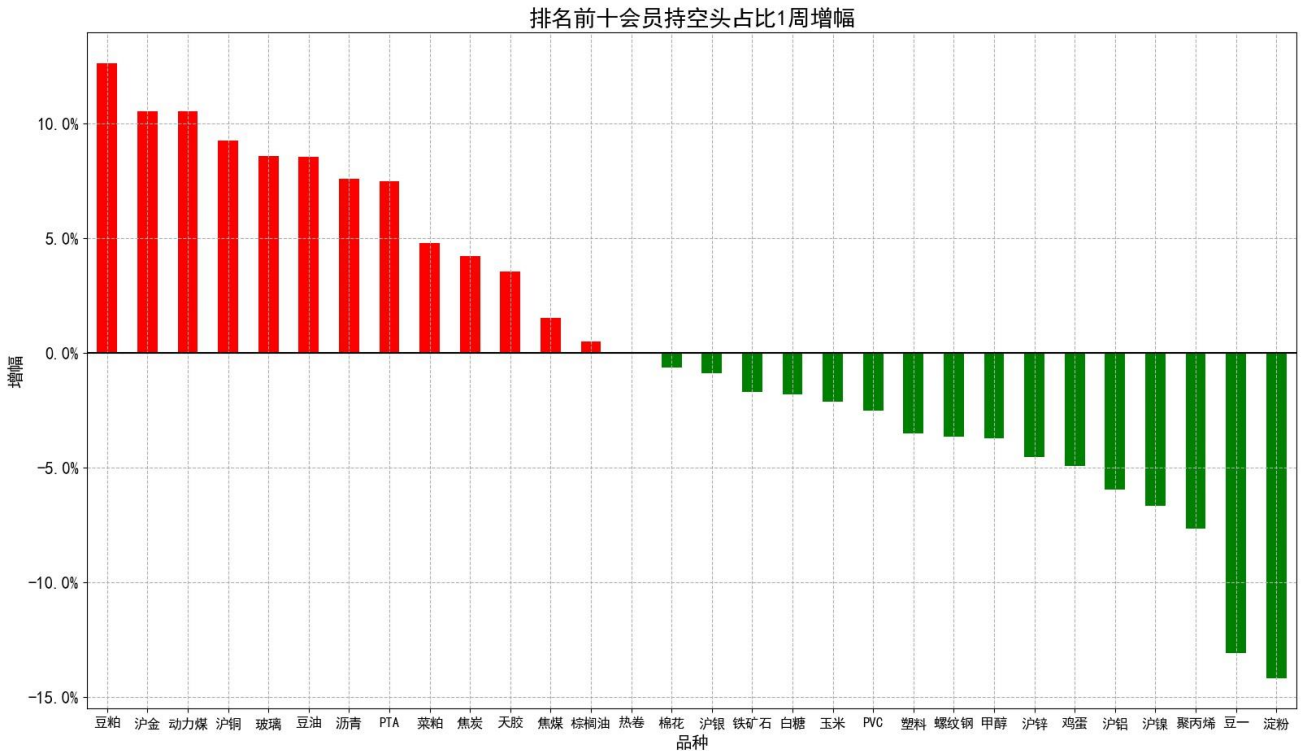
多头占比 1 周增幅排名前五位的品种是：豆一、沪铜、动力煤、沥青、天胶

多头占比 1 周降幅排名前五位的品种是：聚丙烯、PVC、沪锌、棕榈油、焦煤



空头占比 1 周增幅排名前五位的品种是：豆粕、沪金、动力煤、沪铜、玻璃

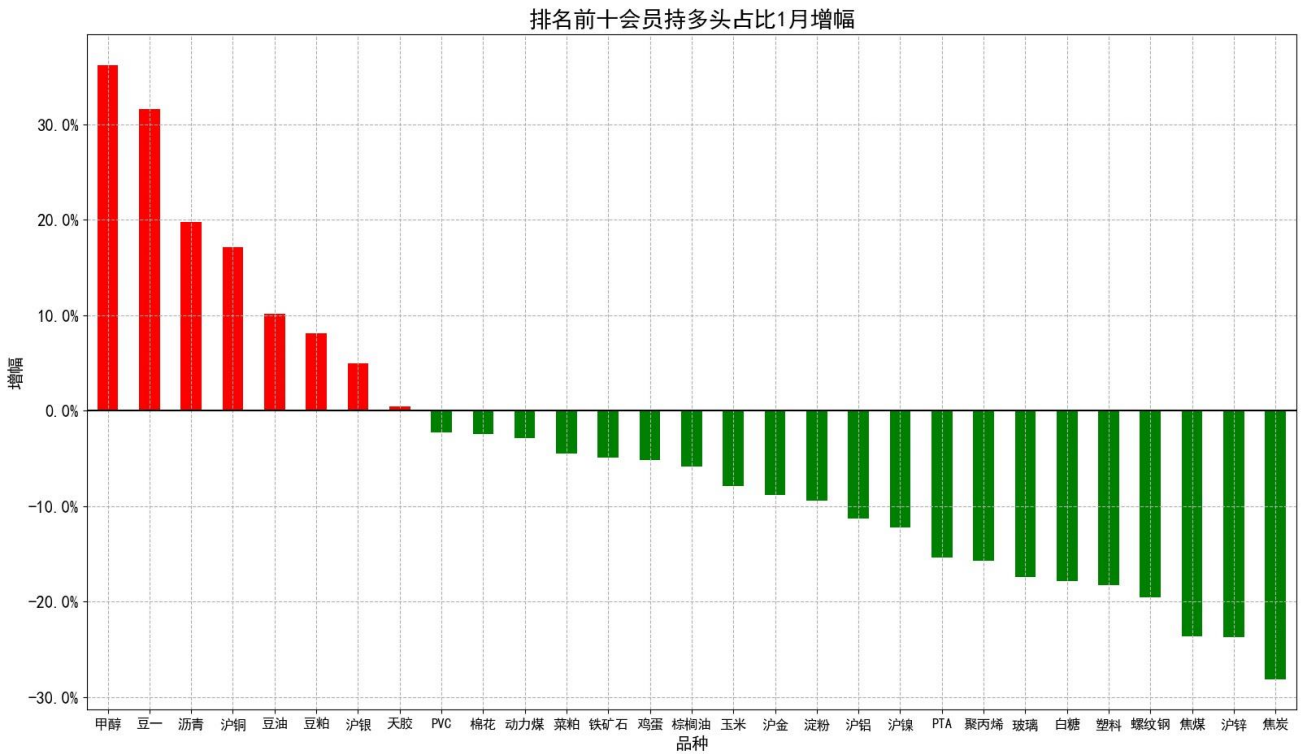
空头占比 1 周降幅排名前五位的品种是：淀粉、豆一、聚丙烯、沪镍、沪铝



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：

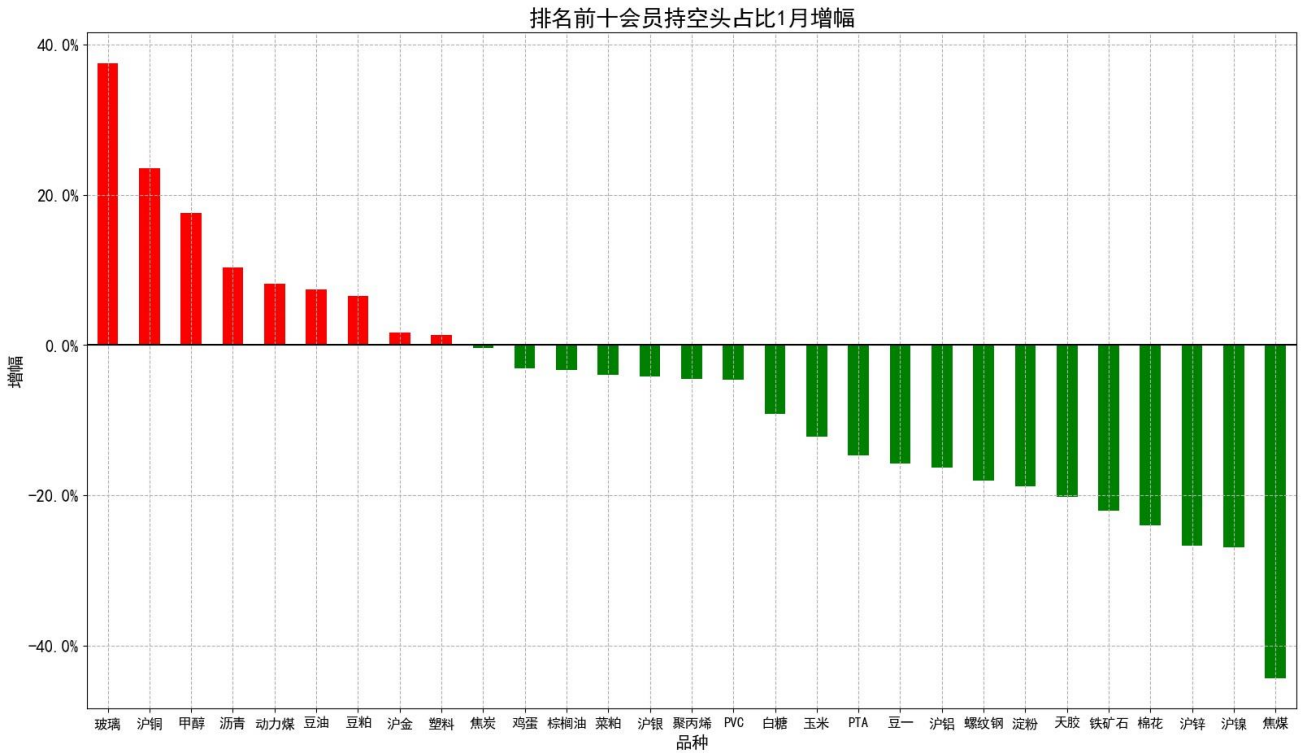
多头占比 1 月增幅排名前五位的品种是：甲醇、豆一、沥青、沪铜、豆油

多头占比 1 月降幅排名前五位的品种是：焦炭、沪锌、焦煤、螺纹钢、塑料



空头占比 1 月增幅排名前五位的品种是：玻璃、沪铜、甲醇、沥青、动力煤

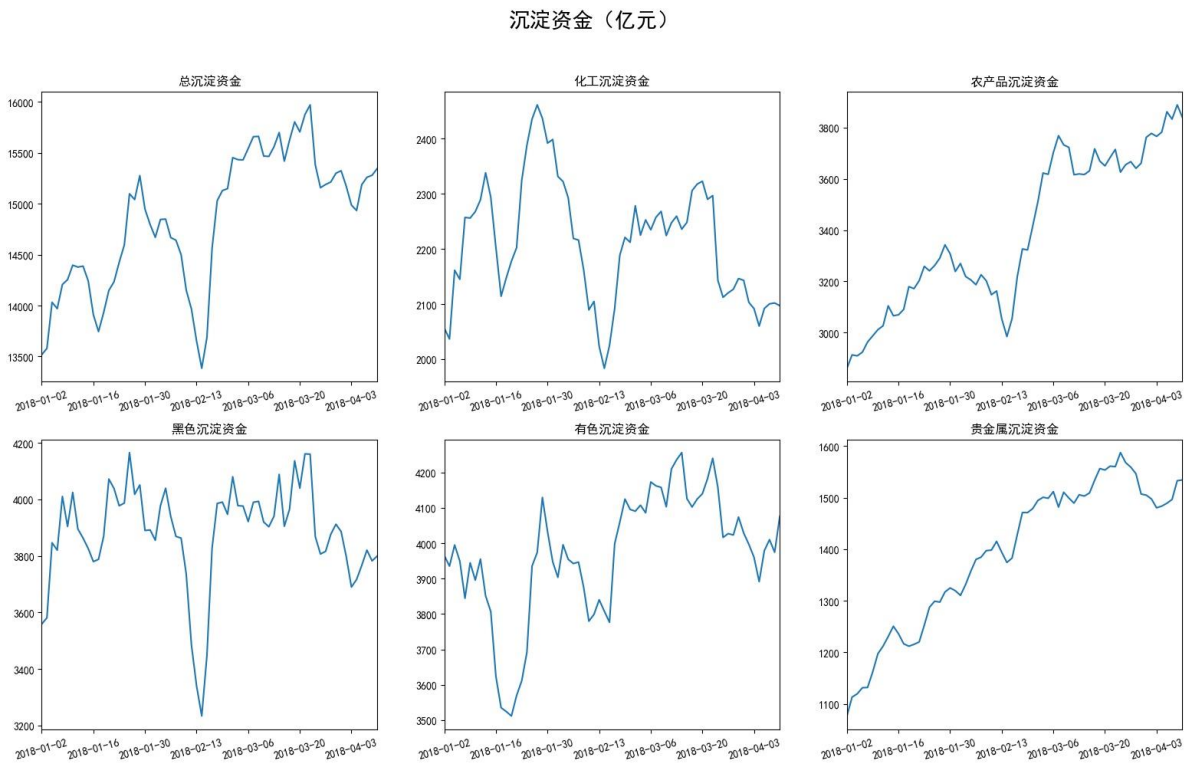
空头占比 1 月降幅排名前五位的品种是：焦煤、沪镍、沪锌、棉花、铁矿石



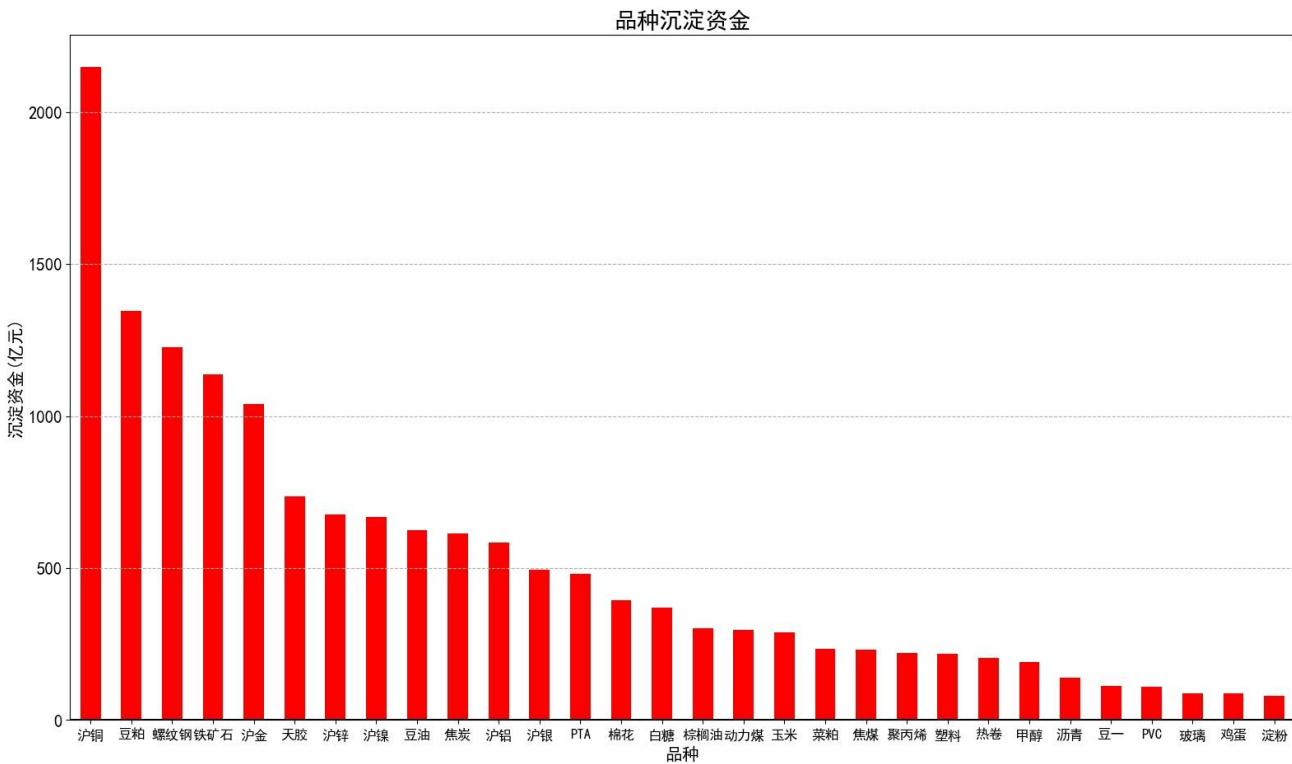
四、品种资金提示

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

