

2018-03-29 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

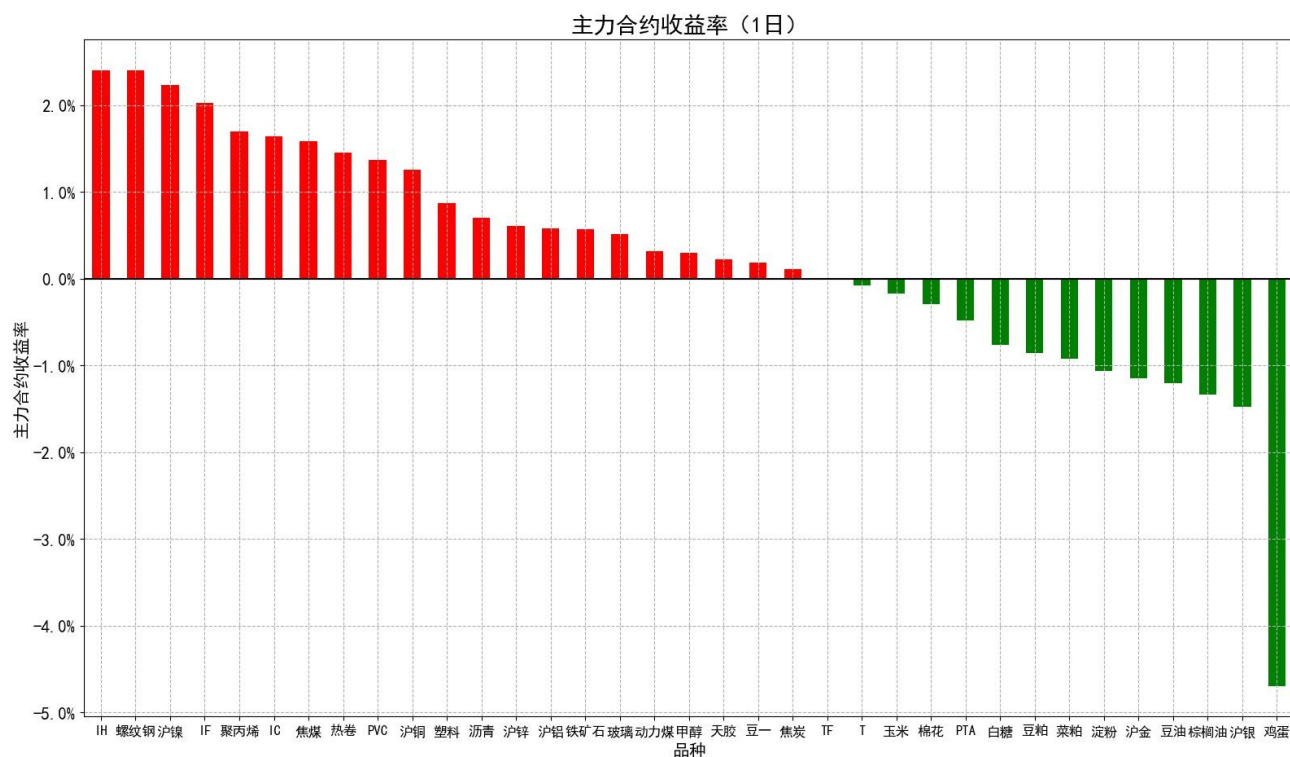
1周收益率 = (今日主力合约收盘价 / 5个交易日前同一合约收盘价) - 1

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

排名前三位的品种是：IH、螺纹钢、沪镍

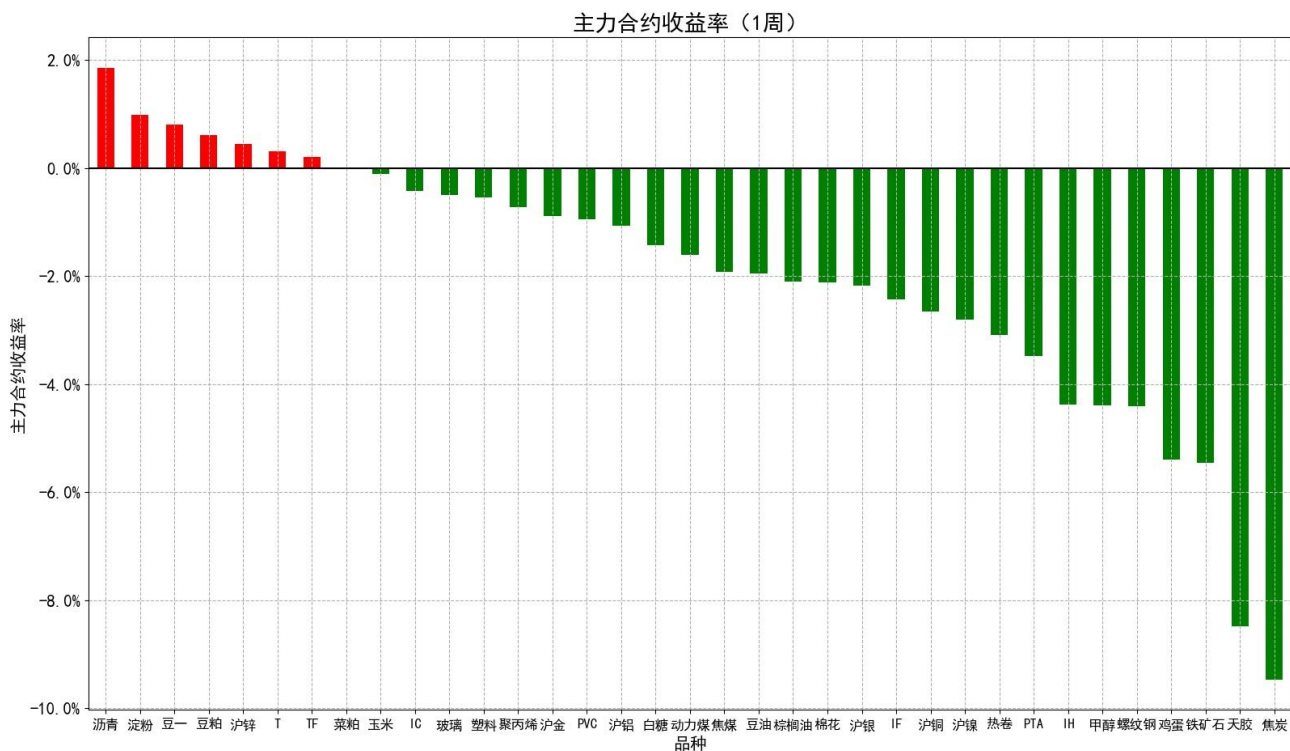
排名后三位的品种是：鸡蛋、沪银、棕榈油



(2) 1周收益

排名前三位的品种是：沥青、淀粉、豆一；

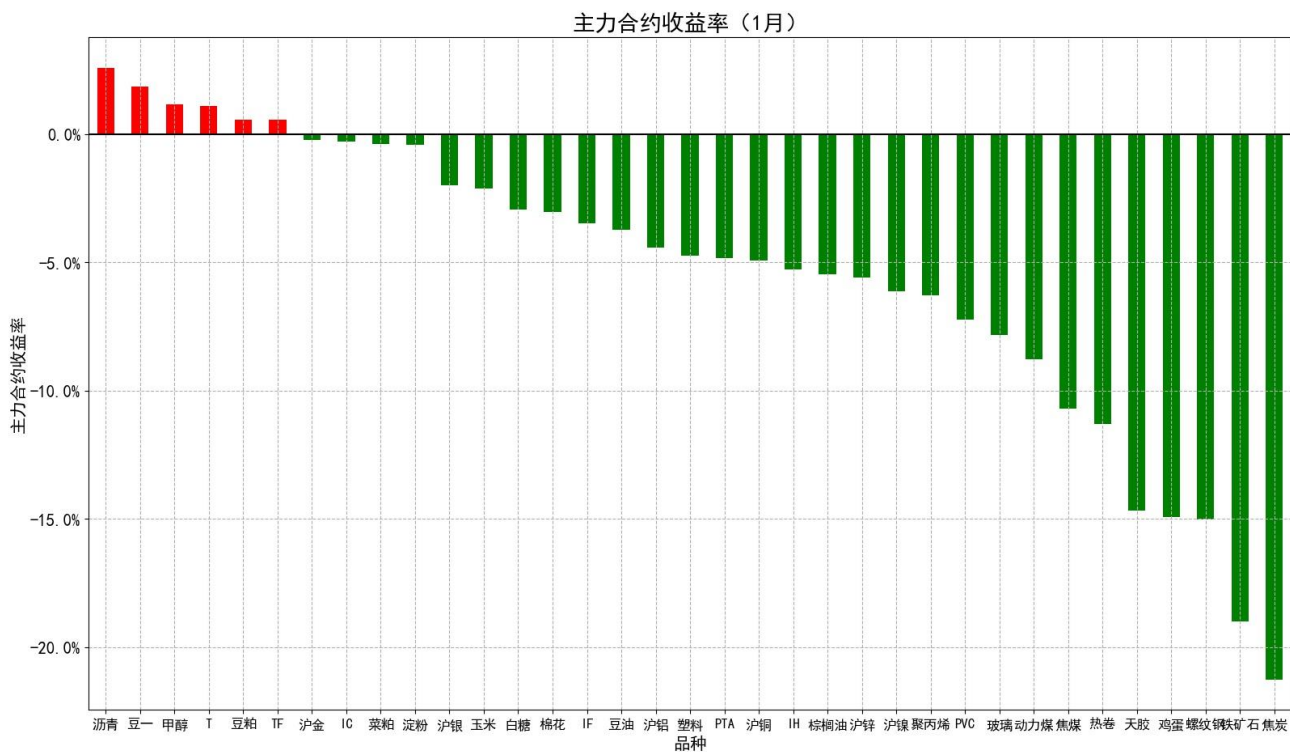
排名后三位的品种是：焦炭、天胶、铁矿石



(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



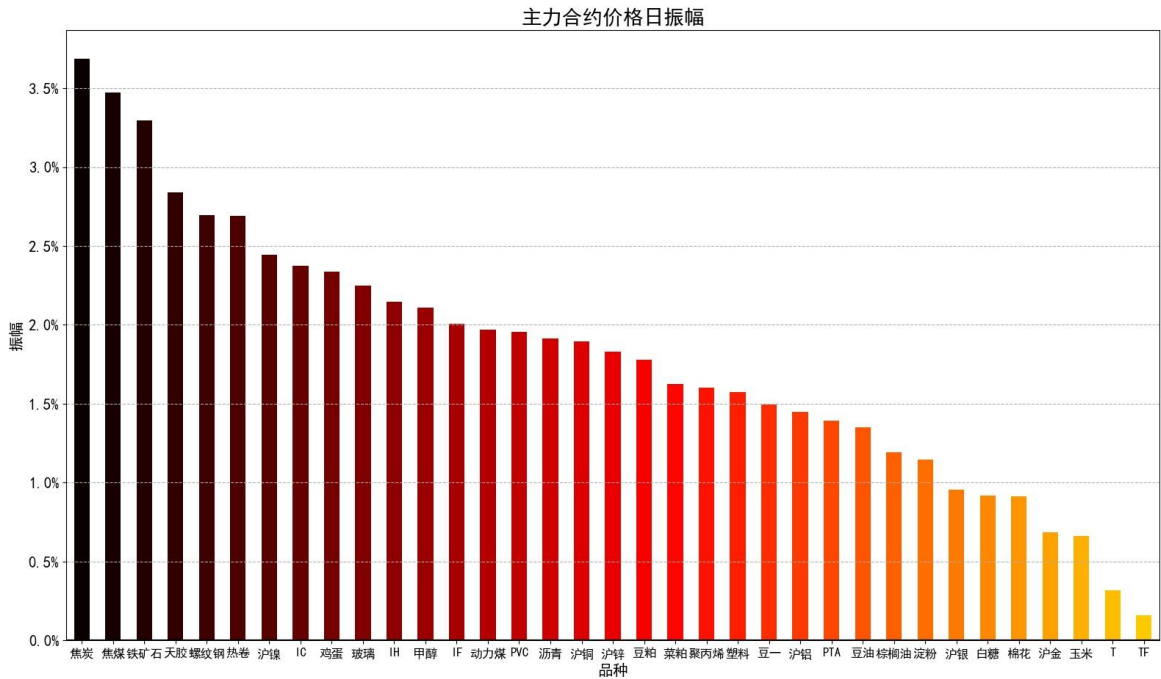
二、品种波动性提示

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



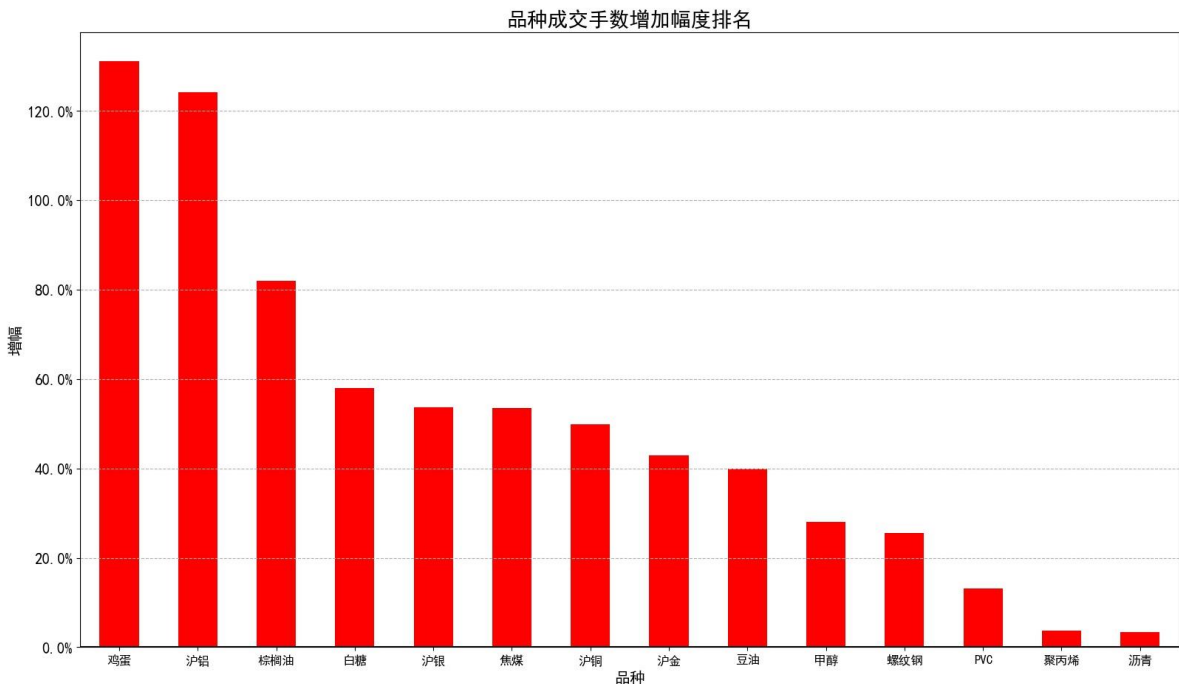
三、品种持仓与成交情况提示

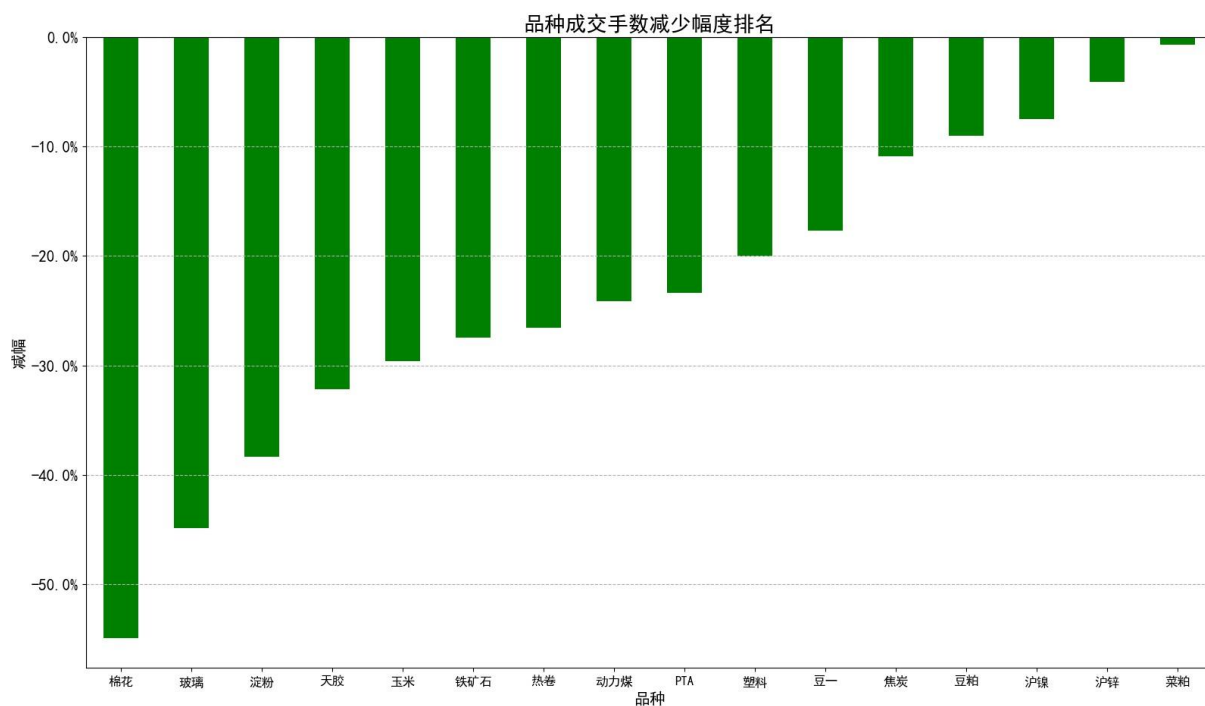
1、品种日成交量变化

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

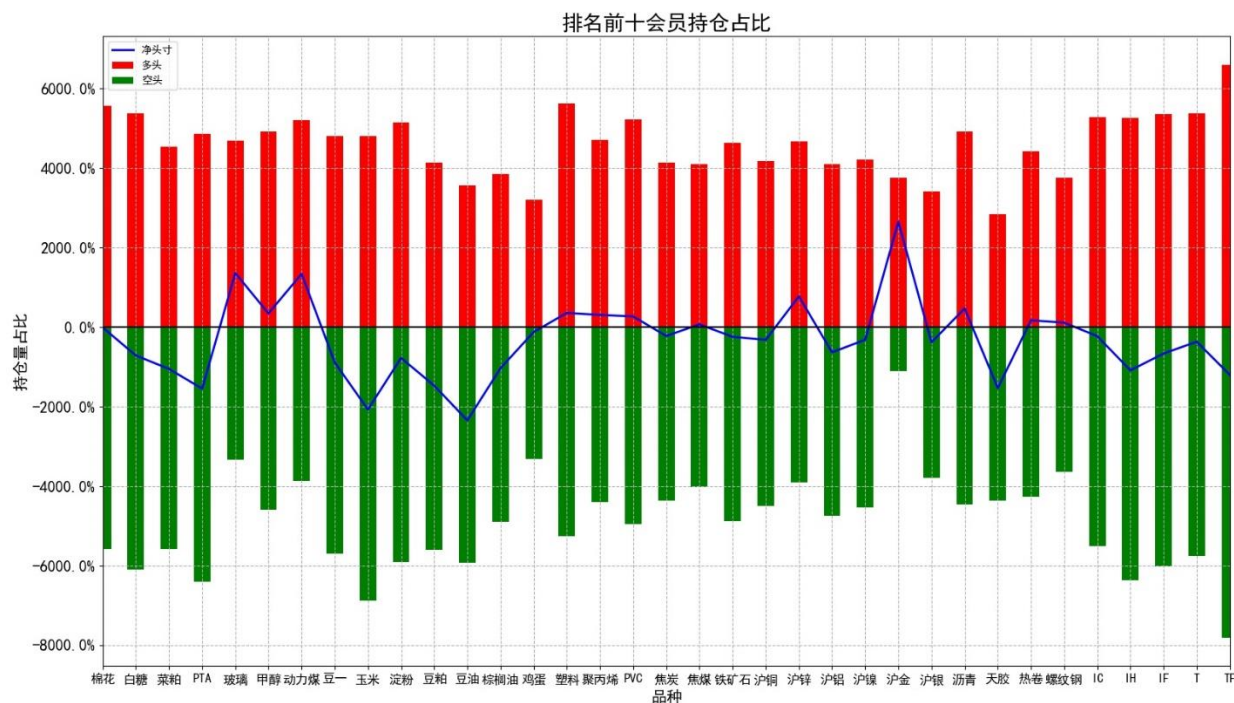




2、持仓排名前十会员持仓占比

(1) 今日持仓排名前十会员持仓占比情况

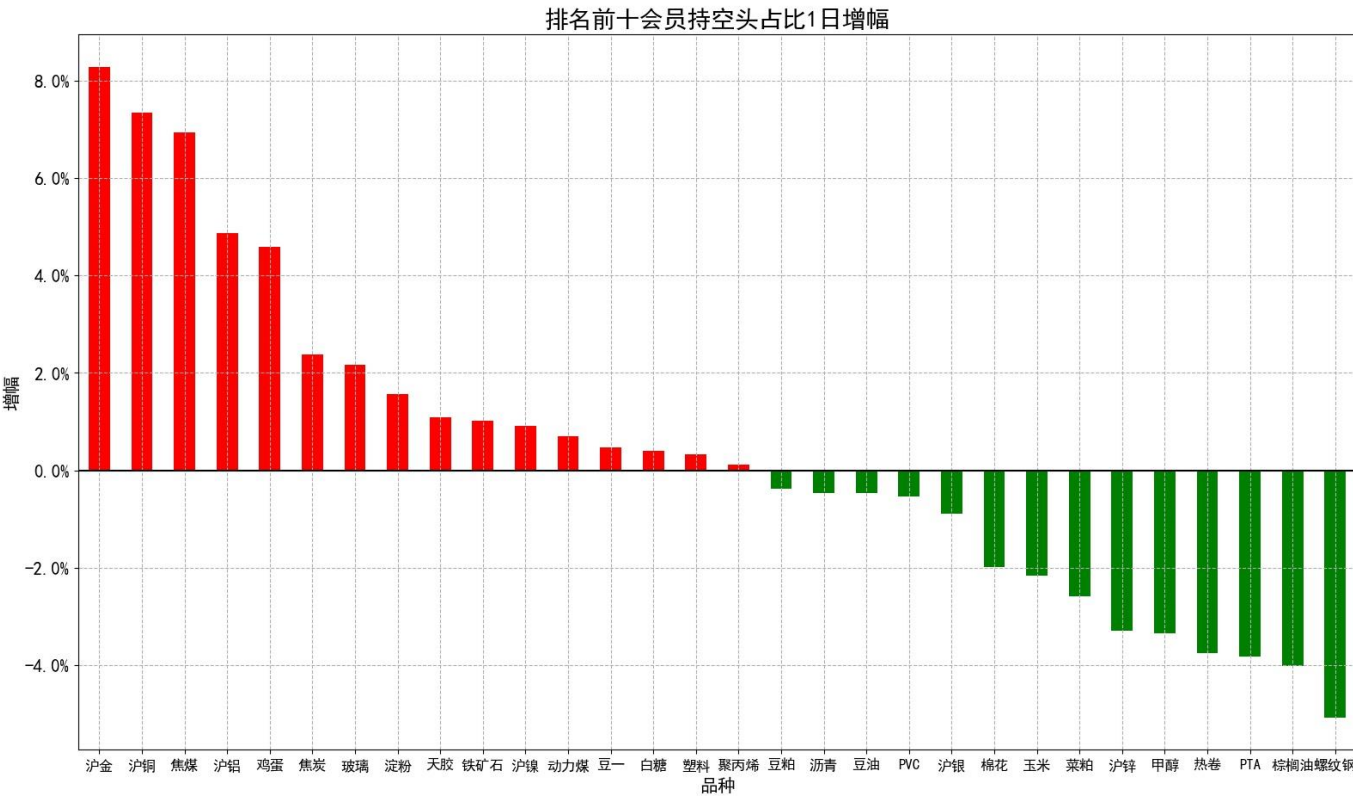
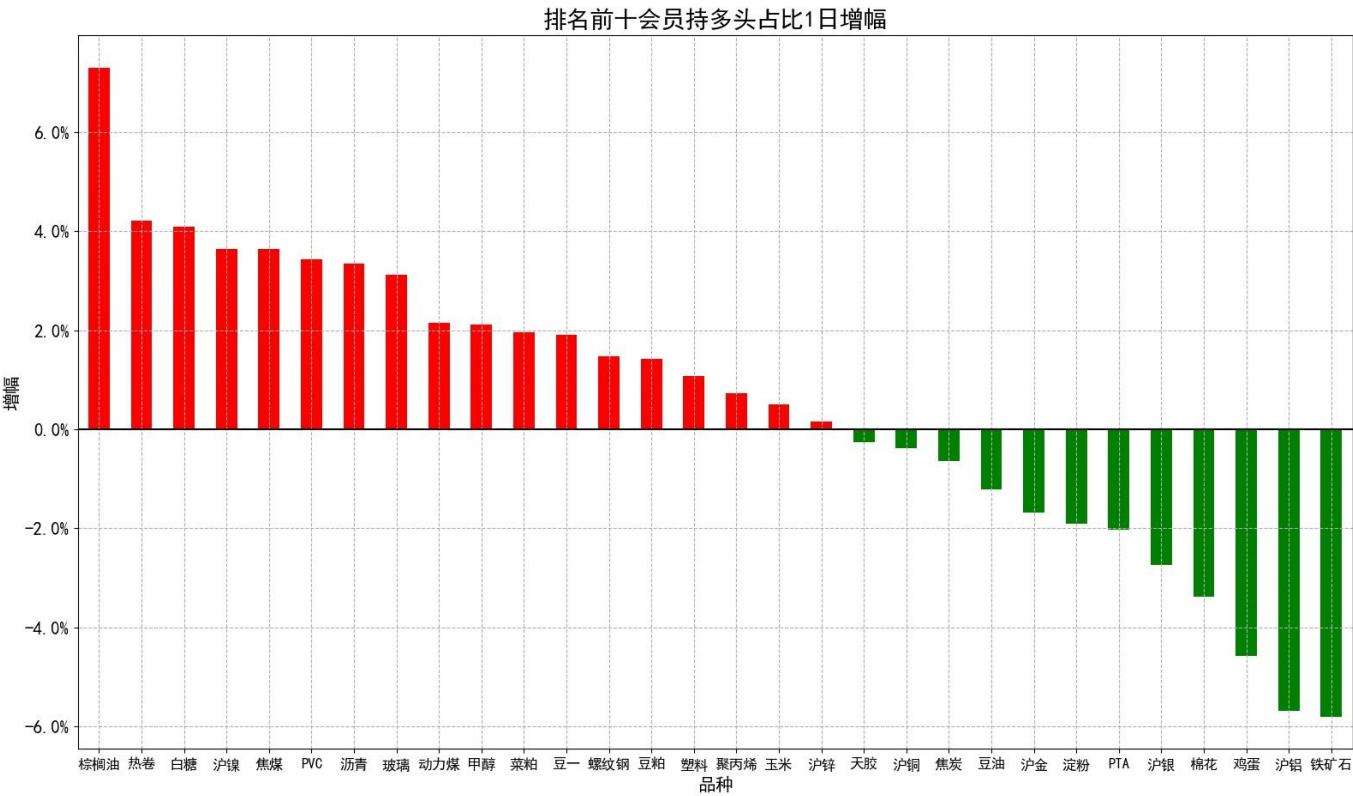
通过统计各品种持仓排名表中排名前十会员的多头、空头及净头寸占合约总持仓量的比例，表征品种交易的集中程度。



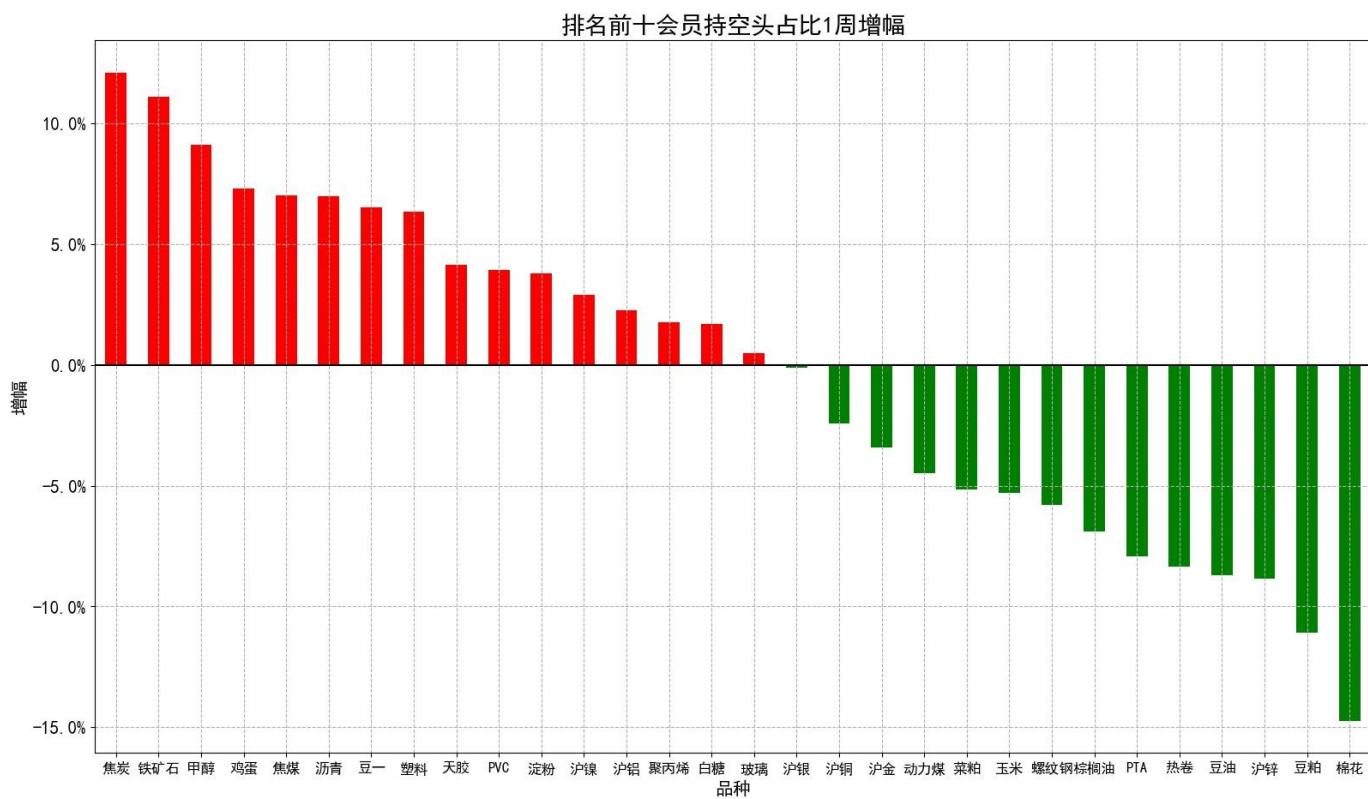
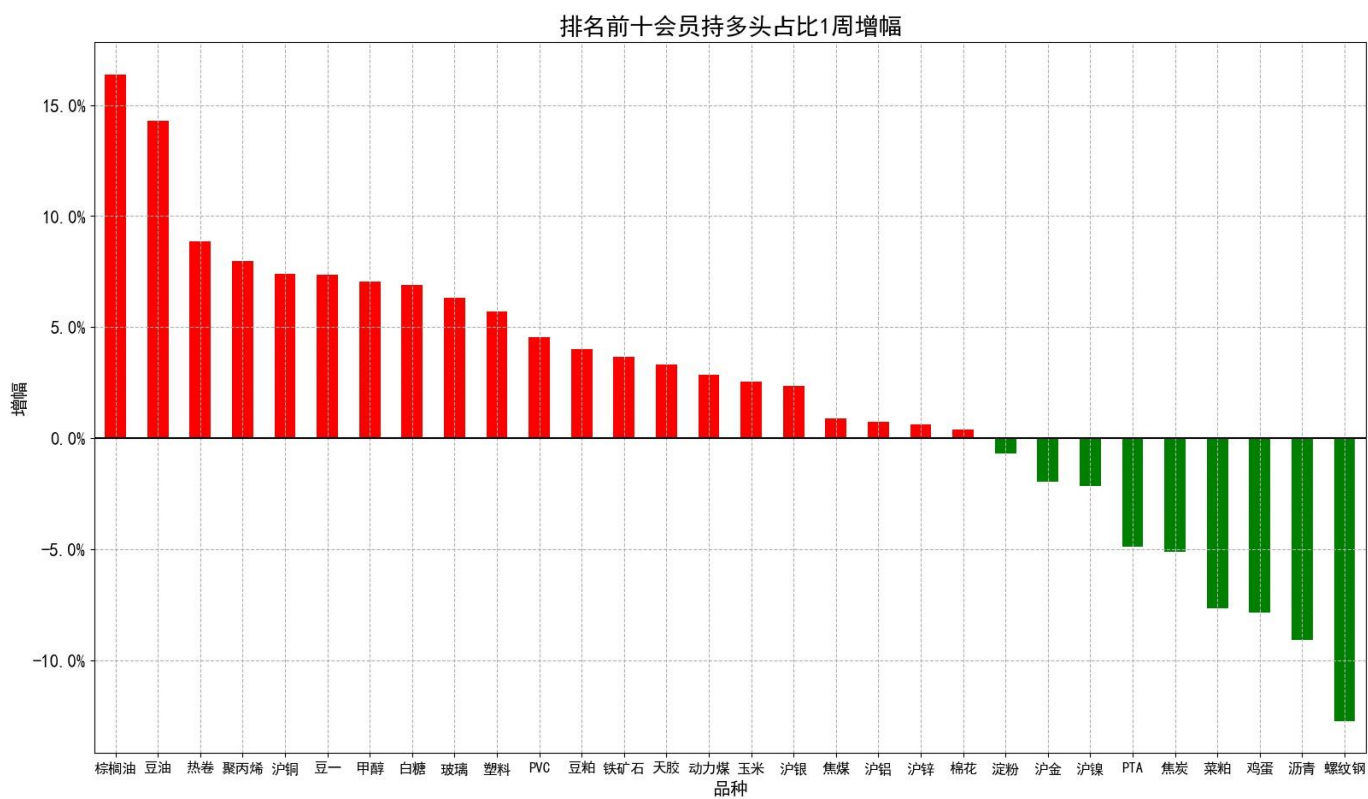
(2) 近期持仓占比排名

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。

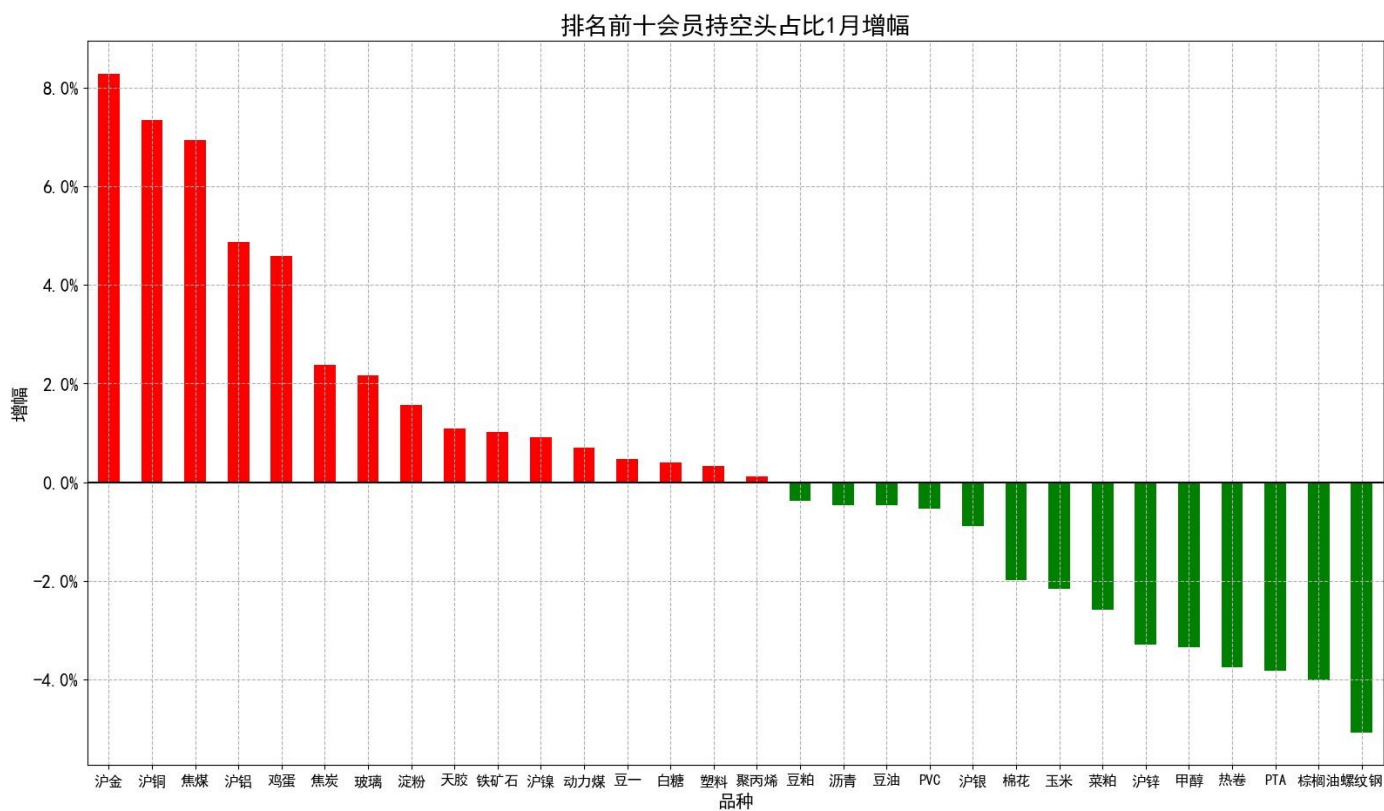
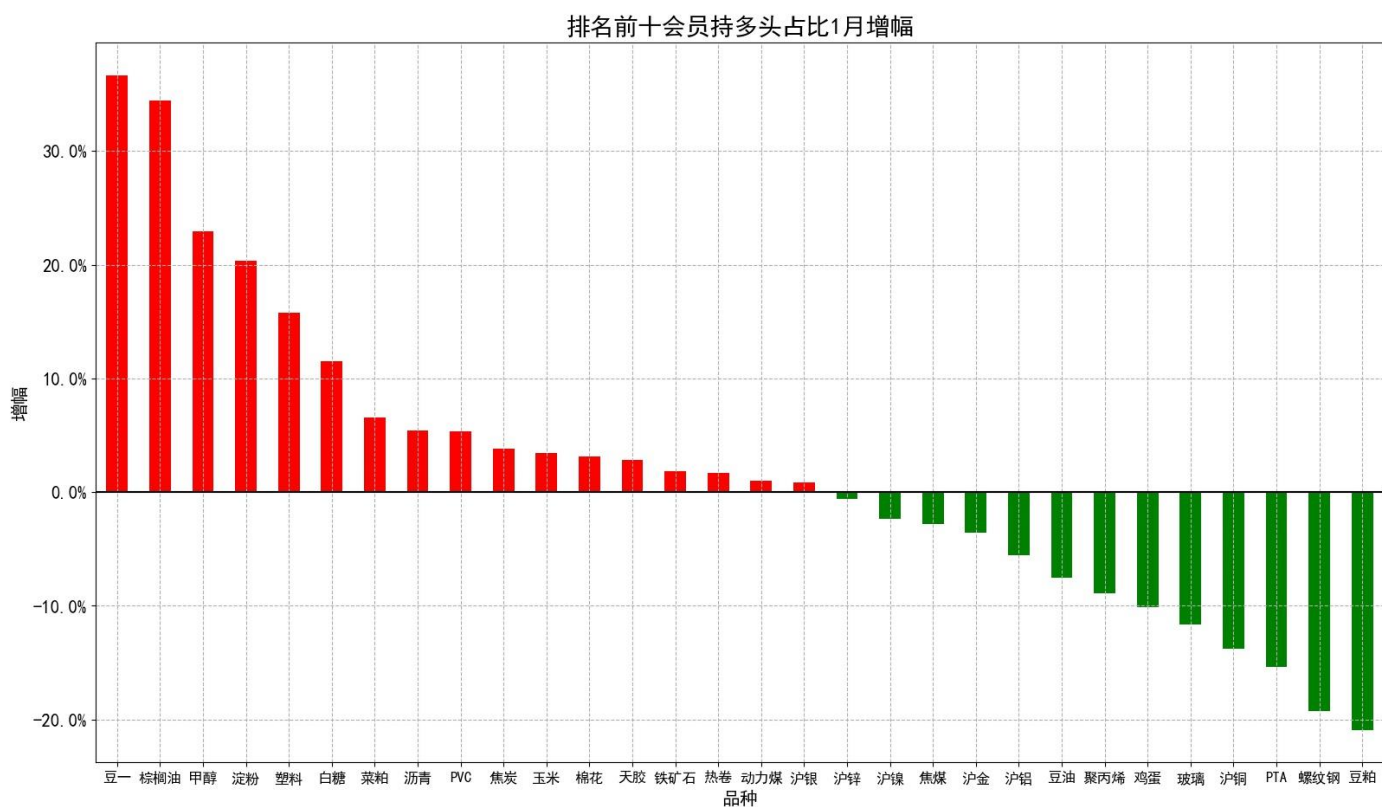
1 日排名前十会员多头持仓占比和空头持仓占比变化情况：



1 周排名前十会员多头持仓占比和空头持仓占比变化情况：



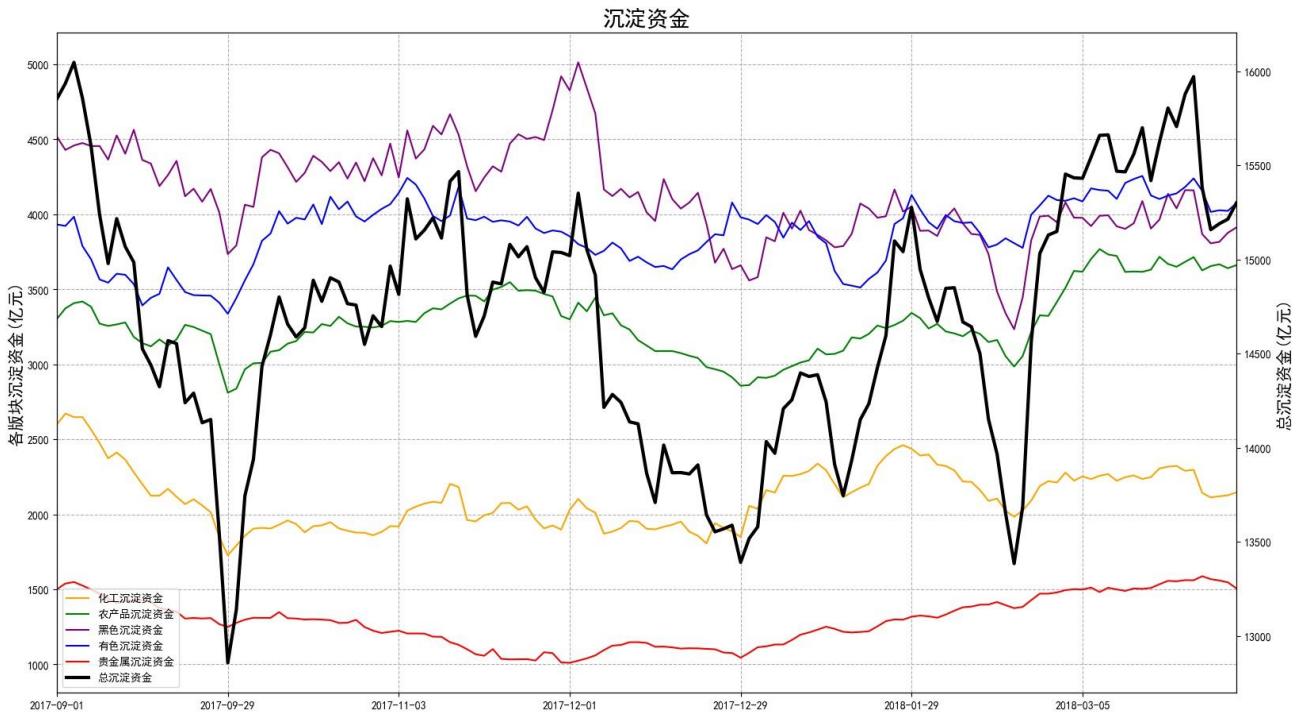
1月排名前十会员多头持仓占比和空头持仓占比变化情况：



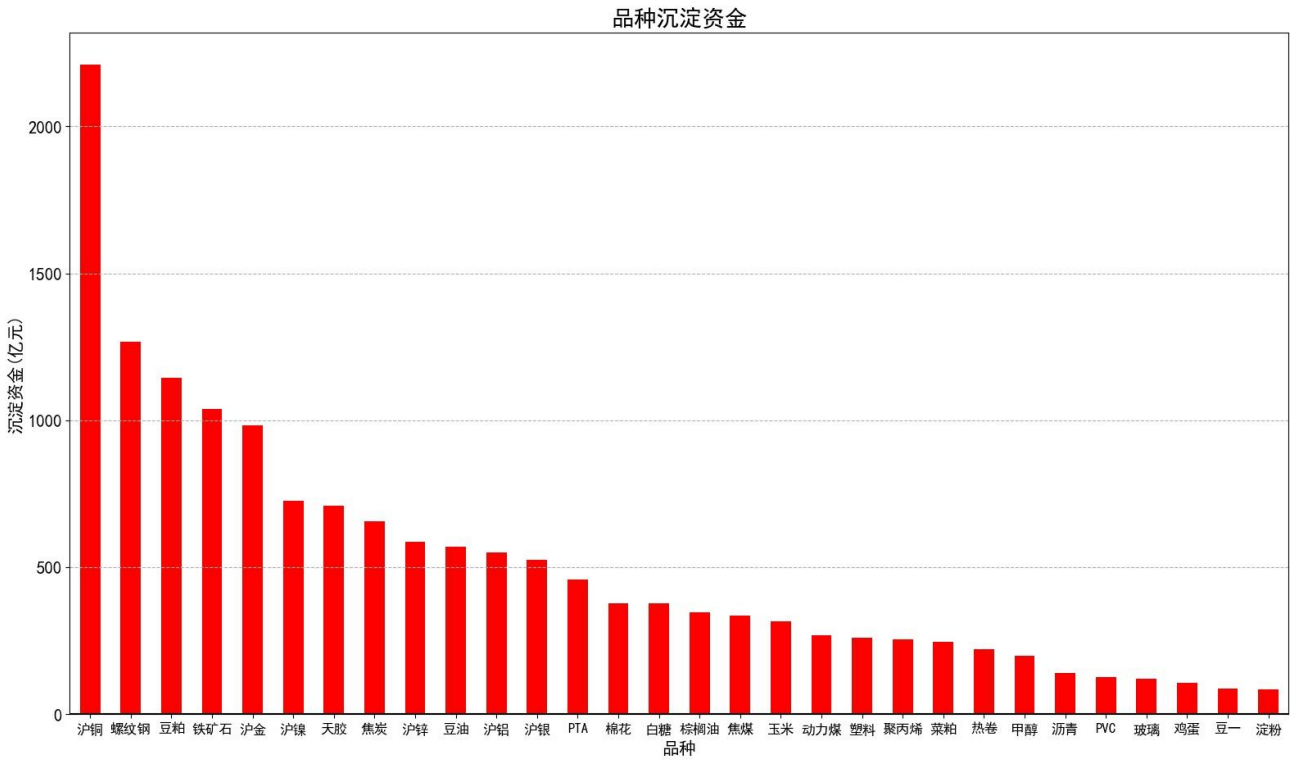
四、品种资金提示

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

