

研发部

庄成锴

0592-5831692

zhuangck@itf.com.cn

## 【量化日报】

### 一、每日品种观察

本版块综合每日基本面、技术面、数据统计等多方信息，描述存在明显异常或有较好交易机会的品种。当无品种存在明显异常或有较好交易机会，该板块可能空缺。

**本日精选：** 原油

**行情观察与建议：** 节日期间原油收出多根阴线，前期反弹已结束。建议前期入场抢原油反弹的化工品多单离场。

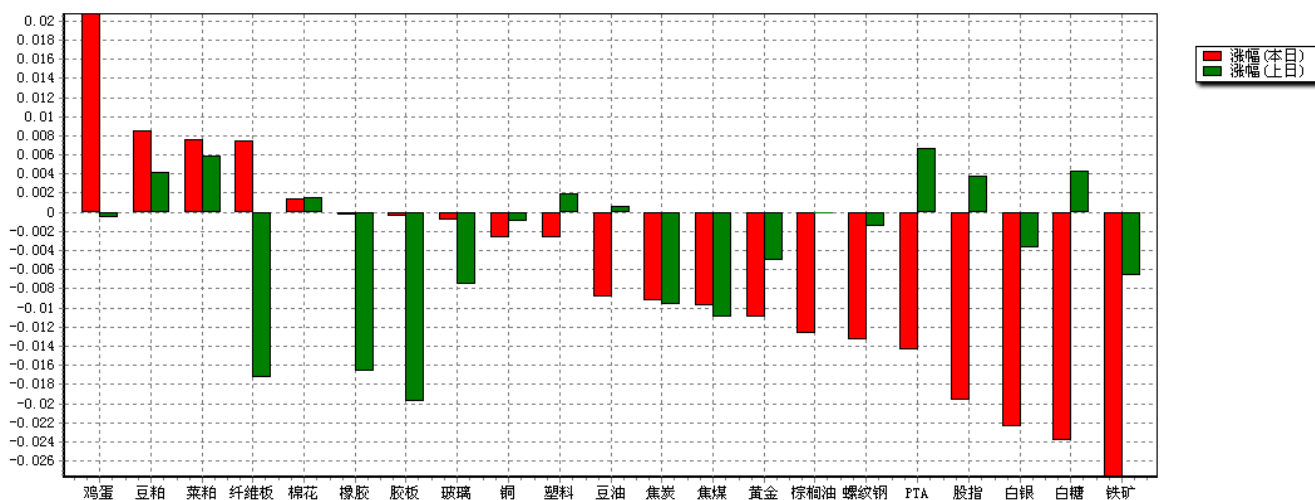
### 二、每日市场概览

#### 1. 多空方向

##### 1) 涨幅

**用法：** 数值为正且绝对值越大的品种涨势越强，数值为负且绝对值越大的品种跌势越强。

图一：各品种涨幅



数据来源：天软科技，国贸期货整理

## 2) 新高与新低

用法：创新高品种宜多不宜空，创新低品种宜空不宜多。

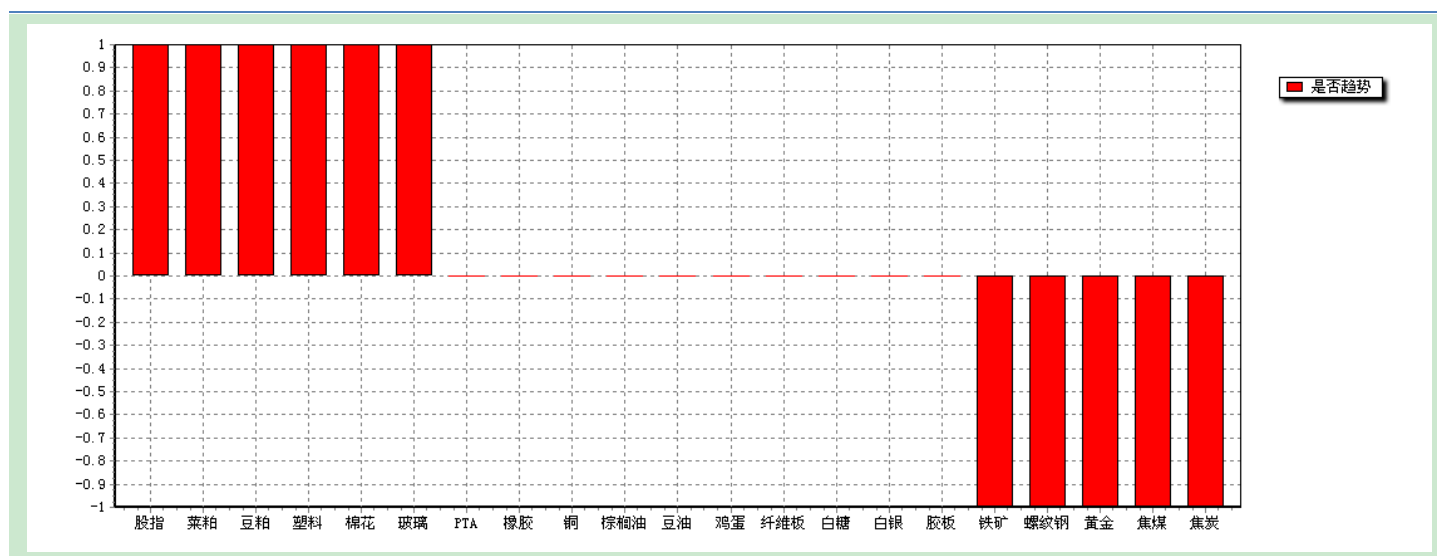
创 5 日新高：豆粕、菜粕、鸡蛋

创 5 日新低：焦煤、焦炭、白糖、黄金

## 3) 趋势性

用法：值为 1（-1）的品种上升（下降）趋势较为明显，走势较为顺畅。  
值为 0 的品种趋势较不清晰，走势较为反复。

图二：各品种趋势性

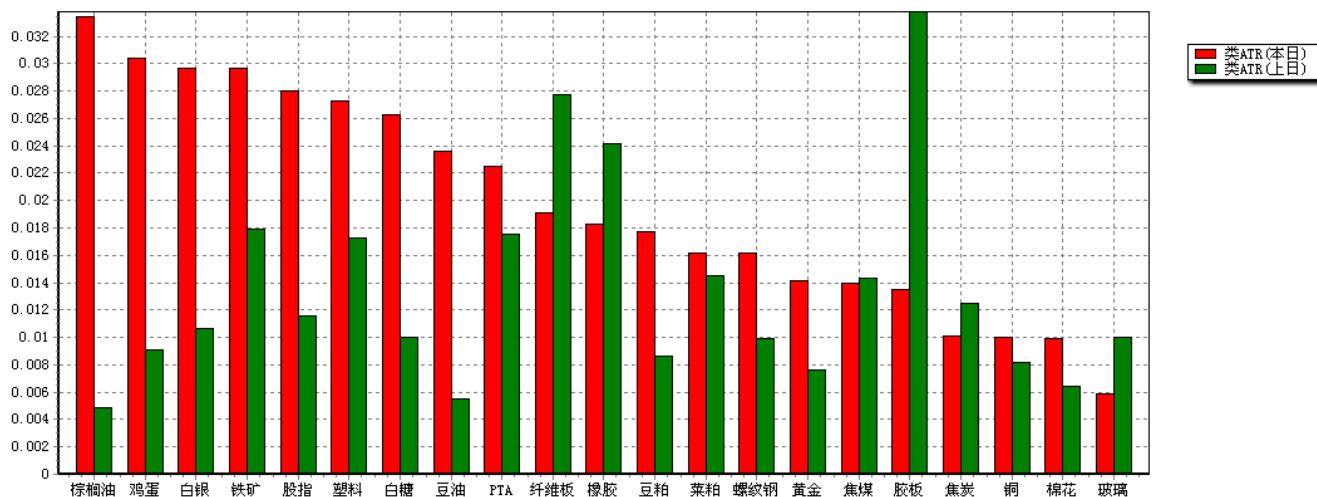


数据来源：天软科技，国贸期货整理

## 2. 震幅值

用法：投机品种须在数值较大的品种中选择，数值排名靠后的品种不推荐投机。

图三：各品种震幅值

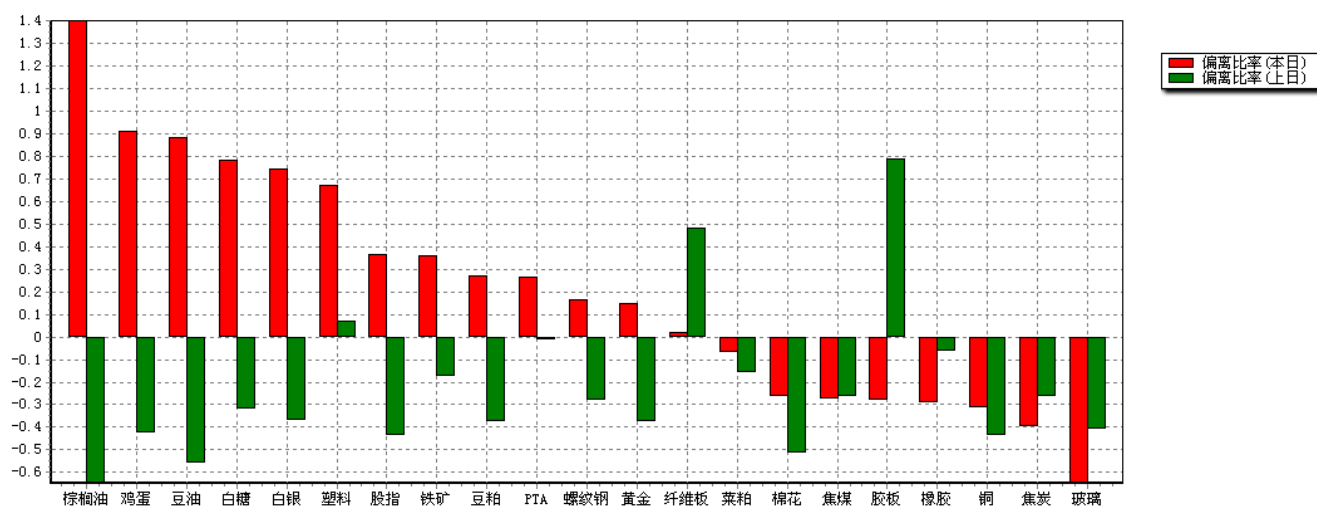


数据来源：天软科技，国贸期货整理

## 3. 震幅偏离值

用法：数值极大或极小的品种波动异常，值得关注。

图四：震幅偏离值

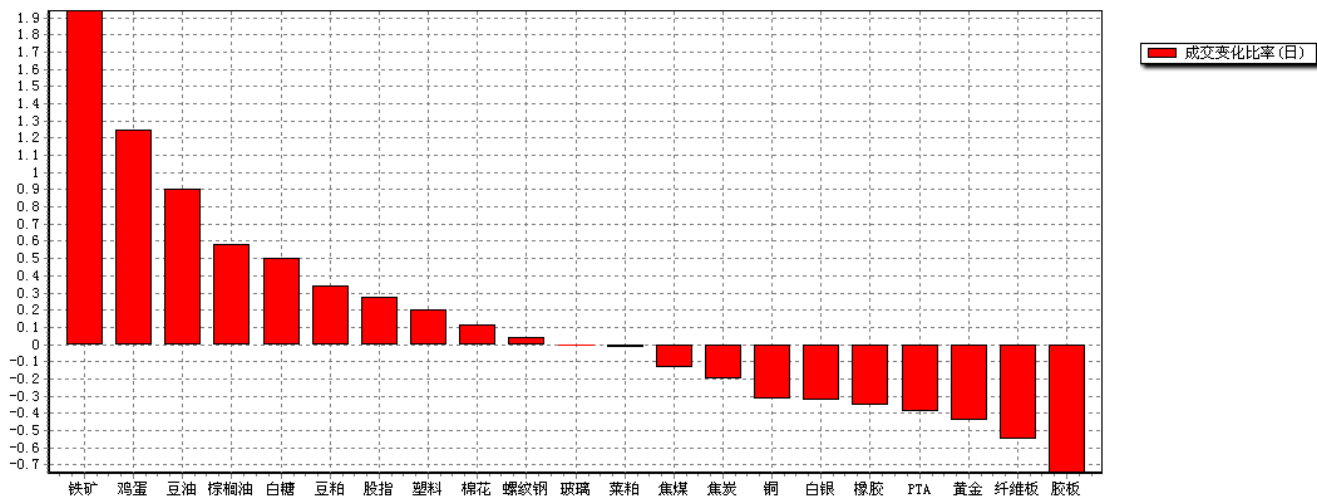


数据来源：天软科技，国贸期货整理

#### 4. 成交手数变化

用法：数值较大的品种成交活跃度上升较快，值得关注。

图五：成交手数变化

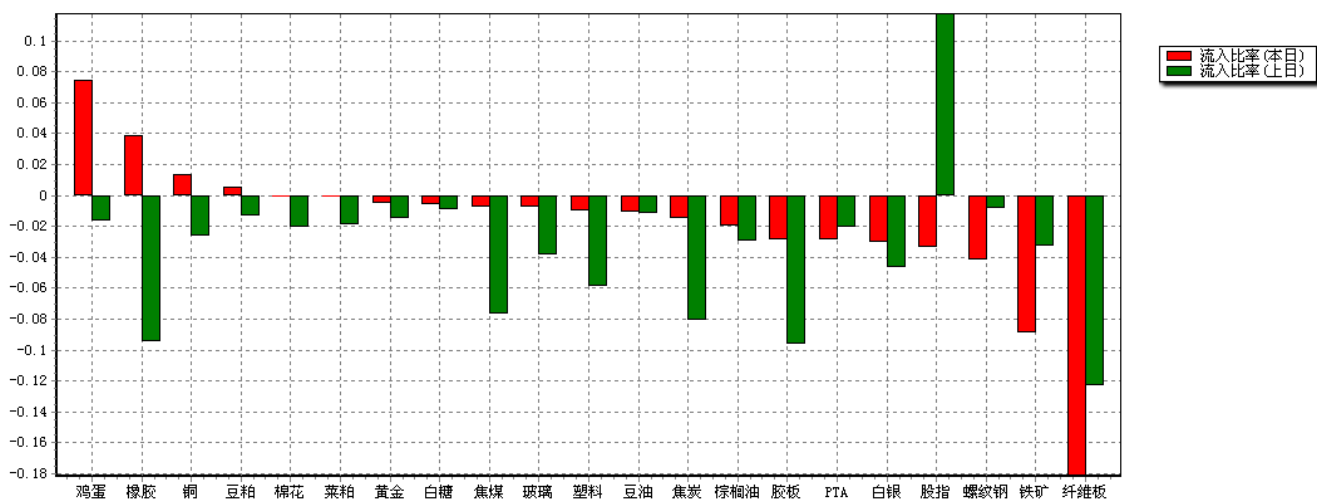


数据来源：天软科技，国贸期货整理

#### 5. 资金流入

用法：数值为正且绝对值越大的品种资金流入越明显，数值为负且绝对值越大资金流出越明显。

图六：各品种流入比率



数据来源：天软科技，国贸期货整理

### 期货实盘群服务:



### 研究员简介:

庄成错，国贸期货研发中心量化研究员，厦门大学王亚南经济研究院金融学硕士，厦门大学数学与应用数学学士。曾以交易员的身份，参与2013年大商所十大研发团队比赛，获工业品组全国第一名。对技术面有深入研究，多年实盘经验，能实现较稳健的获利，善于结合投资者自身情况设计可执行操作计划；同时，还负责期货相关数据的提取、统计与数据挖掘，撰写量化报告、开发策略并实现程序化交易。

### 免责声明:

本报告中的信息均来源于公开可获得资料，国贸期货研发部力求准确可靠，但对这些信息的准确性及完整性不做任何保证，据此投资，责任自负。本报告不构成个人投资建议，也没有考虑到个别客户特殊的投资目标、财务状况或需要。客户应考虑本报告中的任何意见或建议是否符合其特定状况。本报告仅向特定客户传送，未经国贸期货研发部授权许可，任何引用、转载以及向第三方传的行为均可能承担法律责任。

### 联系我们:

电话: 400-888-8598, 0592-5898894

地址: 厦门市湖滨南路国贸大厦 11 层

网址: [www.itf.com.cn](http://www.itf.com.cn)