

2020年9月16日

中银期货研究部

姓名：顾劲涛
 投资咨询号：Z0000552
 联系电话：021-61088053

中银期货量化统计日报

摘要

成交和持仓	成交额最大	IF 9.69%	I 9.65%	AG 8.45%		
	持仓额最大	AU 10.00%	IF 9.21%	IC 9.07%		
成交和持仓资金变动	成交额增长最大	SR 116.72%	SC 91.86%			
	持仓额增长最大	J 6.44%				
波动性	日内波动最大	I 4.90%	SC 3.88%	BU 2.95%	M 2.71%	J 2.58%
	涨幅最大 (相对开盘价)	SC 2.46%	L 0.95%			
	跌幅最大 (相对开盘价)	I -3.80%	J -2.07%			
板块成交额	增长最大	软商品 41.47%	油脂油料 32.47%	有色金属 14.63%		
	减少最大	谷物 -30.20%	股指 -17.74%	国债 -3.71%		
板块持仓额	增长最大	国债 -0.02%	软商品 -0.24%	钢材 -0.31%		
	减少最大	股指 -27.40%	有色金属 -5.36%	油脂油料 -0.86%		

从各品种日内波幅与日成交资金比例分布图上看，交易应重点关注 I、M、SC、J 和 AG 等品种。

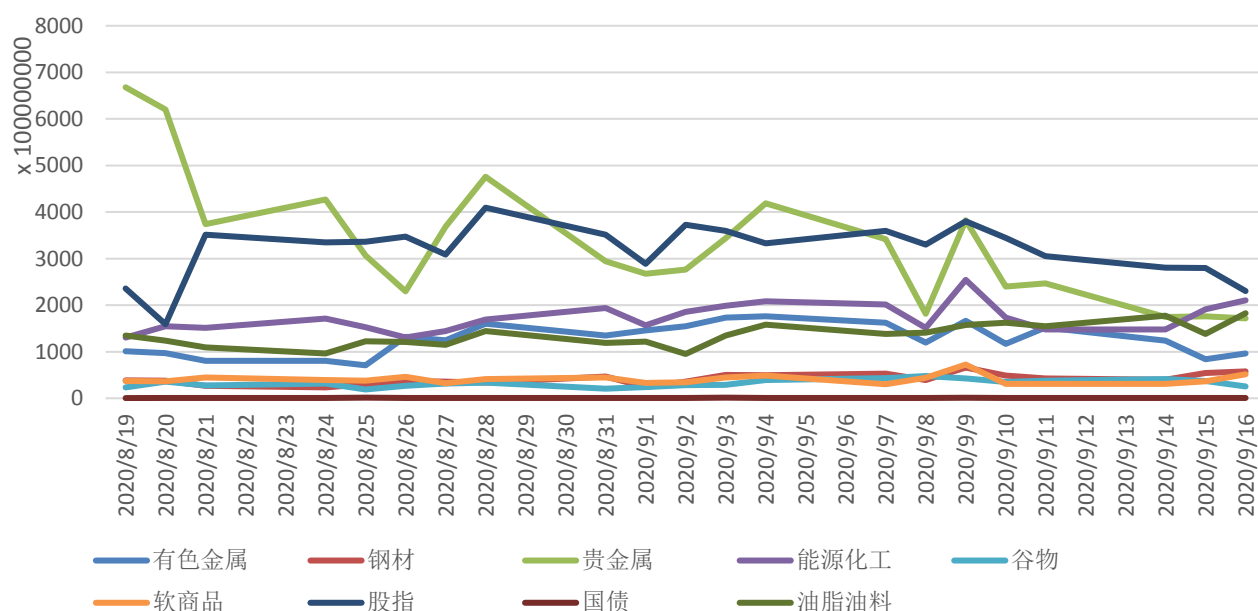
附表目录：

- 1、板块流量（板块成交量）、存量资金（板块持仓量）走势关系（图 1、图 2）
- 2、当日板块存量（板块持仓量）、流量（板块成交量）占比关系（图 3、图 4）
- 3、当日品种成交资金比例及其增减比例（图 5）
- 4、当日品种持仓资金比例及其增减比例（图 6）
- 5、日内波动幅度（图 7）
- 6、当日收盘价相对开盘价涨跌（图 8）
- 7、当日涨跌幅度（图 9）
- 8、短期与中期品种涨跌幅（图 10）
- 9、日内波幅与日成交资金比例分布（图 11）
- 10、各品种主力/近月合约持仓/仓单比（图表 12、图表 13）

板块流量、存量资金走势关系

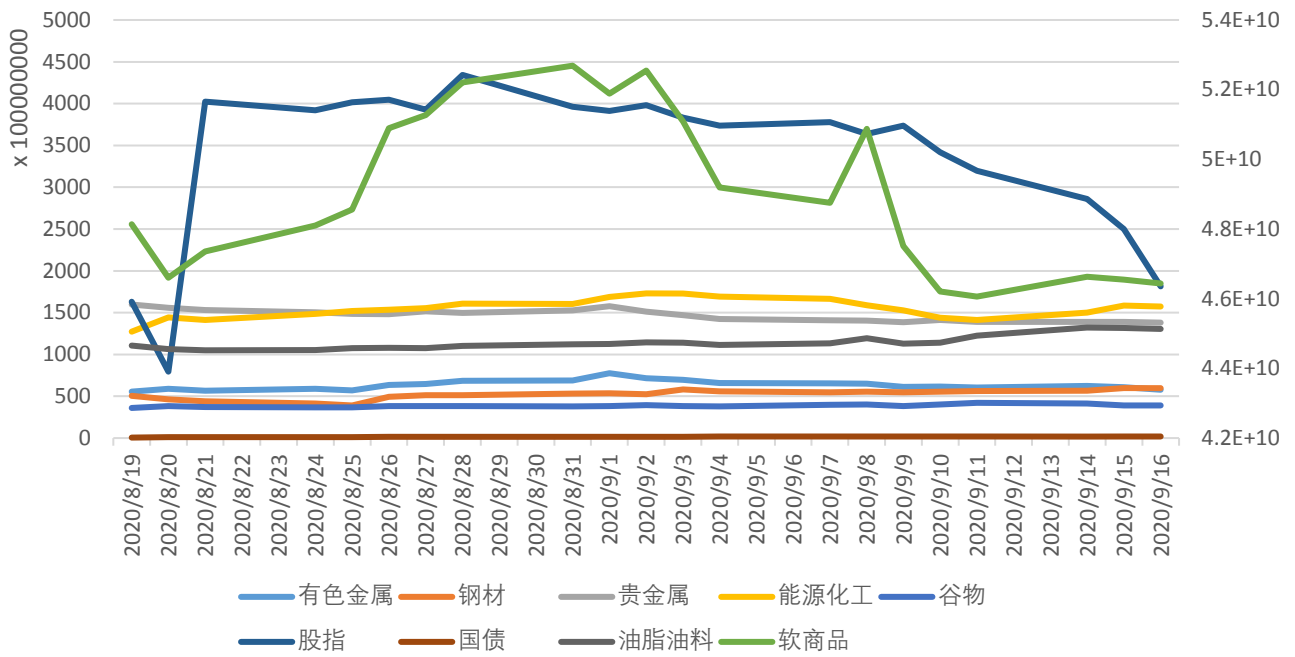
图 1 和图 2 给出板块流量资金和存量资金的走势及比较。

图 1：板块流量资金走势关系（亿元）



资料来源：中银期货

图 2：板块存量资金走势关系（亿元）



资料来源：中银期货

当日板块存量、流量占比关系

本部分表明当前不同板块资金占比。

图 3：当日板块流量资金占比

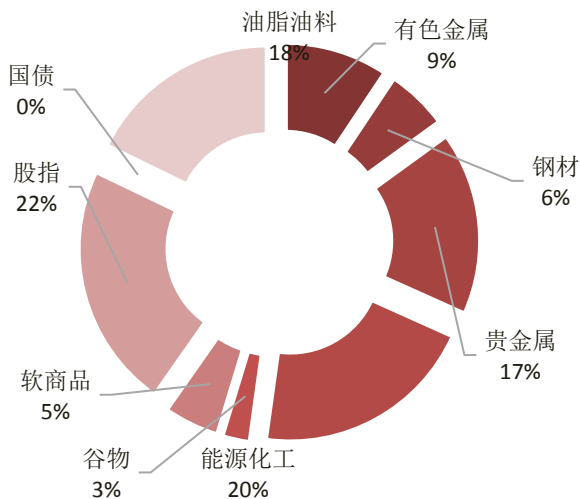
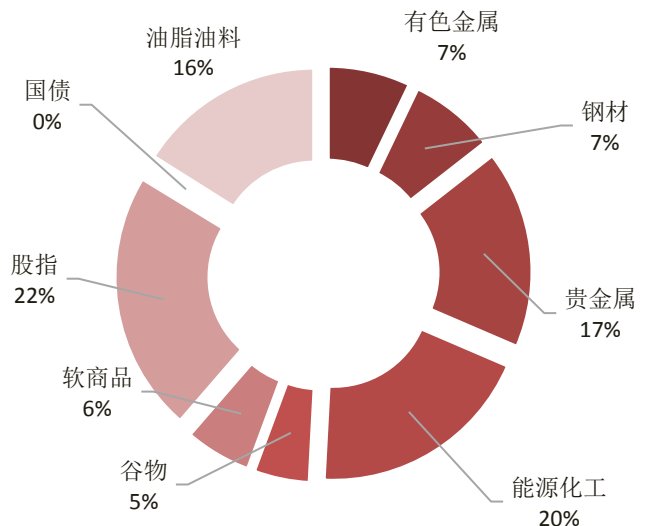


图 4：板块存量资金占比

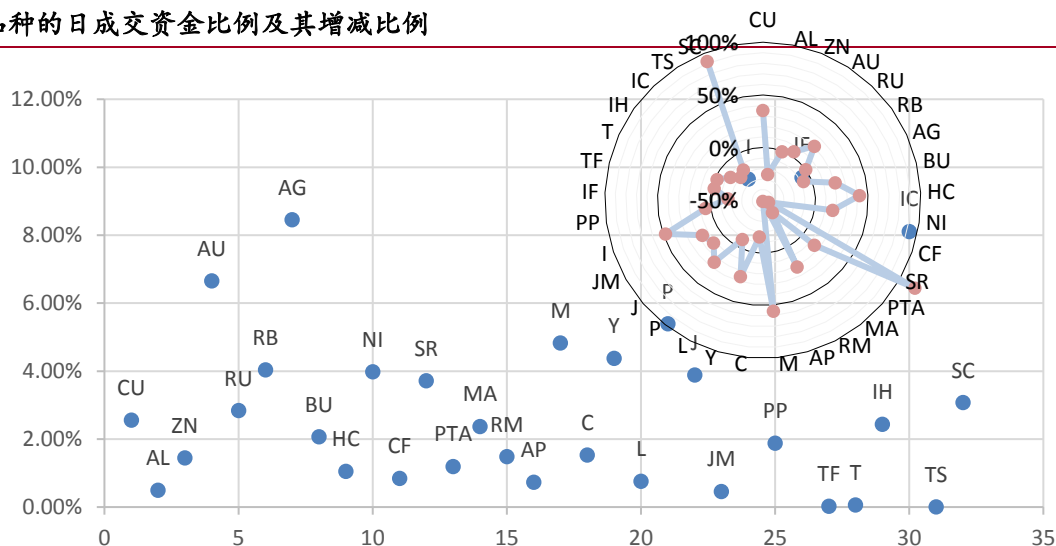


资料来源：中银期货

当日品种成交资金比例及其增减比例

每个交易品种当天的成交额比例，可从中发掘短线资金关注度较高的品种。每个交易品种的成交资金增减比例，表明成交资金当日的流入流出动向及强度。

图 5：各品种的日成交资金比例及其增减比例

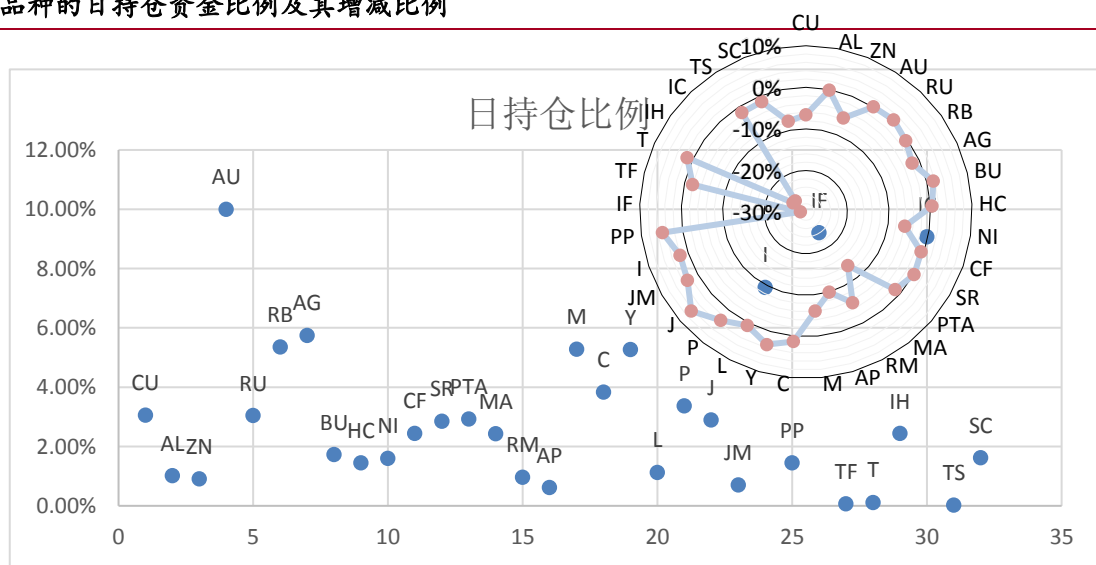


资料来源：中银期货

当日品种持仓资金比例及其增减比例

每个交易品种当天的持仓资金，可从中发掘隔夜资金关注度较高的品种。每个交易品种的持仓资金增减比例，表明持仓资金当日的流入流出动向及强度。

图 6：各品种的日持仓资金比例及其增减比例

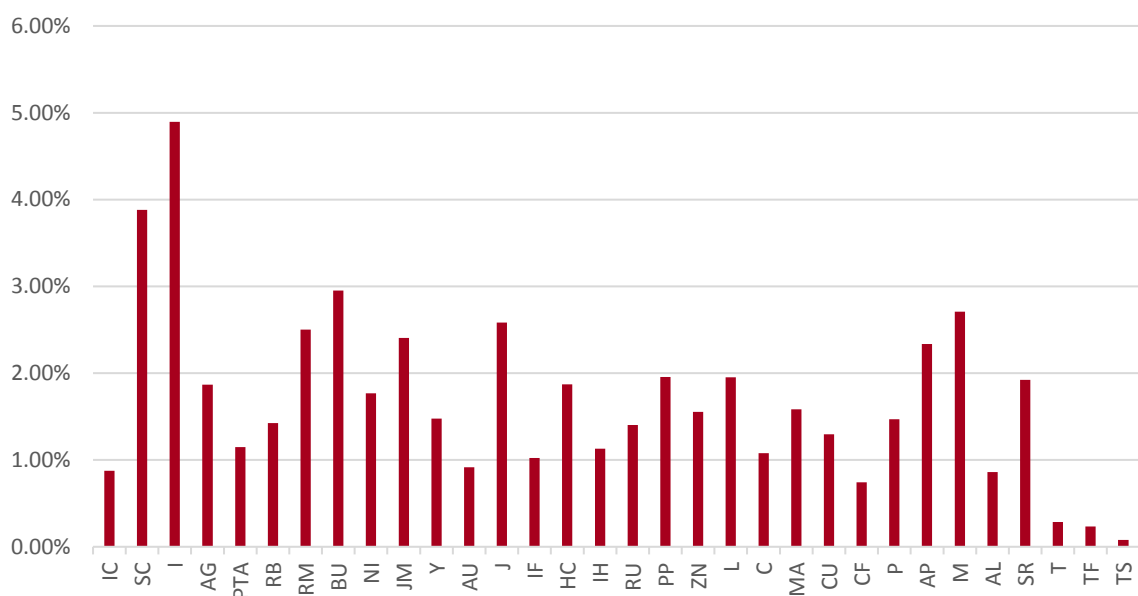


资料来源：中银期货

日内波动幅度

当日波动幅度大的品种，说明有较大资金出入。

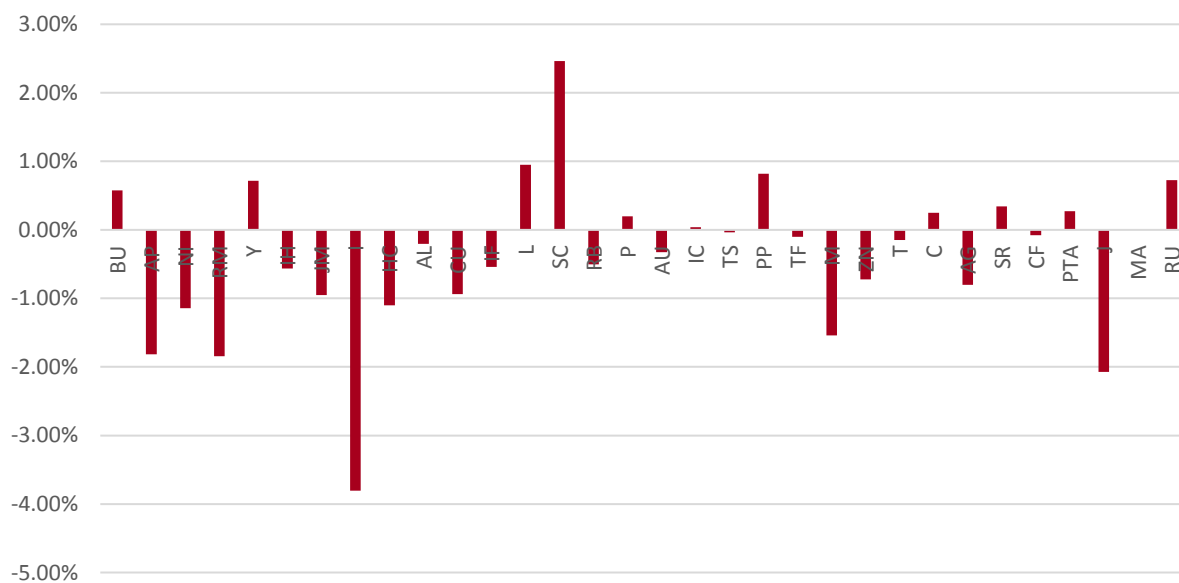
图 7：日内波动幅度



资料来源：中银期货

当日收盘价相对开盘价涨跌

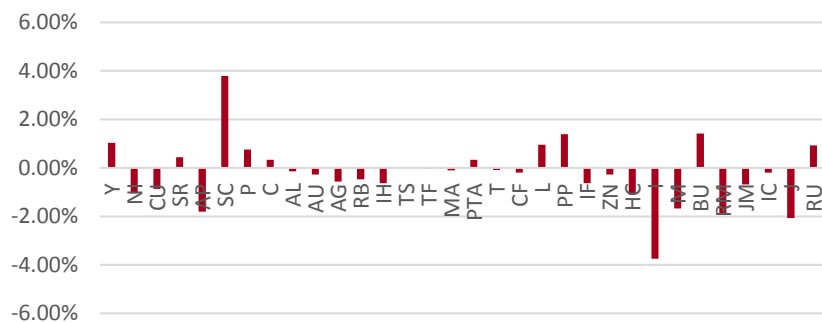
图 8：当日收盘价相对开盘价涨跌



资料来源：中银期货

当日涨跌幅度

图 9：当日涨跌幅度



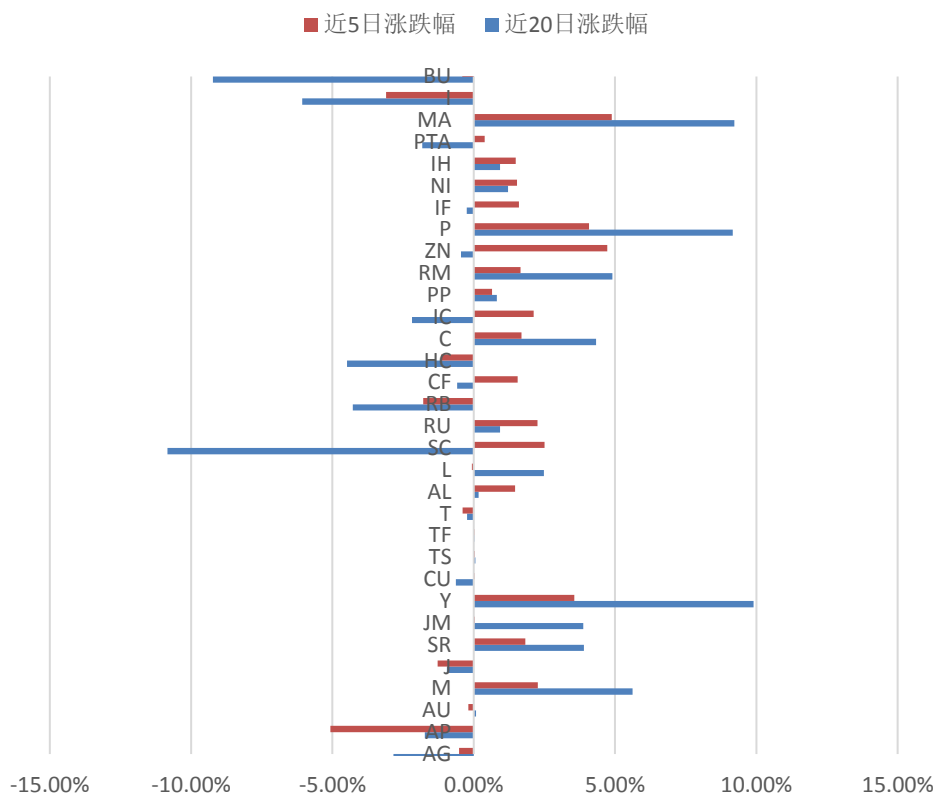
资料来源：中银期货

短期与中期品种涨跌幅

短期涨跌幅：当日收盘价与五个交易日前的收盘价之差比上当日的收盘价。

中期涨跌幅：当日收盘价与 20 个交易日前的收盘价之差比上当日收盘价。

图 10：短期与中期品种涨跌幅

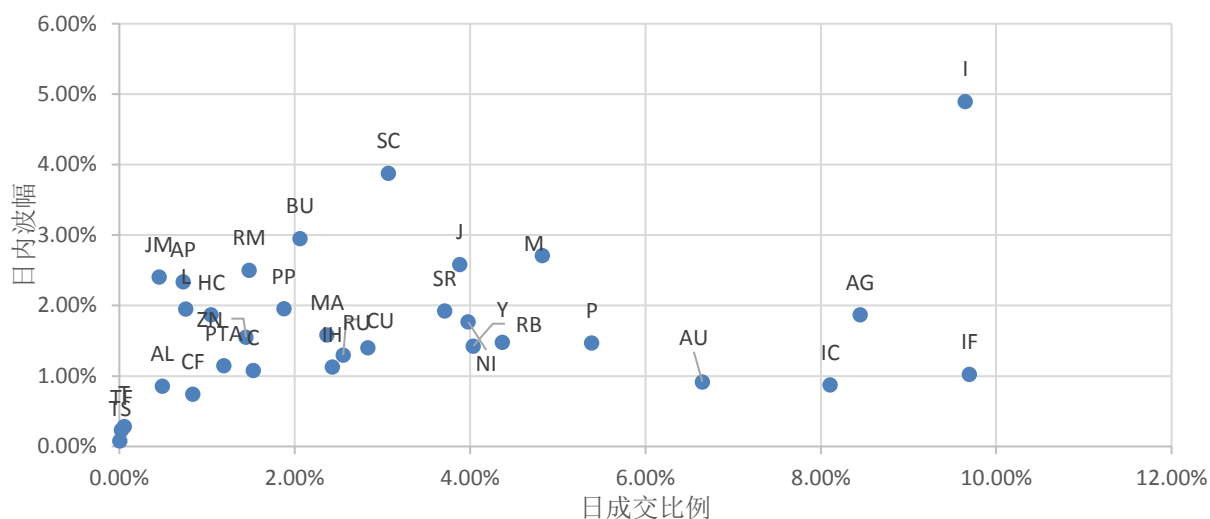


资料来源：中银期货

各品种日内波幅与日成交资金比例分布

图 11 为日内波幅与日成交量比例分布，该图给出日内波幅与日成交量比例均大的品种，这些品种适合做日内交易。

图 11：日内波幅与日成交资金比例分布



资料来源：中银期货

各品种主力/近月合约持仓/仓单比

持仓量统计的是该品种近月或主力合约持仓量，仓单是交易所注册仓单数量，当持仓/注册仓单比值大于 20，则存在逼仓风险。

图表 12：各品种主力合约持仓/仓单比

主力合约	持仓量	注册仓单	持仓/仓单	主力合约	持仓量	注册仓单	持仓/仓单
豆一2101	143590	1883	76.26	晚籼稻2011	711	0	--
白银2012	565403	2408218	0.23	豆粕2101	1510569	26644	56.69
铝2010	122927	138949	0.88	甲醇2101	1023569	10817	94.63
苹果2010	79714	0	--	镍2011	119471	29661	4.03
黄金2012	209430	2208	94.85	菜油2101	166992	2498	66.85
豆二2011	29877	2000	14.94	棕榈油2101	482150	504	956.65
胶合板2012	2	2	1.00	铅2010	25052	28017	0.89
沥青2012	620388	208910	2.97	普麦2103	3	0	--
玉米2101	1393145	38158	36.51	聚丙烯2101	327233	2776	117.88
棉花2101	335543	11291	29.72	螺纹钢2101	1312799	99664	13.17
红枣2101	15687	32	490.22	早籼稻2101	1	0	--
淀粉2101	133783	1700	78.70	菜粕2101	353949	1813	195.23
铜2010	103611	74471	1.39	菜籽2009	5	0	--
棉纱2101	8928	168	53.14	橡胶2101	213893	215210	0.99
乙二醇2101	230820	9524	24.24	硅铁2010	47555	13083	3.63
纤维板2010	680	0	--	锰硅2101	100160	12871	7.78
玻璃2101	675358	300	2251.19	锡2011	21824	3829	5.70
燃油2101	607102	271270	2.24	纸浆2012	172373	102725	1.68
卷板2010	343519	4091	83.97	白糖2101	476022	7247	65.69
铁矿石2101	810703	2600	311.81	PTA2101	1403879	28516	49.23
焦炭2101	131011	450	291.14	PVC2101	190384	4421	43.06
鸡蛋2010	173599	0	--	强麦2101	322	150	2.15
焦煤2101	83076	500	166.15	豆油2101	655632	19683	33.31
粳稻2101	103	14	7.36	动力煤2011	177821	0	--
塑料2101	266645	2291	116.39	锌2010	79811	24232	3.29
线材2101	5	0	--	原油2011	52710	39314000	0.00

资料来源：中银期货

图表 13：各品种近月合约持仓/仓单比

近月合约	持仓量	注册仓单	持仓/仓单	近月合约	持仓量	注册仓单	持仓/仓单
玻璃近月	5318	300	17.73	普麦近月	0	0	--
白糖近月	12808	7247	1.77	强麦近月	27	150	0.18
菜粕近月	35958	1813	19.83	燃油近月	9849	271270	0.04
菜油近月	21603	2498	8.65	塑料近月	955	2291	0.42
菜籽近月	5	0	--	线材近月	1	0	--
豆二近月	1580	2000	0.79	橡胶近月	115	215210	0.00
豆粕近月	61249	26644	2.30	玉米近月	35128	38158	0.92
豆一近月	1966	1883	1.04	纸浆近月	271	102725	0.00
豆油近月	5317	19683	0.27	郑棉近月	16418	11291	1.45
硅铁近月	47555	13083	3.63	菜油近月	0	0	--
沪金近月	1933	2208	0.88	甲醇近月	0	0	--
沪铝近月	122927	138949	0.88	强麦近月	0	0	--
沪镍近月	21593	29661	0.73	硬麦近月	0	0	--
沪铅近月	25052	28017	0.89	热轧卷板近月	79014	4091	19.31
沪铜近月	103611	74471	1.39	玉米淀粉近月	18816	1700	11.07
沪锡近月	1892	3829	0.49	动力煤近月	2772	0	--
沪锌近月	79811	24232	3.29	聚丙烯近月	1688	2776	0.61
沪银近月	18875	2408218	0.01	胶合板近月	1	2	0.50
红枣近月	2222	32	69.44	螺纹钢近月	186638	99664	1.87
甲醇近月	4173	10817	0.39	PTA近月	15506	28516	0.54
鸡蛋近月	123	0	--	PVC近月	850	4421	0.19
粳稻近月	40	14	2.86	纤维板近月	680	0	--
焦煤近月	84	500	0.17	铁矿石近月	14920	2600	5.74
焦炭近月	762	450	1.69	晚籼稻近月	711	0	--
沥青近月	106	208910	0.00	乙二醇近月	0	9524	0.00
锰硅近月	2991	12871	0.23	棕榈油近月	1105	504	2.19
棉纱近月	1	168	0.01	早籼稻近月	0	0	--
苹果近月	79714	0	--	动力煤近月	0	0	--

资料来源：中银期货

免责声明

此报告所载的资料、工具及材料只提供给阁下作参考之用，不作为或被视为出售或购买期货品种的要约或发出的要约邀请。此报告的内容不构成对任何人的投资建议，而中银国际期货有限责任公司（简称“中银国际”）不会因接收人收到此报告而视他们为其客户。

此报告所载资料的来源及观点的出处皆被中银国际认为可靠，但中银国际不能担保其准确性或完整性，而中银国际不对因使用此报告而引起的损失负任何责任。阁下不能依赖此报告以取代自己的独立判断。本报告仅反映编写分析员的不同设想、见解及分析方法。本报告所载的观点不代表中银国际的立场。中银国际可发出其它与本报告所载资料不一致及有不同结论的报告。

本报告以往的表现不应作为日后表现的反映及担保。本报告所载的资料、意见及推测反映中银国际于最初发表此报告日期当日的判断，可随时更改。本报告所指的期货品种的价格、价值及投资收入可能会波动。

中银国际未参与报告所提及的投资品种的交易及投资，不存在与客户之间的利害冲突。

若干投资可能因不易变卖而难以出售，同样地阁下可能难以就有关该投资所面对的价格或风险获得准确的数据。此报告中所指的投资及服务可能不适合阁下。此报告不构成投资、法律、会计或税务建议或担保任何投资或策略适合或切合阁下个别情况。此报告不构成给予阁下私人咨询建议。

此报告并非针对或意图派发给或为任何就派发、发布、可得到或使用此报告而使中银国际违反当地注册或牌照规定的法律或规定或可致使中银国际受制于当地注册或牌照规定的法律或规定的任何地区、国家或其他管辖区域的公民或居民。

此报告的版权属中银国际，除非另有说明，报告中使用材料的版权亦属中银国际。未经中银国际事先书面许可，任何机构和个人不得以任何形式翻版、复制和发布，亦不得作为诉讼、仲裁、传媒及任何单位或个人引用之证明或依据，不得用于未经允许的其它任何用途。如引用、刊发，需注明出处为中银国际期货有限责任公司，且不得对本报告进行有悖原意的引用、删节和修改。所有于此报告中使用的商标、服务标记及标识均为中银国际的商标、服务标记及标识。

中银国际可在法律许可下于发表材料前使用此报告中所载资料或意见或所根据的研究和分析。

中银国际期货有限责任公司

中国上海浦东
世纪大道 1589 号
长泰国际金融大厦 901 室
邮编 200122
电话: 61 088 088
传真: 61 088 066
客服热线: 400 820 8899

相关关联机构:

中银国际证券股份有限公司

中国上海浦东
银城中路 200 号
中银大厦 39 楼
邮编 200120
电话: (8621) 6860 4866
传真: (8621) 5888 3554

中银国际证券有限公司

中国香港
花园道 1 号
中银大厦 20 楼
电话: (852) 2867 6333
传真: (852) 2147 9513