

2021年1月19日

中银期货研究部

姓名：周新宇
 投资咨询号：Z0012683
 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 12.88%	J 7.81%	RB 7.08%		
	持仓额最大	IF 13.15%	IC 9.06%	M 6.11%		
成交和持仓资金变动	成交额增长最大	HC 37.09%	J 26.61%			
	持仓额增长最大	IH 5.64%				
波动性	日内波动最大	J 4.44%	JM 4.10%	I 3.54%	HC 3.01%	BU 2.57%
	涨幅最大 (相对开盘价)	AG 0.85%	SC 0.54%			
	跌幅最大 (相对开盘价)	J -3.85%	HC -2.64%			
板块成交额	增长最大	钢材 24.22%	软商品 0.73%	股指 0.48%		
	减少最大	贵金属 -52.62%	谷物 -31.53%	有色金属 -30.76%		
板块持仓额	增长最大	贵金属 1.43%	股指 0.40%	能源化工 -0.63%		
	减少最大	钢材 -2.81%	有色金属 -2.55%	国债 -1.70%		

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 J、RB、RU、IF 和 I 等品种。

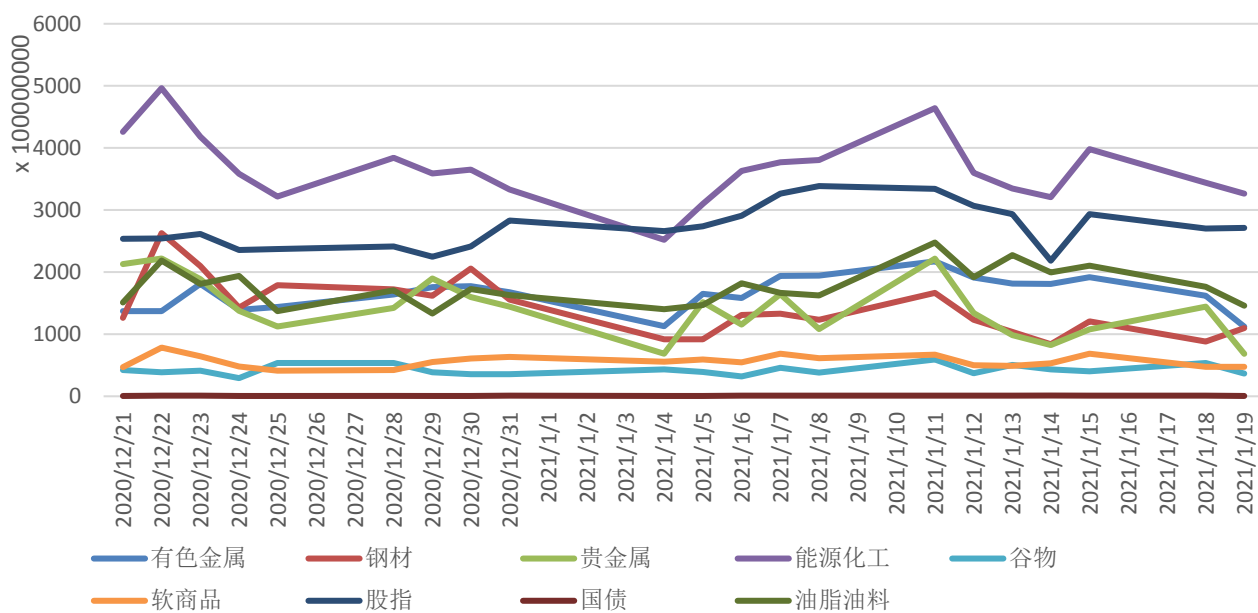
附表目录:

- 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

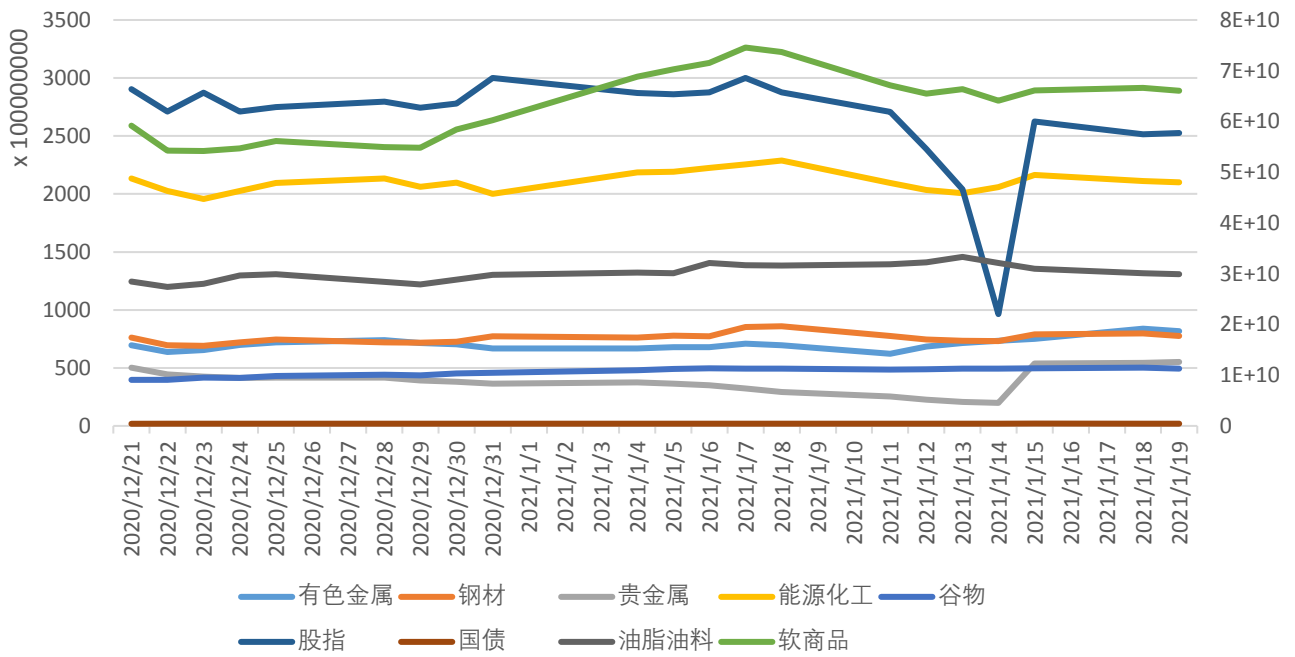
图 1 和图 2 给出板块流量资金和存量资金的走势及比较。

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

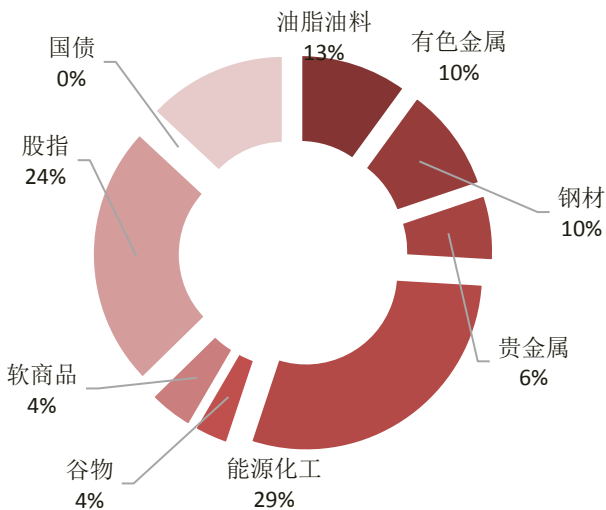
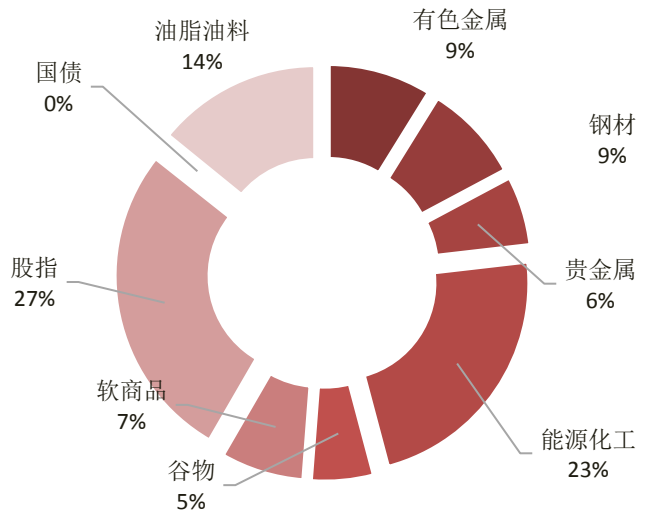


图 4：板块存量资金占比

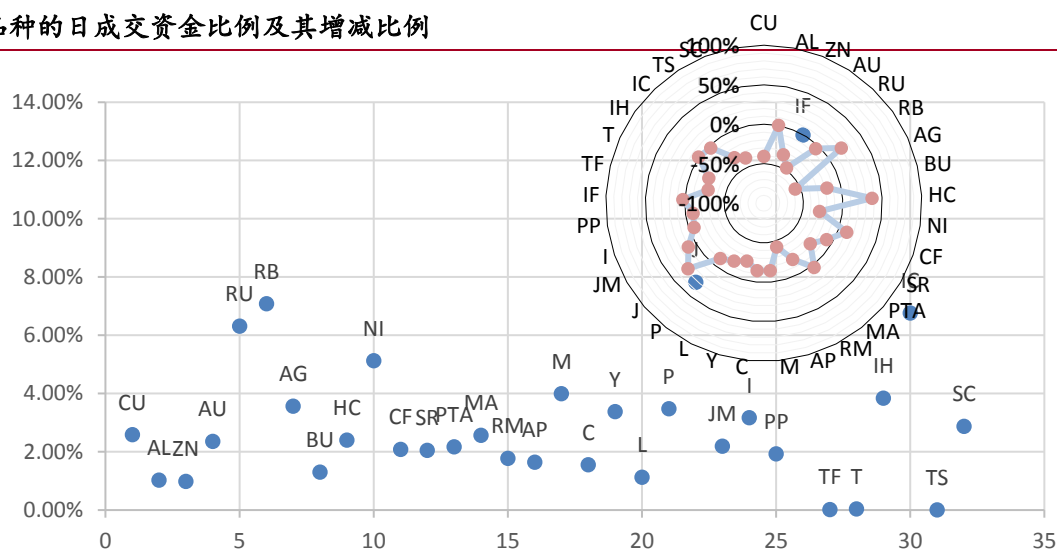


资料来源：中银期货

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

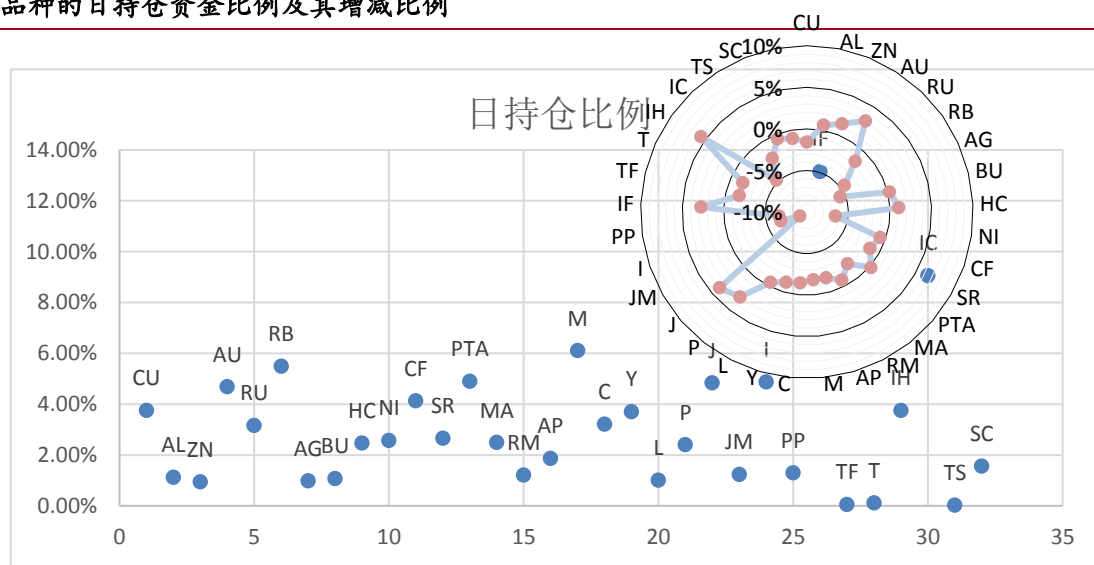


资料来源：中银期货

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

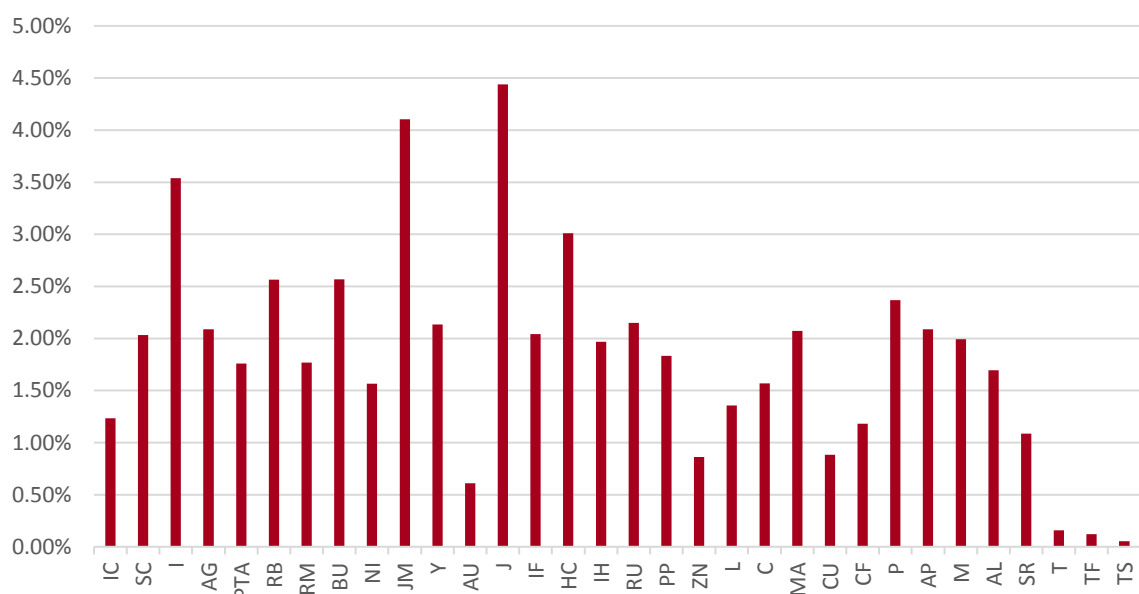


资料来源：中银期货

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。

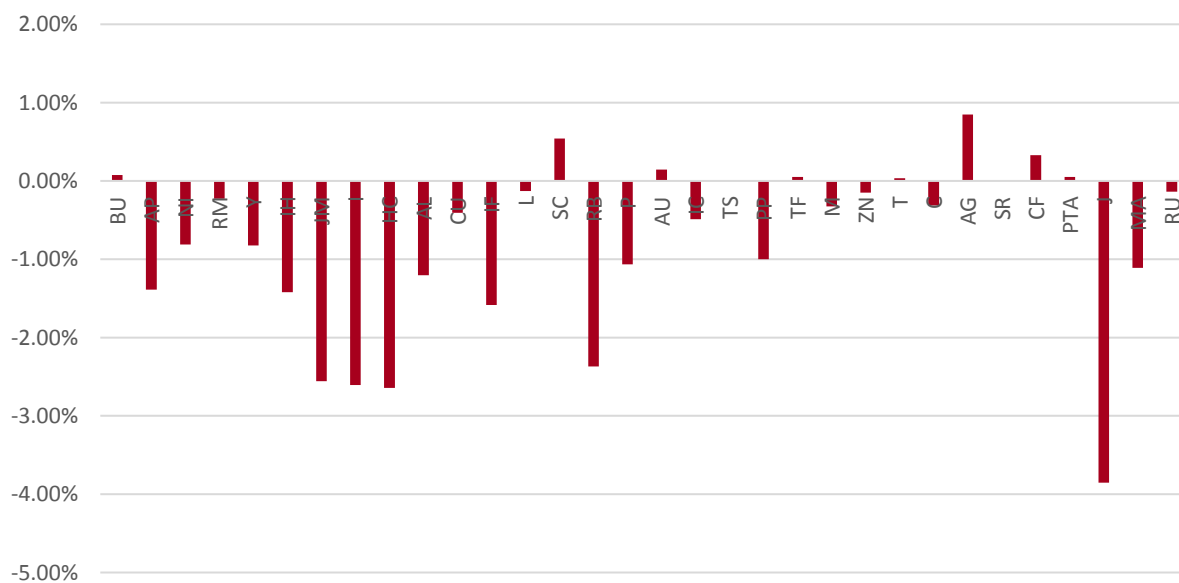
图 7：日内波动幅度



资料来源：中银期货

当日收盘价相对开盘价涨跌

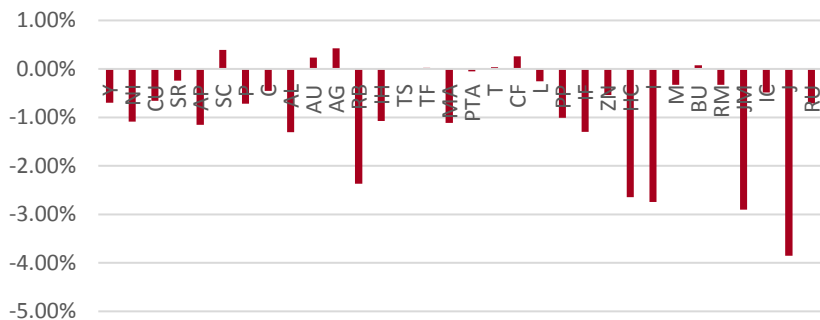
图 8：当日收盘价相对开盘价涨跌



资料来源：中银期货

当日涨跌幅度

图 9: 当日涨跌幅度

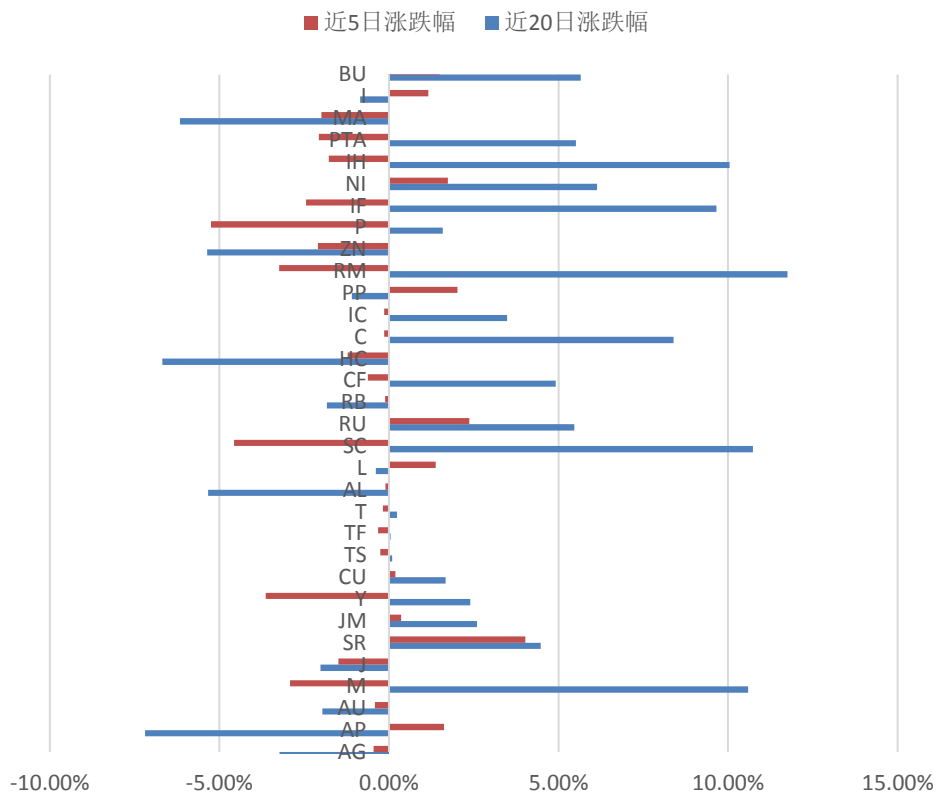


资料来源: 中银期货

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的收盘价。

图 10: 短期与中期品种涨跌幅

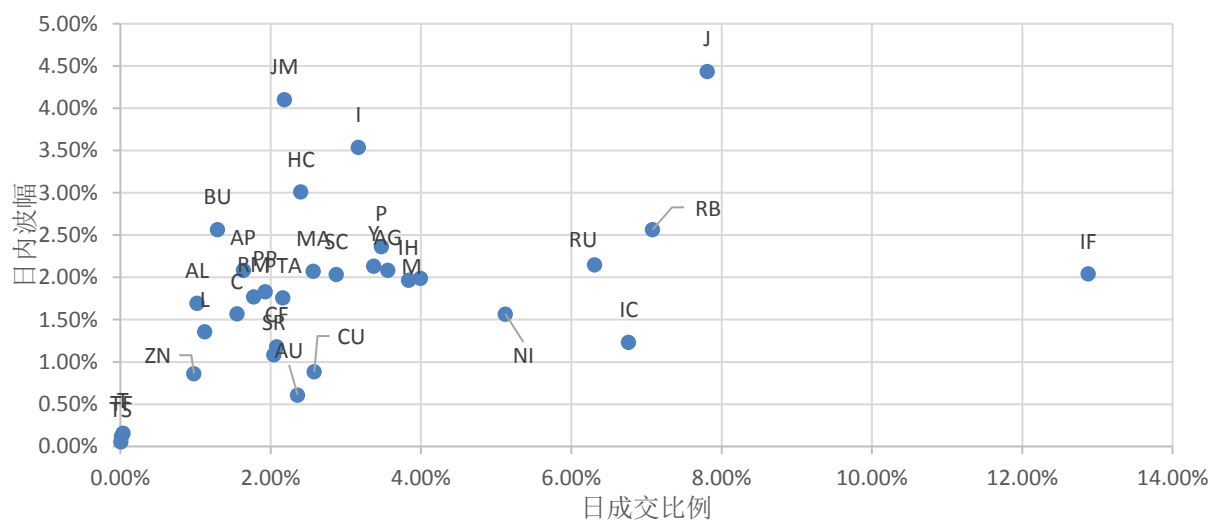


资料来源: 中银期货

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
豆一2105	90165	9710	9.29	晚籼稻2103	0	0	--
白银2102	122159	2914568	0.04	豆粕2105	1621366	24614	65.87
铝2103	147752	89482	1.65	甲醇2105	1046484	3869	270.48
苹果2105	293490	25	11739.60	镍2103	187656	12578	14.92
黄金2106	117548	2733	43.01	菜油2105	141739	2000	70.87
豆二2103	23976	0	--	棕榈油2105	350519	2191	159.98
胶合板2102	0	0	--	铅2103	35894	48238	0.74
沥青2106	384080	295420	1.30	普麦2107	18	0	--
玉米2105	1091791	101684	10.74	聚丙烯2105	310458	574	540.87
棉花2105	527333	16259	32.43	螺纹钢2105	1246331	100304	12.43
红枣2105	25993	706	36.82	早籼稻2103	0	0	--
淀粉2105	173673	4211	41.24	菜粕2105	387209	3388	114.29
铜2103	124070	26642	4.66	菜籽2107	22	0	--
棉纱2105	8568	240	35.70	橡胶2105	209792	165870	1.26
乙二醇2105	204598	2261	90.49	硅铁2105	167386	3401	49.22
纤维板2102	1530	434	3.53	锰硅2105	126803	9002	14.09
玻璃2105	447119	470	951.32	锡2103	33343	5374	6.20
燃油2105	412952	252940	1.63	纸浆2103	147449	84707	1.74
卷板2105	548048	219455	2.50	白糖2105	475454	11716	40.58
铁矿石2105	453527	3000	151.18	PTA2105	2398977	366518	6.55
焦炭2105	176054	490	359.29	PVC2105	397861	12801	31.08
鸡蛋2105	171368	9	19040.89	强麦2109	720	0	--
焦煤2105	120712	300	402.37	豆油2105	469533	6611	71.02
粳稻2105	49	9	5.44	动力煤2105	253140	0	--
塑料2105	254483	1121	227.01	锌2103	91001	14548	6.26
线材2105	60	0	--	原油2103	45654	25584000	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	91	470	0.19	普麦近月	3	0	--
白糖近月	12269	11716	1.05	强麦近月	1	0	--
菜粕近月	22414	3388	6.62	燃油近月	2094	252940	0.01
菜油近月	9324	2000	4.66	塑料近月	2067	1121	1.84
菜籽近月	22	0	--	线材近月	0	0	--
豆二近月	4673	0	--	橡胶近月	1888	165870	0.01
豆粕近月	48520	24614	1.97	玉米近月	97089	101684	0.95
豆一近月	6243	9710	0.64	纸浆近月	3464	84707	0.04
豆油近月	6958	6611	1.05	郑棉近月	18302	16259	1.13
硅铁近月	136	3401	0.04	菜油近月	0	0	--
沪金近月	16642	2733	6.09	甲醇近月	0	0	--
沪铝近月	74373	89482	0.83	强麦近月	0	0	--
沪镍近月	14913	12578	1.19	硬麦近月	0	0	--
沪铅近月	9244	48238	0.19	热轧卷板近月	3609	219455	0.02
沪铜近月	58559	26642	2.20	玉米淀粉近月	18925	4211	4.49
沪锡近月	2964	5374	0.55	动力煤近月	2434	0	--
沪锌近月	34668	14548	2.38	聚丙烯近月	503	574	0.88
沪银近月	122159	2914568	0.04	胶合板近月	0	0	--
红枣近月	1138	706	1.61	螺纹钢近月	5211	100304	0.05
甲醇近月	8307	3869	2.15	PTA近月	11099	366518	0.03
鸡蛋近月	287	9	31.89	PVC近月	4393	12801	0.34
粳稻近月	0	9	0.00	纤维板近月	1530	434	3.53
焦煤近月	1115	300	3.72	铁矿石近月	5780	3000	1.93
焦炭近月	1958	490	4.00	晚籼稻近月	0	0	--
沥青近月	6912	295420	0.02	乙二醇近月	473	2261	0.21
锰硅近月	43	9002	0.00	棕榈油近月	10044	2191	4.58
棉纱近月	0	240	0.00	早籼稻近月	0	0	--
苹果近月	21879	25	875.16	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资料。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