

2020年11月20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 9.70%	IC 8.99%	P 7.84%		
	持仓额最大	IF 18.06%	IC 17.53%	I 5.53%		
成交和持仓资金变动	成交额增长最大	TF 111.94%	IF 82.92%			
	持仓额增长最大	IF 537.93%				
波动性	日内波动最大	J 3.49%	P 3.33%	L 2.71%	ZN 2.59%	M 2.33%
	涨幅最大 (相对开盘价)	J 2.61%	ZN 2.31%			
	跌幅最大 (相对开盘价)	P -2.14%	L -1.96%			
板块成交额	增长最大	股指 76.45%	国债 75.93%	软商品 45.51%		
	减少最大	钢材 -18.39%	贵金属 -5.63%	能源化工 -4.94%		
板块持仓额	增长最大	股指 505.30%	国债 62.04%	有色金属 7.43%		
	减少最大	贵金属 -12.87%	谷物 -2.75%	油脂油料 -1.87%		

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 P、J、Y、M 和 RU 等品种。

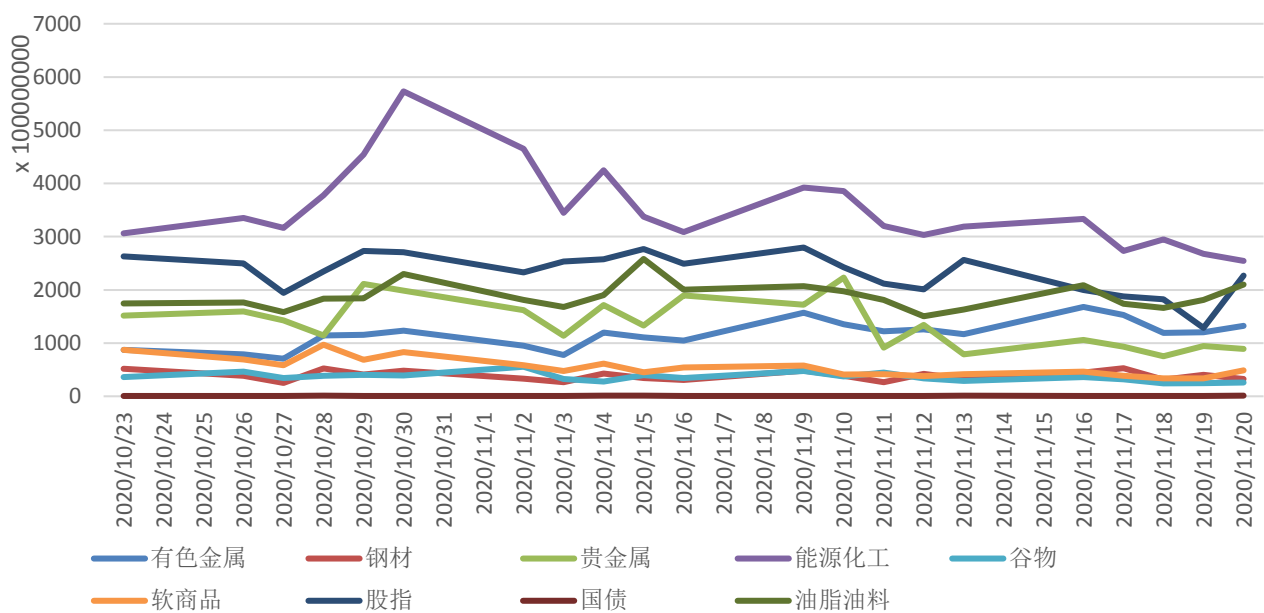
附表目录:

- 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

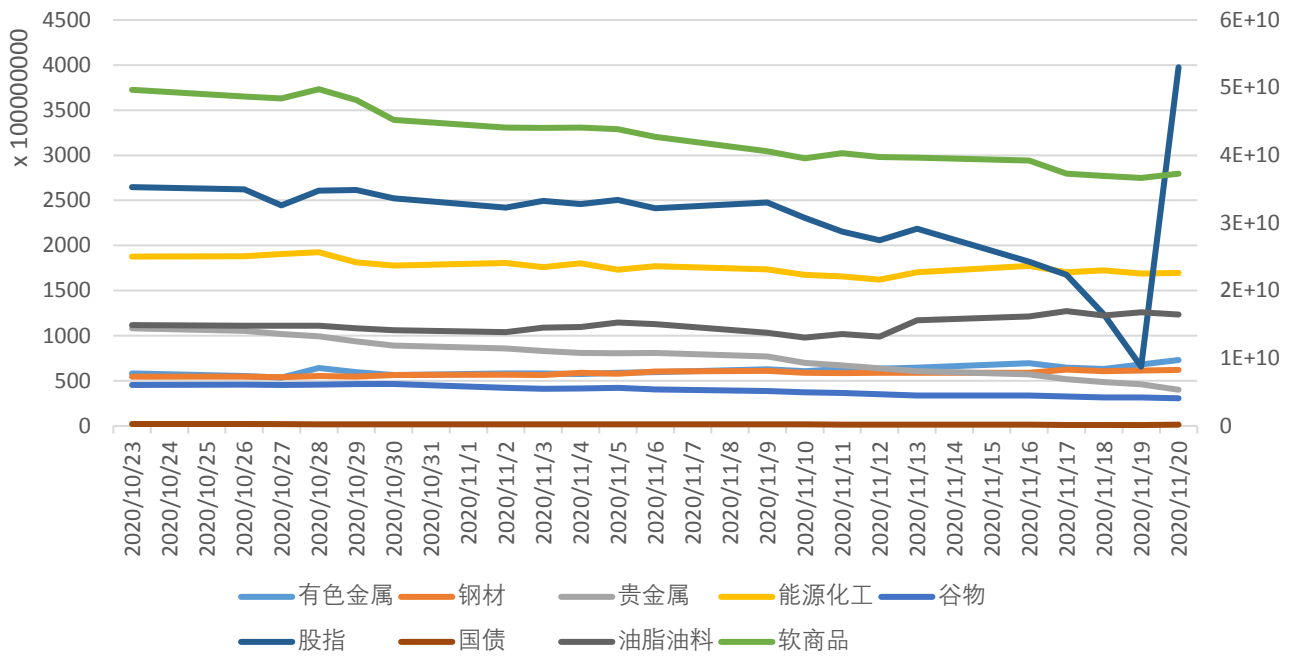
图 1 和图 2 给出板块流量资金和存量资金的走势及比较。

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

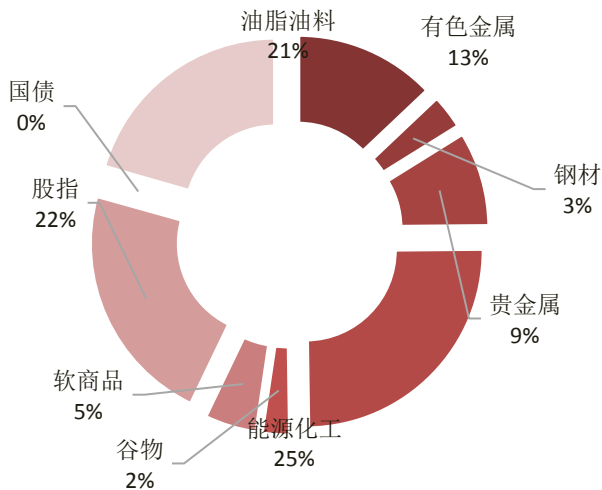
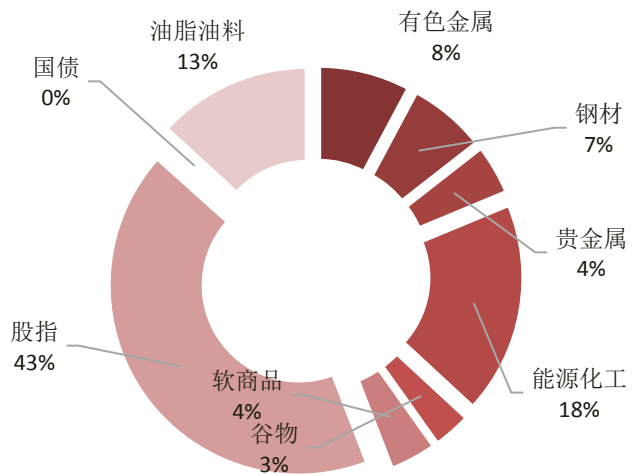


图 4：板块存量资金占比

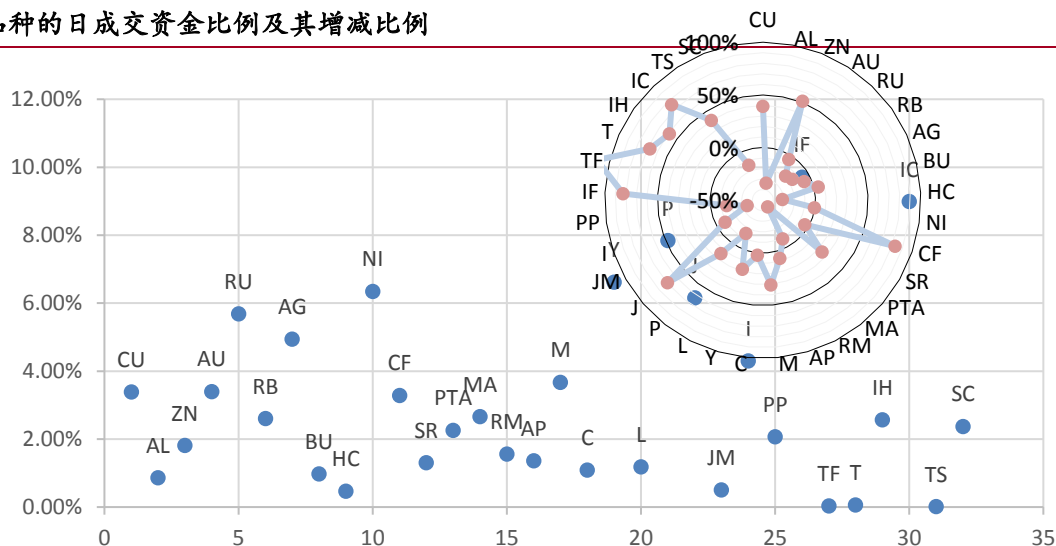


资料来源：中银期货

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

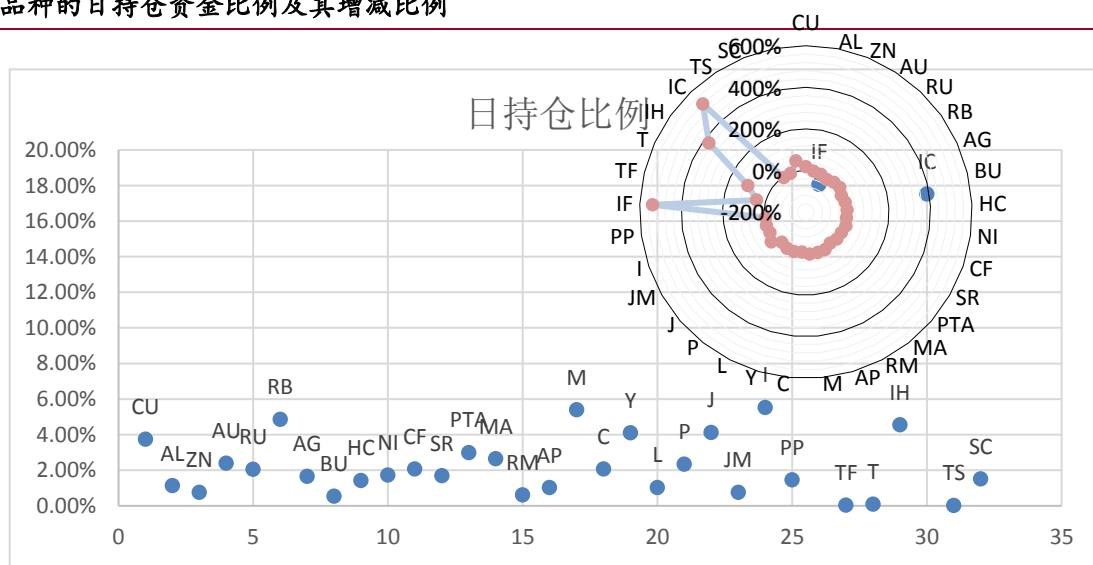


资料来源：中银期货

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

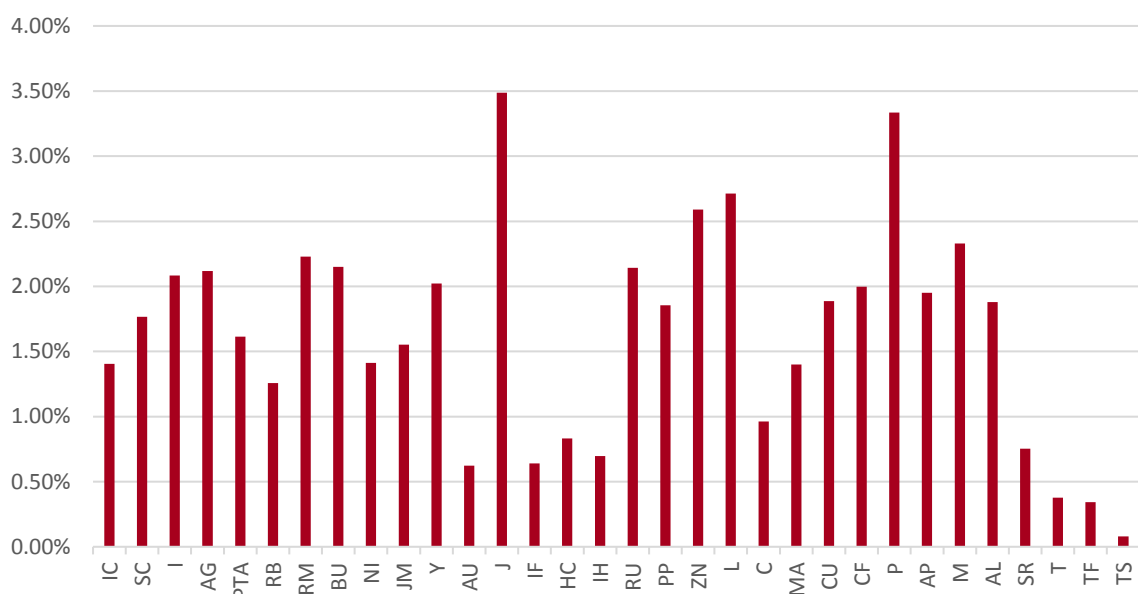


资料来源：中银期货

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。

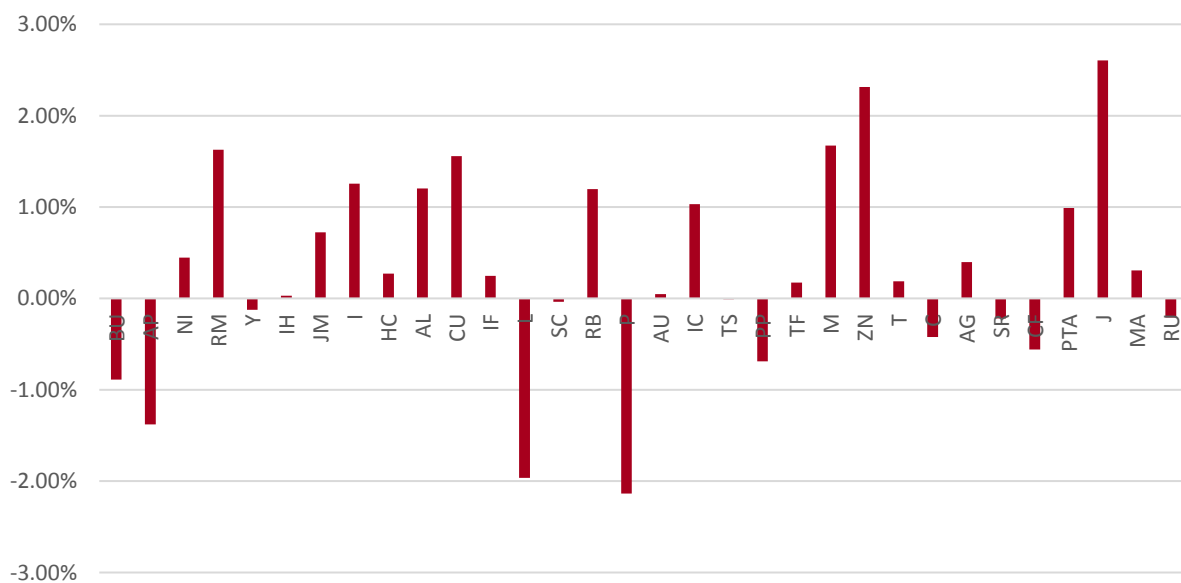
图 7：日内波动幅度



资料来源：中银期货

当日收盘价相对开盘价涨跌

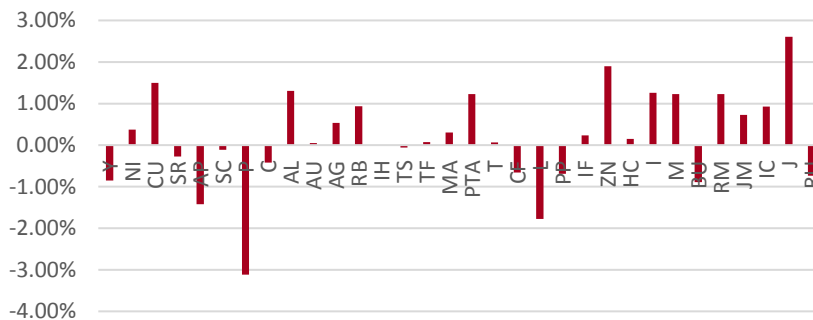
图 8：当日收盘价相对开盘价涨跌



资料来源：中银期货

当日涨跌幅度

图 9：当日涨跌幅度



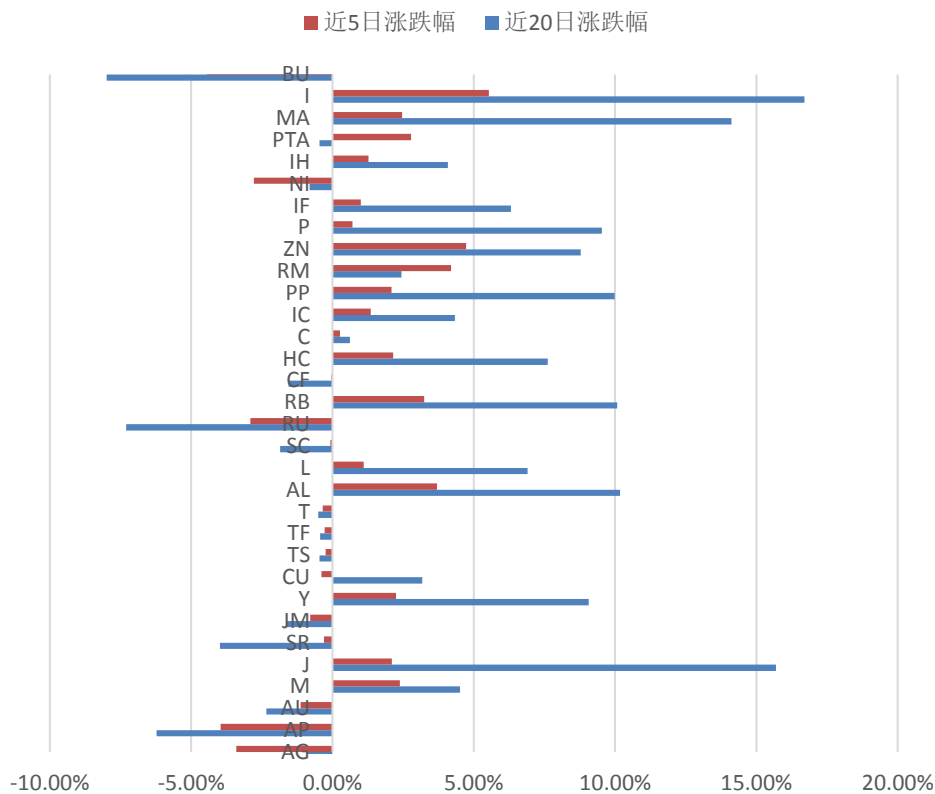
资料来源：中银期货

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

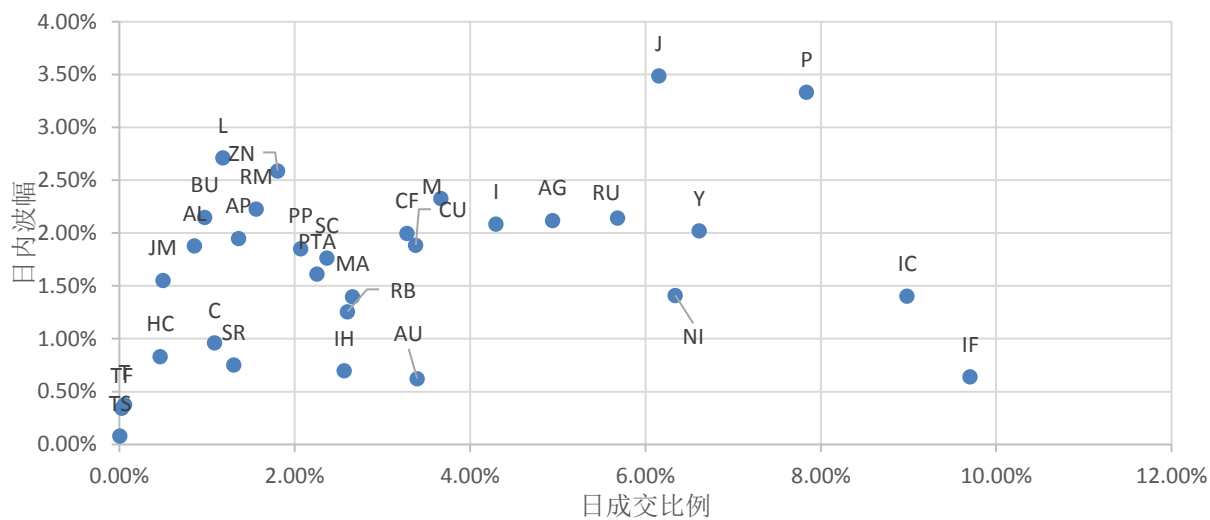


资料来源：中银期货

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	106839	1036	103.13	晚籼稻2101	0	0	--
白银2012	216287	2316205	0.09	豆粕2105	1660773	30171	55.05
铝2012	140392	110336	1.27	甲醇2101	1146286	0	--
苹果2101	143319	75	1910.92	镍2102	146755	23402	6.27
黄金2012	60399	2199	27.47	菜油2101	144045	1180	122.07
豆二2102	33281	0	--	棕榈油2101	342221	0	--
胶合板2012	10	2	5.00	铅2101	19660	28552	0.69
沥青2012	239382	152760	1.57	普麦2107	12	0	--
玉米2101	787438	63996	12.30	聚丙烯2101	339960	288	1180.42
棉花2101	287620	5566	51.67	螺纹钢2101	1209316	1500	806.21
红枣2101	18396	0	--	早籼稻2101	0	0	--
淀粉2101	102521	314	326.50	菜粕2101	239085	0	--
铜2101	138831	46210	3.00	菜籽2107	4	0	--
棉纱2101	8795	0	--	橡胶2101	142924	73820	1.94
乙二醇2101	183495	3862	47.51	硅铁2101	120204	5192	23.15
纤维板2101	1561	154	10.14	锰硅2101	119881	3142	38.15
玻璃2101	443477	0	--	锡2101	33788	4678	7.22
燃油2101	406852	238160	1.71	纸浆2101	121543	114717	1.06
卷板2101	345564	6270	55.11	白糖2101	332771	5712	58.26
铁矿石2101	617018	0	--	PTA2101	1710877	215684	7.93
焦炭2101	164773	20	8238.65	PVC2101	262140	1256	208.71
鸡蛋2101	169197	16	10574.81	强麦2101	611	0	--
焦煤2101	95001	0	--	豆油2101	514806	14404	35.74
粳稻2101	81	0	--	动力煤2101	165070	0	--
塑料2101	264619	1171	225.98	锌2012	70799	18294	3.87
线材2101	16	0	--	原油2101	57646	32985000	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	1669	0	--	普麦近月	0	0	--
白糖近月	332771	5712	58.26	强麦近月	611	0	--
菜粕近月	239085	0	--	燃油近月	10067	238160	0.04
菜油近月	144045	1180	122.07	塑料近月	618	1171	0.53
菜籽近月	4	0	--	线材近月	0	0	--
豆二近月	407	0	--	橡胶近月	142924	73820	1.94
豆粕近月	5156	30171	0.17	玉米近月	787438	63996	12.30
豆一近月	106839	1036	103.13	纸浆近月	11905	114717	0.10
豆油近月	532	14404	0.04	郑棉近月	287620	5566	51.67
硅铁近月	6207	5192	1.20	菜油近月	0	0	--
沪金近月	60399	2199	27.47	甲醇近月	0	0	--
沪铝近月	140392	110336	1.27	强麦近月	0	0	--
沪镍近月	24597	23402	1.05	硬麦近月	0	0	--
沪铅近月	19660	28552	0.69	热轧卷板近月	200	6270	0.03
沪铜近月	78308	46210	1.69	玉米淀粉近月	102521	314	326.50
沪锡近月	1788	4678	0.38	动力煤近月	4669	0	--
沪锌近月	70799	18294	3.87	聚丙烯近月	201	288	0.70
沪银近月	216287	2316205	0.09	胶合板近月	10	2	5.00
红枣近月	375	0	--	螺纹钢近月	722	1500	0.48
甲醇近月	3509	0	--	PTA近月	8285	215684	0.04
鸡蛋近月	18	16	1.13	PVC近月	84	1256	0.07
粳稻近月	81	0	--	纤维板近月	22	154	0.14
焦煤近月	59	0	--	铁矿石近月	4410	0	--
焦炭近月	94	20	4.70	晚籼稻近月	0	0	--
沥青近月	239382	152760	1.57	乙二醇近月	0	3862	0.00
锰硅近月	2949	3142	0.94	棕榈油近月	1900	0	--
棉纱近月	0	0	--	早籼稻近月	0	0	--
苹果近月	1467	75	19.56	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