

2019年6月11日

中银国际期货研究部
研究团队

顾劲涛

021-61088053

research.bocif@bocichina.com

中银国际期货量化统计日报

摘要

成交和持仓	成交额最大	RB 11.39%	I 11.20%	SC 9.11%		
	持仓额最大	I 9.95%	AU 9.88%	RB 7.83%		
成交和持仓资金变动	成交额增长最大	SC 300.44%	TS 175.25%			
	持仓额增长最大	JM 15.52%				
波动性	日内波动最大	I 4.73%	BU 4.64%	IC 4.43%	J 4.08%	RB 3.18%
	涨幅最大 (相对开盘价)	IC 4.40%	I 4.18%			
	跌幅最大 (相对开盘价)	AG -0.69%	SC -0.67%			
板块成交额	增长最大	钢材 121.44%	有色金属 89.43%	软商品 88.08%		
	减少最大	谷物 -18.63%	股指 18.44%	国债 24.35%		
板块持仓额	增长最大	能源化工 5.24%	股指 4.49%	油脂油料 0.19%		
	减少最大	国债 -4.71%	贵金属 -1.71%	有色金属 -1.40%		

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、RB、J、IC 和 IF 等品种。

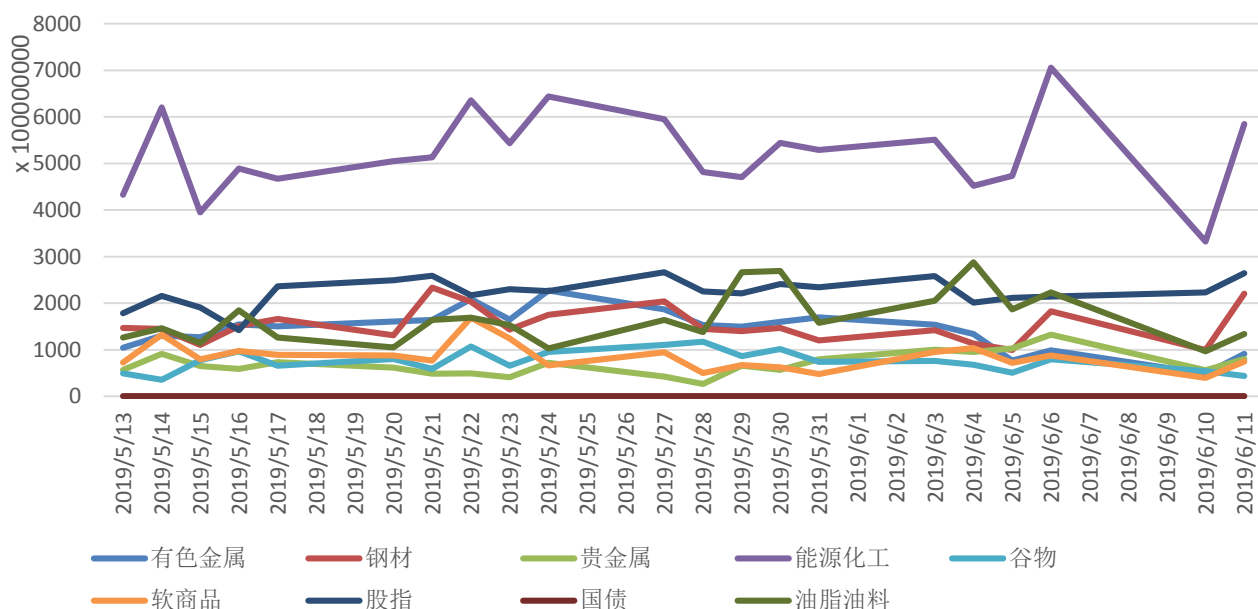
附表目录:

- 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

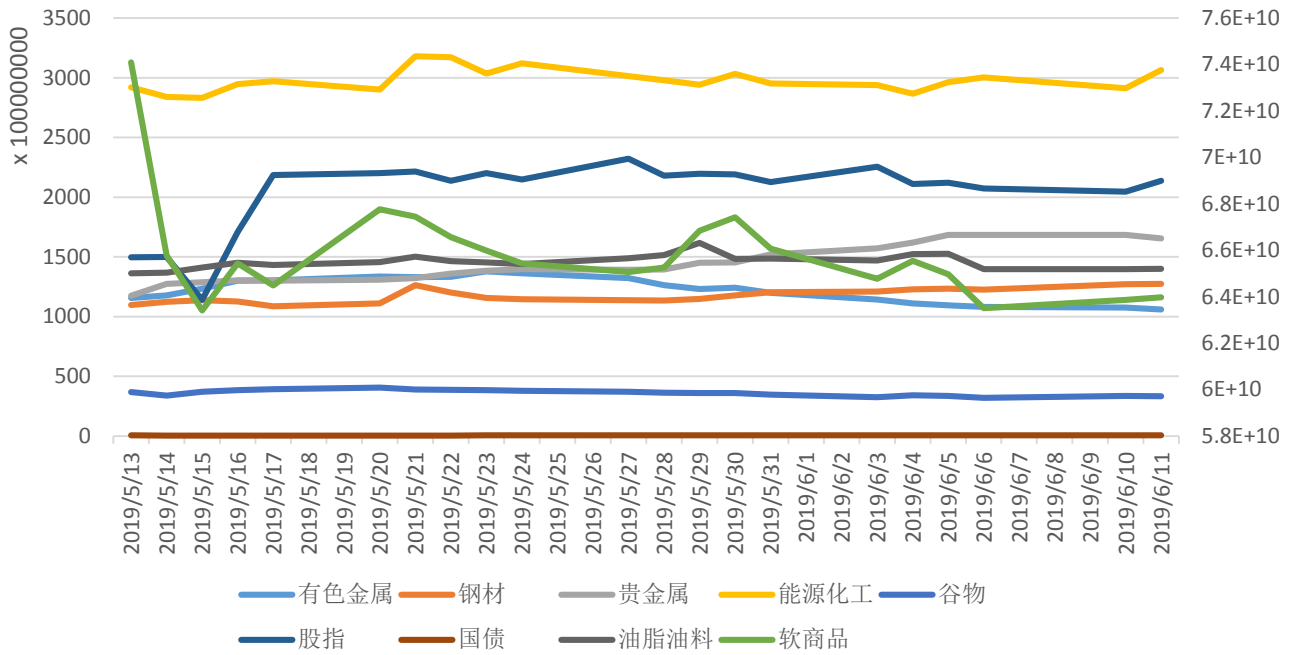
图 1 和图 2 给出板块流量资金和存量资金的走势及比较。

图 1：板块流量资金走势关系（亿元）



资料来源：中银国际期货

图 2：板块存量资金走势关系（亿元）



资料来源：中银国际期货

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

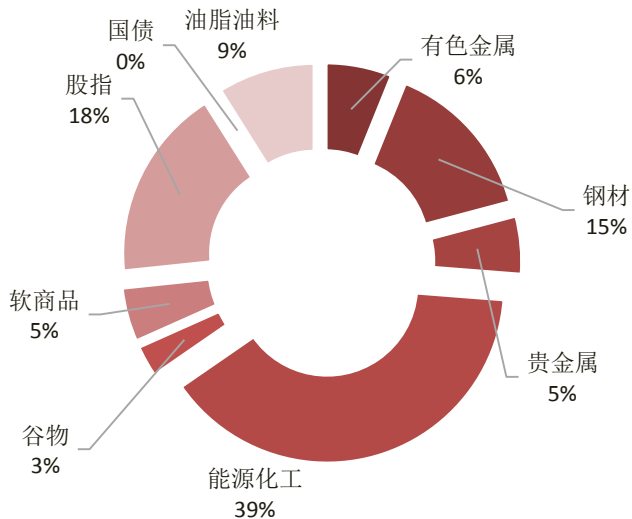
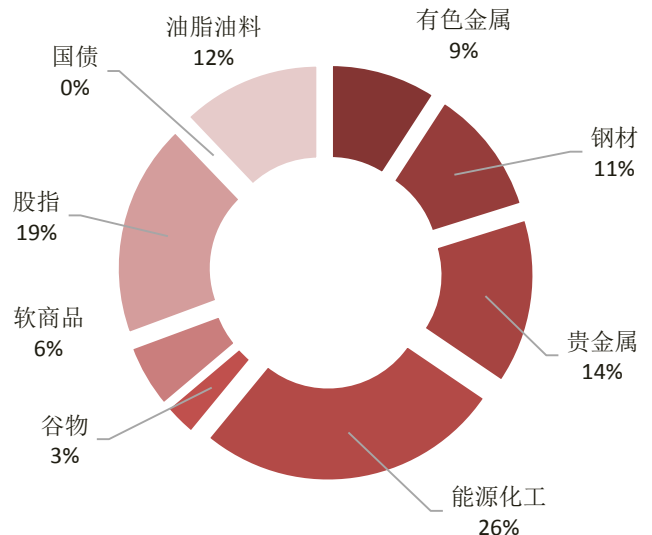


图 4：板块存量资金占比

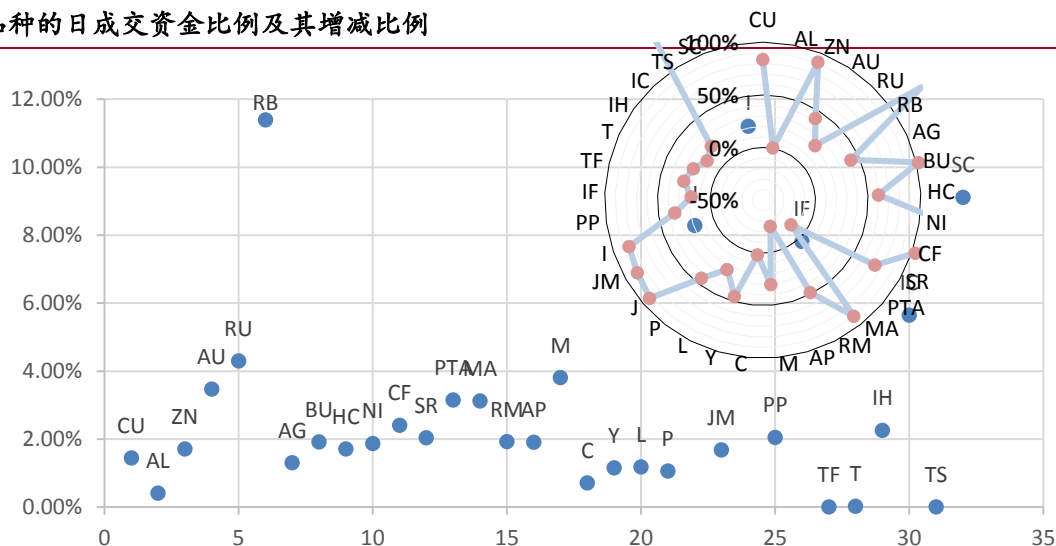


资料来源：中银国际期货

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

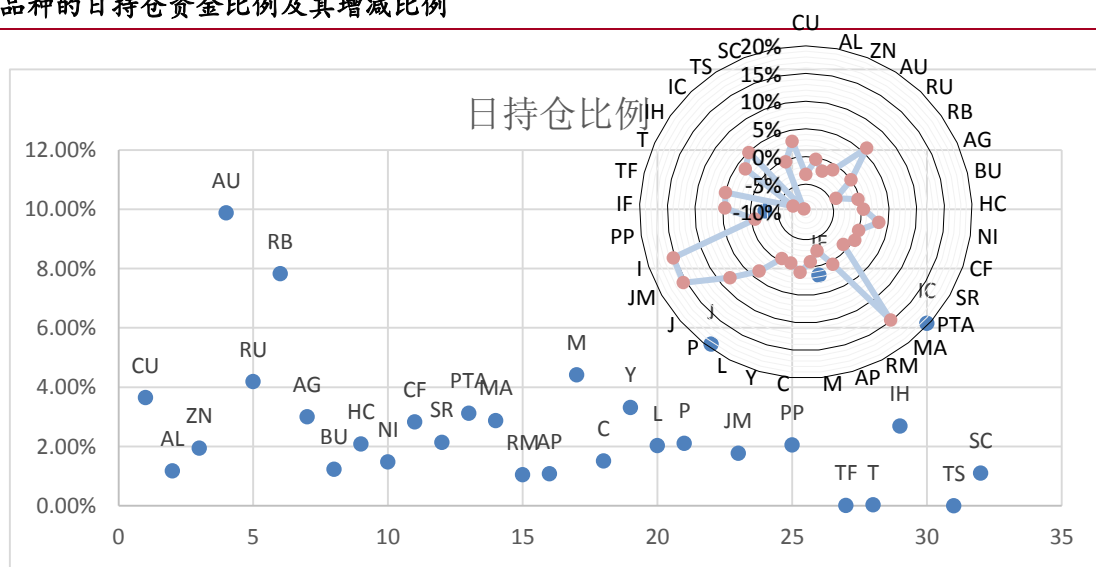


资料来源：中银国际期货

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

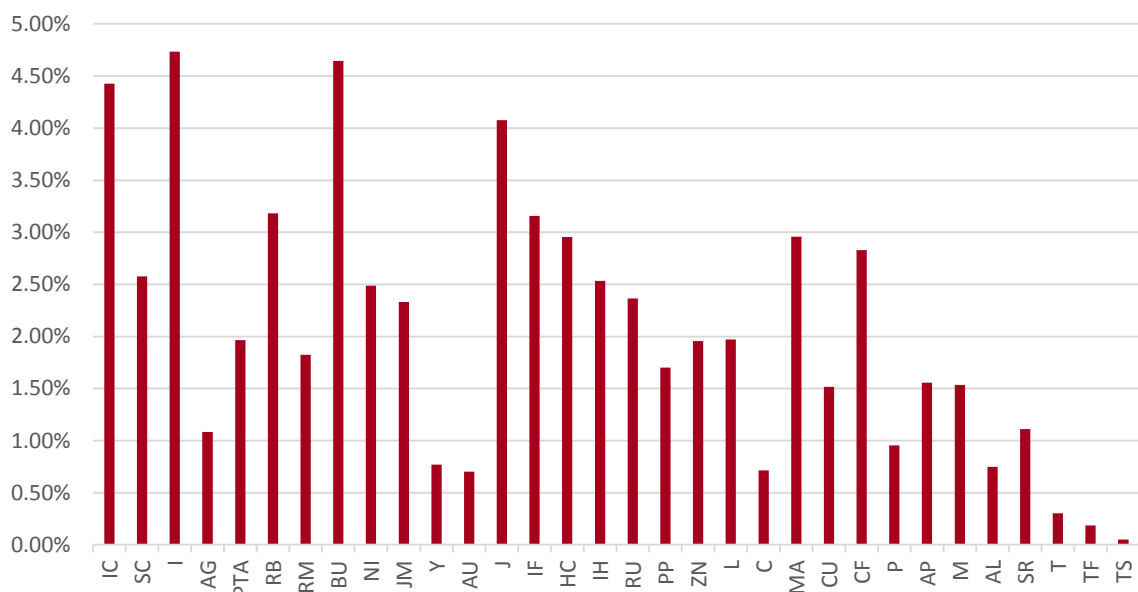


资料来源：中银国际期货

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。

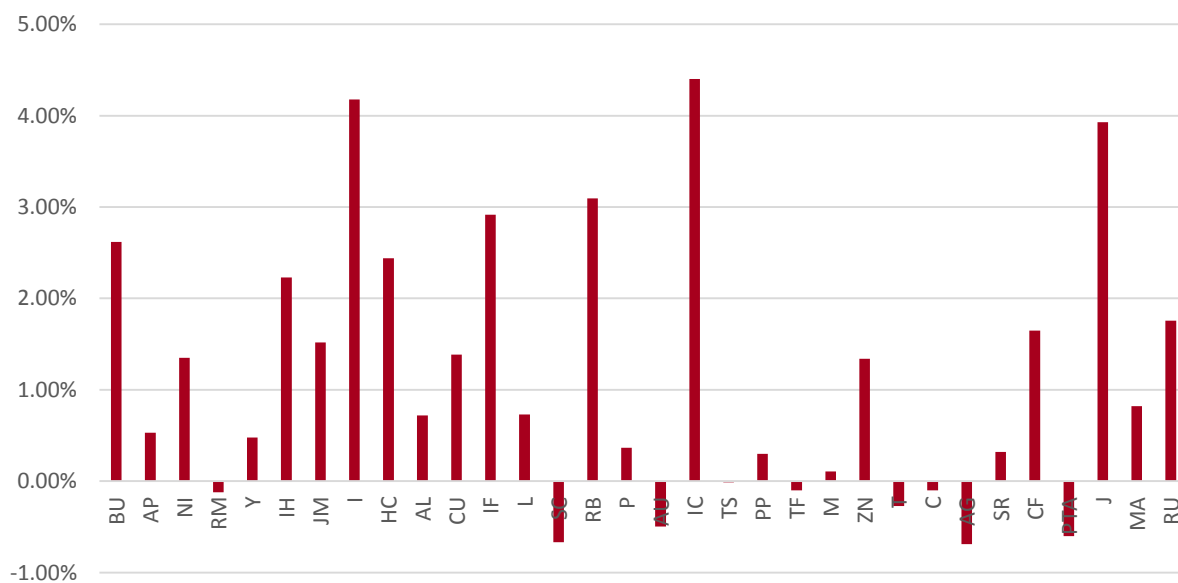
图 7：日内波动幅度



资料来源：中银国际期货

当日收盘价相对开盘价涨跌

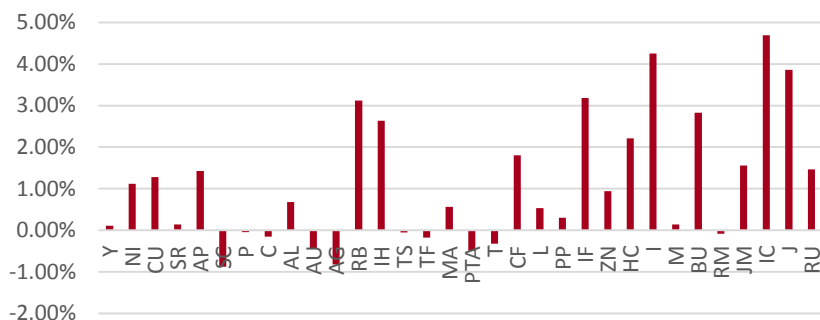
图 8：当日收盘价相对开盘价涨跌



资料来源：中银国际期货

当日涨跌幅度

图 9：当日涨跌幅度



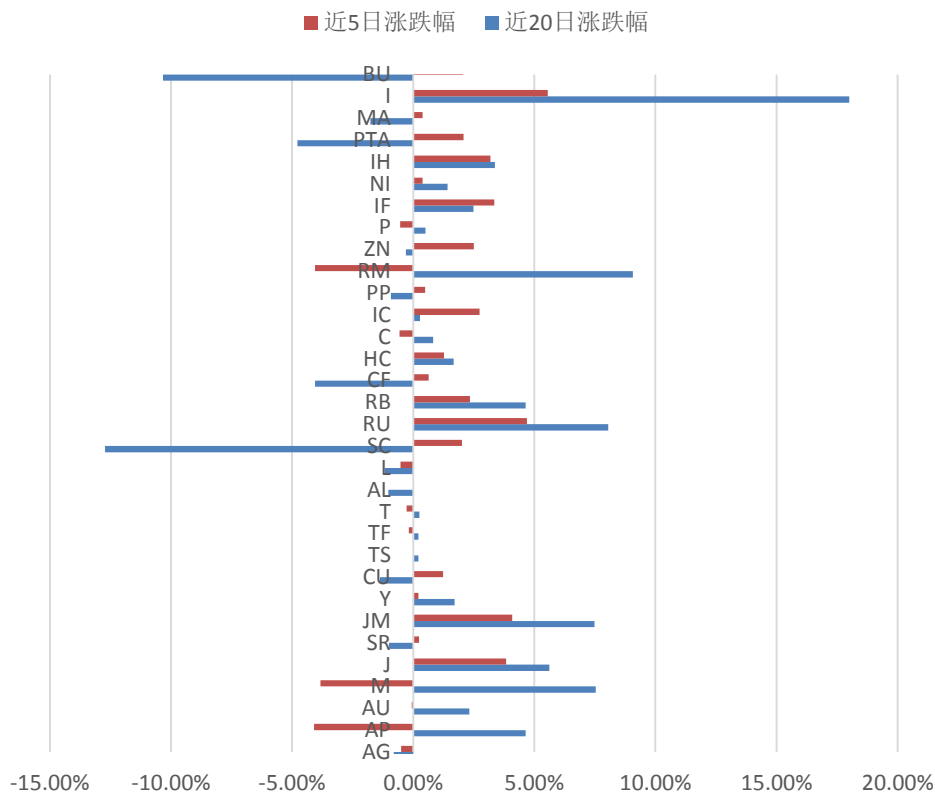
资料来源：中银国际期货

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

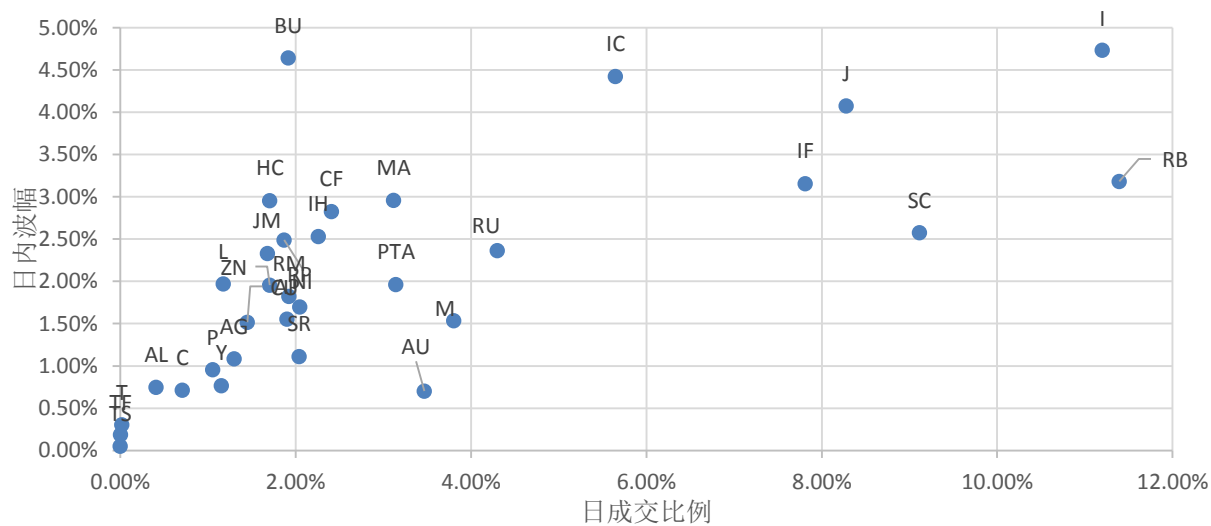


资料来源：中银国际期货

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: 中银国际期货

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
豆一1909	116468	25331	4.60	晚籼稻1911	60	23	2.61
白银1912	715036	1150051	0.62	豆粕1909	1981676	4521	438.33
铝1908	215906	208719	1.03	甲醇1909	1586188	0	--
苹果1910	152900	0	--	镍1908	196854	8993	21.89
黄金1912	423948	2730	155.29	菜油1909	261708	3500	74.77
豆二1909	32950	300	109.83	桐油1909	616766	300	2055.89
合板1910	4	0	--	铅1907	46472	19241	2.42
沥青1912	518740	72990	7.11	普麦1907	6	0	--
玉米1909	989332	85062	11.63	丙烯1909	655340	337	1944.63
棉花1909	549356	17368	31.63	纹钢1910	2624268	23005	114.07
红枣1912	125136	0	--	早籼稻1909	378	0	--
淀粉1909	140678	1276	110.25	菜粕1909	546690	408	1339.93
铜1908	200116	64883	3.08	菜籽1911	20	0	--
棉纱2001	23226	0	--	橡胶1909	431902	414840	1.04
二醇1909	489110	14626	33.44	硅铁1909	138910	5125	27.10
维板1907	864	197	4.39	锰硅1909	135188	681	198.51
玻璃1909	353176	800	441.47	锡1909	42476	7411	5.73
燃油1909	263650	13760	19.16	纸浆1909	191320	11062	17.30
卷板1910	734016	0	--	白糖1909	546858	17063	32.05
矿石1909	1680990	0	--	PTA1909	1515916	70028	21.65
焦炭1909	317276	60	5287.93	PVC1909	434340	2000	217.17
鸡蛋1909	190530	0	--	强麦1909	1286	0	--
焦煤1909	263632	0	--	豆油1909	780028	21497	36.29
粳稻1907	172	0	--	力煤1909	279602	0	--
塑料1909	686650	1637	419.46	锌1908	244604	34771	7.03
线材1907	338	0	--	原油1907	32934	3066000	0.01

资料来源：中银国际期货

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	0	800	0.00	普麦近月	6	0	--
白糖近月	428	17063	0.03	强麦近月	0	0	--
菜粕近月	106	408	0.26	燃油近月	104	13760	0.01
菜油近月	1040	3500	0.30	塑料近月	2	1637	0.00
菜籽近月	28	0	--	线材近月	0	0	--
豆二近月	0	300	0.00	橡胶近月	202	414840	0.00
豆粕近月	20852	4521	4.61	玉米近月	67834	85062	0.80
豆一近月	670	25331	0.03	纸浆近月	5340	11062	0.48
豆油近月	2	21497	0.00	郑棉近月	6196	17368	0.36
硅铁近月	30	5125	0.01	菜油近月	0	0	--
沪金近月	648	2730	0.24	甲醇近月	0	0	--
沪铝近月	53470	208719	0.26	强麦近月	0	0	--
沪镍近月	17004	8993	1.89	硬麦近月	0	0	--
沪铅近月	4490	19241	0.23	热轧卷板近月	0	0	--
沪铜近月	30390	64883	0.47	玉米淀粉近月	10	1276	0.01
沪锡近月	0	7411	0.00	动力煤近月	52446	0	--
沪锌近月	47690	34771	1.37	聚丙烯近月	2	337	0.01
沪银近月	20024	1150051	0.02	胶合板近月	0	0	--
红枣近月	125136	0	--	螺纹钢近月	3180	23005	0.14
甲醇近月	452	0	--	PTA近月	8	70028	0.00
鸡蛋近月	294	0	--	PVC近月	0	2000	0.00
粳稻近月	172	0	--	纤维板近月	78	197	0.40
焦煤近月	0	0	--	铁矿石近月	6444	0	--
焦炭近月	0	60	0.00	晚籼稻近月	38	23	1.65
沥青近月	11658	72990	0.16	乙二醇近月	4280	14626	0.29
锰硅近月	0	681	0.00	棕榈油近月	0	300	0.00
棉纱近月	0	0	--	早籼稻近月	0	0	--
苹果近月	11372	0	--	动力煤近月	0	0	--

资料来源: 中银国际期货

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

中银国际期货有限责任公司 上海世纪大道营业部

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

相关关联机构:

中银国际证券有限责任公司

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