中信期货
CITIC Futures

中信期货研究|量化数据日报

2020-09-28

资金流向雷达

投资咨询业务资格:
证监许可【2012】669 号

报告要点

市场单边总持仓 1642.1 亿保证金

资产配置团队

研究员:
张革
021-60812988
从业资格号 F3004355
投资咨询号 Z0010982

熊鹰
从业资格号 F3075662

摘要:

市场单边总持仓 1642.1 亿保证金:

1 日增量:-11.08 亿

5 日增量:-114.17 亿

10 日增量:-100.83 亿

沉淀资金增量排名前三:

按绝对量:焦炭(+1.09 亿),甲醇(+0.83 亿),玉米(+0.69 亿)

按变化率:沪锡(+9.25%),焦煤(+8.43%),甲醇(+5.11%)

活跃度排名前三:

沪镍(3.43),棕榈油(3.24),菜油(3.22)

日内资金流向情况:

K 线收阳对应资金流入:无

K 线收阳对应资金流出:棉花、沪铝、硅锰、动力煤

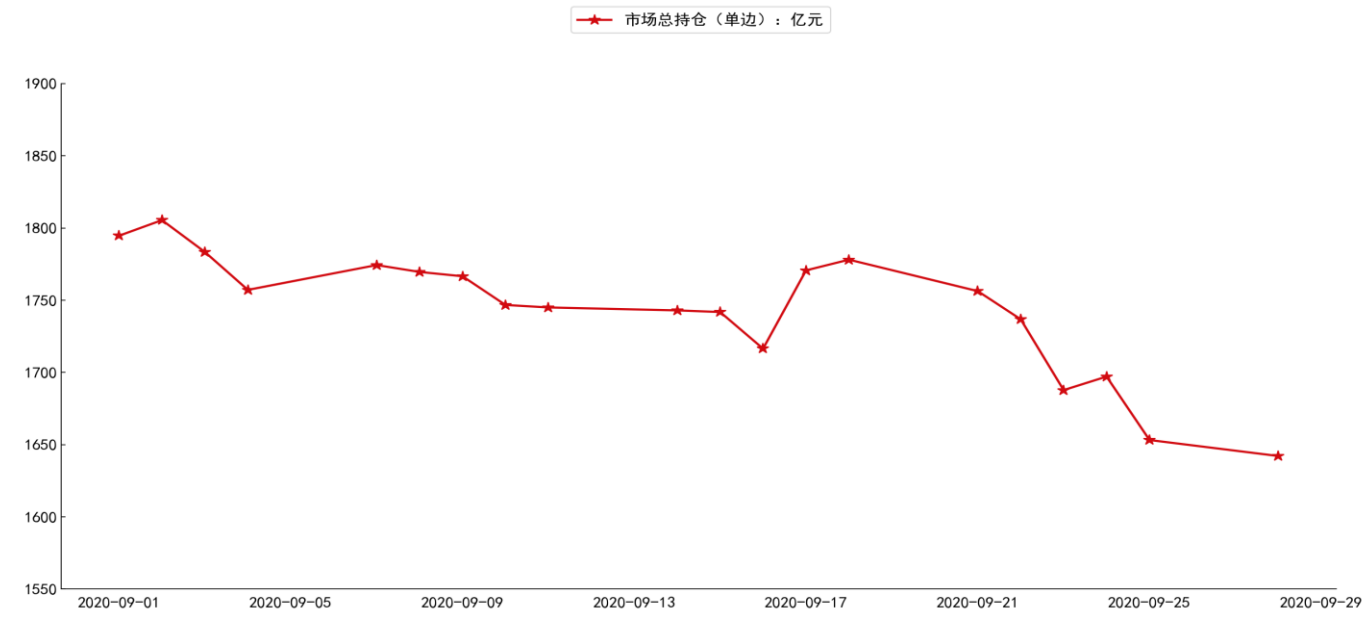
K 线收阴对应资金流入:白糖、鸡蛋、苹果、甲醇

K 线收阴对应资金流出:无

重要提示:本报告中发布的观点和信息仅供中信期货的专业投资者参考。若您并非中信期货客户中的专业投资者,为控制投资风险,请取消订阅、接收或使用本报告的任何信息。本报告难以设置访问权限,若给您造成不便,敬请谅解。我司不会因为关注、收到或阅读本报告内容而视相关人员为客户;市场有风险,投资需谨慎。

一、 市场总持仓保证金

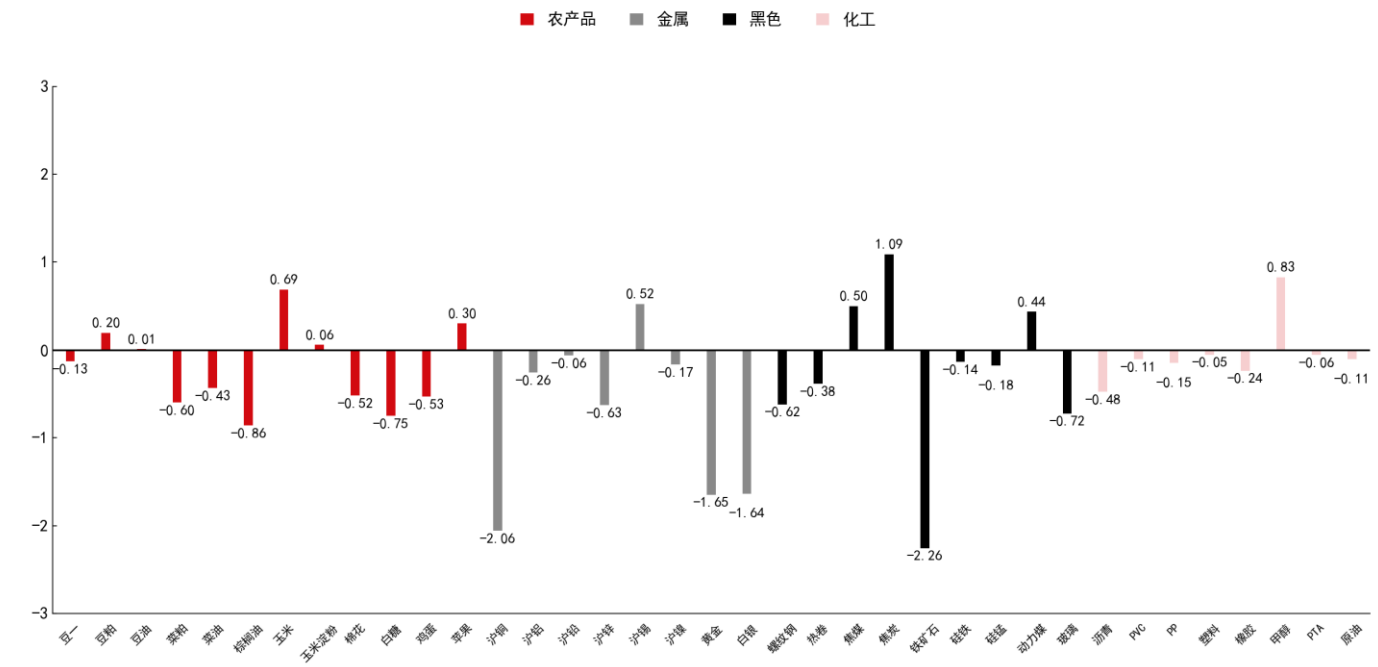
图表 1：市场总持仓保证金变化



资料来源：Wind 中信期货研究部

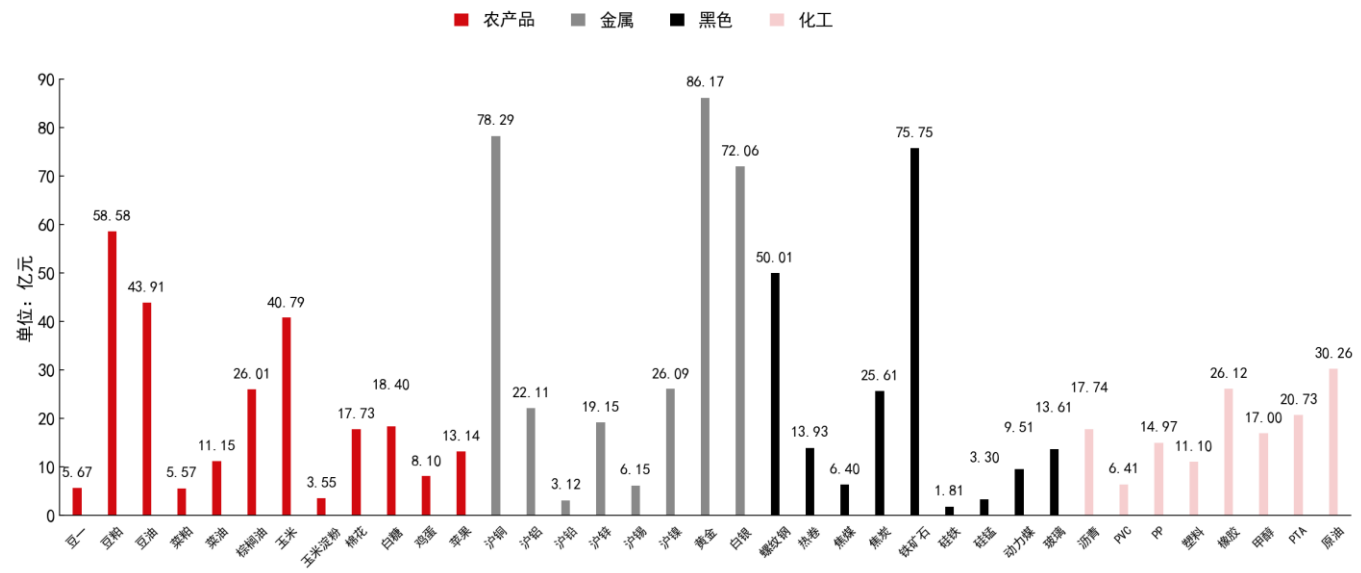
二、 当日沉淀资金变化

图表 2：主要交易品种当日沉淀资金变化



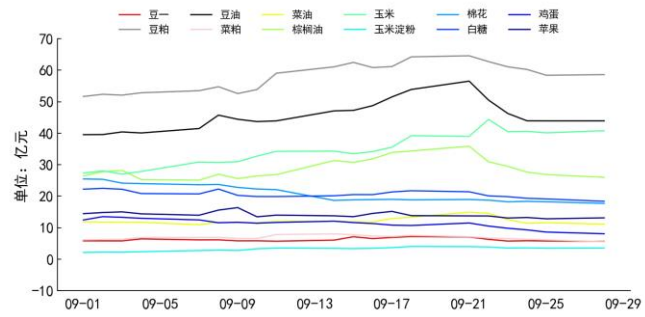
资料来源：Wind 中信期货研究部

图表 3：主要交易品种当日沉淀资金



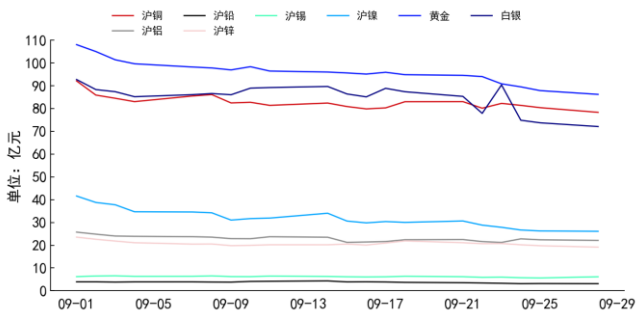
资料来源：Wind 中信期货研究部

图表 4：农产品板块



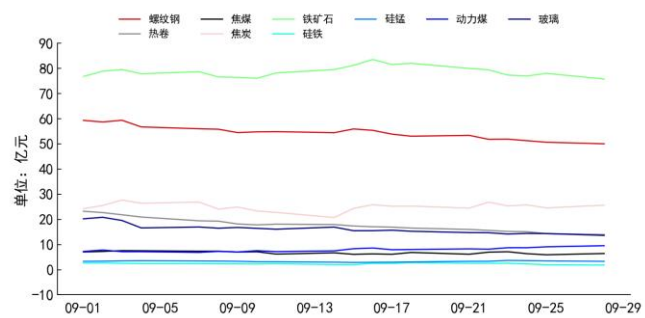
资料来源：Wind 中信期货研究部

图表 5：有色金属和贵金属板块



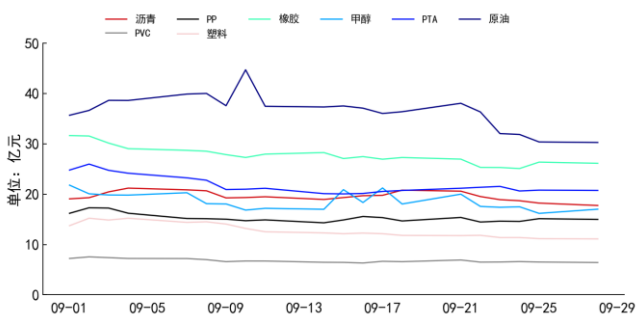
资料来源：Wind 中信期货研究部

图表 6：黑色建材板块



资料来源：Wind 中信期货研究部

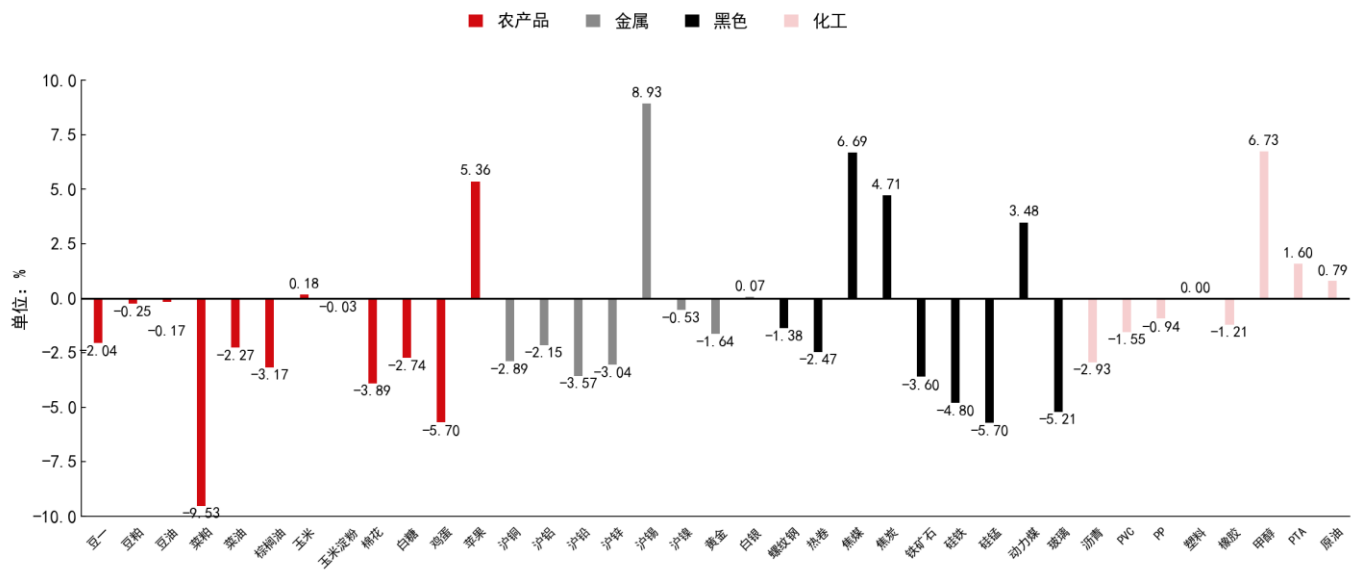
图表 7：能源化工板块



资料来源：Wind 中信期货研究部

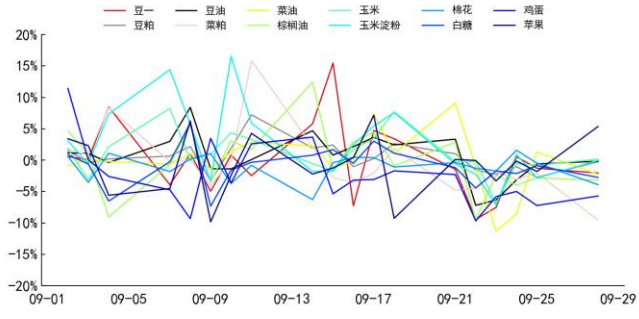
三、 当日持仓量变化

图表 8：主要交易品种当日持仓量变化



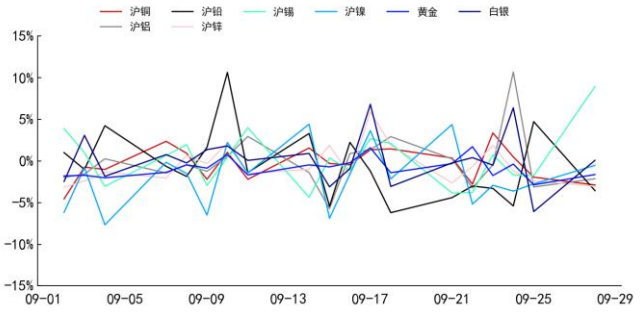
资料来源：Wind 中信期货研究部

图表 9：农产品板块



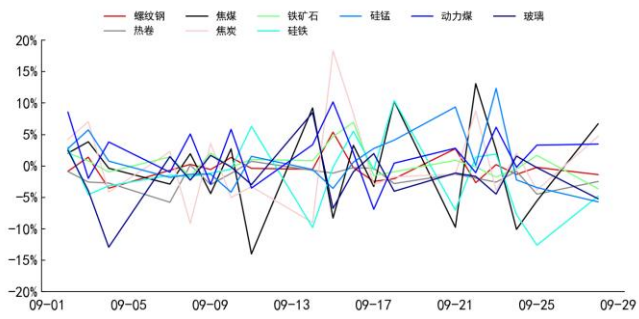
资料来源：Wind 中信期货研究部

图表 10：有色金属和贵金属板块



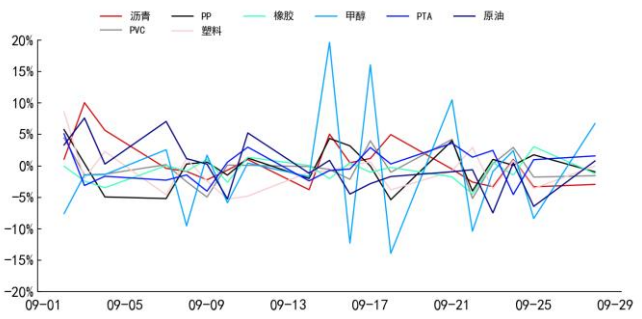
资料来源：Wind 中信期货研究部

图表 11：黑色建材板块



资料来源：Wind 中信期货研究部

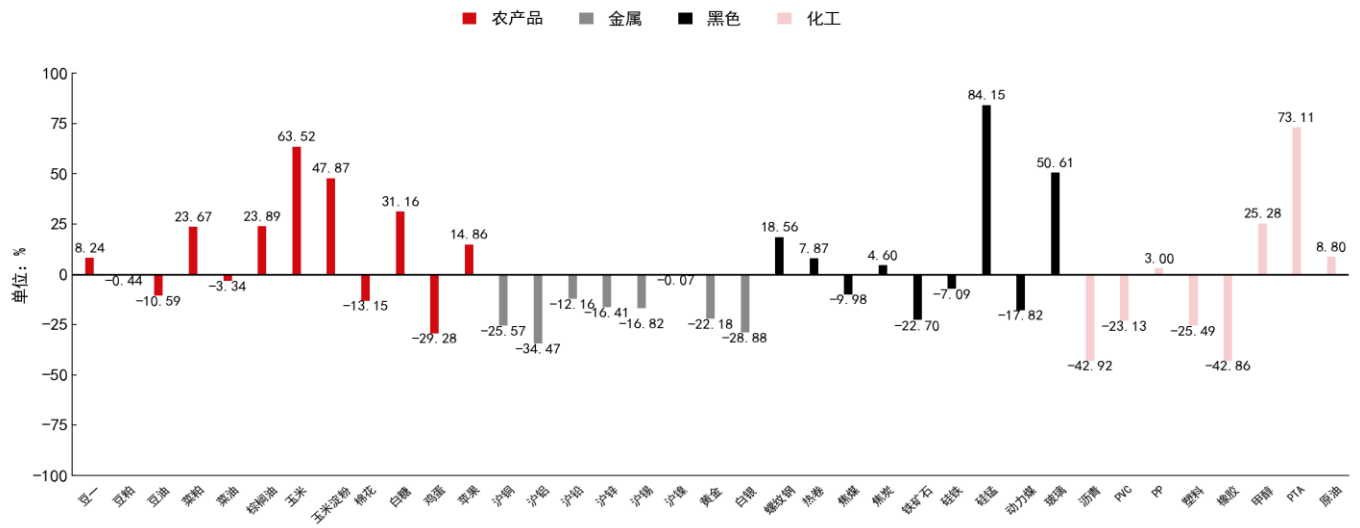
图表 12：能源化工板块



资料来源：Wind 中信期货研究部

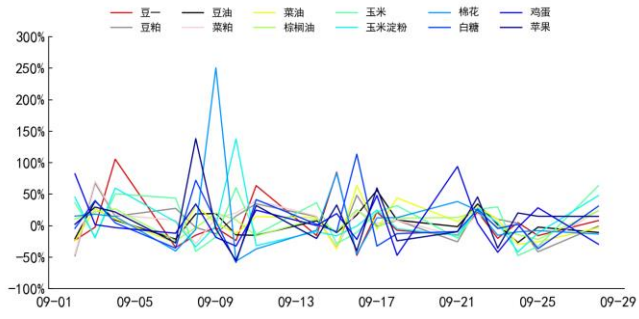
四、 当日成交量变化

图表 13：主要交易品种当日成交量变化



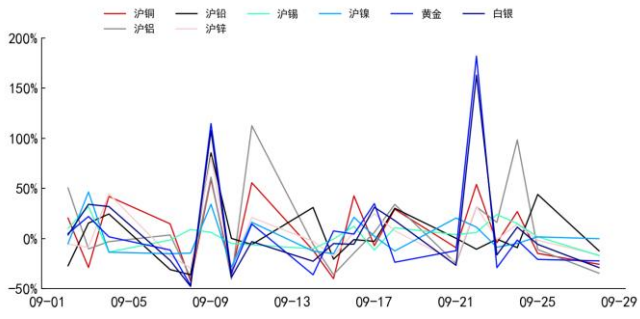
资料来源：Wind 中信期货研究部

图表 14：农产品板块



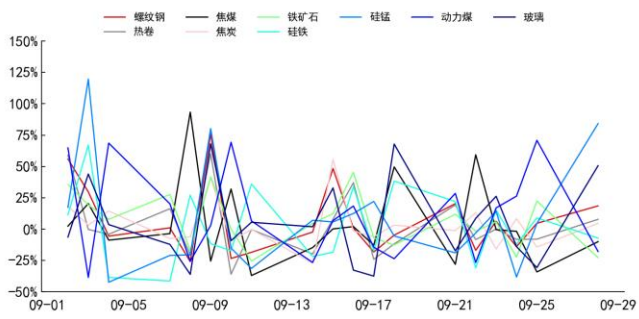
资料来源：Wind 中信期货研究部

图表 15：有色金属和贵金属板块



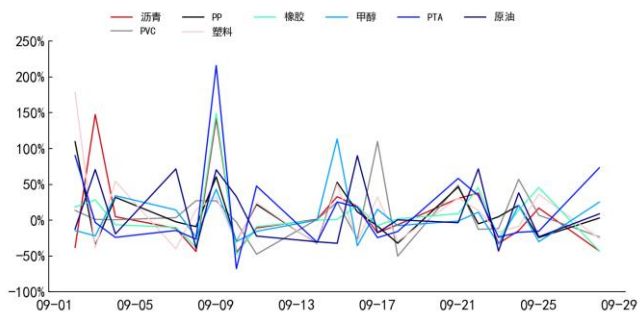
资料来源：Wind 中信期货研究部

图表 16：黑色建材板块



资料来源：Wind 中信期货研究部

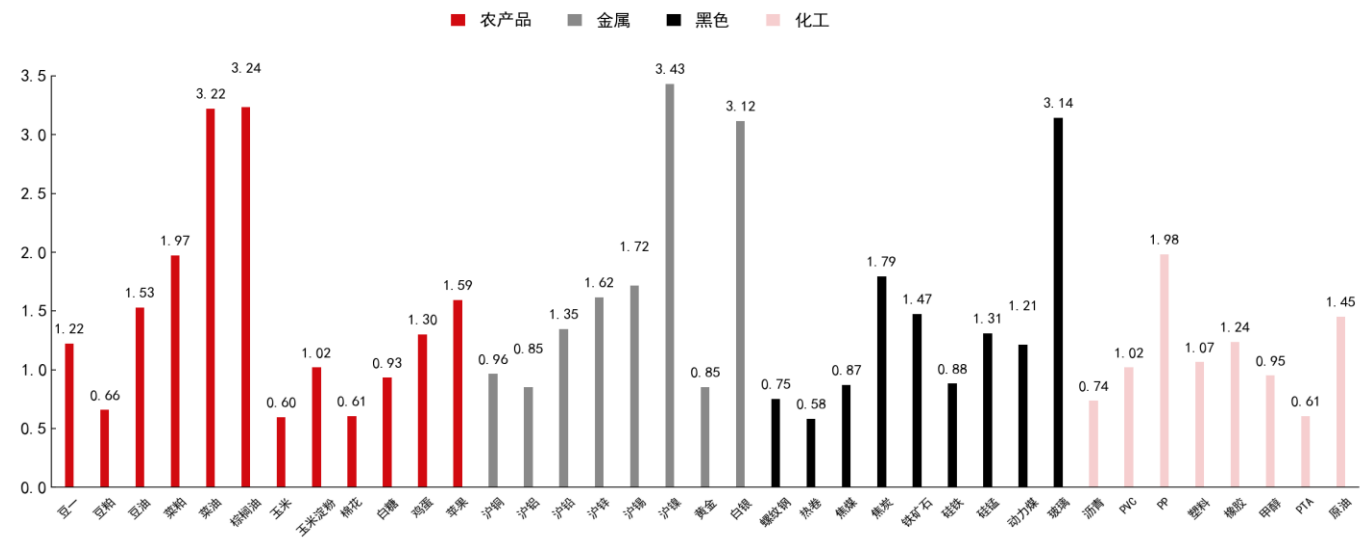
图表 17：能源化工板块



资料来源：Wind 中信期货研究部

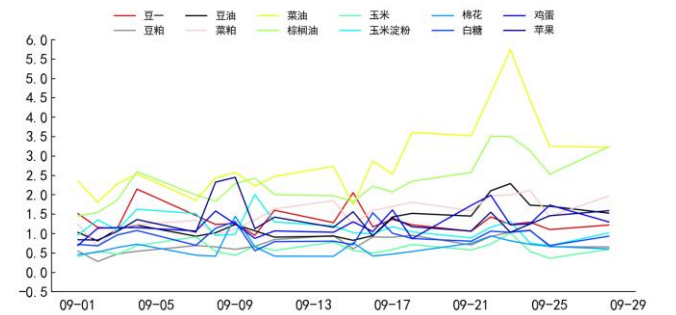
五、 当日活跃度

图表 18：主要交易品种当日活跃度



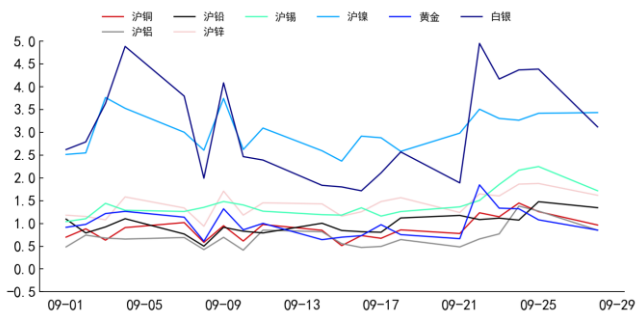
资料来源：Wind 中信期货研究部

图表 19：农产品板块



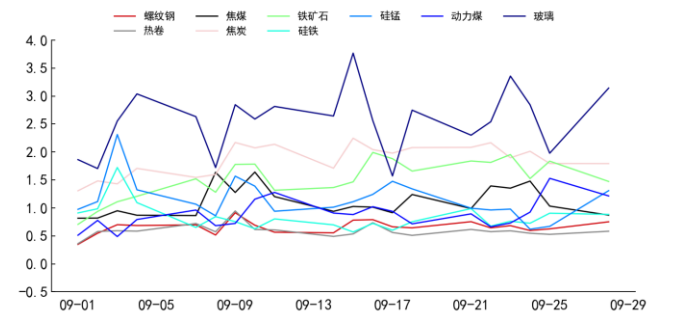
资料来源：Wind 中信期货研究部

图表 20：有色金属和贵金属板块



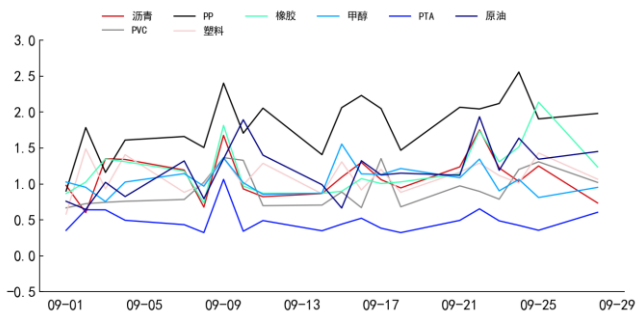
资料来源：Wind 中信期货研究部

图表 21：黑色建材板块



资料来源：Wind 中信期货研究部

图表 22：能源化工板块



资料来源：Wind 中信期货研究部

六、 日内资金流向

图表 23：日内资金流向

	多头增仓	多头减仓	空头增仓	空头减仓	资金净流向	K线实体	幅度
豆一	11133	11423	9327	10767	0.015	-7	-0.16%
豆粕	75368	77321	59938	73480	0.017	13	0.42%
豆油	46473	51961	51083	54150	-0.008	-22	-0.32%
菜粕	39627	48831	30444	41412	0.026	-9	-0.38%
菜油	35665	37232	36574	36044	0.000	-40	-0.45%
棕榈油	57780	61896	58702	60884	0.000	-22	-0.37%
玉米	68273	71413	62783	77993	-0.001	40	1.65%
玉米淀粉	10530	7270	9172	9570	-0.008	49	1.80%
棉花	8217	16348	9722	18855	-0.020	105	0.83%
白糖	26722	35805	22267	23721	0.039	-71	-1.36%
鸡蛋	26882	30607	24929	28268	0.015	-34	-0.94%
苹果	30545	23922	26351	18341	0.034	-133	-1.79%
沪铜	6998	7634	7445	7915	-0.005	420	0.83%
沪铝	7526	7281	9052	12891	-0.048	155	1.11%
沪铅	1835	2209	2182	2188	-0.007	450	3.09%
沪锌	11733	11204	11664	13403	-0.009	140	0.74%
沪锡	619	1193	758	972	0.002	2220	1.59%
沪镍	23232	23871	24406	23808	-0.002	270	0.24%
黄金	4329	4814	3923	5280	0.000	0.92	0.23%
白银	63189	68596	65350	66132	0.000	-46	-0.93%
螺纹钢	63012	71572	67019	72771	-0.004	22	0.63%
热卷	11481	14591	10370	16936	-0.006	-2	-0.05%
焦煤	7041	1866	6947	2176	-0.004	21	1.69%
焦炭	21338	11079	19462	9702	0.018	-6	-0.31%
铁矿石	43499	63497	47189	57578	0.003	5	0.65%
硅铁	1350	3939	947	4387	-0.002	56	0.99%
硅锰	14954	17248	15417	20866	-0.026	54	0.89%
动力煤	19551	19576	21722	20254	-0.009	8.2	1.34%
玻璃	144967	190471	160295	168147	0.003	9	0.54%
沥青	33834	42050	25151	33468	0.034	16	0.69%
PVC	10434	9492	14249	14509	-0.048	-5	-0.08%
PP	28102	30419	27654	31450	-0.001	-4	-0.05%
塑料	18423	19345	19155	15842	0.011	-15	-0.21%
橡胶	16132	16917	12675	14169	0.022	75	0.60%
甲醇	118258	50620	114492	39962	0.013	-22	-1.09%
PTA	65474	65797	58182	72854	0.000	-62	-1.76%

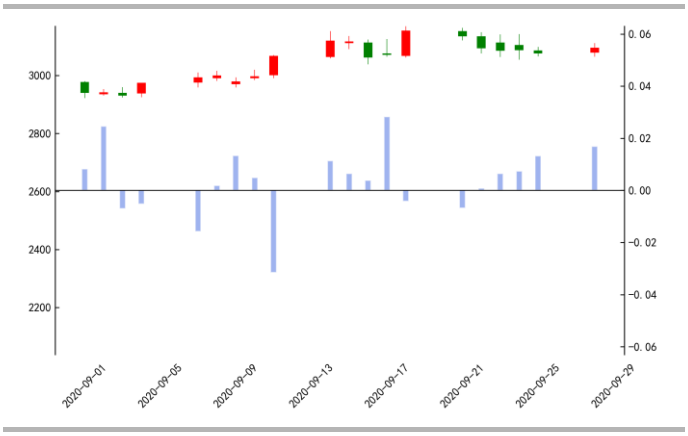
资料来源：Wind 中信期货研究部

图表 24：豆一资金净流向



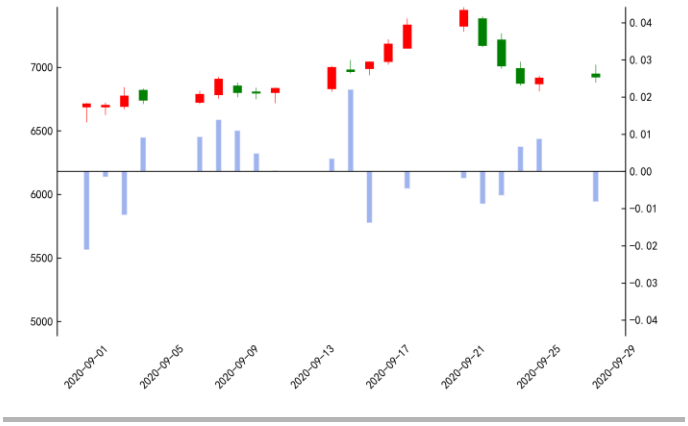
资料来源：Wind 中信期货研究部

图表 25：豆粕资金净流向



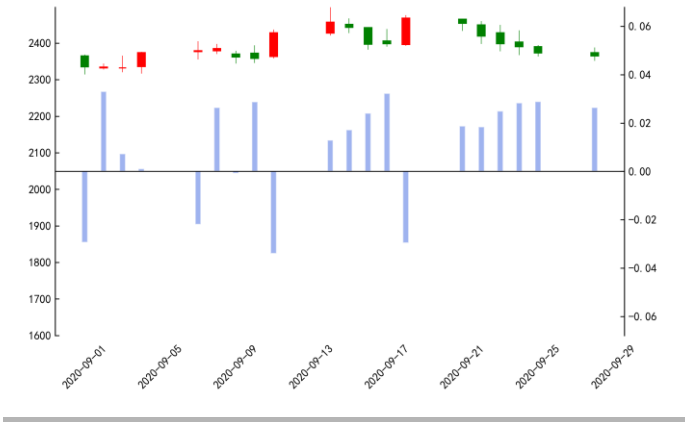
资料来源：Wind 中信期货研究部

图表 26：豆油资金净流向



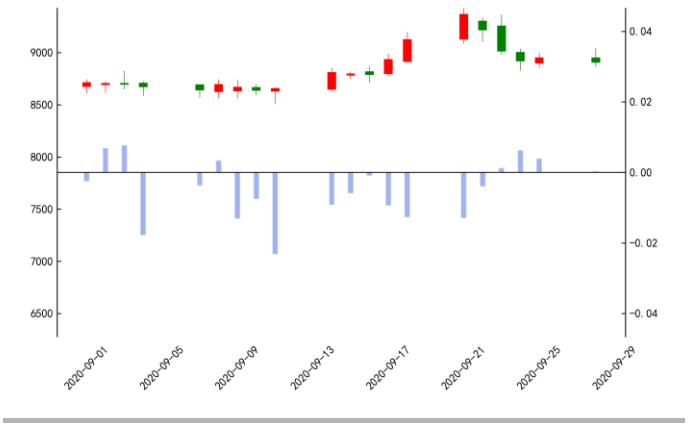
资料来源：Wind 中信期货研究部

图表 27：菜粕资金净流向



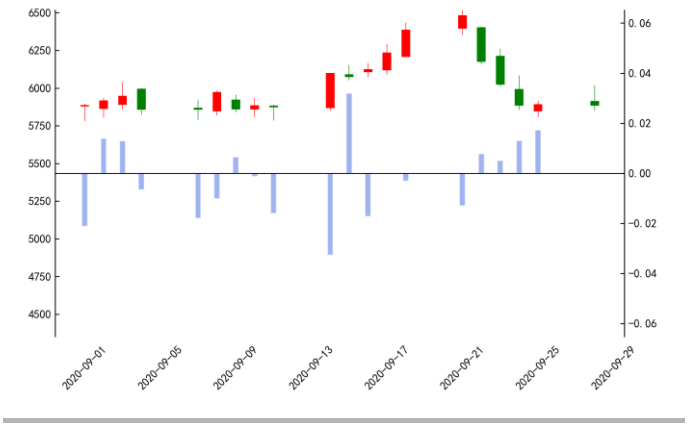
资料来源：Wind 中信期货研究部

图表 28：菜油资金净流向



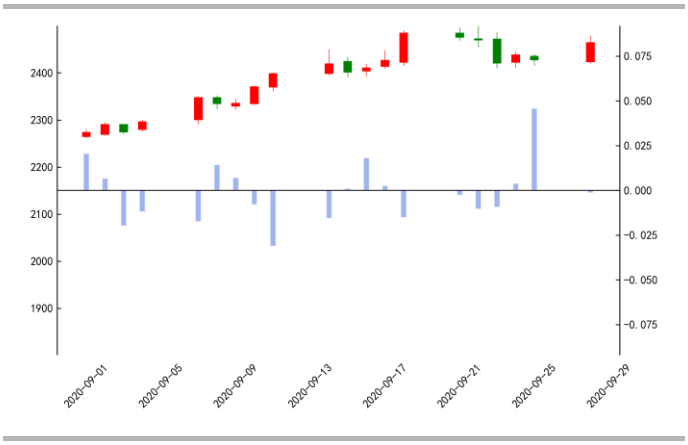
资料来源：Wind 中信期货研究部

图表 29：棕榈油资金净流向



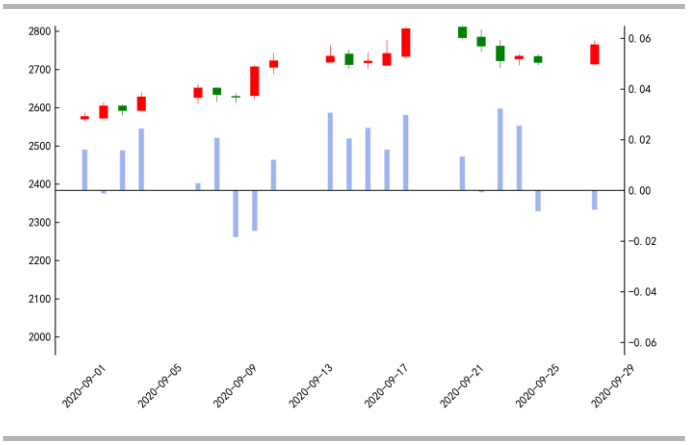
资料来源：Wind 中信期货研究部

图表 30：玉米资金净流向



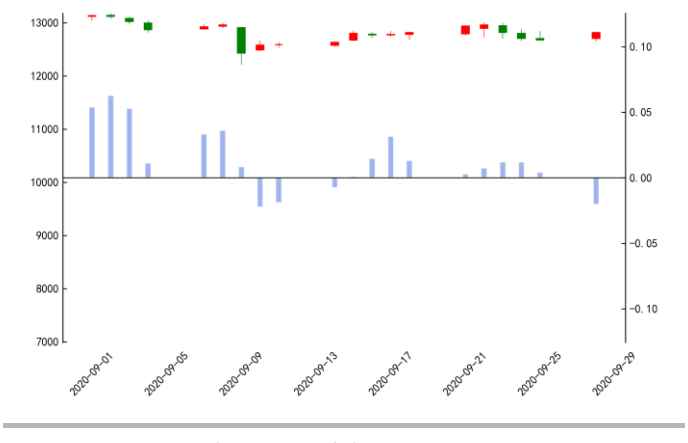
资料来源：Wind 中信期货研究部

图表 31：玉米淀粉资金净流向



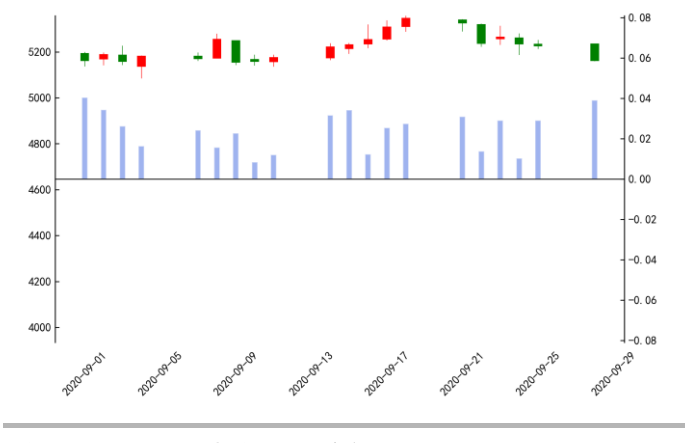
资料来源：Wind 中信期货研究部

图表 32：棉花资金净流向



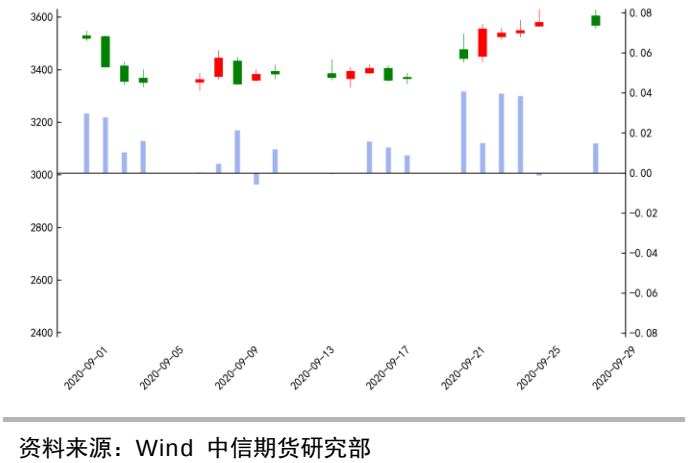
资料来源：Wind 中信期货研究部

图表 33：白糖资金净流向



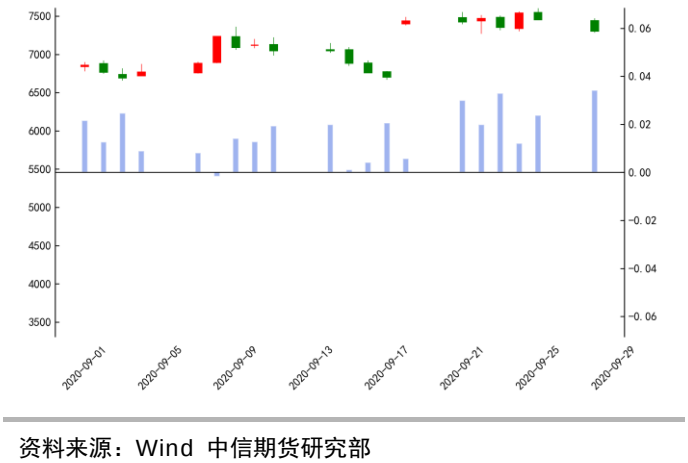
资料来源：Wind 中信期货研究部

图表 34：鸡蛋资金净流向



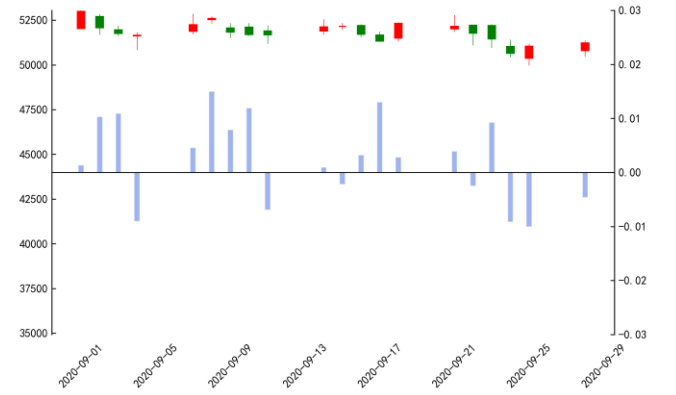
资料来源：Wind 中信期货研究部

图表 35：苹果资金净流向



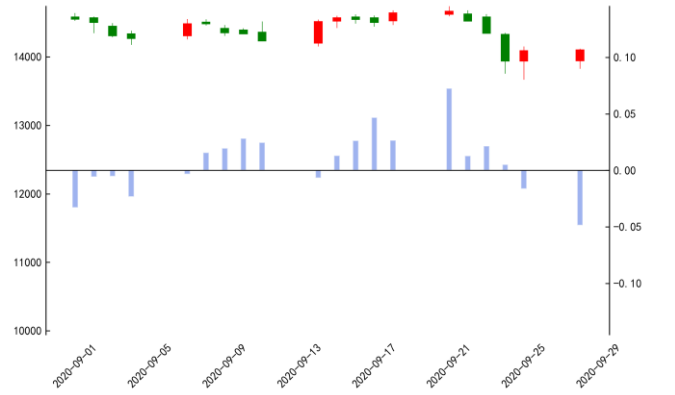
资料来源：Wind 中信期货研究部

图表 36：沪铜资金净流向



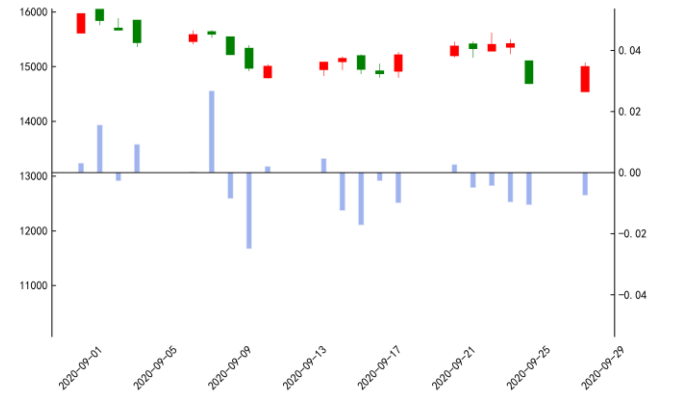
资料来源：Wind 中信期货研究部

图表 37：沪铝资金净流向



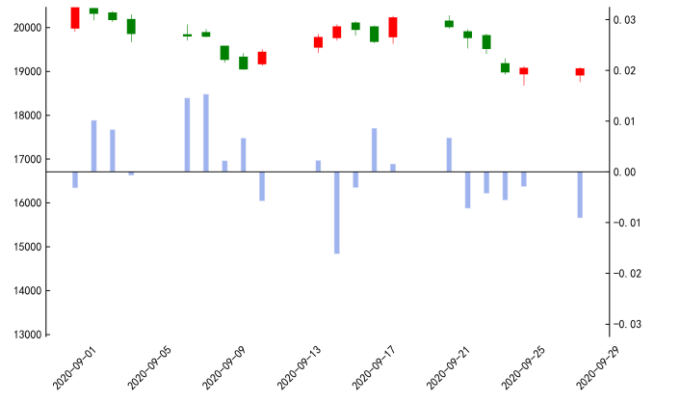
资料来源：Wind 中信期货研究部

图表 38：沪铅资金净流向



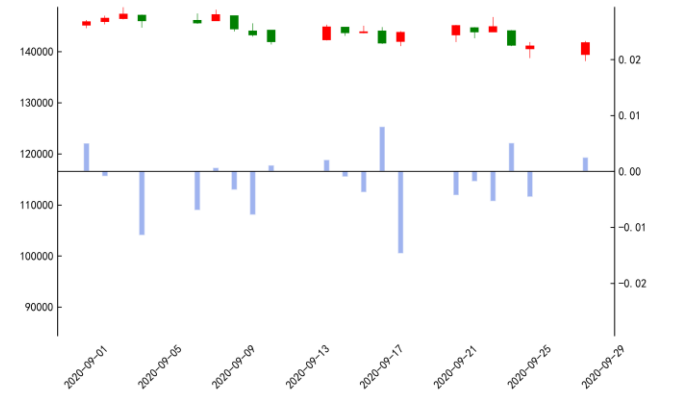
资料来源：Wind 中信期货研究部

图表 39：沪锌资金净流向



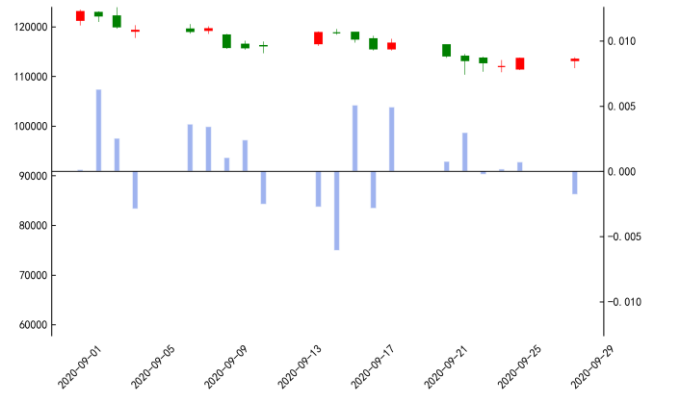
资料来源：Wind 中信期货研究部

图表 40：沪锡资金净流向



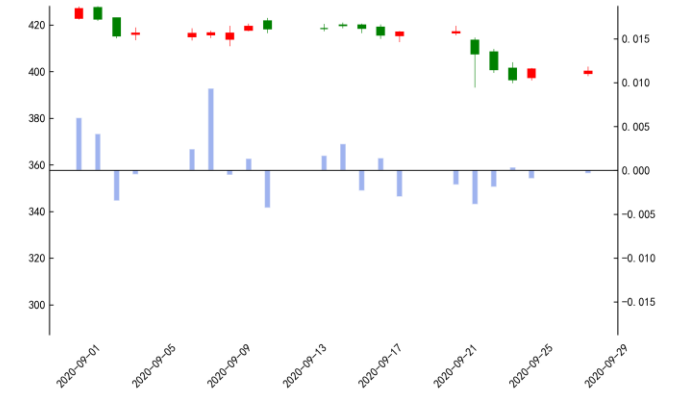
资料来源：Wind 中信期货研究部

图表 41：沪镍资金净流向



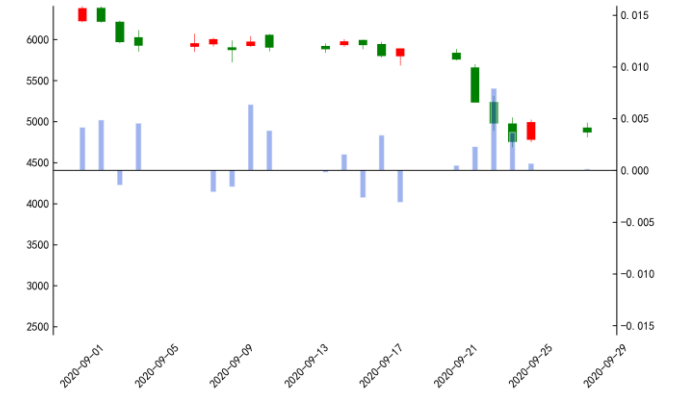
资料来源：Wind 中信期货研究部

图表 42：黄金资金净流向



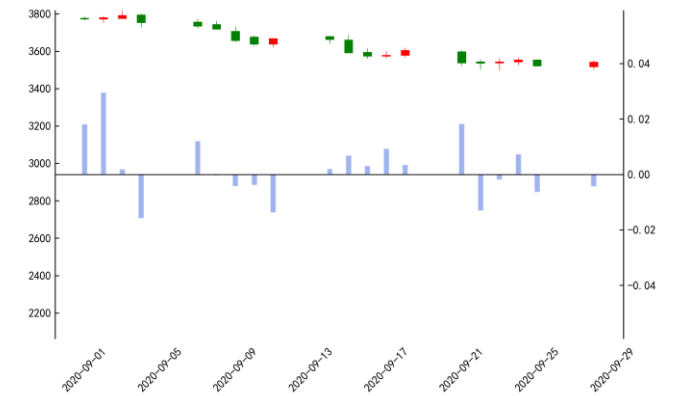
资料来源：Wind 中信期货研究部

图表 43：白银资金净流向



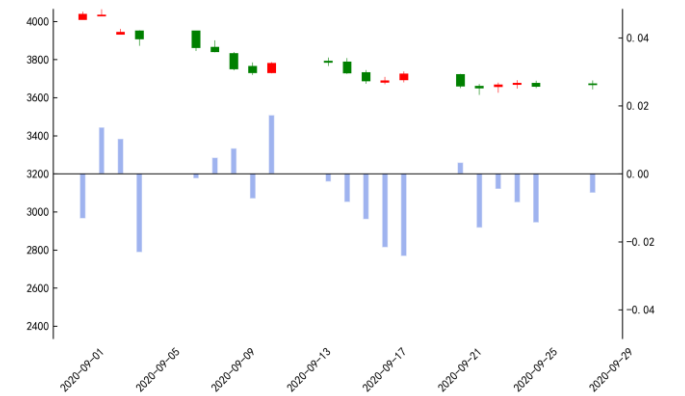
资料来源：Wind 中信期货研究部

图表 44：螺纹钢资金净流向



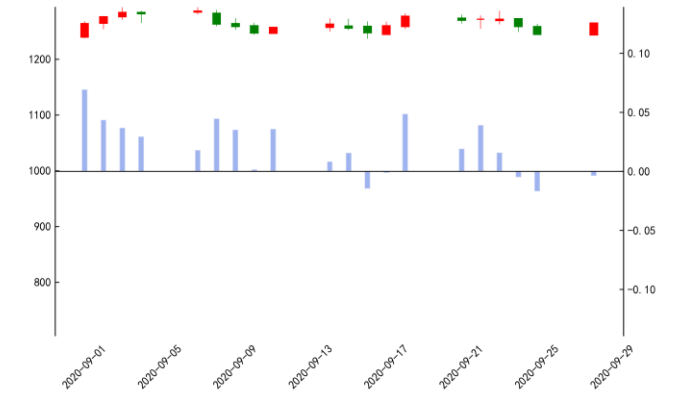
资料来源：Wind 中信期货研究部

图表 45：热卷资金净流向



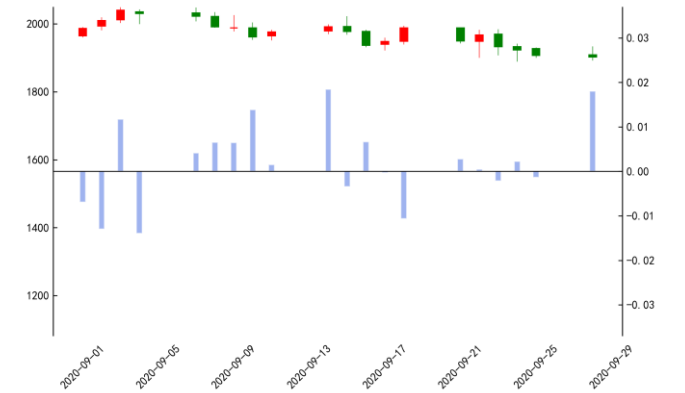
资料来源：Wind 中信期货研究部

图表 46：焦煤资金净流向



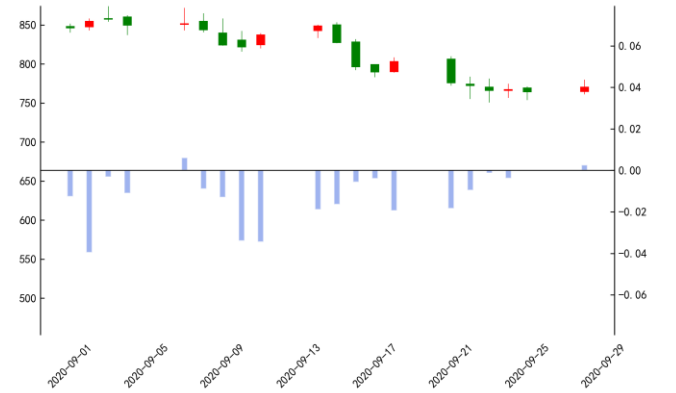
资料来源：Wind 中信期货研究部

图表 47：焦炭资金净流向



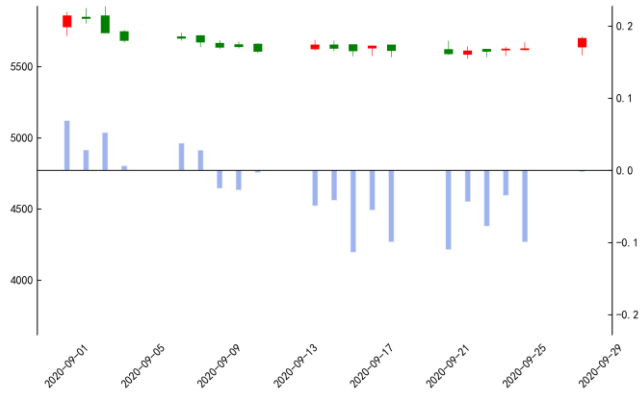
资料来源：Wind 中信期货研究部

图表 48：铁矿石资金净流向



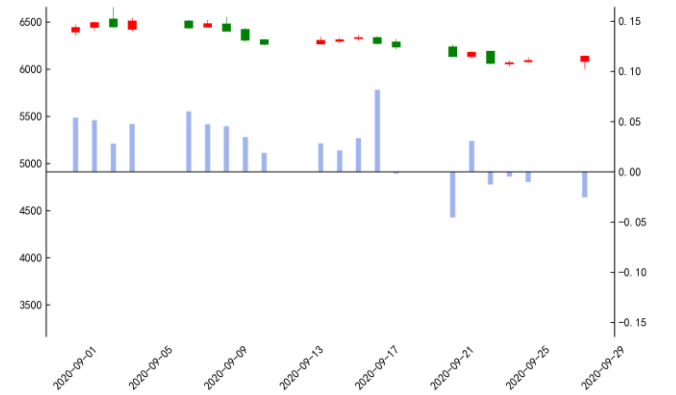
资料来源：Wind 中信期货研究部

图表 49：硅铁资金净流向



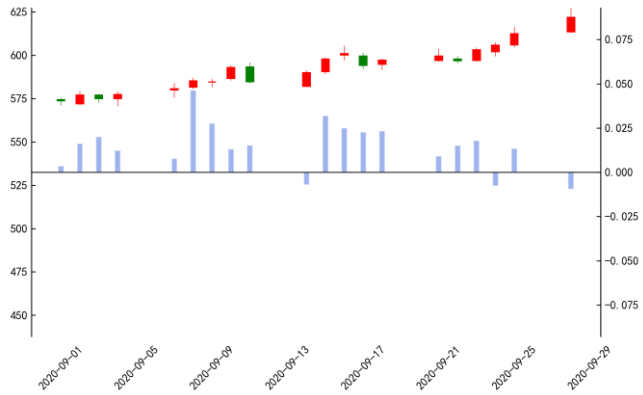
资料来源：Wind 中信期货研究部

图表 50：硅锰资金净流向



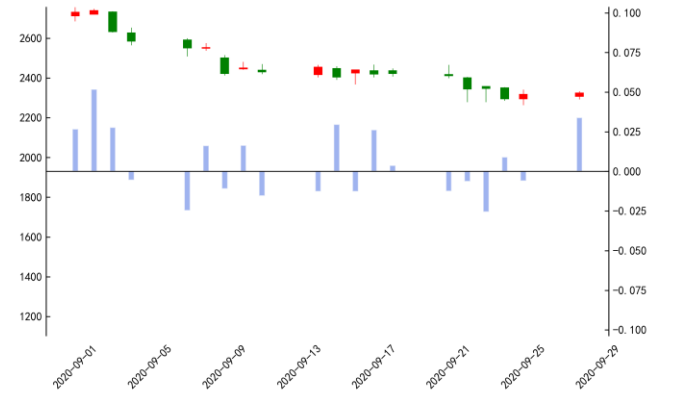
资料来源：Wind 中信期货研究部

图表 51：动力煤资金净流向



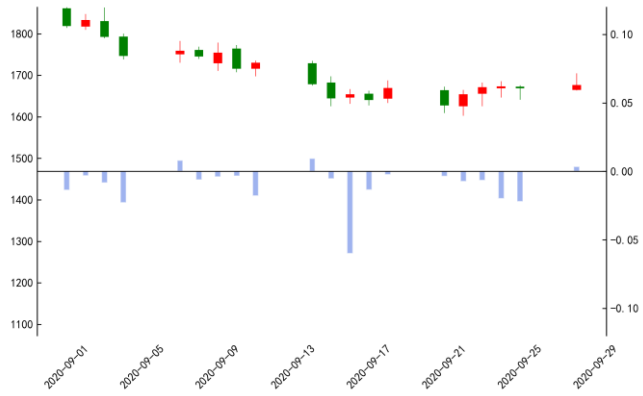
资料来源：Wind 中信期货研究部

图表 52：沥青资金净流向



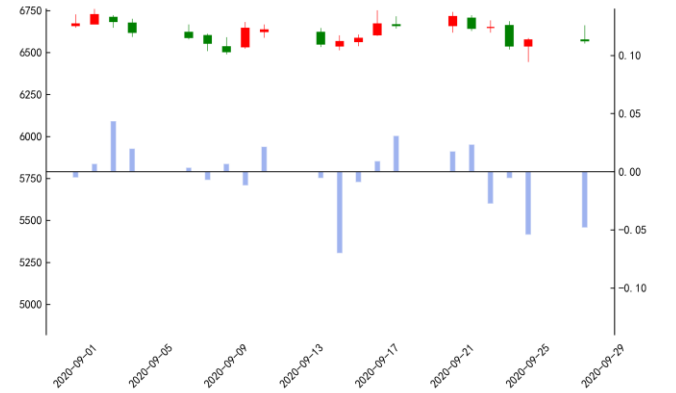
资料来源：Wind 中信期货研究部

图表 53：玻璃资金净流向



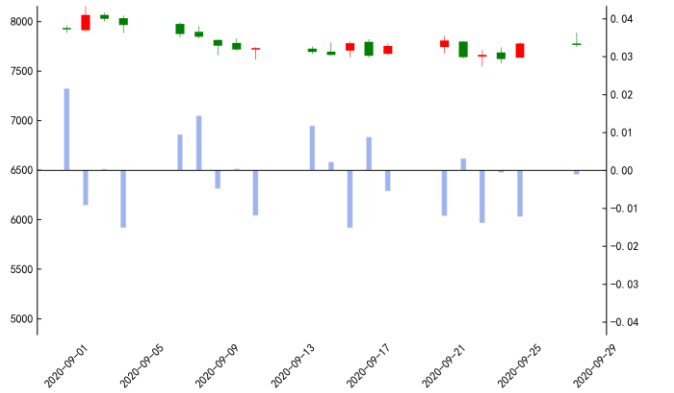
资料来源：Wind 中信期货研究部

图表 54：PVC 资金净流向



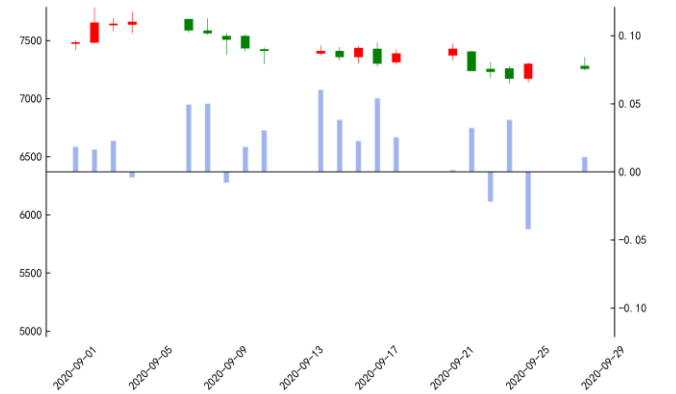
资料来源：Wind 中信期货研究部

图表 55：PP 资金净流向



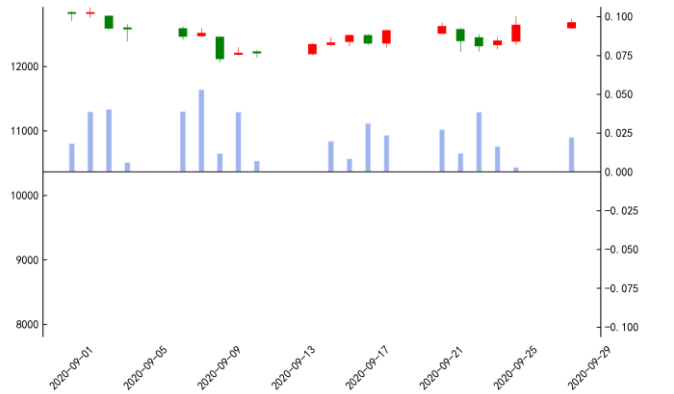
资料来源：Wind 中信期货研究部

图表 56：塑料资金净流向



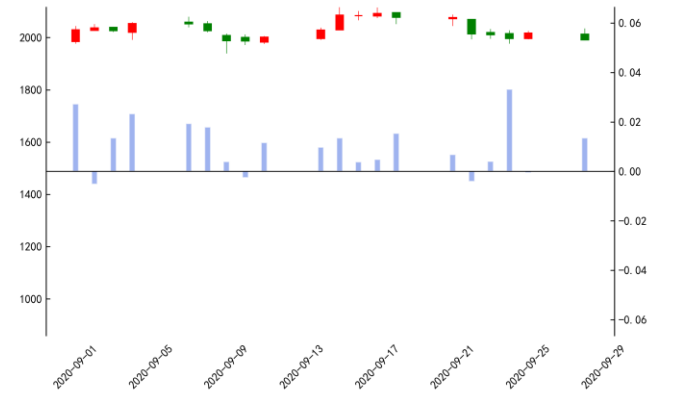
资料来源：Wind 中信期货研究部

图表 57：橡胶资金净流向



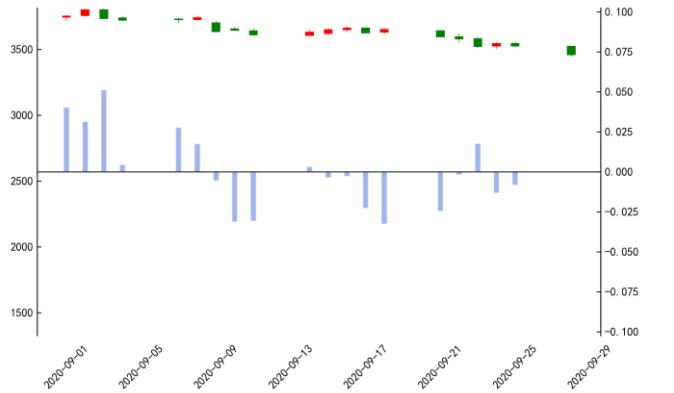
资料来源：Wind 中信期货研究部

图表 58：甲醇资金净流向



资料来源：Wind 中信期货研究部

图表 59：PTA 资金净流向



资料来源：Wind 中信期货研究部

说明：

1、资金流向基于各品种主力合约日内 Tick 数据计算，以持仓变化手数为单位，成交价大于等于盘口卖价记为主动买入，成交价小于等于盘口买价记为主动卖出；主动买入增仓与主动卖出减仓记为正向（价格与持仓同向变化），主动买入减仓与主动卖出增仓记为负向（价格与持仓反向变化），净流向即为二者之差；为了便于比较，将净流向与成交量的比值定义为当日资金流向指数。

2、通常连续的行情由资金推动，对于一段涨势来说，多头增仓的作用大于空头减仓，对于一段跌势来说，空头增仓的作大于多头减仓；因此大部分时间日 K 线阳线伴随资金正流向，阴线伴随资金负流向。在拐点位置，尤其连续涨势后出现大幅正流向，并伴随日 K 线阴线，一般预示顶部来临；连续跌势后出现大幅负流向，并伴随日 K 线阳线，一般预示底部出现；日 K 线实体部分越大，同时与之方向相反的净流向幅度越大，说明资金流的背离程度严重，出现行情拐点几率越高。

免责声明

除非另有说明，本报告的著作权属中信期货有限公司。未经中信期货有限公司书面授权，任何人不得更改或以任何方式发送、复制或传播此报告的全部或部分材料、内容。除非另有说明，此报告中使用的所有商标、服务标记及标记均为中信期货有限公司的商标、服务标记及标记。中信期货有限公司不会故意或有针对性的将此报告提供给对研究报告传播有任何限制或有可能导致中信期货有限公司违法的任何国家、地区或其它法律管辖区域。

此报告所载的全部内容仅作参考之用。此报告的内容不构成对任何人的投资建议，且中信期货有限公司不因接收人收到此报告而视其为客户。

中信期货有限公司认为此报告所载资料的来源和观点的出处客观可靠，但中信期货有限公司不担保其准确性或完整性。中信期货有限公司不对因使用此报告及所载材料而造成的损失承担任何责任。此报告不应取代个人的独立判断。本报告和上述报告仅反映编写人的不同设想、见解及分析方法。本报告所载的观点并不代表中信期货有限公司或任何其附属或联营公司的立场。

此报告中所指的投资及服务可能不适合阁下，我们建议阁下如有任何疑问应咨询独立投资顾问。此报告不构成投资、法律、会计或税务建议，且不担保任何投资及策略适合阁下。此报告并不构成给予阁下的私人咨询建议。

中信期货有限公司 2020 版权所有并保留一切权利。

深圳总部

地址：深圳市福田区中心三路 8 号卓越时代广场（二期）北座 13 层 1301-1305、14 层

邮编：518048

电话：400-990-8826

传真：(0755)83241191

网址：http://www.citicsf.com