豆油增仓首位，焦煤减仓首位

投资咨询业务资格：
证监许可【2011】1289 号
研究院 量化组
研究员
陈辰
☎ 0755-23887993
✉ chenchen@htfc.com
从业资格号：F3024056
投资咨询号：Z0014257

品种流动性情况：

2020-09-21，焦煤减仓 7.27 亿元，环比减少 9.65%，位于当日全品种减仓排名首位。豆油增仓 32.62 亿元，环比增加 4.87%，位于当日全品种增仓排名首位；豆油 5 日、10 日滚动增仓最多；玻璃、原油 5 日、10 日滚动减仓最多。成交金额上，铁矿石、白银、棕榈油分别成交 1356.51 亿元、1354.59 亿元和 1028.34 亿元（环比：10.3%、-26.25%、15.23%），位于当日成交金额排名前三名。

板块流动性情况：

本报告板块划分采用 Wind 大类商品划分标准，共分为有色、油脂油料、软商品、农副产品、能源、煤焦钢矿、化工、贵金属、谷物和非金属建材 10 个板块。2020-09-21，油脂油料板块位于增仓首位；煤焦钢矿板块位于减仓首位。成交量上油脂油料、煤焦钢矿、贵金属分别成交 3817.09 亿元、2683.85 亿元和 2139.55 亿元，位于当日板块成交金额排名前三；谷物、软商品、农副产品板块成交低迷。

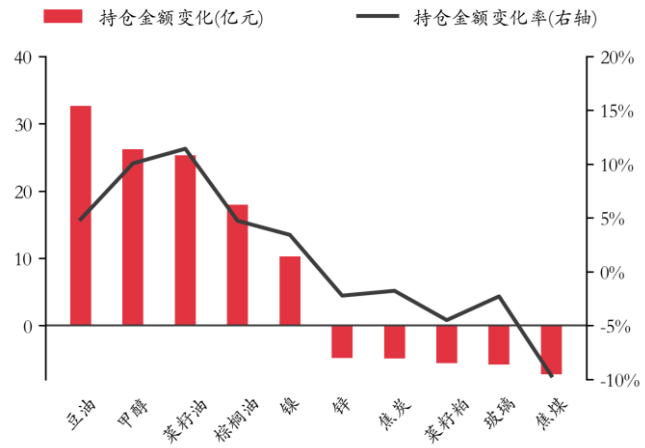
备注：本文使用的成交金额、持仓金额数据为每日收盘的时点数。

目录

图 1：前一交易日增减仓前五名品种持仓金额变化情况 3
图 2：前一交易日成交金额前十名品种成交情况 3
图 3：前一交易日各板块持仓金额变化情况 3
图 4：前一交易日各板块成交金额情况 3
图 5：5 日滚动增减仓前五名品种持仓金额变化情况 4
图 6：5 日滚动成交金额前十名品种成交情况 4
图 7：5 日滚动各板块持仓金额变化情况 4
图 8：5 日滚动各板块成交金额情况 4
图 9：10 日滚动增减仓前五名品种持仓金额变化情况 5
图 10：10 日滚动成交金额前十名品种成交情况 5
图 11：10 日滚动各板块持仓金额变化情况 5
图 12：10 日滚动各板块成交金额情况 5
图 13：各版块持仓金额(亿元) 6
图 14：各版块成交金额(亿元) 6
图 15：中国商品期货市场持仓金额、成交金额与 Wind 商品指数 7
图 16：有色板块持仓金额、成交金额与 Wind 有色指数 7
图 17：油脂油料板块持仓金额、成交金额与 Wind 油脂油料指数 8
图 18：软商品板块持仓金额、成交金额与 Wind 软商品指数 8
图 19：农副产品板块持仓金额、成交金额与 Wind 农副产品指数 9
图 20：谷物板块持仓金额、成交金额与 Wind 谷物指数 9
图 21：贵金属板块持仓金额、成交金额与 Wind 贵金属指数 10
图 22：能源板块持仓金额、成交金额与 Wind 能源指数 10
图 23：煤焦钢矿持仓金额、成交金额与 Wind 煤焦钢矿指数 11
图 24：非金属建材持仓金额、成交金额与 Wind 非金属建材指数 11
图 25：化工板块持仓金额、成交金额与 Wind 化工指数 12
图 26：有色板块月度成交金额(亿元) 12
图 27：油脂油料板块月度成交金额(亿元) 12
图 28：软商品板块月度成交金额(亿元) 13
图 29：农副产品板块月度成交金额(亿元) 13
图 30：谷物板块月度成交金额(亿元) 13
图 31：贵金属板块月度成交金额(亿元) 13
图 32：能源板块月度成交金额(亿元) 14
图 33：煤焦钢矿板块月度成交金额(亿元) 14
图 34：非金属建材板块月度成交金额(亿元) 14
图 35：化工板块月度成交金额(亿元) 14

图1：前一交易日增减仓前五名品种持仓金额变化情况

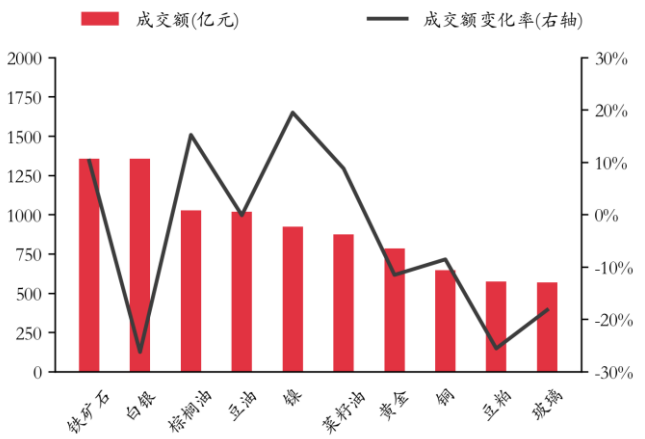
2020-09-21



数据来源：Ricequant 华泰期货研究院

图2：前一交易日成交金额前十名品种成交情况

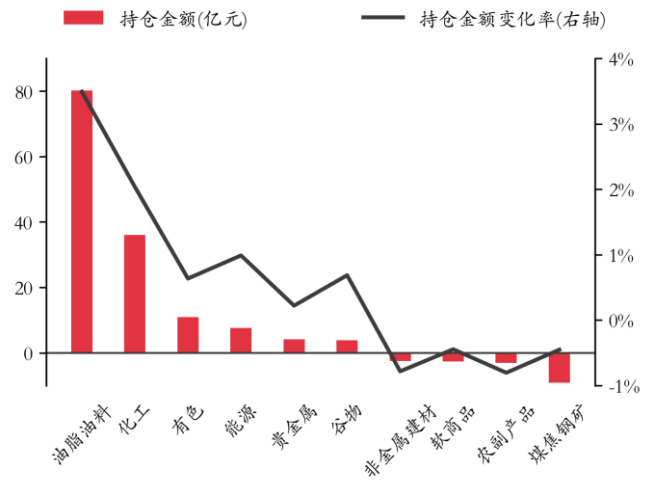
2020-09-21



数据来源：Ricequant 华泰期货研究院

图3：前一交易日各板块持仓金额变化情况

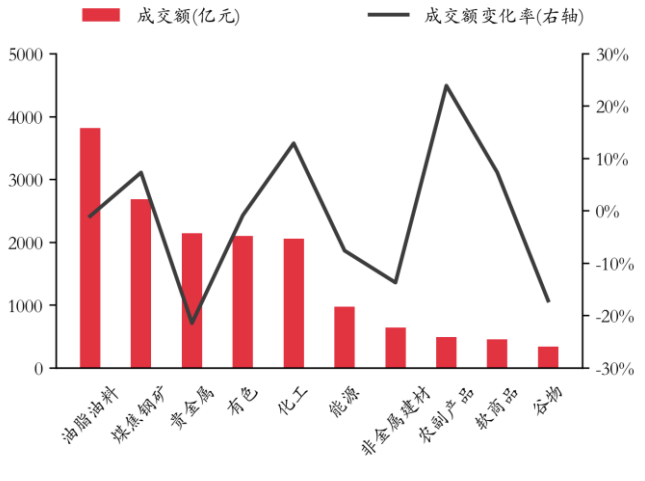
2020-09-21



数据来源：Ricequant 华泰期货研究院

图4：前一交易日各板块成交金额情况

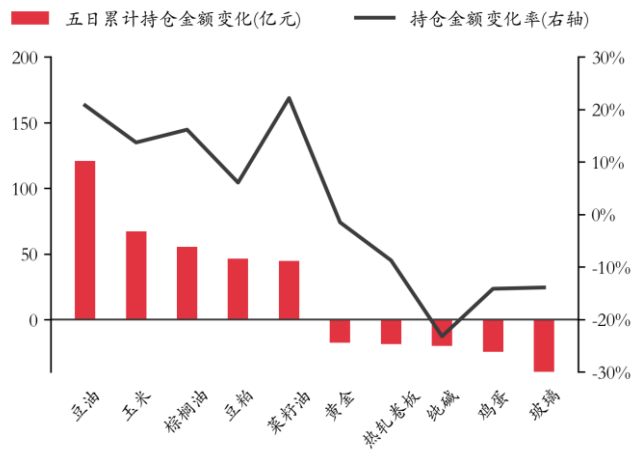
2020-09-21



数据来源：Ricequant 华泰期货研究院

图5：5 日滚动增减仓前五名品种持仓金额变化情况

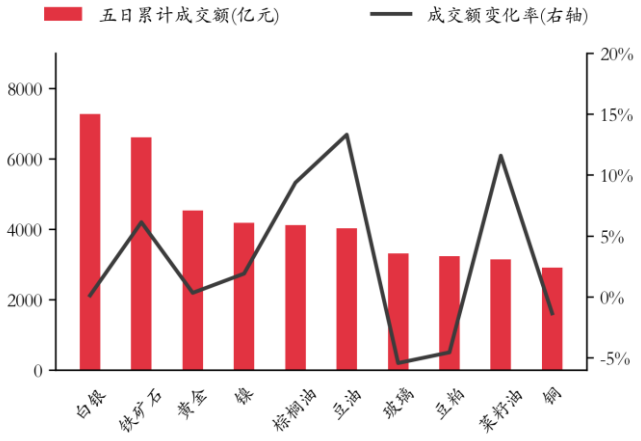
2020-09-14 至 2020-09-21



数据来源：Ricequant 华泰期货研究院

图6：5 日滚动成交金额前十名品种成交情况

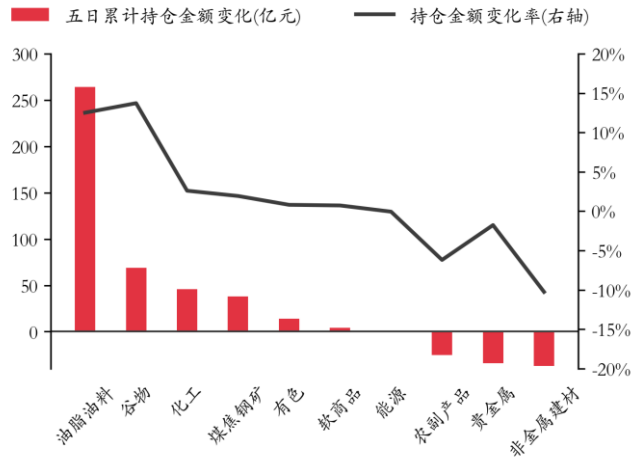
2020-09-14 至 2020-09-21



数据来源：Ricequant 华泰期货研究院

图7：5 日滚动各板块持仓金额变化情况

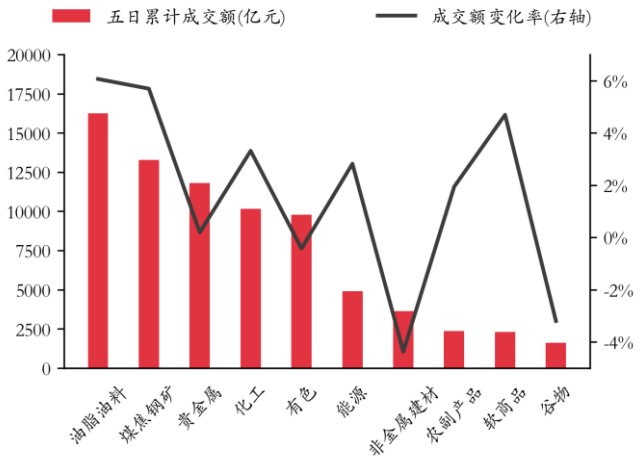
2020-09-14 至 2020-09-21



数据来源：Ricequant 华泰期货研究院

图8：5 日滚动各板块成交金额情况

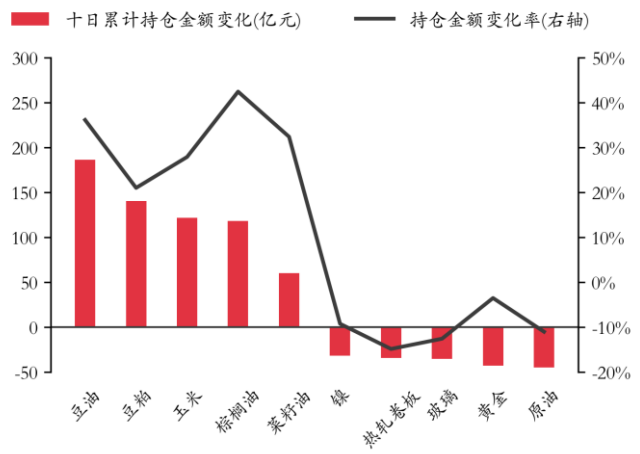
2020-09-14 至 2020-09-21



数据来源：Ricequant 华泰期货研究院

图9： 10 日滚动增减仓前五名品种持仓金额变化情况

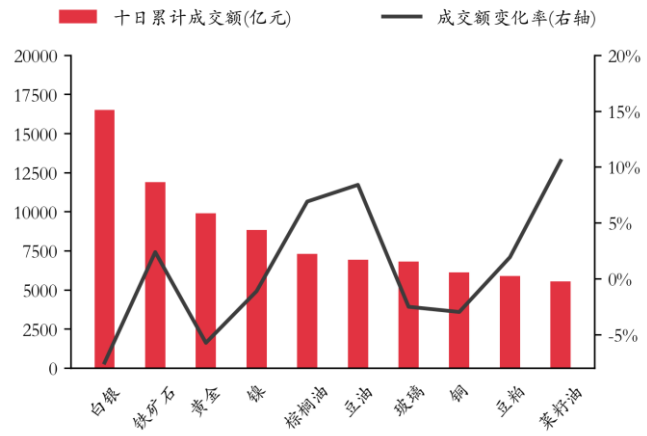
2020-09-07 至 2020-09-21



数据来源：Ricequant 华泰期货研究院

图10： 10 日滚动成交金额前十名品种成交情况

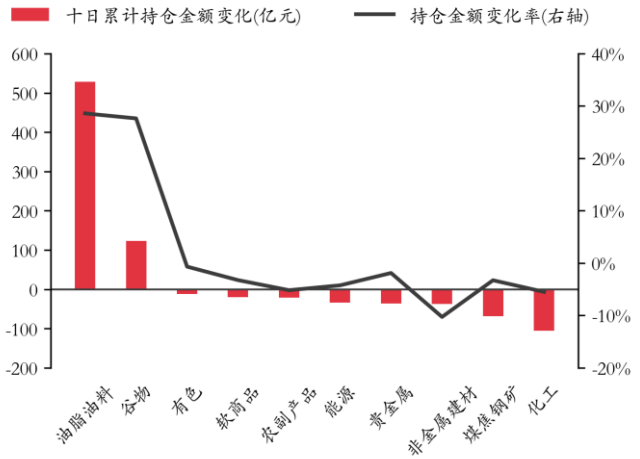
2020-09-07 至 2020-09-21



数据来源：Ricequant 华泰期货研究院

图11： 10 日滚动各板块持仓金额变化情况

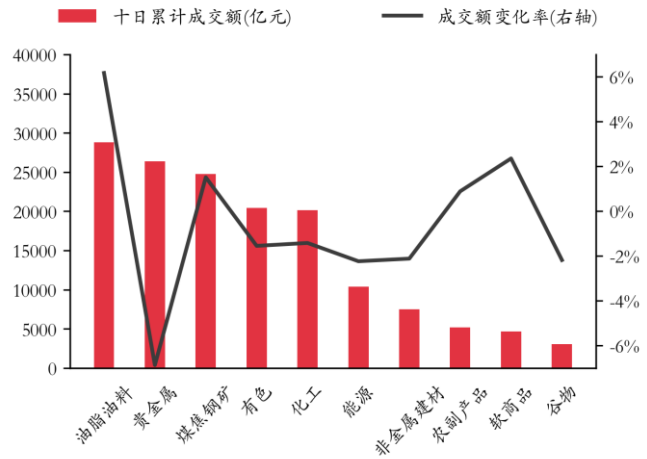
2020-09-07 至 2020-09-21



数据来源：Ricequant 华泰期货研究院

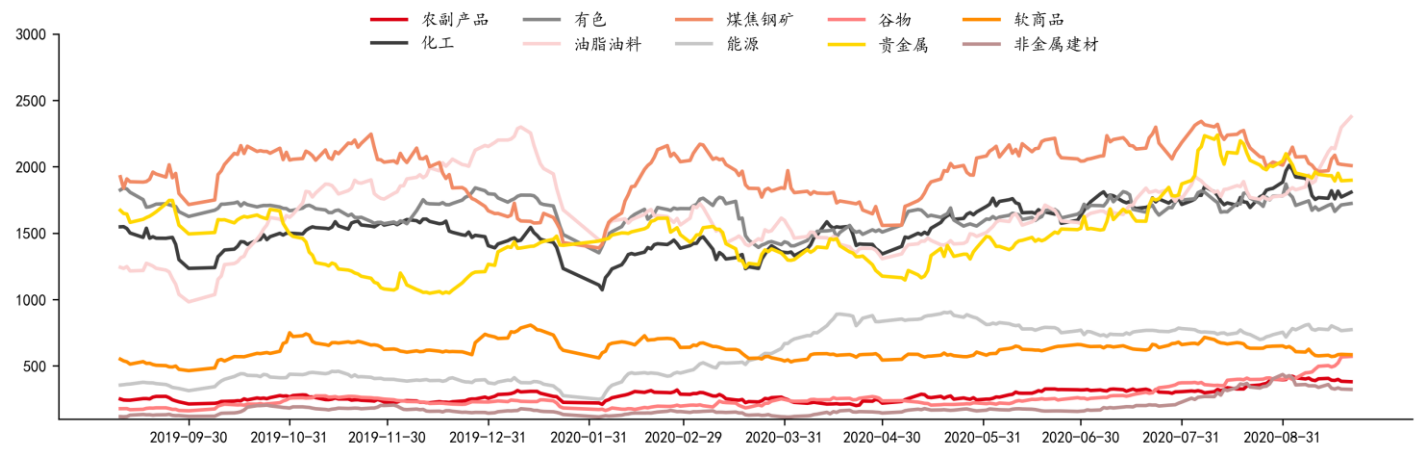
图12： 10 日滚动各板块成交金额情况

2020-09-07 至 2020-09-21



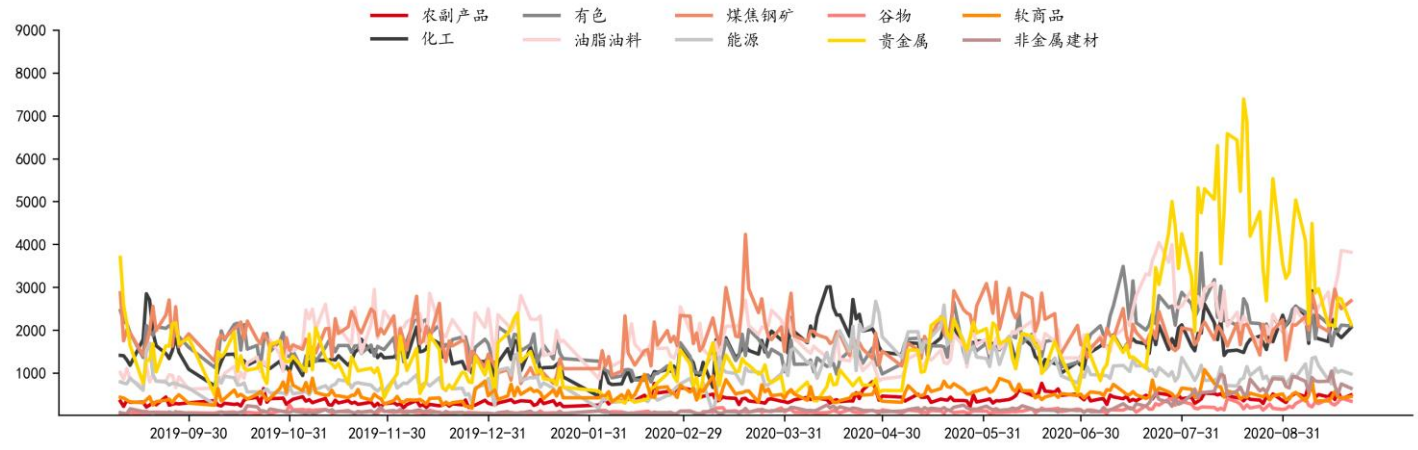
数据来源：Ricequant 华泰期货研究院

图13： 各版块持仓金额(亿元)



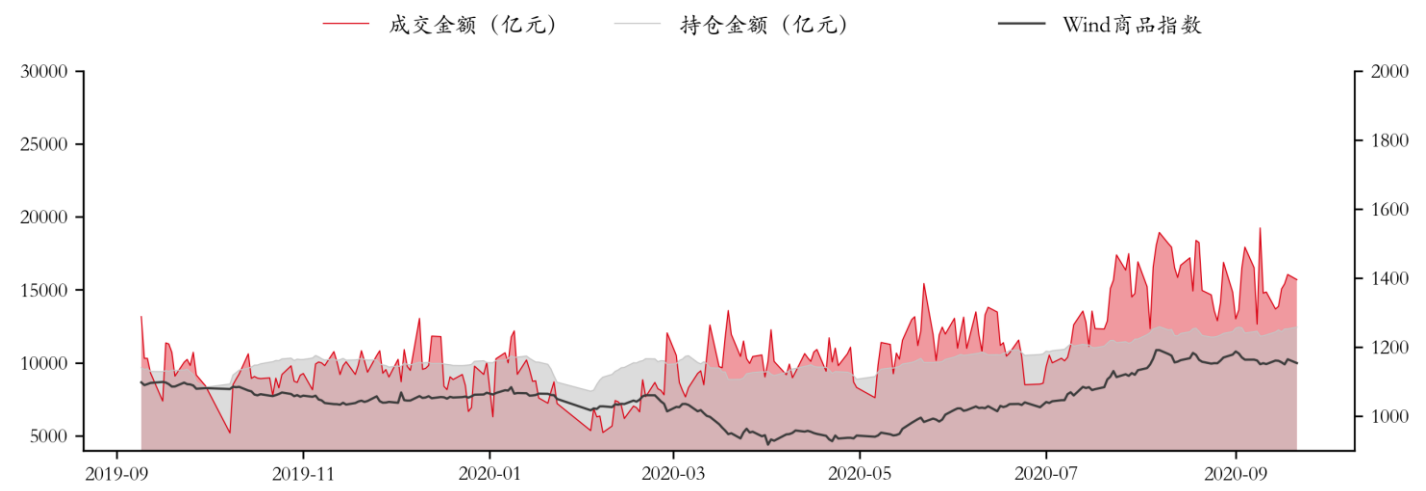
数据来源：Ricequant 华泰期货研究院

图14： 各版块成交金额(亿元)



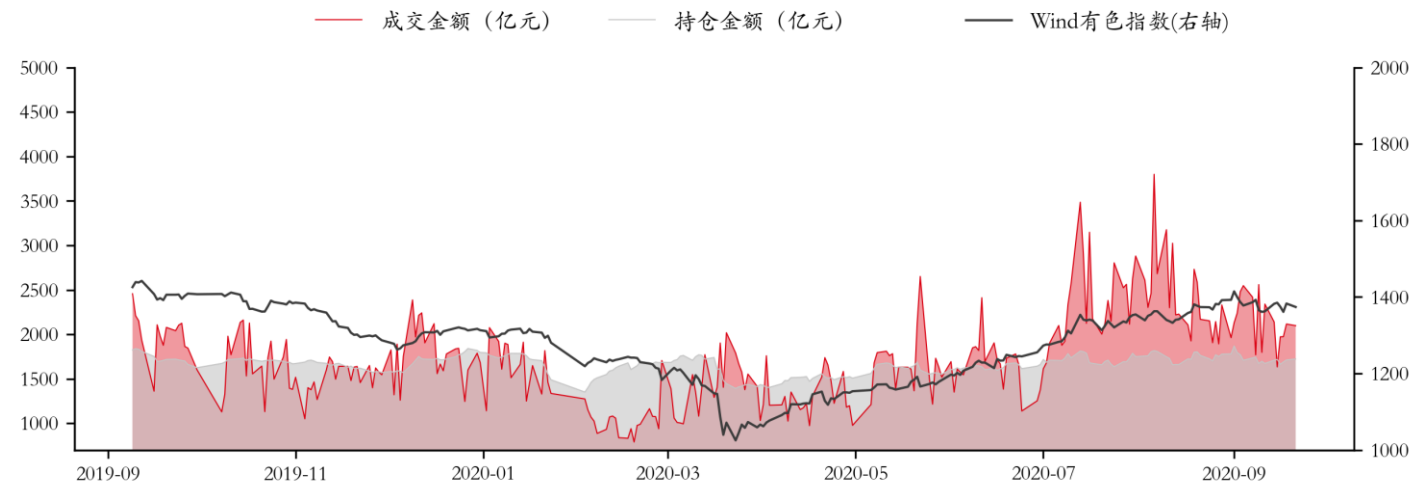
数据来源：Ricequant 华泰期货研究院

图15： 中国商品期货市场持仓金额、成交金额与 Wind 商品指数



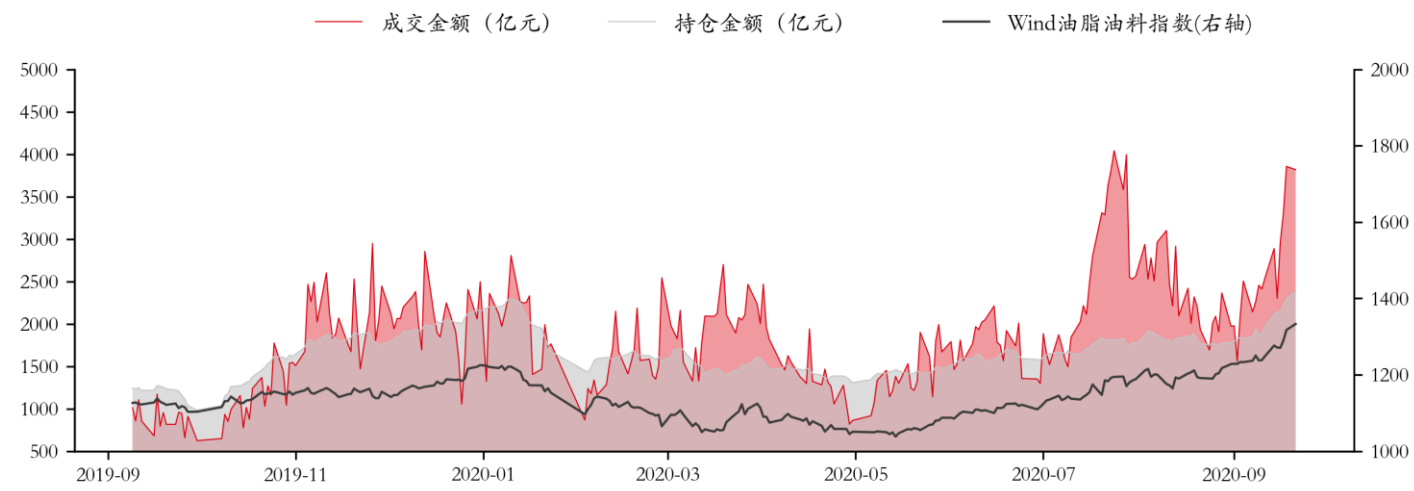
数据来源：Ricequant Wind 华泰期货研究院

图16： 有色板块持仓金额、成交金额与 Wind 有色指数



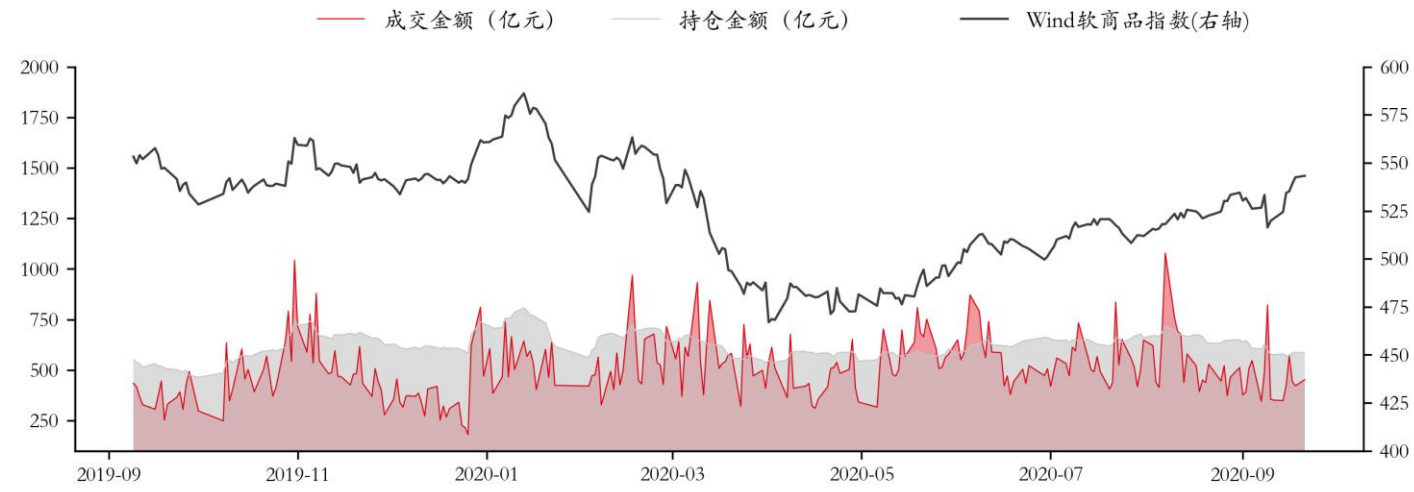
数据来源：Ricequant Wind 华泰期货研究院

图17： 油脂油料板块持仓金额、成交金额与 Wind 油脂油料指数



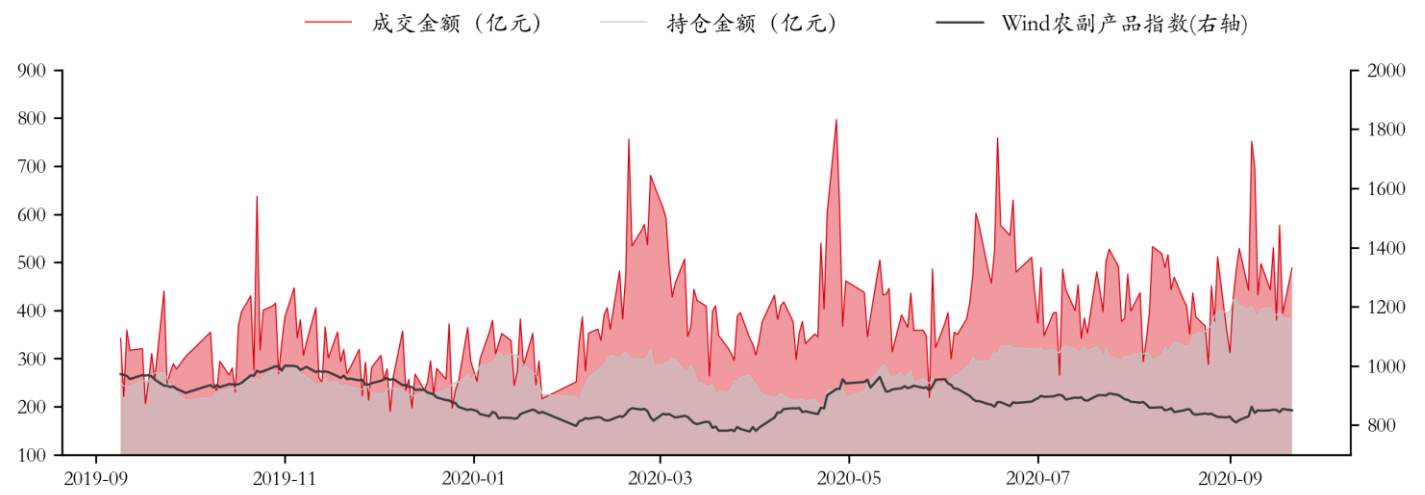
数据来源：Ricequant Wind 华泰期货研究院

图18： 软商品板块持仓金额、成交金额与 Wind 软商品指数



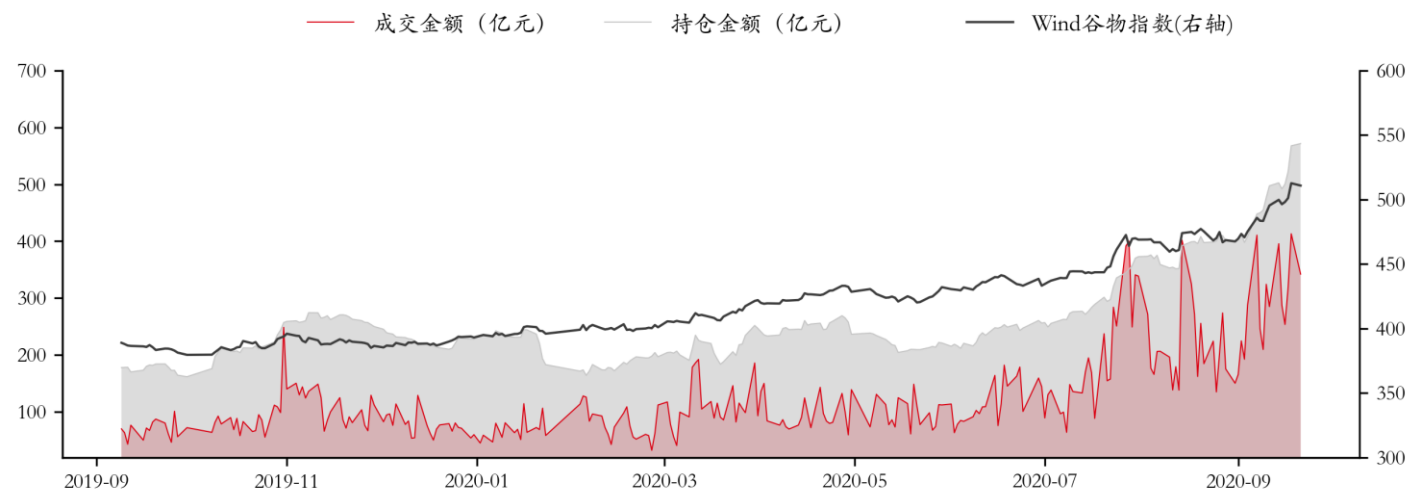
数据来源：Ricequant Wind 华泰期货研究院

图19： 农副产品板块持仓金额、成交金额与 Wind 农副产品指数



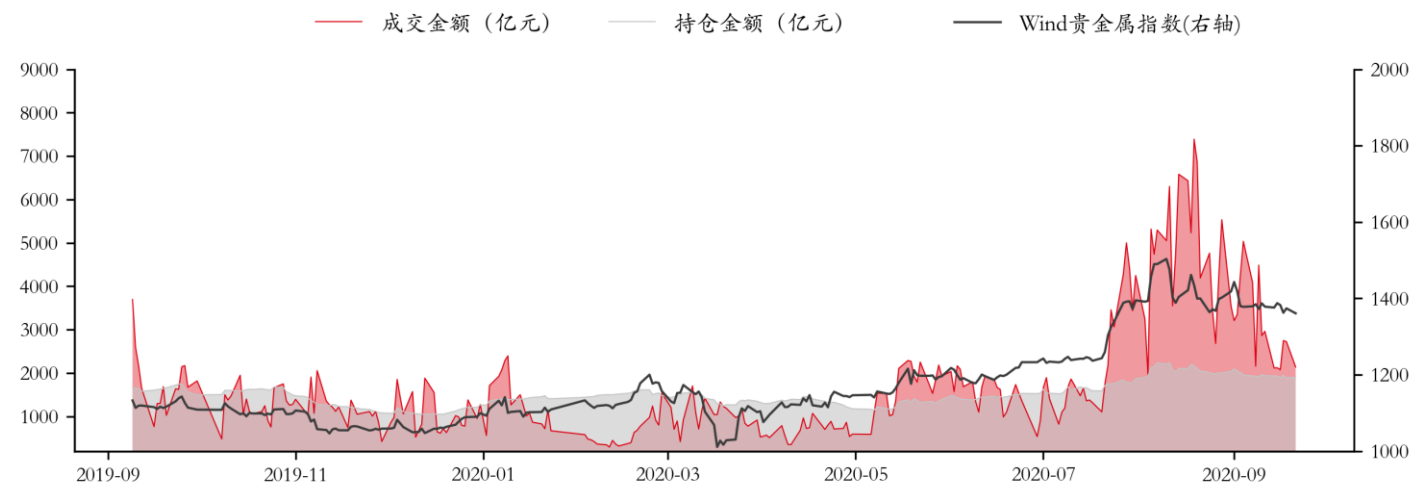
数据来源：Ricequant Wind 华泰期货研究院

图20： 谷物板块持仓金额、成交金额与 Wind 谷物指数



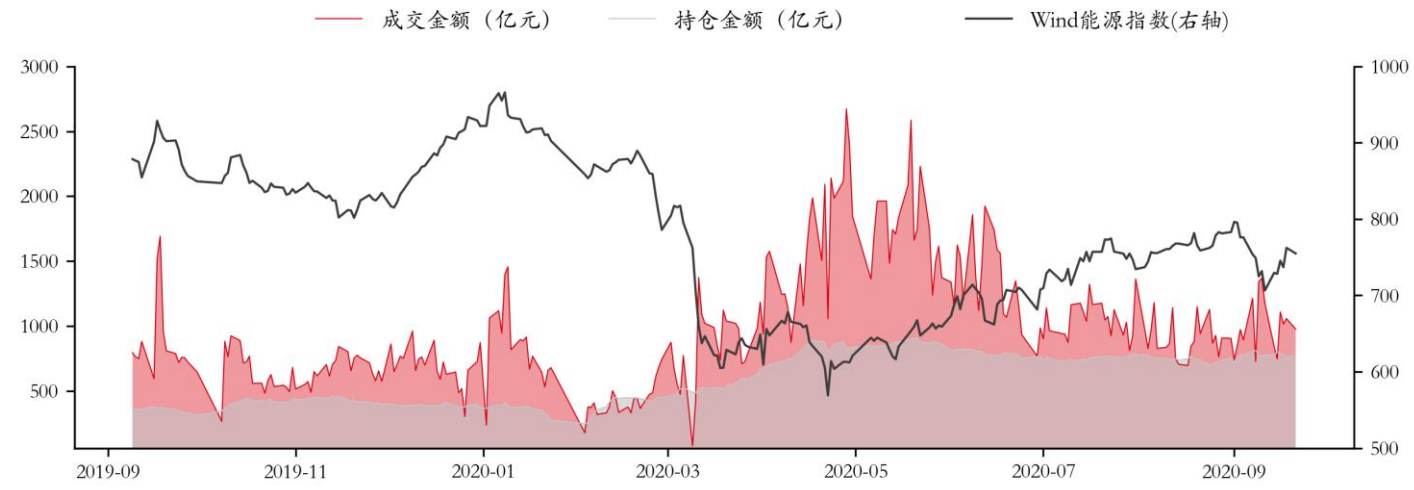
数据来源：Ricequant Wind 华泰期货研究院

图21： 贵金属板块持仓金额、成交金额与 Wind 贵金属指数



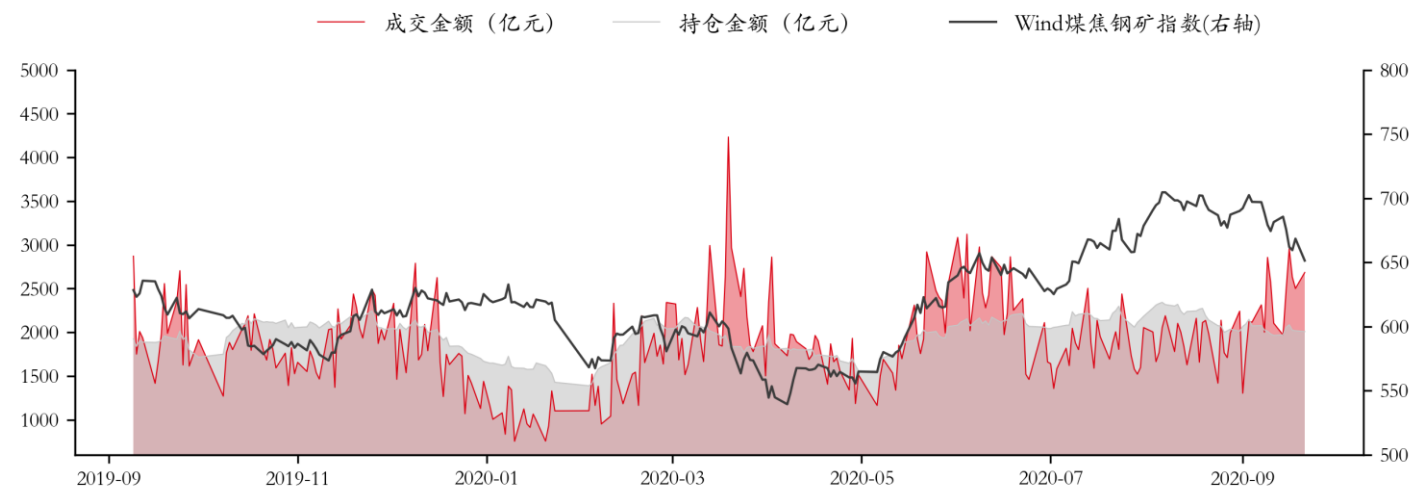
数据来源：Ricequant Wind 华泰期货研究院

图22： 能源板块持仓金额、成交金额与 Wind 能源指数



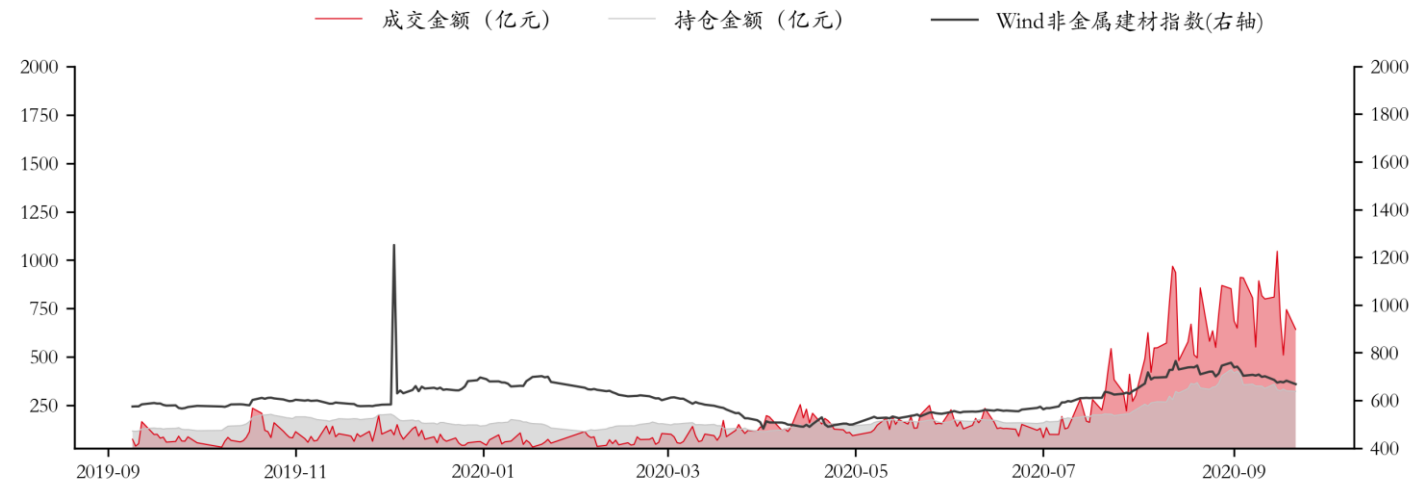
数据来源：Ricequant Wind 华泰期货研究院

图23： 煤焦钢矿持仓金额、成交金额与 Wind 煤焦钢矿指数



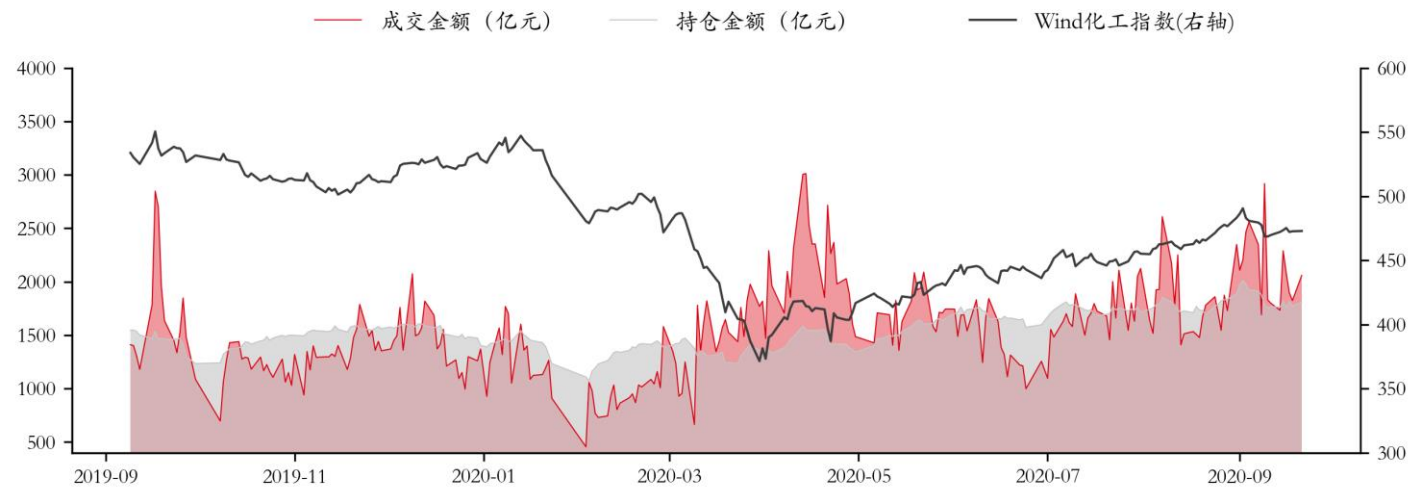
数据来源：Ricequant Wind 华泰期货研究院

图24： 非金属建材持仓金额、成交金额与 Wind 非金属建材指数



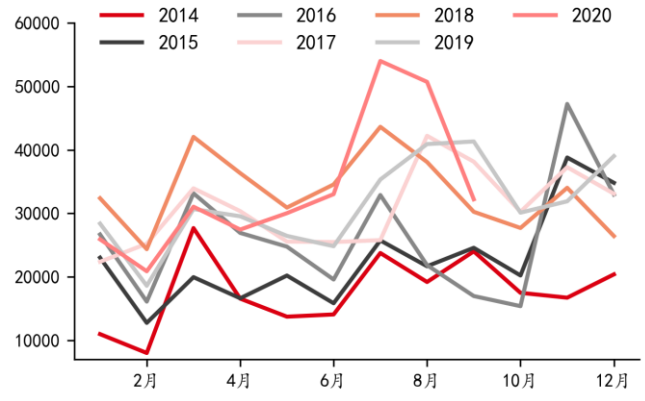
数据来源：Ricequant Wind 华泰期货研究院

图25： 化工板块持仓金额、成交金额与 Wind 化工指数



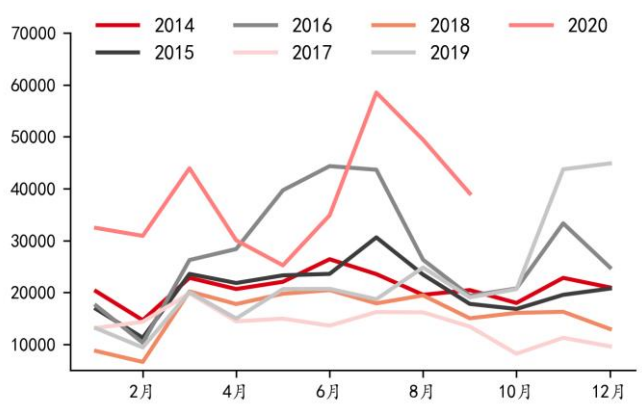
数据来源：Ricequant Wind 华泰期货研究院

图26： 有色板块月度成交金额(亿元)



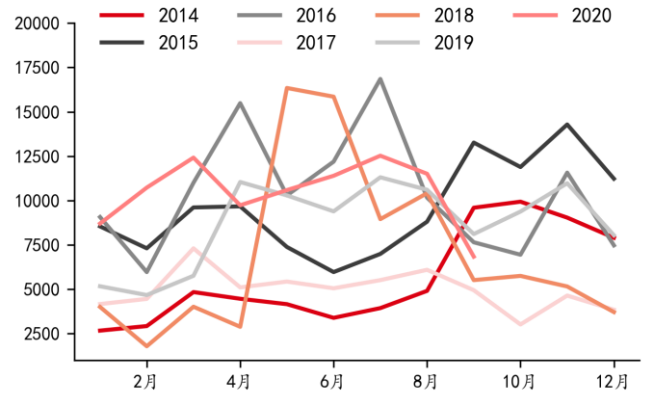
数据来源：Ricequant 华泰期货研究院

图27： 油脂油料板块月度成交金额(亿元)



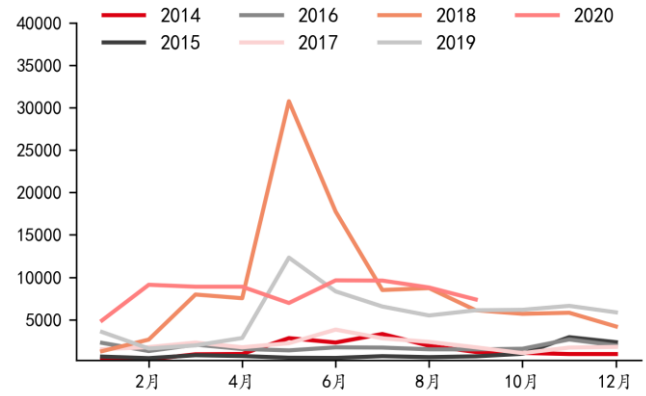
数据来源：Ricequant 华泰期货研究院

图28： 软商品板块月度成交金额(亿元)



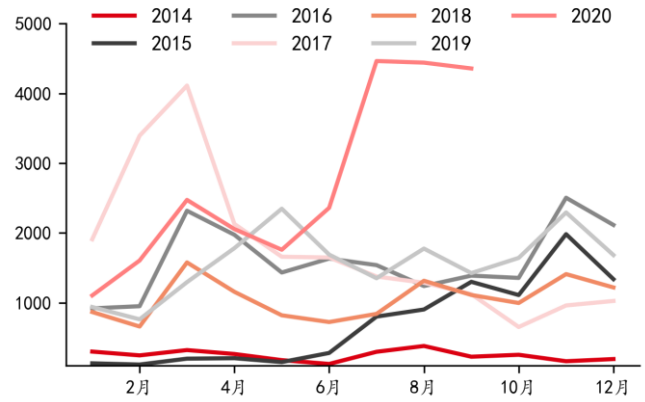
数据来源：Ricequant 华泰期货研究院

图29： 农副产品板块月度成交金额(亿元)



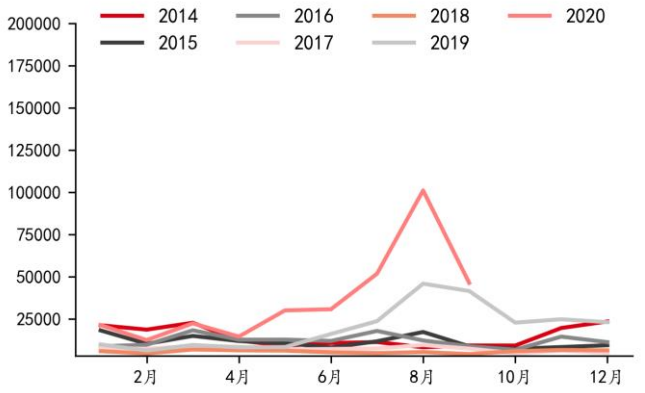
数据来源：Ricequant 华泰期货研究院

图30： 谷物板块月度成交金额(亿元)



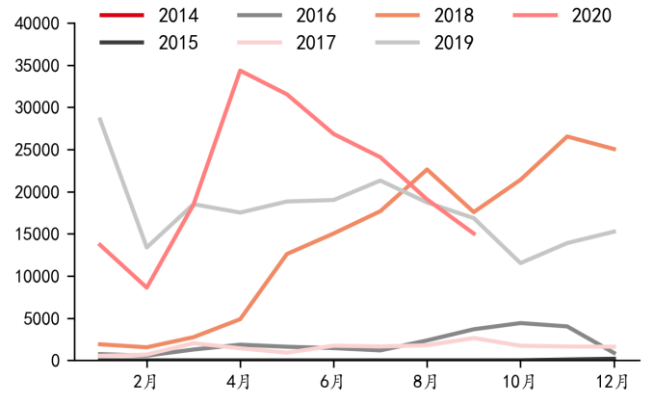
数据来源：Ricequant 华泰期货研究院

图31： 贵金属板块月度成交金额(亿元)



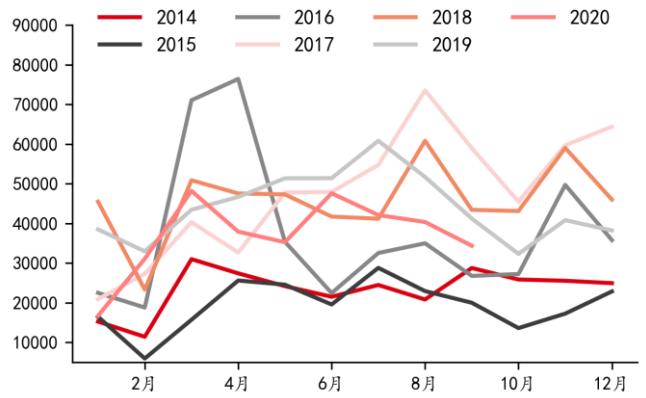
数据来源：Ricequant 华泰期货研究院

图32： 能源板块月度成交金额(亿元)



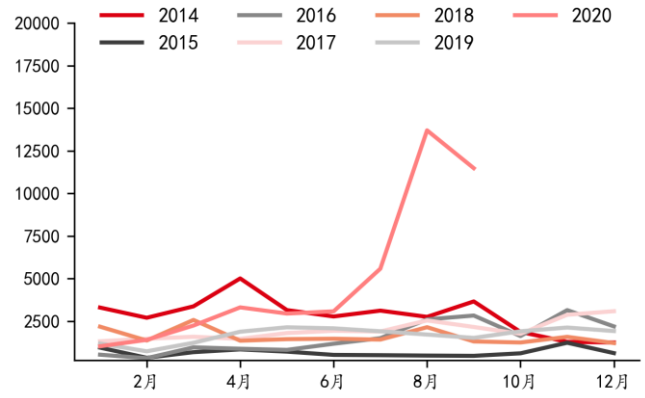
数据来源：Ricequant 华泰期货研究院

图33： 煤焦钢矿板块月度成交金额(亿元)



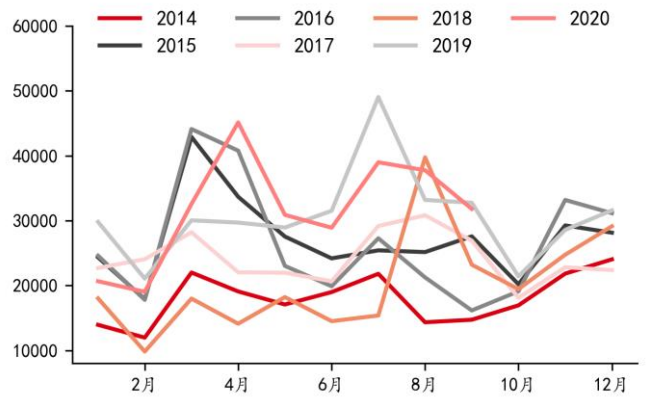
数据来源：Ricequant 华泰期货研究院

图34： 非金属建材板块月度成交金额(亿元)



数据来源：Ricequant 华泰期货研究院

图35： 化工板块月度成交金额(亿元)



数据来源：Ricequant 华泰期货研究院

免责声明

本报告基于本公司认为可靠的、已公开的信息编制，但本公司对该等信息的准确性及完整性不作任何保证。本报告所载的意见、结论及预测仅反映报告发布当日的观点和判断。在不同时期，本公司可能会发出与本报告所载意见、评估及预测不一致的研究报告。本公司不保证本报告所含信息保持在最新状态。本公司对本报告所含信息可在不发出通知的情形下做出修改，投资者应当自行关注相应的更新或修改。

本公司力求报告内容客观、公正，但本报告所载的观点、结论和建议仅供参考，投资者并不能依靠本报告以取代行使独立判断。对投资者依据或者使用本报告所造成的一切后果，本公司及作者均不承担任何法律责任。

本报告版权仅为本公司所有。未经本公司书面许可，任何机构或个人不得以翻版、复制、发表、引用或再次分发他人等任何形式侵犯本公司版权。如征得本公司同意进行引用、刊发的，需在允许的范围内使用，并注明出处为“华泰期货研究院”，且不得对本报告进行任何有悖原意的引用、删节和修改。本公司保留追究相关责任的权力。所有本报告中使用的商标、服务标记及标记均为本公司的商标、服务标记及标记。

华泰期货有限公司版权所有并保留一切权利。

公司总部

地址：广东省广州市越秀区东风东路761号丽丰大厦20层

电话：400-6280-888

网址：www.htfc.com