

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

当日持仓保证金为：1977.08 亿元（商品），1101.02 亿元（金融）。

摘要：

当日持仓保证金为：1977.08 亿元（商品），1101.02 亿元（金融）。

当日增量：-8.80 亿元（商品），-4.68 亿元（金融）。

三日增量：-27.14 亿元（商品），+21.60 亿元（金融）。

五日增量：-36.44 亿元（商品），+34.79 亿元（金融）。

持仓保证金增量排名前三：

K 线收阳对应资金流出：PTA

K 线收阴对应资金流入：生猪

成交持仓比排名前三：

K 线收阴对应资金流出：无

日内资金流向情况：

K 线收阳对应资金流入：豆一、沪铝、热卷、焦煤、PVC、乙二醇

K 线收阳对应资金流出：PTA

K 线收阴对应资金流入：生猪

K 线收阴对应资金流出：无

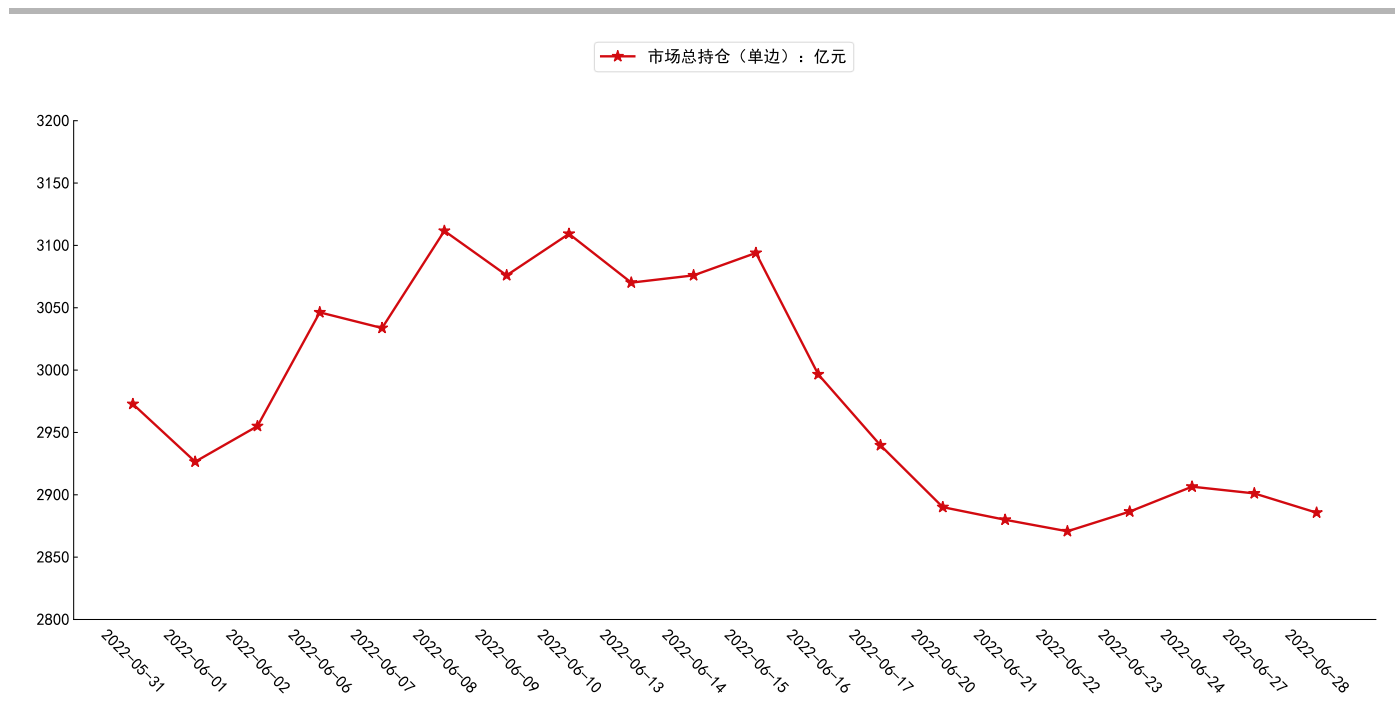


商品量化团队

研究员：
魏新照
021-80401773
weixinzhao@citicsf.com
从业资格号 F3084987
投资咨询号 Z0016364

一、 市场总持仓保证金

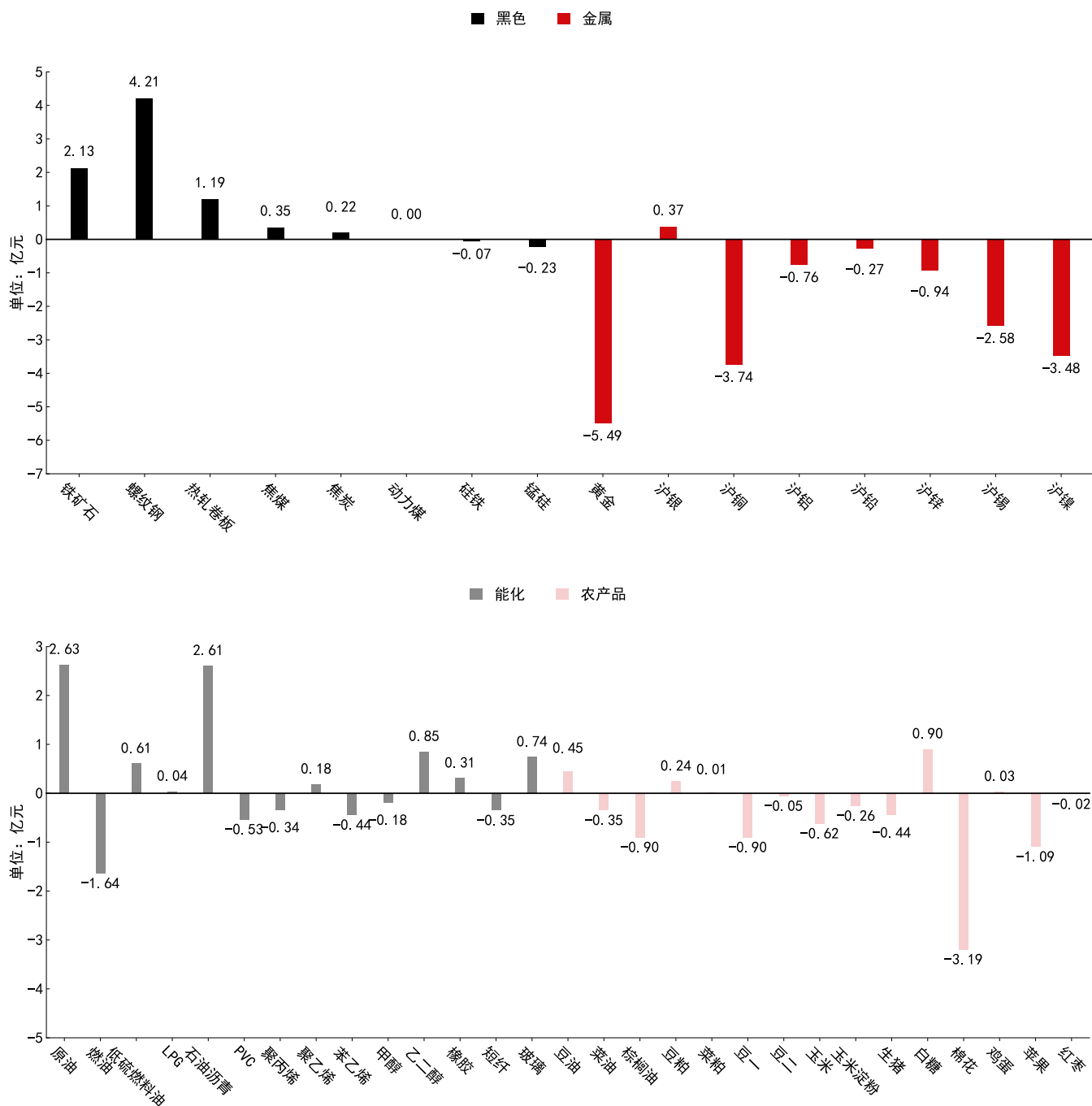
图表 1：市场总持仓保证金变化



资料来源：Wind 中信期货研究所

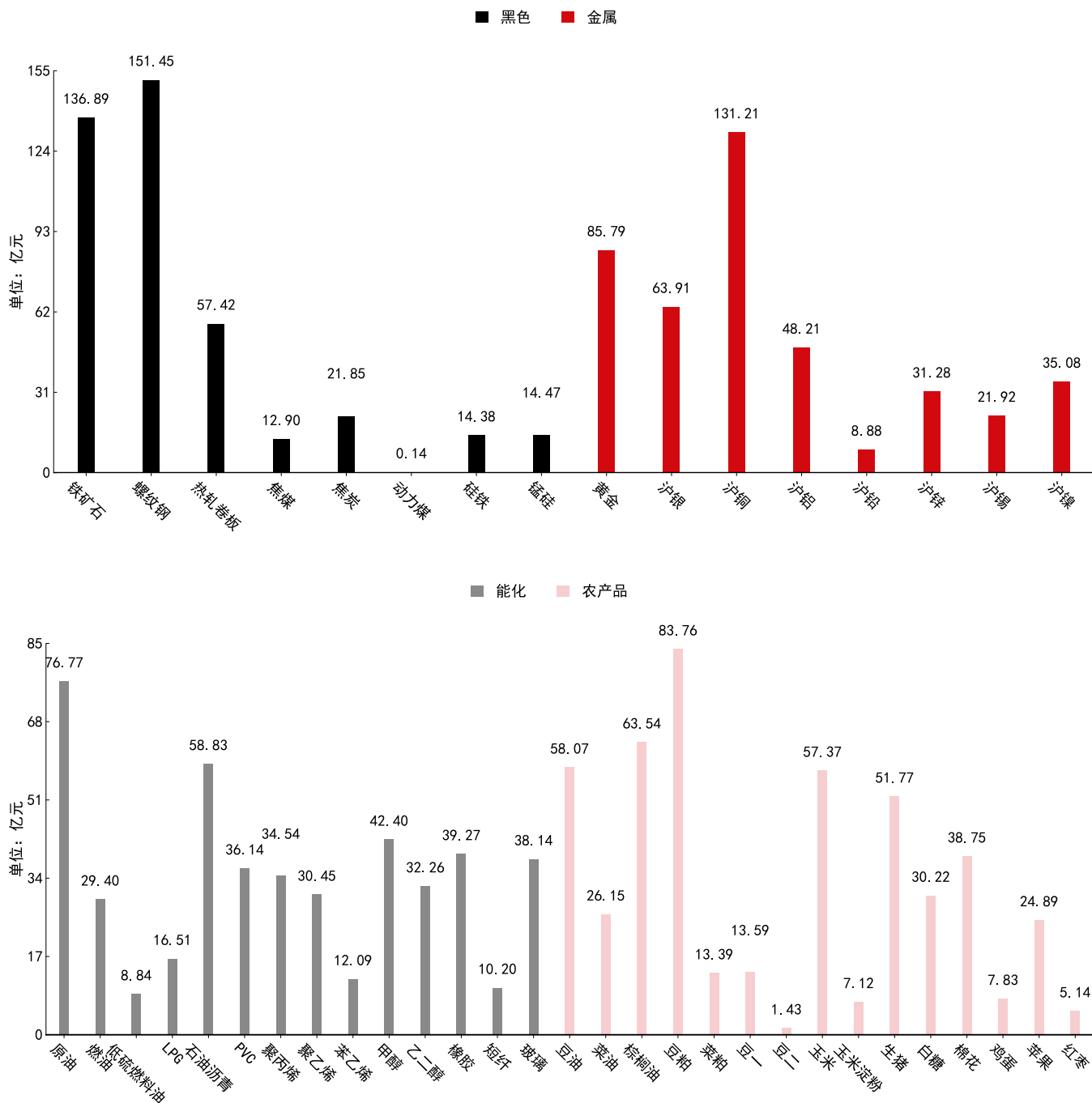
二、 当日持仓保证金变化

图表 2：主要交易品种当日持仓保证金变化值



资料来源：Wind 中信期货研究所

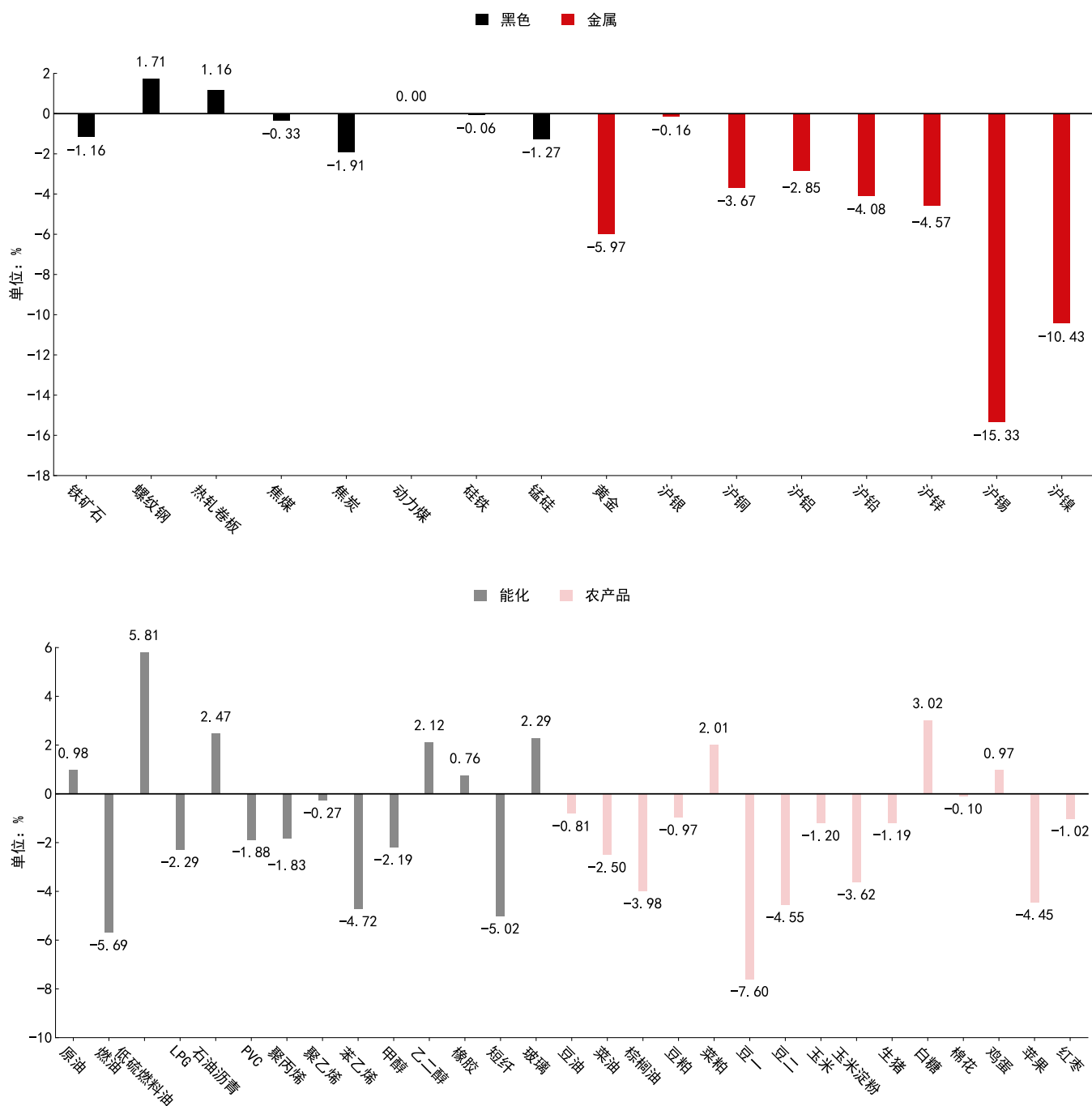
图表 3：主要交易品种当日持仓保证金



资料来源：Wind 中信期货研究所

三、 当日持仓量变化

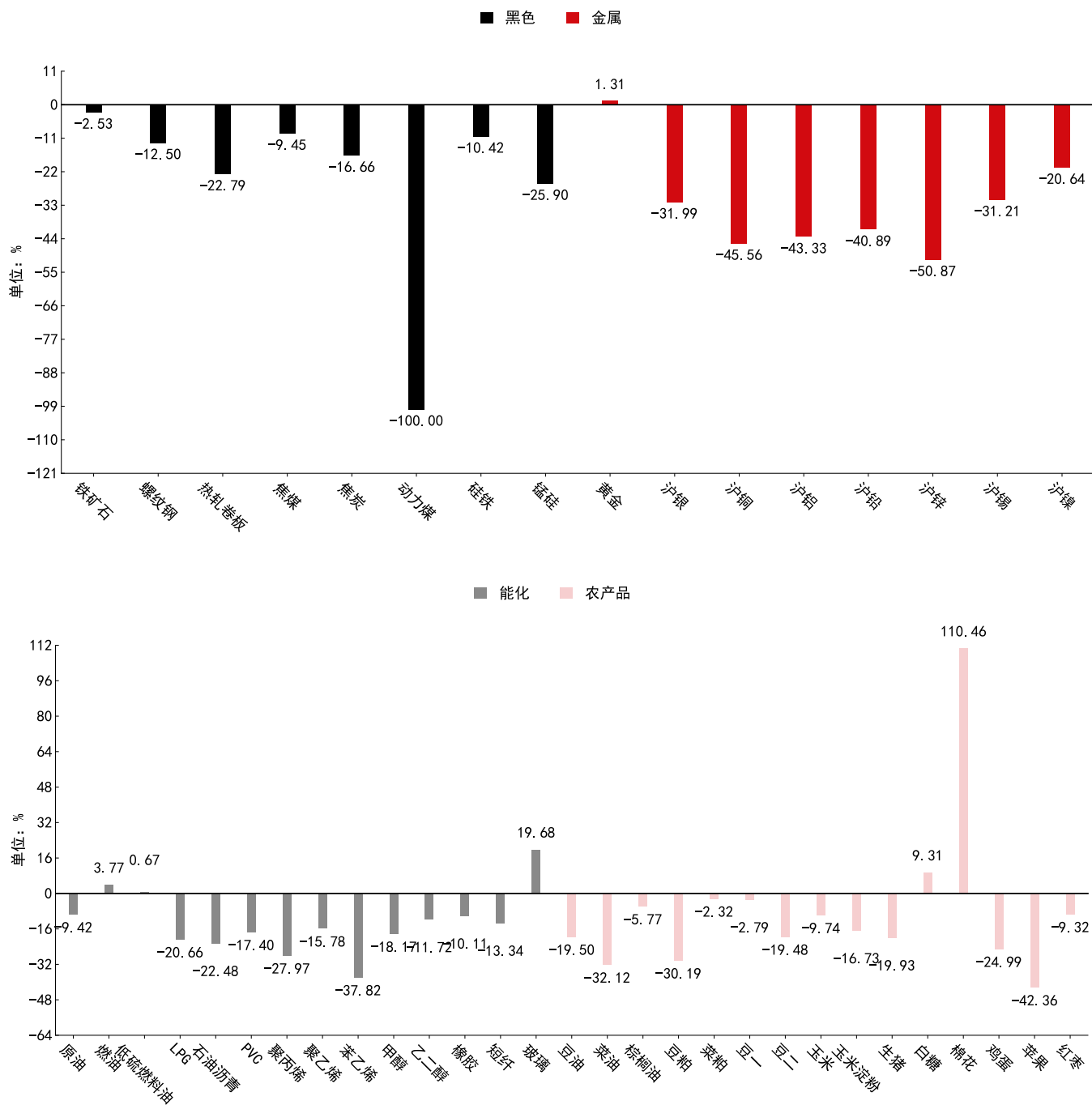
图表 4：主要交易品种当日持仓量变化率



资料来源：Wind 中信期货研究所

四、 当日成交量变化

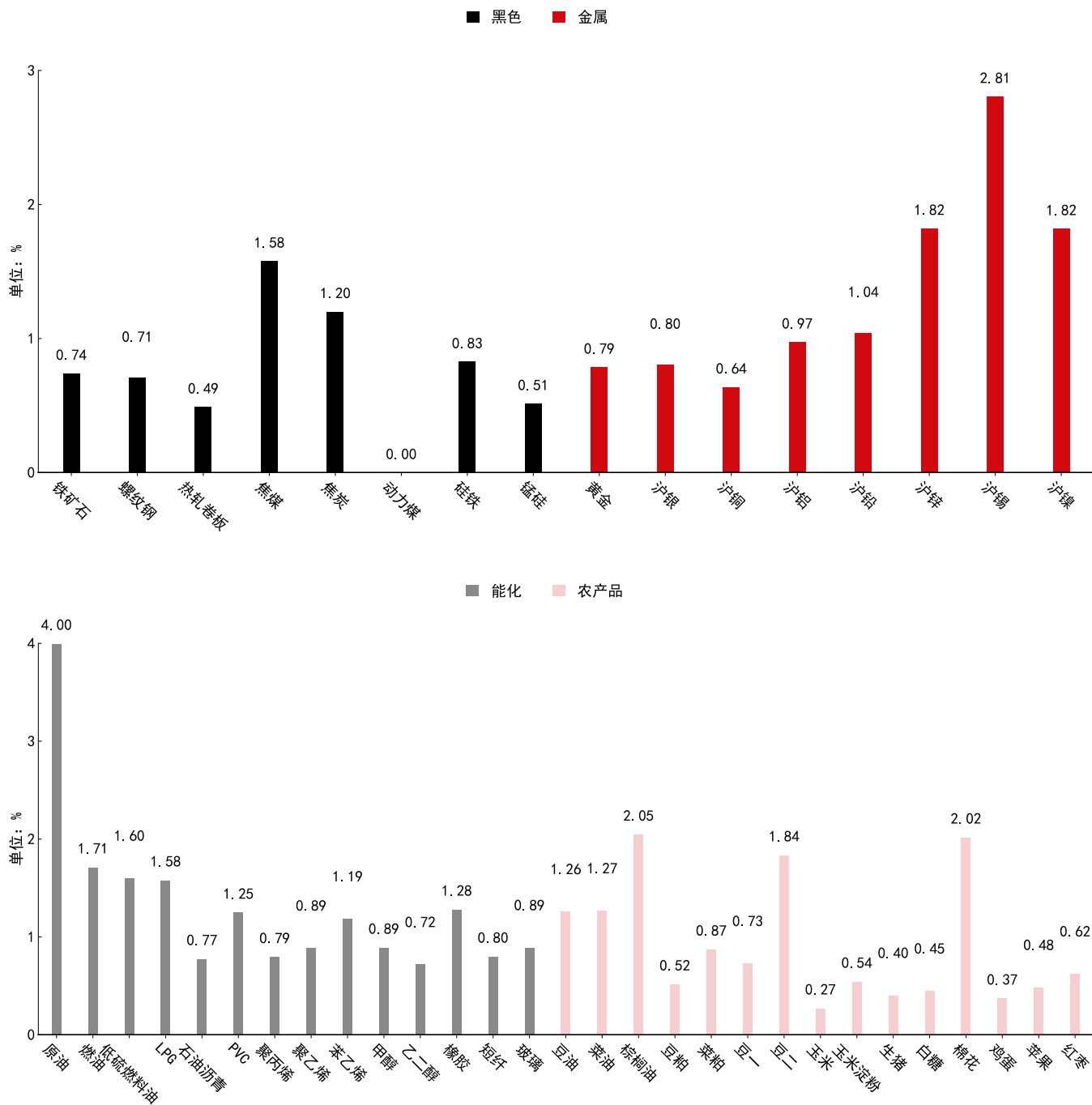
图表 5：主要交易品种当日成交量变化



资料来源：Wind 中信期货研究所

五、 当日活跃度

图表 6：主要交易品种当日活跃度



资料来源：Wind 中信期货研究所

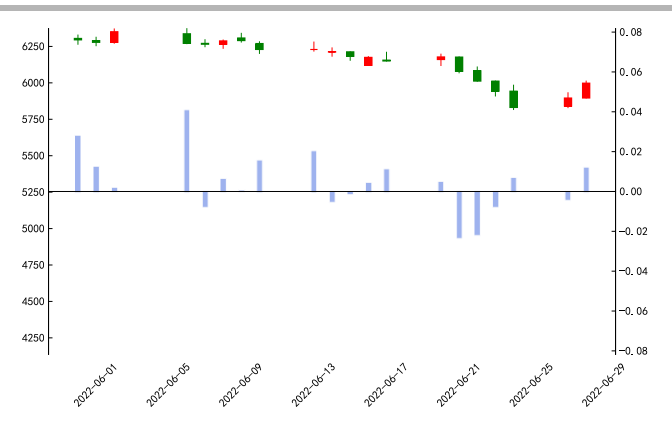
六、 日内资金流向

图表 7: 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	4236	5877	3310	5429	0.012	102	1.73%
豆粕	32261	37488	27621	37453	0.006	53	1.38%
豆油	28980	28506	26985	29968	0.001	76	0.74%
菜粕	11259	7029	9404	7695	0.006	46	1.65%
菜油	7104	9683	7293	9586	0.000	214	1.79%
棕榈油	45243	48609	42472	47027	0.004	184	1.93%
玉米	10597	20316	16506	36769	-0.074	18	0.64%
玉米淀粉	4122	7128	4579	7318	-0.006	26	0.82%
棉花	39855	46488	35942	44623	0.008	425	2.47%
白糖	16676	13586	14129	12739	0.013	27	0.46%
鸡蛋	6809	6894	6964	5792	0.015	-18	-0.39%
生猪	2431	3083	2243	2986	0.009	-285	-1.37%
苹果	7801	13608	8028	13968	-0.005	-87	-0.97%
沪铜	4831	7900	5036	8246	-0.004	1130	1.77%
沪铝	14596	17565	13698	15930	0.009	275	1.43%
沪铅	3799	2486	3090	2884	0.005	50	0.33%
沪锌	9428	10820	10192	11270	-0.005	575	2.43%
沪锡	1581	2642	1637	2149	0.007	3860	1.77%
沪镍	1738	3201	1721	3896	-0.008	2140	1.19%
黄金	1507	1873	1612	1990	-0.002	-1.34	-0.34%
白银	19963	24211	17670	21617	0.010	-18	-0.39%
螺纹钢	123793	112109	138676	103283	-0.003	69	1.61%
热卷	34120	26136	26516	24094	0.024	60	1.38%
焦煤	3664	4068	3601	3380	0.011	123.5	5.16%
焦炭	2111	1858	1969	2317	-0.008	89	2.84%
铁矿石	43641	34700	41606	36843	0.000	34	4.39%
硅铁	13846	14594	13146	14681	0.004	134	1.57%
硅锰	11796	10279	9464	9898	0.023	18	0.23%
动力煤	0	0	0	0	0.000	0	0.00%
玻璃	76389	70675	72225	68607	0.006	10	0.61%
沥青	28501	24394	31753	23996	-0.005	76	1.68%
PVC	44854	49991	39203	45241	0.011	162	2.23%
PP	18612	22324	17523	23205	0.000	89	1.05%
塑料	13786	16294	11894	15390	0.007	107	1.27%
橡胶	17132	18246	16891	19095	-0.002	80	0.62%
甲醇	116742	54118	115172	53441	0.001	44	1.70%
PTA	62456	80938	79278	97658	-0.024	128	1.94%
乙二醇	22318	16266	19017	16021	0.010	37	0.82%

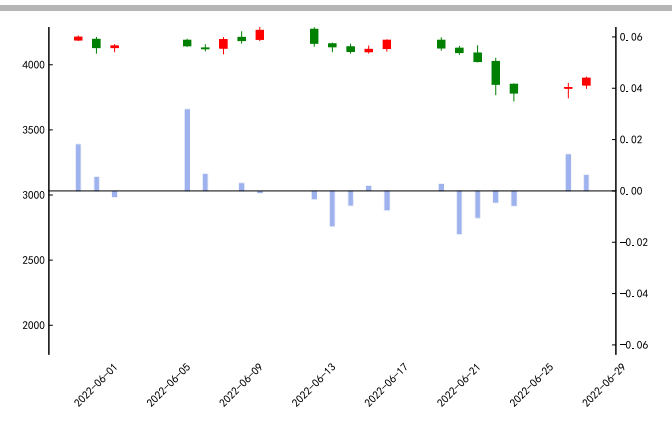
资料来源: Wind 中信期货研究所

图表 8：豆一资金净流向



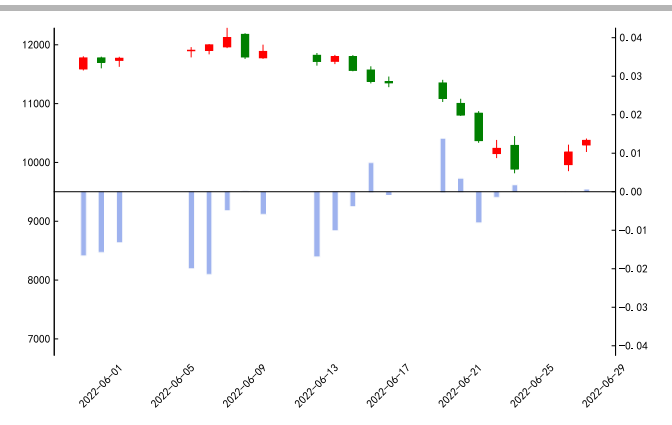
资料来源：Wind 中信期货研究所

图表 9：豆粕资金净流向



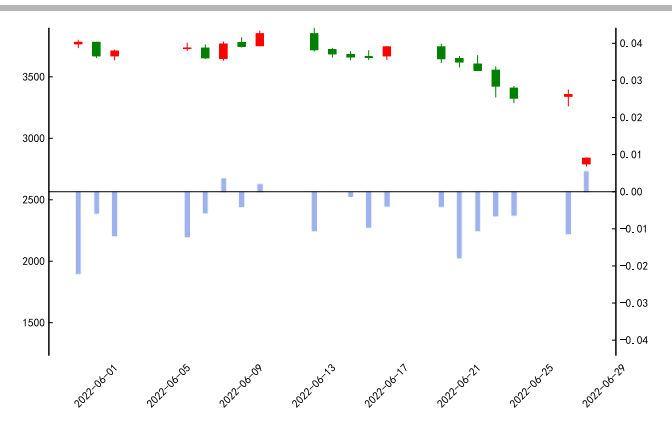
资料来源：Wind 中信期货研究所

图表 10：豆油资金净流向



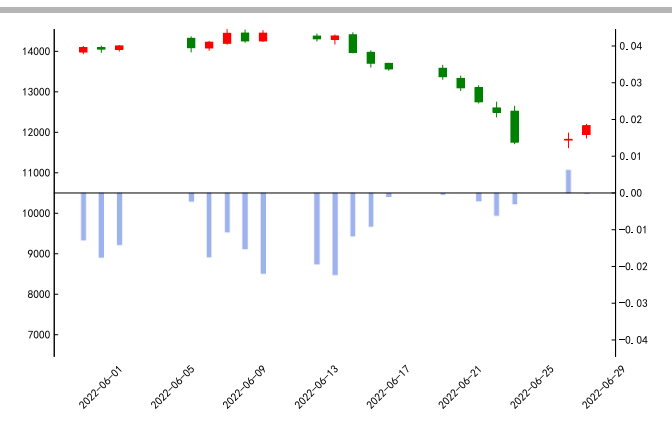
资料来源：Wind 中信期货研究所

图表 11：菜粕资金净流向



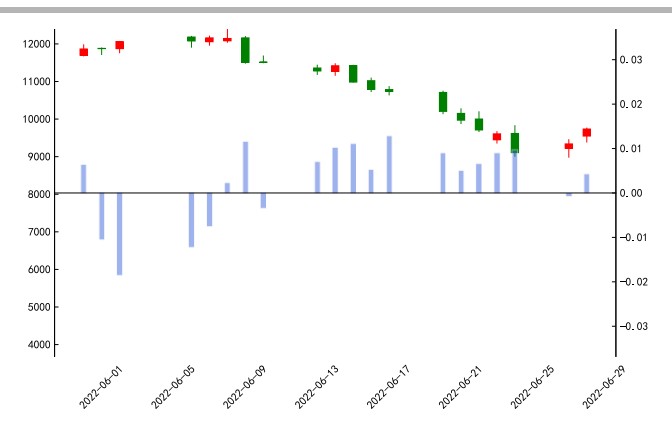
资料来源：Wind 中信期货研究所

图表 12：菜油资金净流向



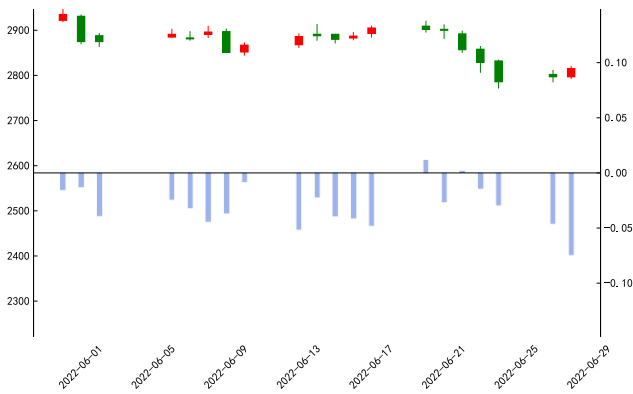
资料来源：Wind 中信期货研究所

图表 13：棕榈油资金净流向



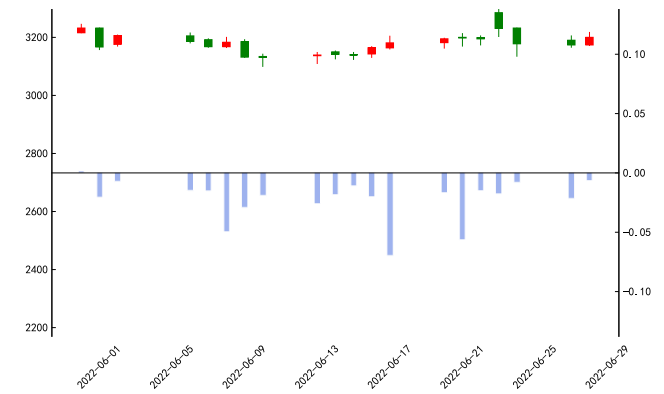
资料来源：Wind 中信期货研究所

图表 14: 玉米资金净流向



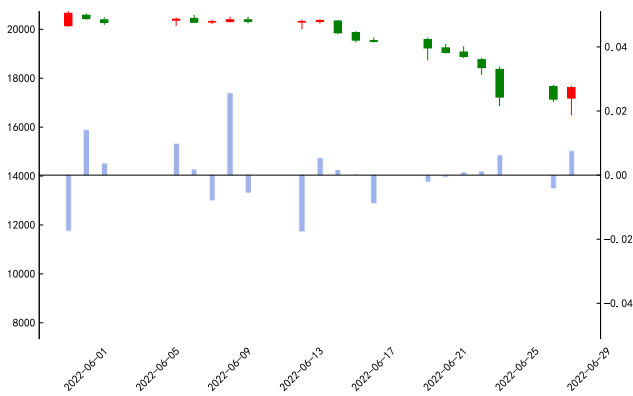
资料来源: Wind 中信期货研究所

图表 15: 玉米淀粉资金净流向



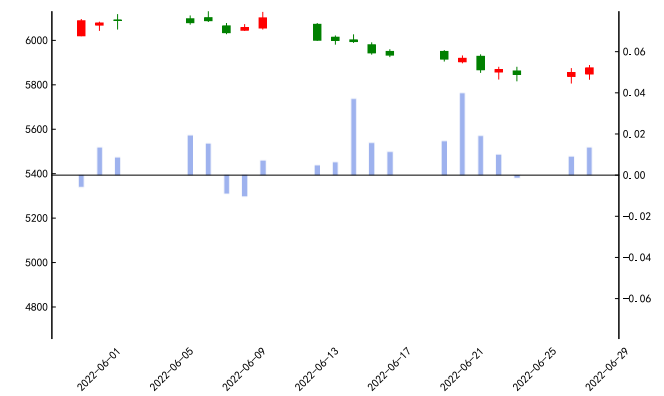
资料来源: Wind 中信期货研究所

图表 16: 棉花资金净流向



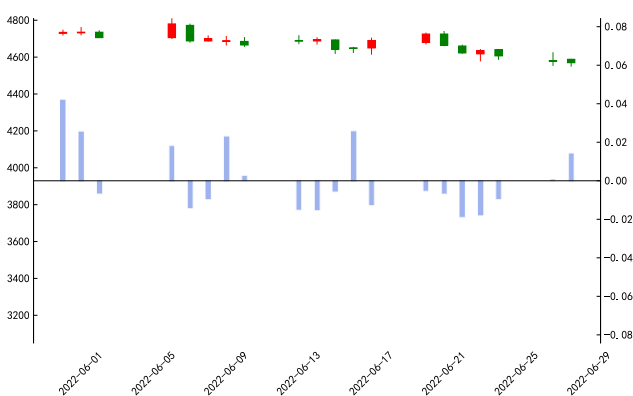
资料来源: Wind 中信期货研究所

图表 17: 白糖资金净流向



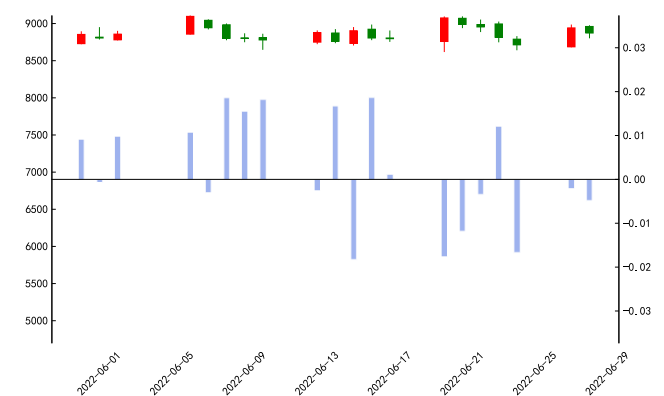
资料来源: Wind 中信期货研究所

图表 18: 鸡蛋资金净流向



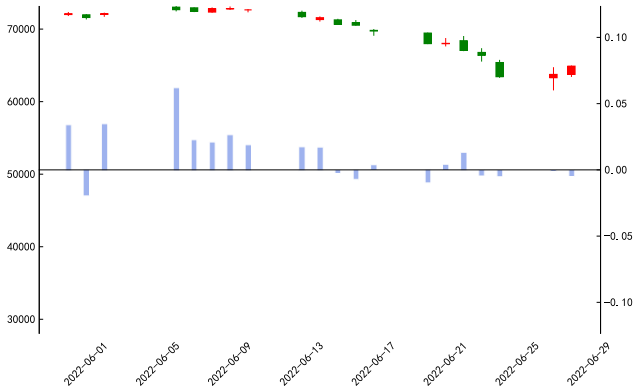
资料来源: Wind 中信期货研究所

图表 19: 苹果资金净流向



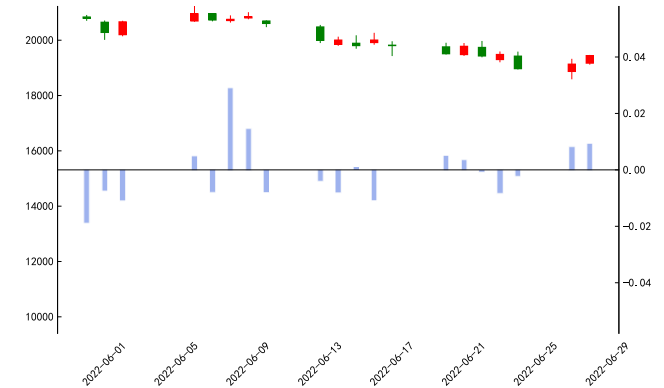
资料来源: Wind 中信期货研究所

图表 20：沪铜资金净流向



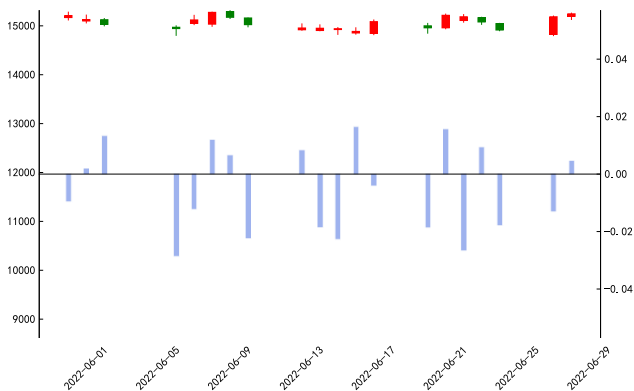
资料来源：Wind 中信期货研究所

图表 21：沪铝资金净流向



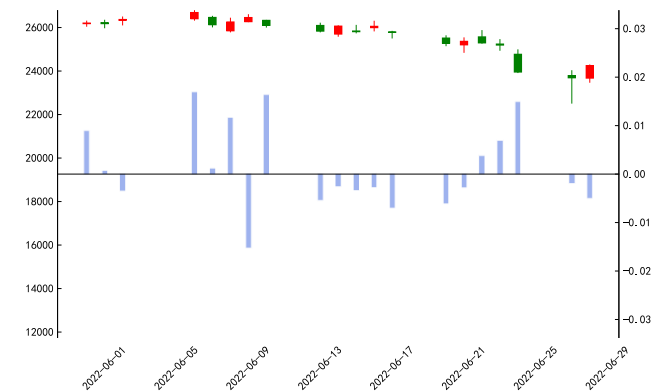
资料来源：Wind 中信期货研究所

图表 22：沪铅资金净流向



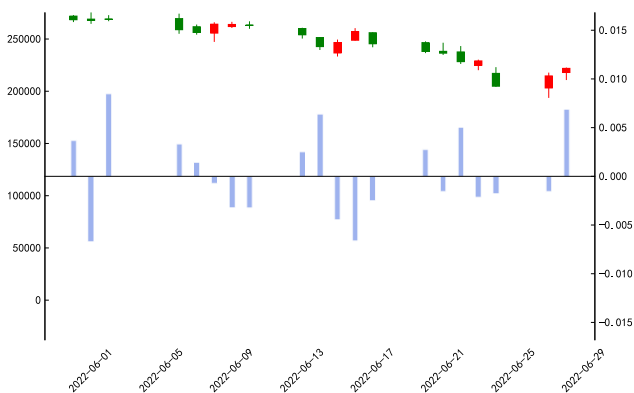
资料来源：Wind 中信期货研究所

图表 23：沪锌资金净流向



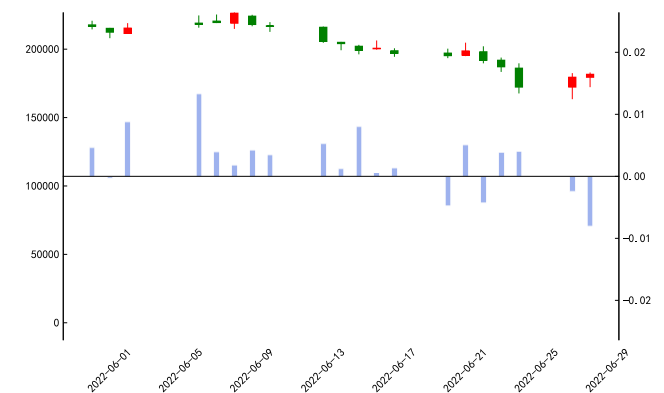
资料来源：Wind 中信期货研究所

图表 24：沪锡资金净流向



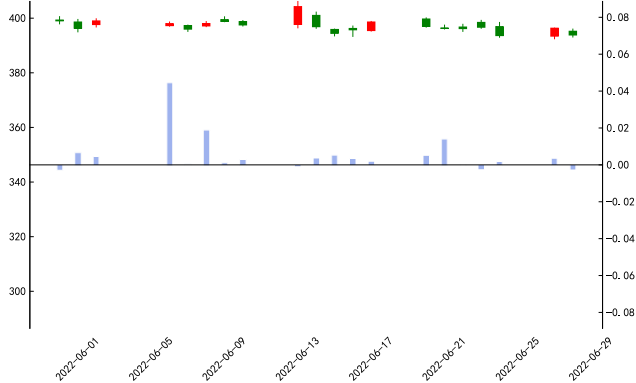
资料来源：Wind 中信期货研究所

图表 25：沪镍资金净流向



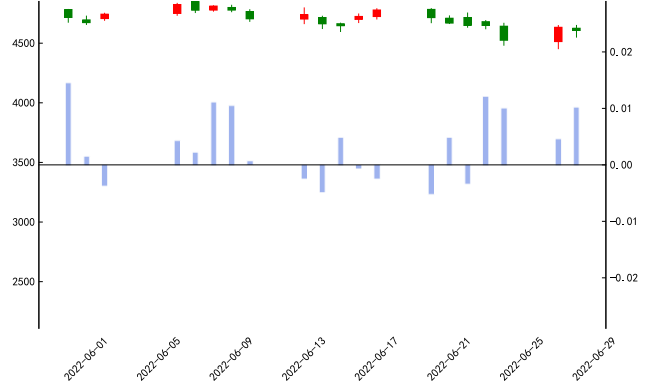
资料来源：Wind 中信期货研究所

图表 26: 黄金资金净流向



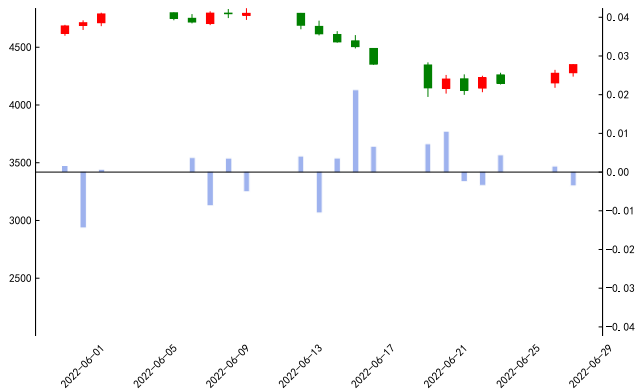
资料来源: Wind 中信期货研究所

图表 27: 白银资金净流向



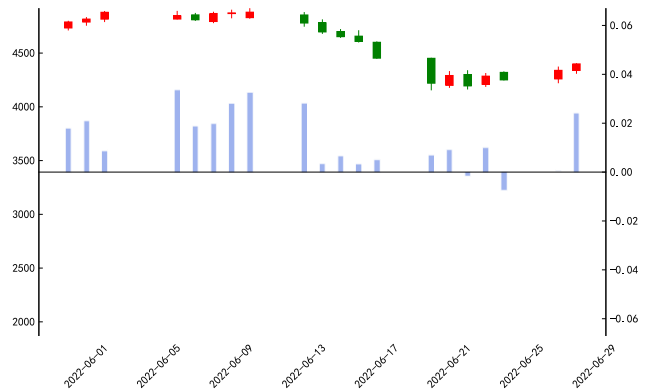
资料来源: Wind 中信期货研究所

图表 28: 螺纹钢资金净流向



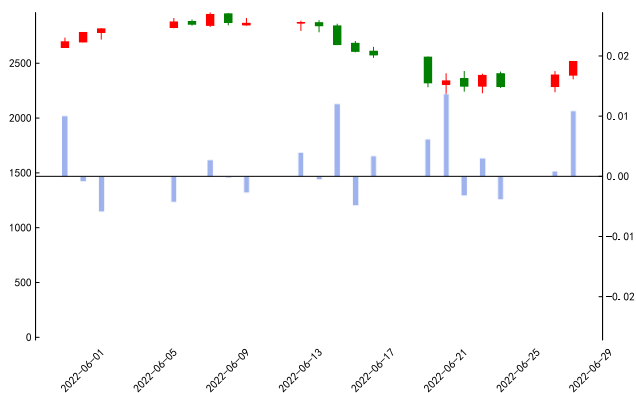
资料来源: Wind 中信期货研究所

图表 29: 热卷资金净流向



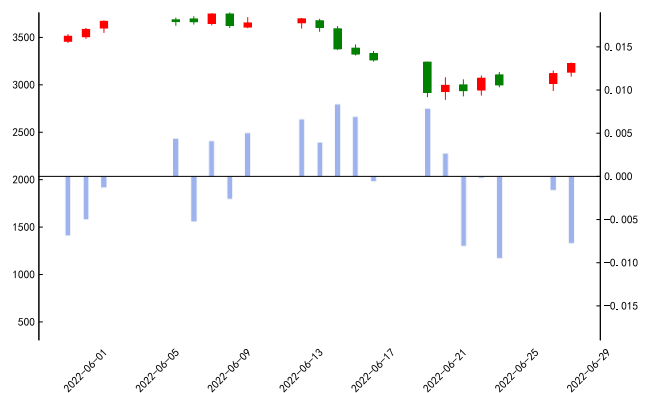
资料来源: Wind 中信期货研究所

图表 30: 焦煤资金净流向



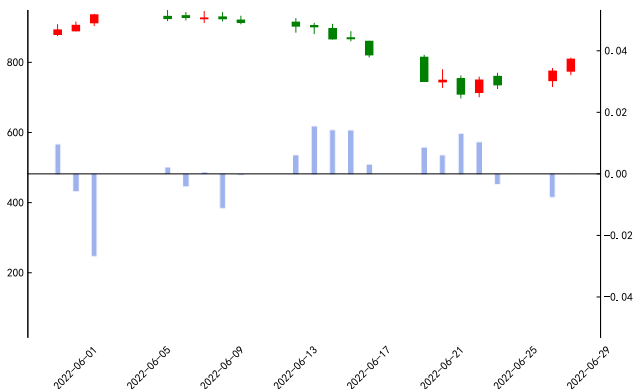
资料来源: Wind 中信期货研究所

图表 31: 焦炭资金净流向



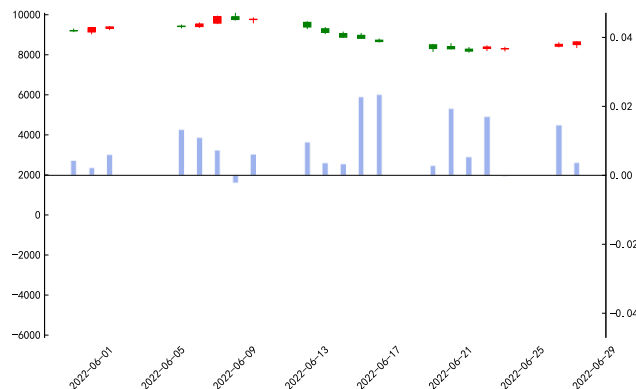
资料来源: Wind 中信期货研究所

图表 32：铁矿石资金净流向



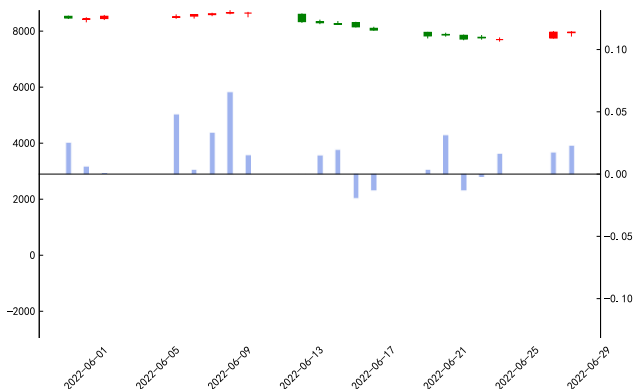
资料来源：Wind 中信期货研究所

图表 33：硅铁资金净流向



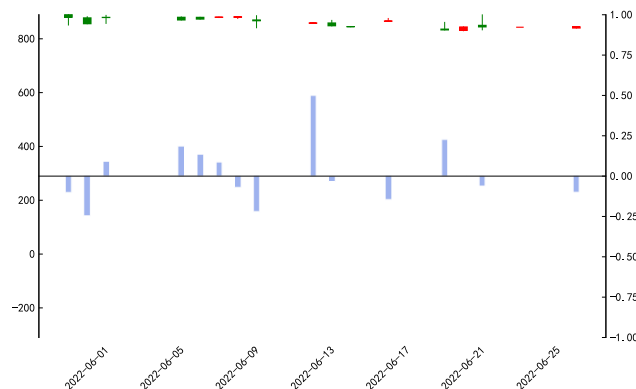
资料来源：Wind 中信期货研究所

图表 34：硅锰资金净流向



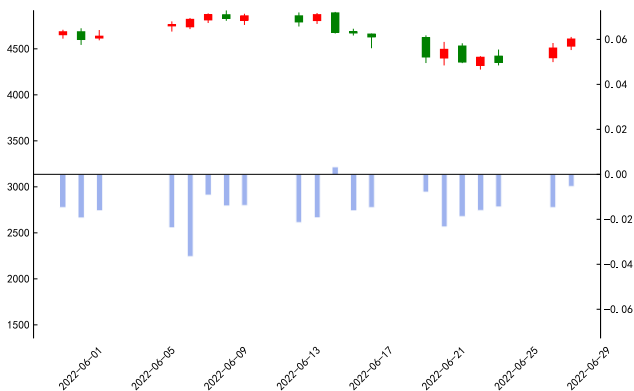
资料来源：Wind 中信期货研究所

图表 35：动力煤资金净流向



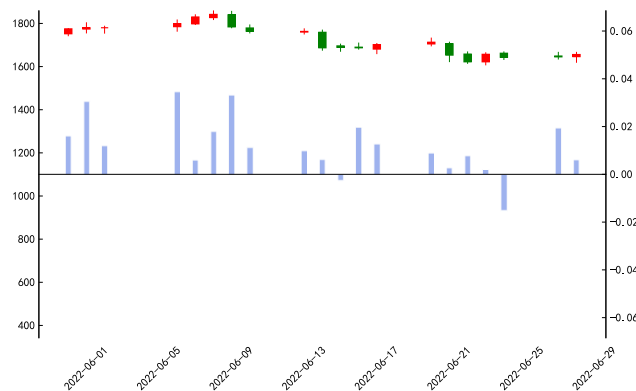
资料来源：Wind 中信期货研究所

图表 36：沥青资金净流向



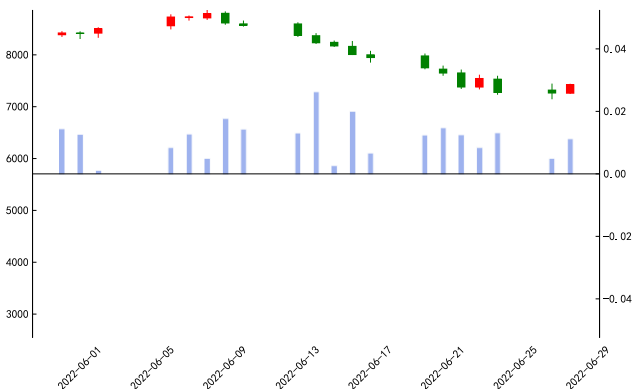
资料来源：Wind 中信期货研究所

图表 37：玻璃资金净流向



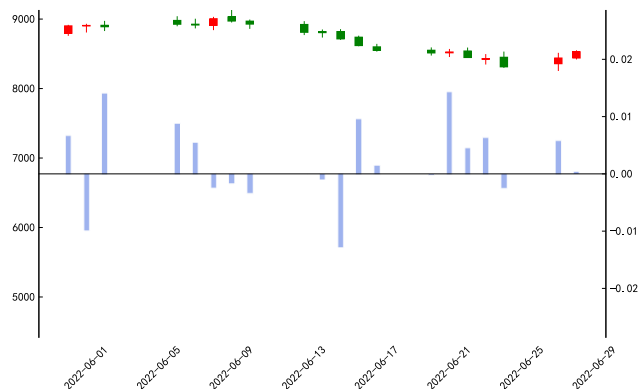
资料来源：Wind 中信期货研究所

图表 38: PVC 资金净流向



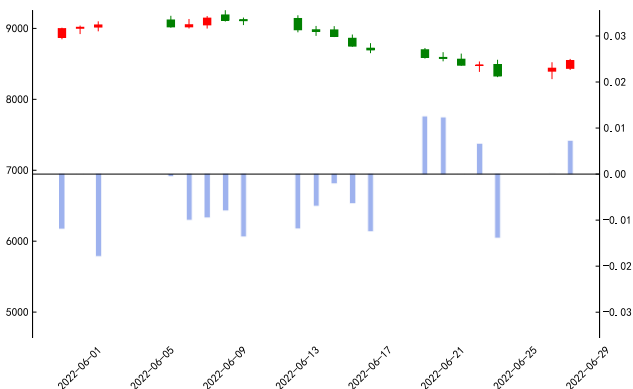
资料来源: Wind 中信期货研究所

图表 39: PP 资金净流向



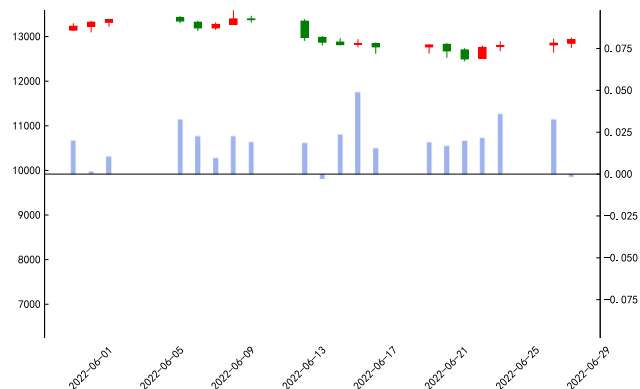
资料来源: Wind 中信期货研究所

图表 40: 塑料资金净流向



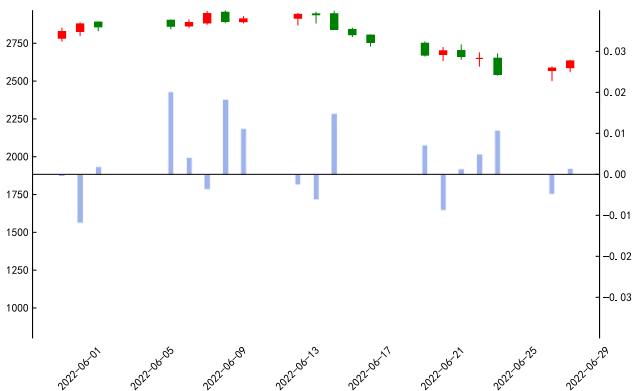
资料来源: Wind 中信期货研究所

图表 41: 橡胶资金净流向



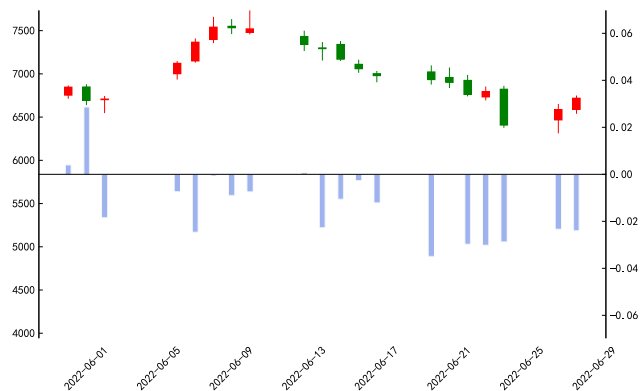
资料来源: Wind 中信期货研究所

图表 42: 甲醇资金净流向



资料来源: Wind 中信期货研究所

图表 43: PTA 资金净流向



资料来源: Wind 中信期货研究所

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，空头增仓的作用大于多头减仓；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，中信期货有限公司拥有本报告的版权和/或其他相关知识产权。未经中信期货有限公司事先书面许可，任何单位或个人不得以任何方式复制、转载、引用、刊登、发表、发行、修改、翻译此报告的全部或部分材料、内容。除非另有说明，本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所有或经合法授权被许可使用的商标、服务标记及标记。未经中信期货有限公司或商标所有权人的书面许可，任何单位或个人不得使用该商标、服务标记及标记。

如果在任何国家或地区管辖范围内，本报告内容或其适用与任何政府机构、监管机构、自律组织或者清算机构的法律、规则或规定内容相抵触，或者中信期货有限公司未被授权在当地提供这种信息或服务，那么本报告的内容并不意图提供给这些地区的个人或组织，任何个人或组织也不得在当地查看或使用本报告。本报告所载的内容并非适用于所有国家或地区或者适用于所有人。

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会因接收人收到此报告而视其为客户。

尽管本报告中所包含的信息是我们于发布之时从我们认为可靠的渠道获得，但中信期货有限公司对于本报告所载的信息、观点以及数据的准确性、可靠性、时效性以及完整性不作任何明确或隐含的保证。因此任何人不得对本报告所载的信息、观点以及数据的准确性、可靠性、时效性及完整性产生任何依赖，且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。本报告不应取代个人的独立判断。本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。此报告不构成任何投资、法律、会计或税务建议，且不担保任何投资及策略适合阁下。此报告并不构成中信期货有限公司给予阁下的任何私人咨询建议。

中信期货有限公司

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