



## 豆油增仓首位，焦煤减仓首位

### 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。

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

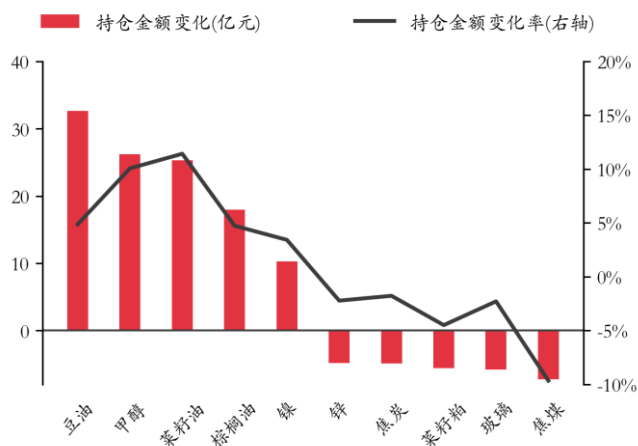
投资咨询号：Z0014257

## 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

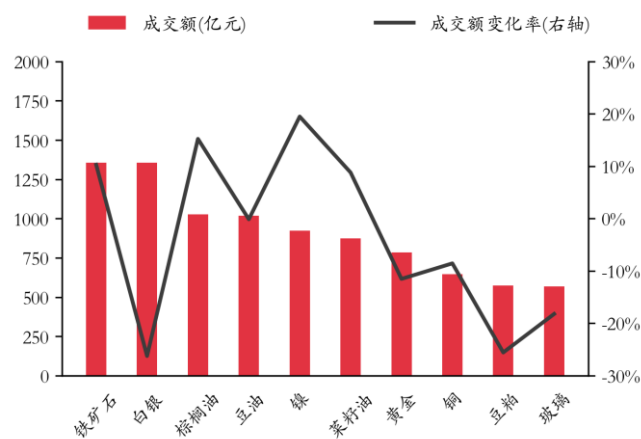
2020-09-21



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

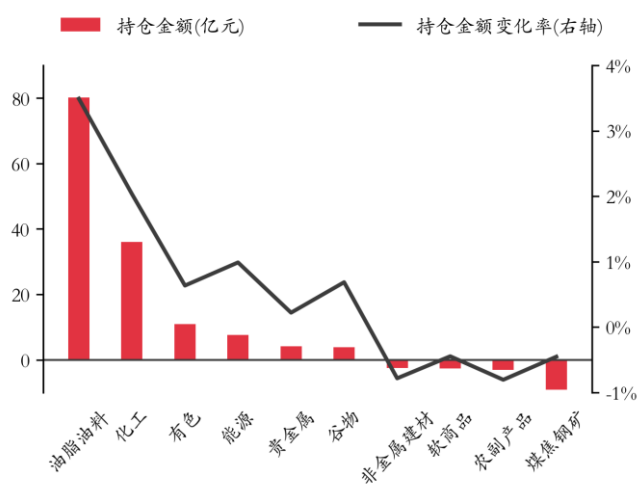
2020-09-21



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

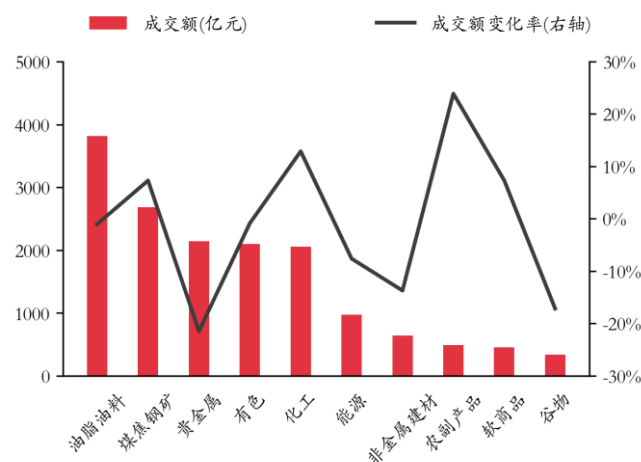
2020-09-21



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

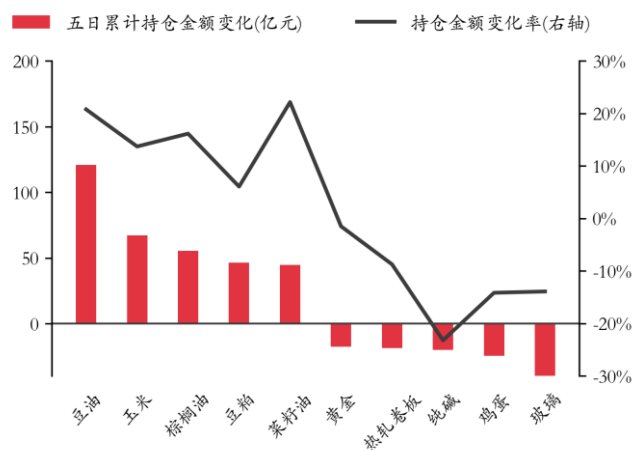
2020-09-21



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

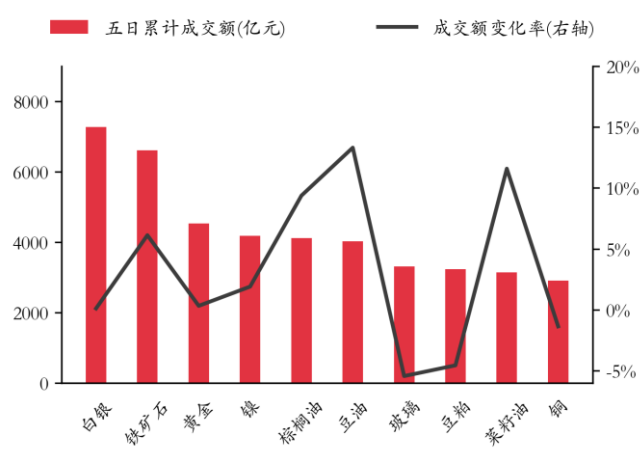
2020-09-14 至 2020-09-21



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

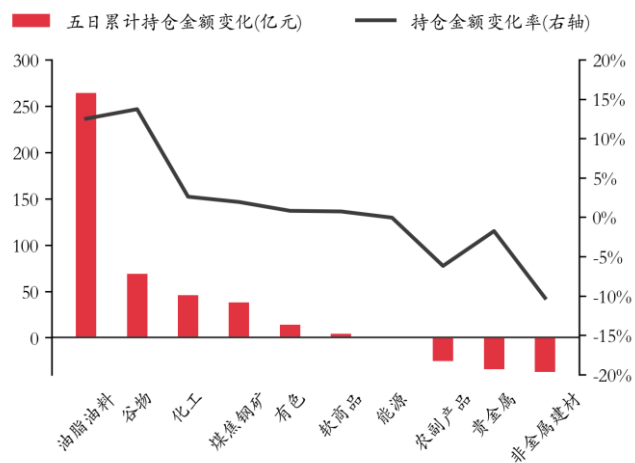
2020-09-14 至 2020-09-21



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

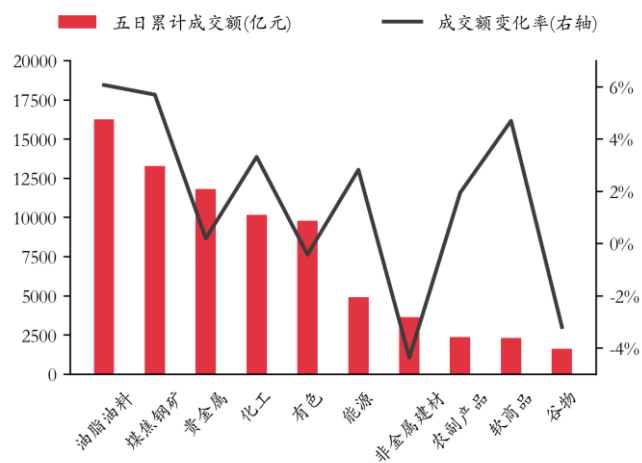
2020-09-14 至 2020-09-21



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

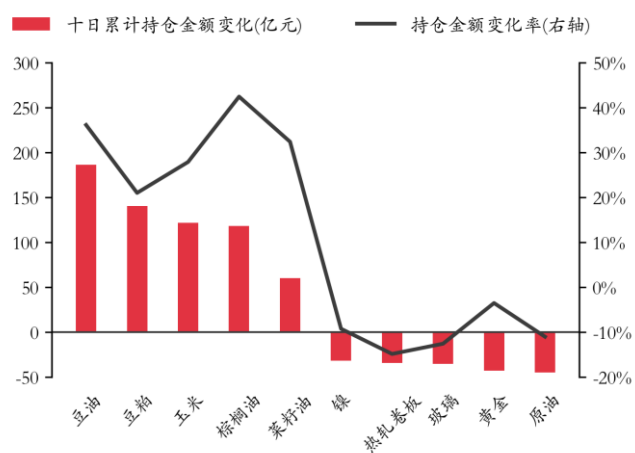
2020-09-14 至 2020-09-21



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

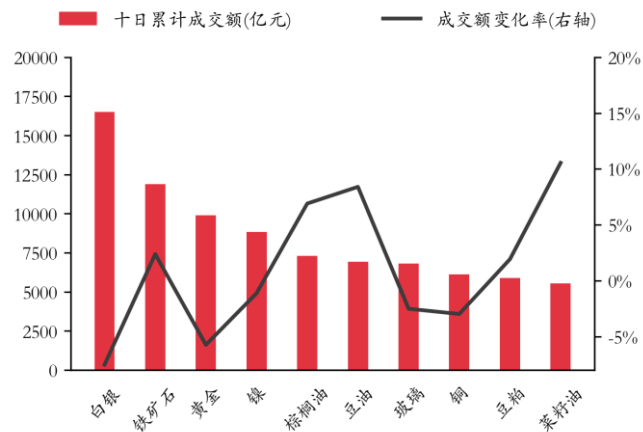
2020-09-07 至 2020-09-21



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

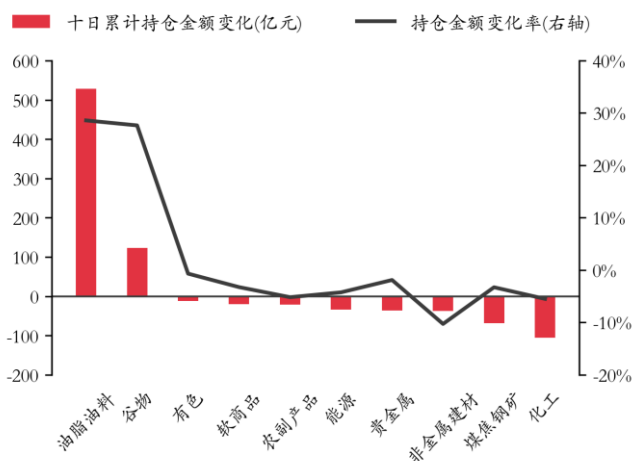
2020-09-07 至 2020-09-21



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

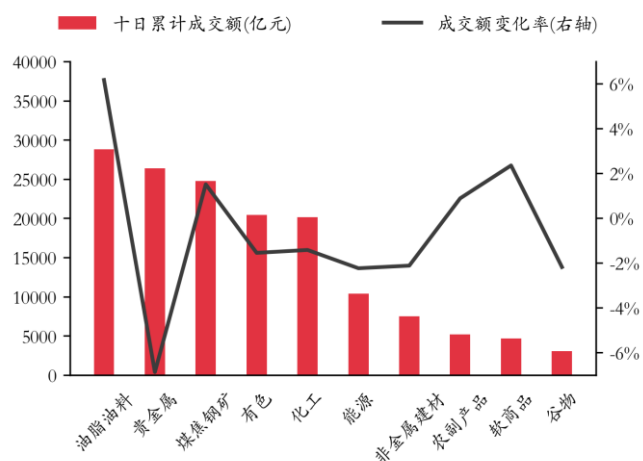
2020-09-07 至 2020-09-21



数据来源: Ricequant 华泰期货研究院

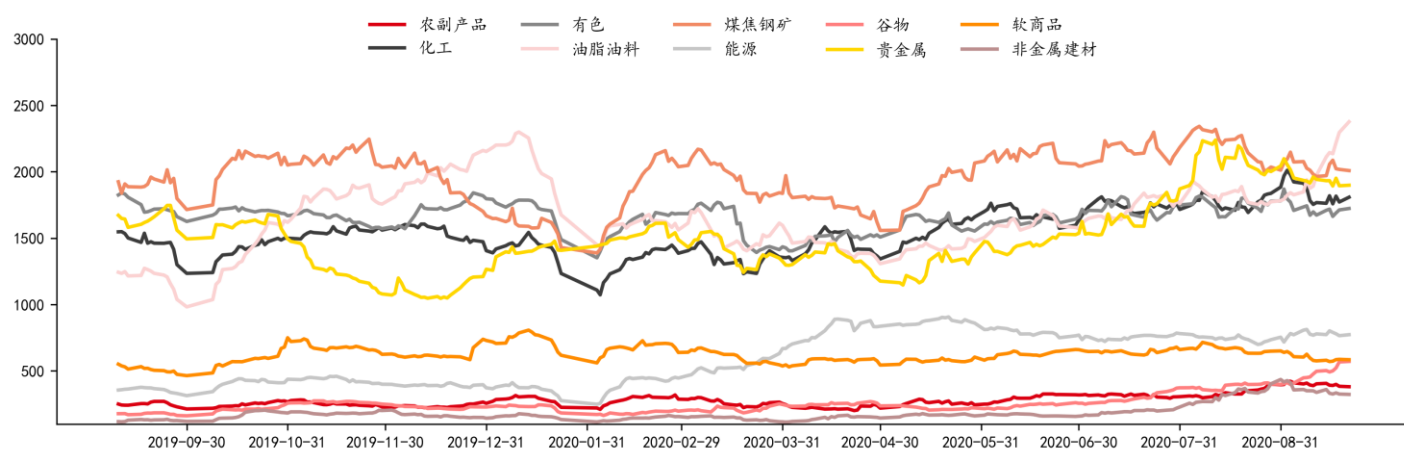
图12: 10日滚动各板块成交金额情况

2020-09-07 至 2020-09-21



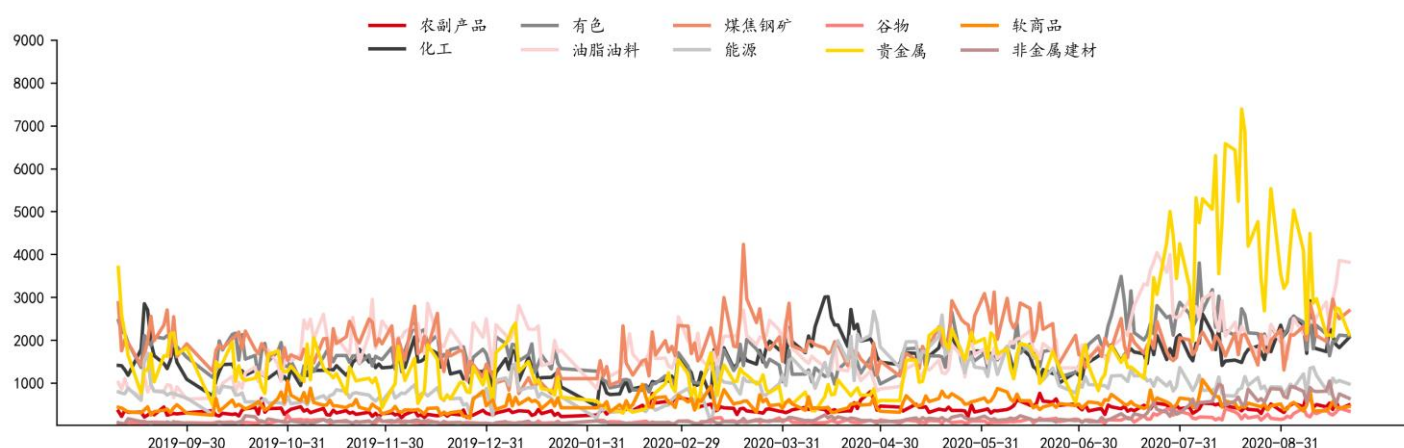
数据来源: Ricequant 华泰期货研究院

图13: 各版块持仓金额(亿元)



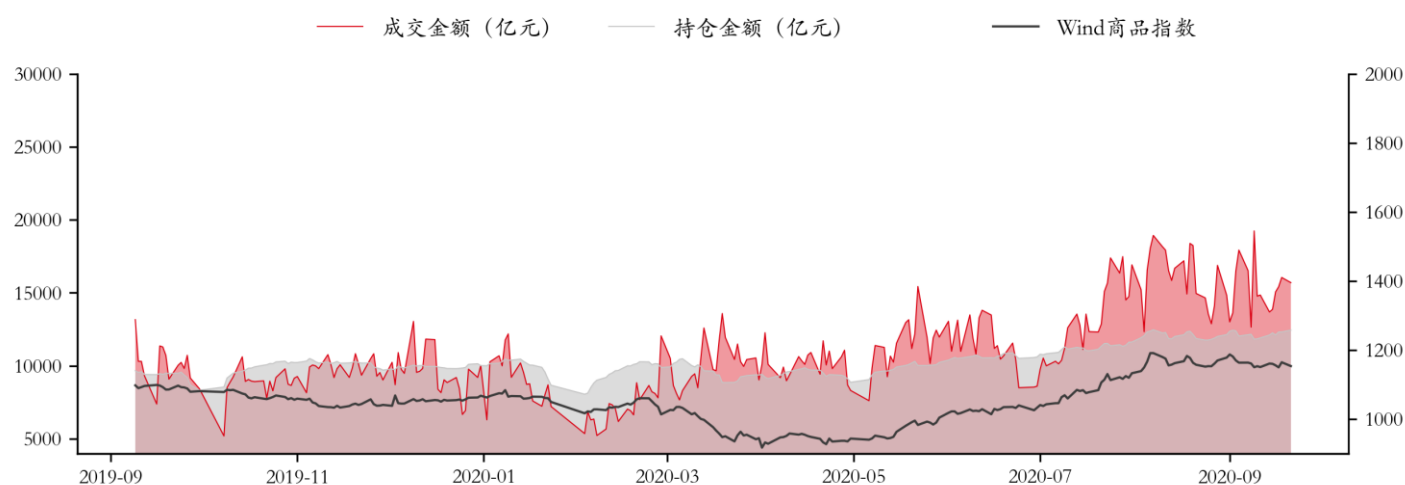
数据来源: Ricequant 华泰期货研究院

图14: 各版块成交金额(亿元)



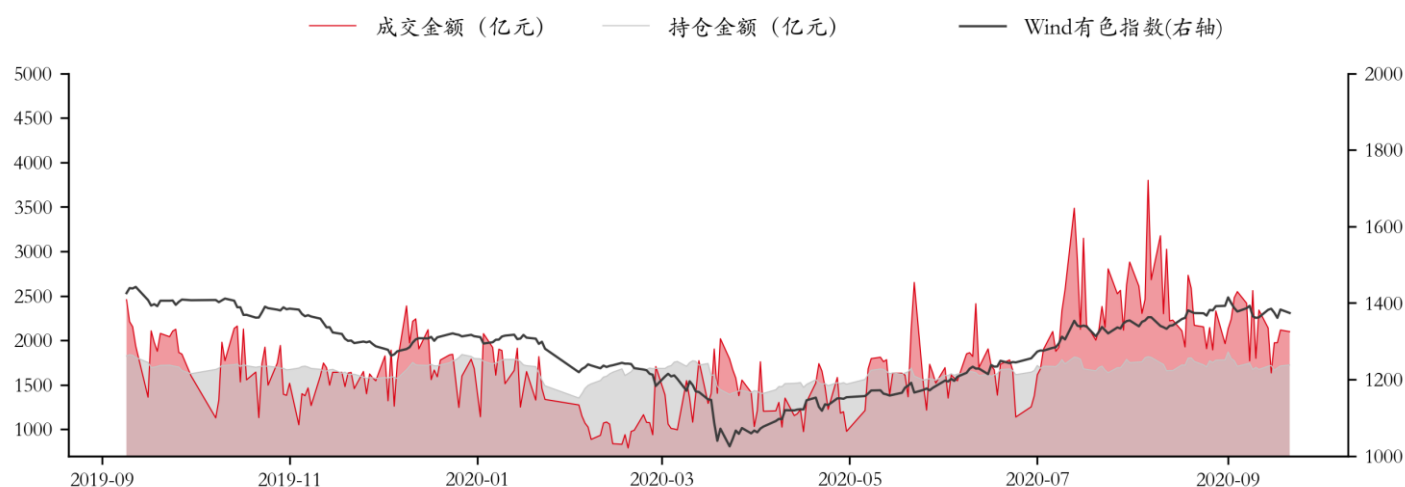
数据来源: Ricequant 华泰期货研究院

图15: 中国商品期货市场持仓金额、成交金额与 Wind 商品指数



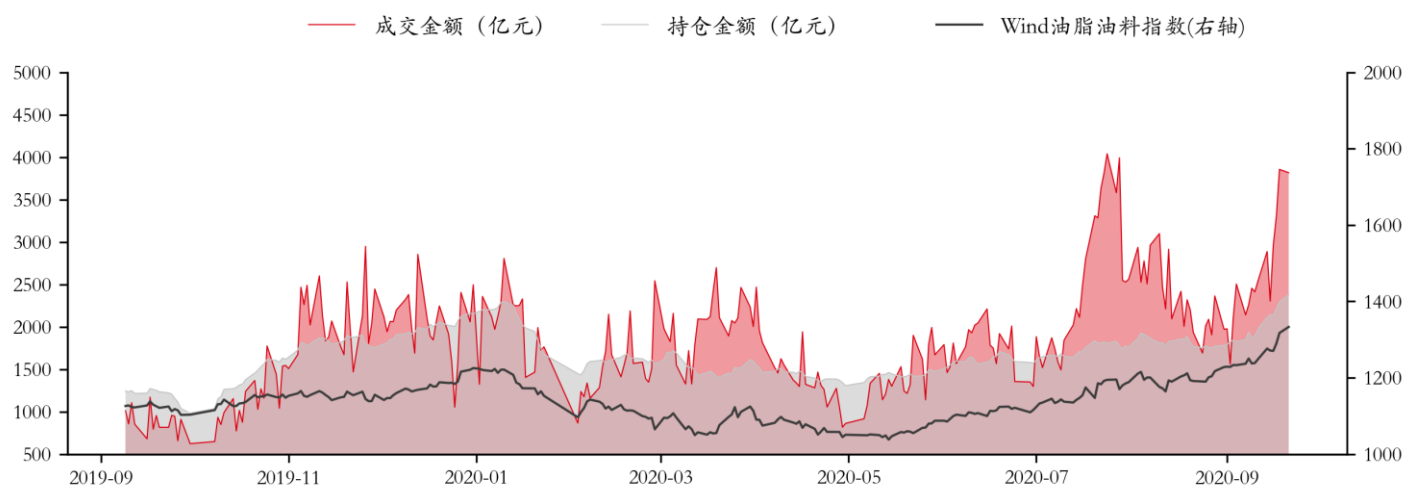
数据来源: Ricequant Wind 华泰期货研究院

图16: 有色板块持仓金额、成交金额与 Wind 有色指数



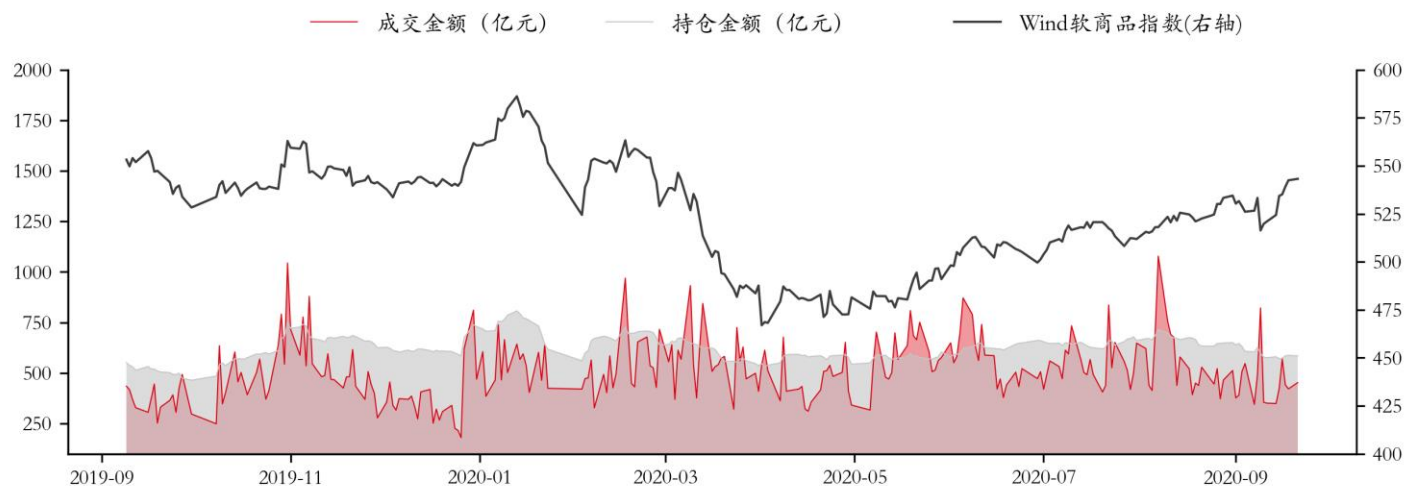
数据来源: Ricequant Wind 华泰期货研究院

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



预览已结束，完整报告链接和二维码如下：

[https://www.yunbaogao.cn/report/index/report?reportId=1\\_2403](https://www.yunbaogao.cn/report/index/report?reportId=1_2403)

