



市场持仓分析

2018/1/18

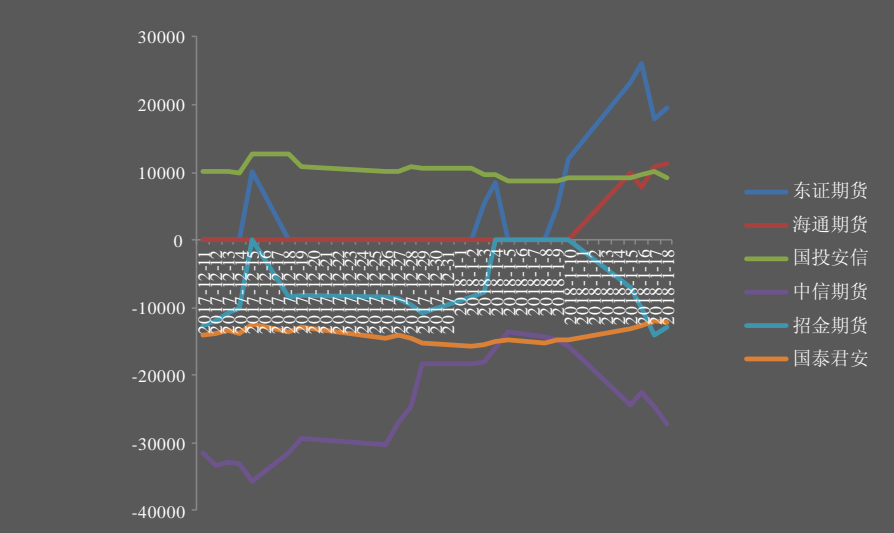
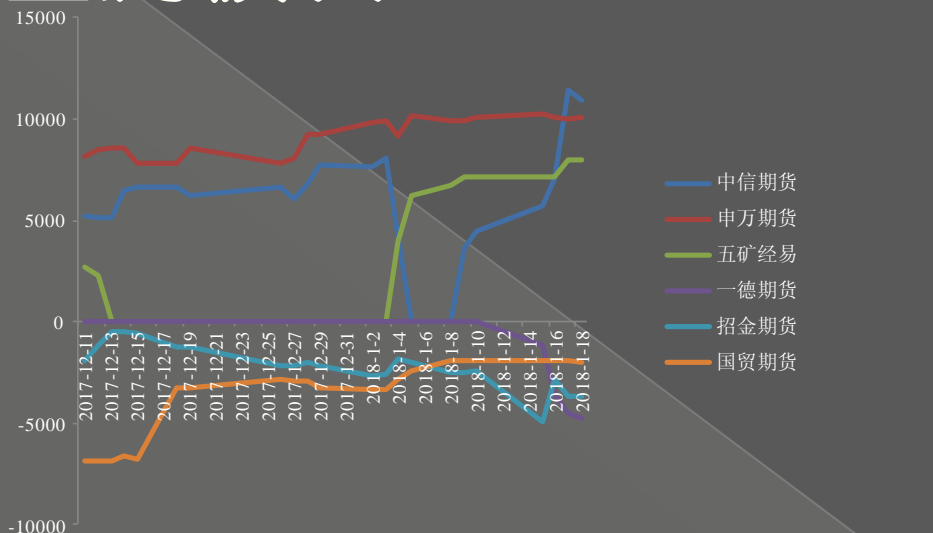
今天持仓变化

品种	今天变化						今天头寸变化参考	
	多头前3	多头前5	多头前20	空头前3	空头前5	空头前20	多头前3-空头前3	指标参考
焦炭	-8.65%	-11.51%	-11.09%	13.20%	13.07%	10.67%	-21.85%	☆☆☆☆
甲醇	2.31%	5.33%	5.31%	2.65%	0.19%	-4.29%	-0.35%	☆
焦煤	-5.15%	-5.47%	-4.17%	12.27%	12.01%	8.94%	-17.42%	☆☆☆
动力煤	8.66%	8.49%	10.55%	-9.31%	-7.36%	-13.15%	17.97%	☆☆☆
铁矿石	-5.51%	-4.52%	-4.25%	0.98%	4.32%	2.73%	-6.49%	☆☆
玻璃	5.18%	3.38%	6.58%	-8.52%	-5.54%	-8.19%	13.70%	☆☆☆
豆粕	-2.67%	-2.18%	-0.48%	0.02%	-0.35%	-0.25%	-2.69%	☆
玉米	1.30%	-0.76%	-3.08%	2.09%	3.19%	1.61%	-0.79%	☆
棕榈油	-1.16%	-0.25%	1.92%	4.16%	3.83%	-1.25%	-5.32%	☆☆
鸡蛋	-3.82%	-2.68%	-0.65%	3.05%	1.69%	1.92%	-6.87%	☆☆
沪镍	-1.41%	-0.98%	-1.48%	-0.17%	-1.81%	-1.40%	-1.24%	☆
菜籽粕	0.38%	0.20%	-0.02%	0.03%	-0.19%	-0.90%	0.35%	☆
橡胶	1.96%	2.28%	1.46%	-2.59%	-2.03%	-0.30%	4.56%	☆
豆油	0.66%	1.32%	1.92%	-0.58%	-0.04%	-0.12%	1.24%	☆
沪铜	3.52%	2.13%	0.65%	-0.35%	0.21%	1.21%	3.87%	☆
棉花	5.45%	11.30%	18.05%	-2.03%	-1.36%	-14.79%	7.48%	☆☆
白糖	4.30%	2.96%	2.80%	-0.38%	-1.83%	-3.99%	4.67%	☆
沪锌	-1.26%	-0.59%	0.24%	-1.47%	-1.21%	0.39%	0.22%	☆
聚乙烯	-1.82%	-2.21%	0.50%	0.42%	0.47%	-0.06%	-2.24%	☆
聚丙烯	4.97%	2.68%	2.18%	2.76%	1.49%	-0.72%	2.22%	☆
沥青	0.04%	0.47%	-0.08%	-0.63%	-0.54%	-0.61%	0.68%	☆
沪银	3.94%	2.15%	1.35%	-0.16%	-0.89%	-1.20%	4.10%	☆
PTA	0.48%	0.66%	-0.04%	-0.85%	-0.93%	-1.88%	1.33%	☆
沪金	1.15%	1.47%	-0.16%	-6.37%	-5.43%	-0.35%	7.52%	☆☆
沪铝	0.75%	0.92%	0.11%	-0.04%	-0.84%	-0.34%	0.79%	☆
螺纹钢	9.60%	7.86%	8.77%	2.07%	1.18%	-5.78%	7.53%	☆☆

近5日持仓变化

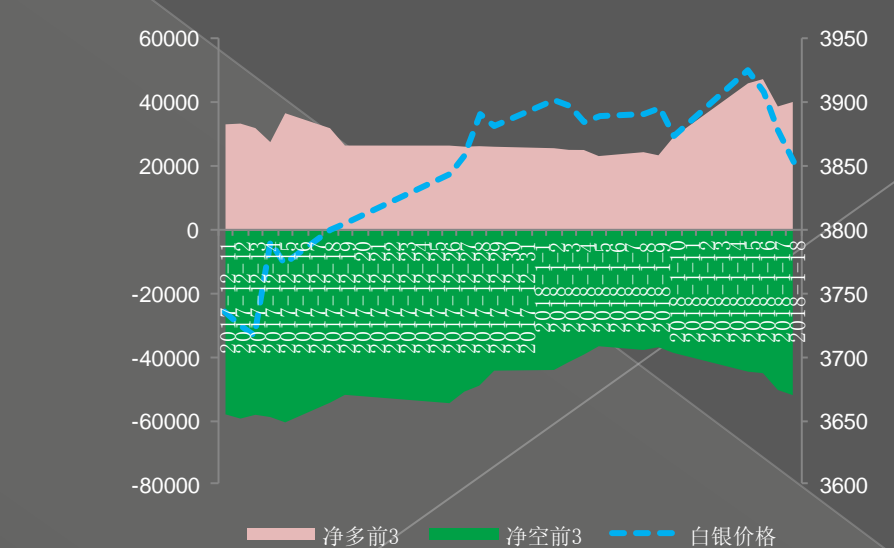
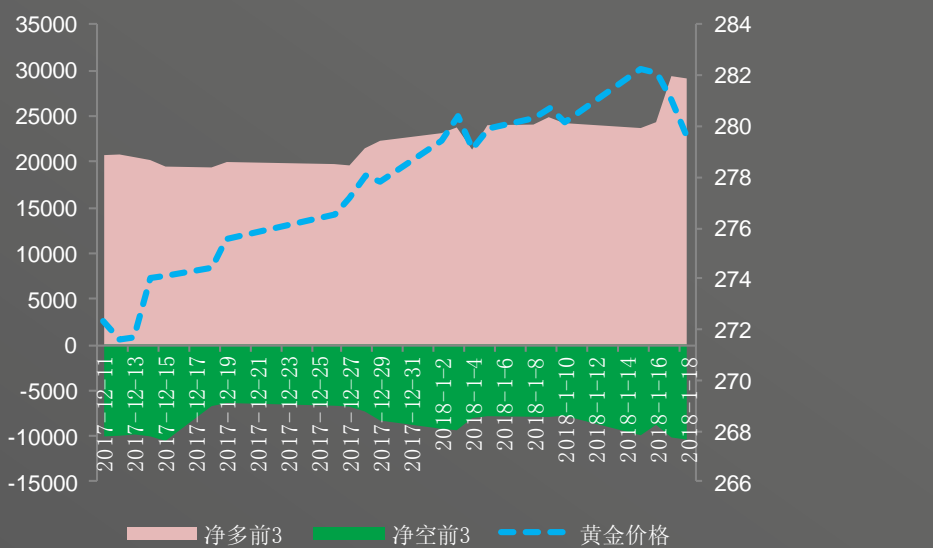
品种	五日变化						近五日头寸变化参考	
	多头前3	多头前5	多头前20	空头前3	空头前5	空头前20	多头前3-空头前3	指标参考
甲醇	1.03%	1.73%	3.26%	-29.95%	-30.68%	-19.62%	30.98%	☆☆☆
玉米	4.20%	4.65%	3.29%	-14.67%	-9.78%	-7.30%	18.87%	☆☆
棕榈油	-11.39%	-9.30%	-0.25%	-2.05%	-0.41%	-7.94%	-9.35%	☆
动力煤	32.29%	32.62%	33.93%	-5.37%	-7.37%	-20.31%	37.66%	☆☆☆
聚丙烯	0.91%	4.68%	1.55%	5.94%	4.60%	5.94%	-5.03%	☆
橡胶	9.03%	2.57%	1.30%	6.98%	5.80%	2.76%	2.04%	☆
棉花	-3.79%	4.95%	19.93%	-3.48%	-15.24%	-26.41%	-0.32%	☆
鸡蛋	1.24%	3.73%	2.75%	-2.34%	-0.44%	-0.86%	3.58%	☆
菜籽粕	2.67%	1.48%	5.76%	-1.10%	-1.31%	-6.50%	3.77%	☆
铁矿石	-20.11%	-13.47%	-15.56%	-1.07%	3.13%	8.10%	-19.04%	☆☆
豆油	-6.96%	-2.56%	2.10%	-3.66%	-0.98%	-3.15%	-3.30%	☆
沪镍	-7.69%	-7.77%	-5.55%	6.43%	3.67%	2.58%	-14.11%	☆☆
焦炭	-18.82%	-13.10%	-3.39%	-5.38%	-3.84%	-5.55%	-13.44%	☆☆
沥青	26.21%	18.58%	10.80%	-7.44%	-5.67%	-0.17%	33.65%	☆☆☆
沪银	26.95%	19.90%	10.95%	-12.61%	-14.00%	-12.26%	39.55%	☆☆☆
沪铝	-16.24%	-14.15%	-11.62%	10.11%	6.02%	4.71%	-26.35%	☆☆
沪金	13.16%	8.63%	9.72%	3.21%	0.57%	3.68%	9.96%	☆
焦煤	16.07%	6.35%	-0.03%	-2.40%	5.02%	6.04%	18.47%	☆☆
沪锌	-2.24%	-1.06%	-9.23%	-3.18%	5.09%	7.34%	0.94%	☆
聚乙烯	5.64%	-4.66%	-9.38%	24.87%	18.33%	11.53%	-19.23%	☆☆
沪铜	-10.43%	-12.25%	-12.80%	5.86%	5.72%	7.73%	-16.28%	☆☆
豆粕	8.54%	7.54%	5.53%	-2.63%	-1.18%	-6.22%	11.17%	☆☆
螺纹钢	29.21%	22.76%	16.27%	8.58%	4.92%	-8.79%	20.63%	☆☆
PTA	3.22%	-4.87%	-7.34%	5.82%	9.56%	10.09%	-2.60%	☆
白糖	-14.45%	-13.14%	-4.96%	12.54%	10.53%	0.36%	-26.99%	☆☆
玻璃	-4.57%	-2.86%	-0.97%	9.83%	13.98%	4.34%	-14.40%	☆☆

金属板块：AU & AG

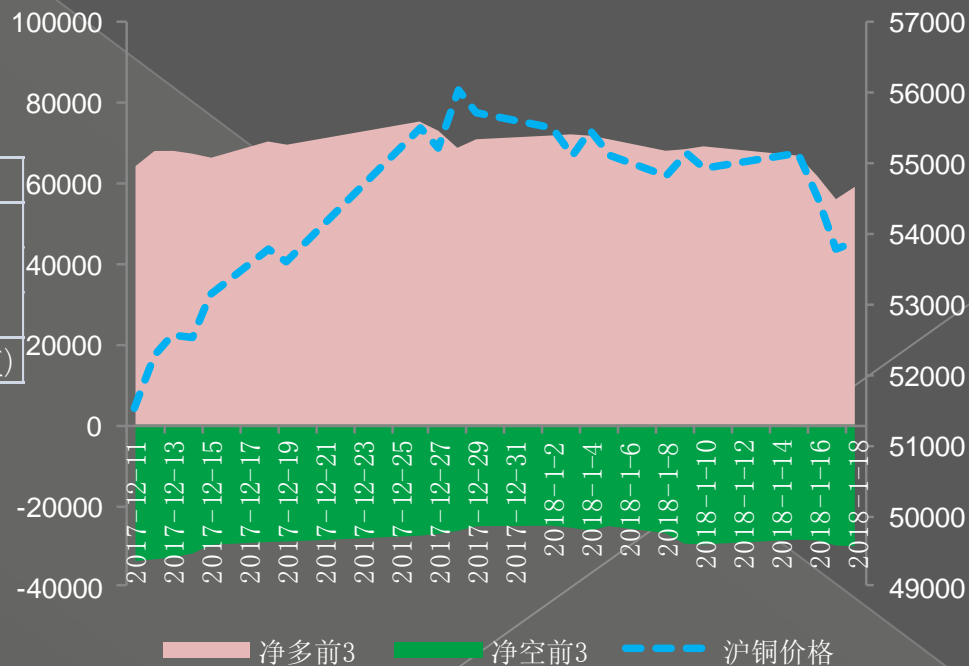
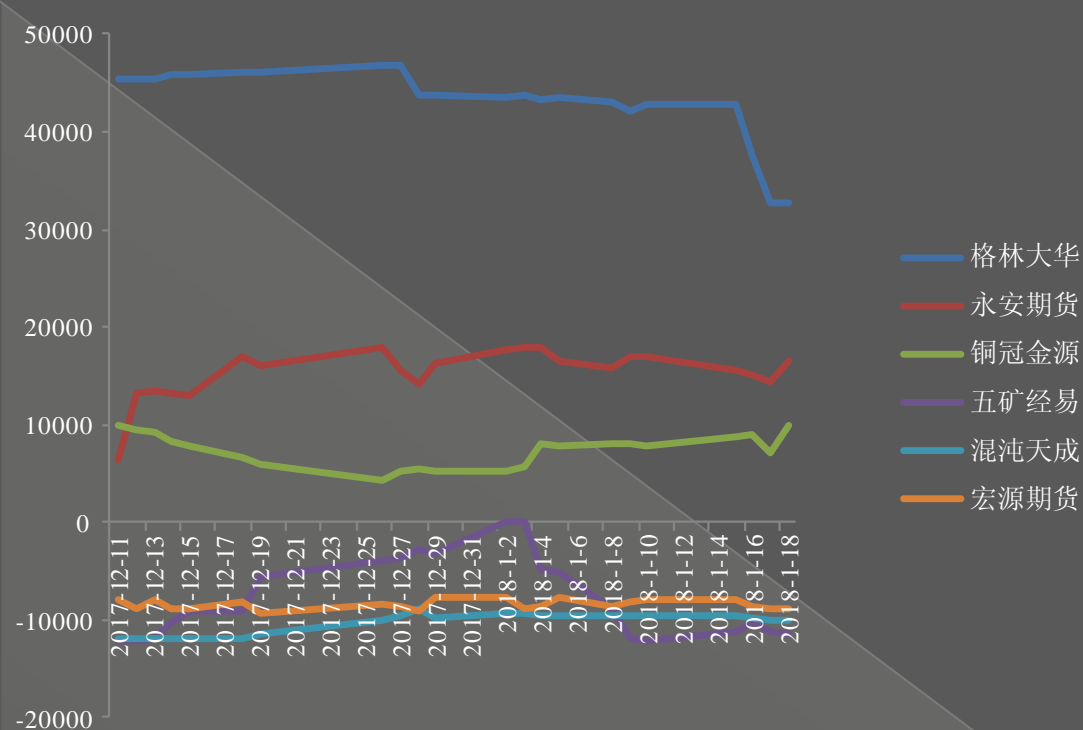


变动幅度		当日	最近5日	平均变化	波动率
au持仓	多头前3	-0.85%	17.03%	3.41%	5.82%
	空头前3	2.40%	31.38%	6.28%	
au涨幅		-0.55%	-0.44%	-0.09%	
震荡幅度	0.84%	0.58%(月均值)	投机度	0.41	0.36(月均值)

变动幅度		当日	最近5日	平均变化	波动率
ag持仓	多头前3	3.59%	70.64%	14.13%	10.92%
	空头前3	3.24%	41.17%	8.23%	
ag涨幅		-0.63%	-1.08%	-0.22%	
震荡幅度	0.98%	0.84%(月均值)	投机度	0.50	0.48(月均值)



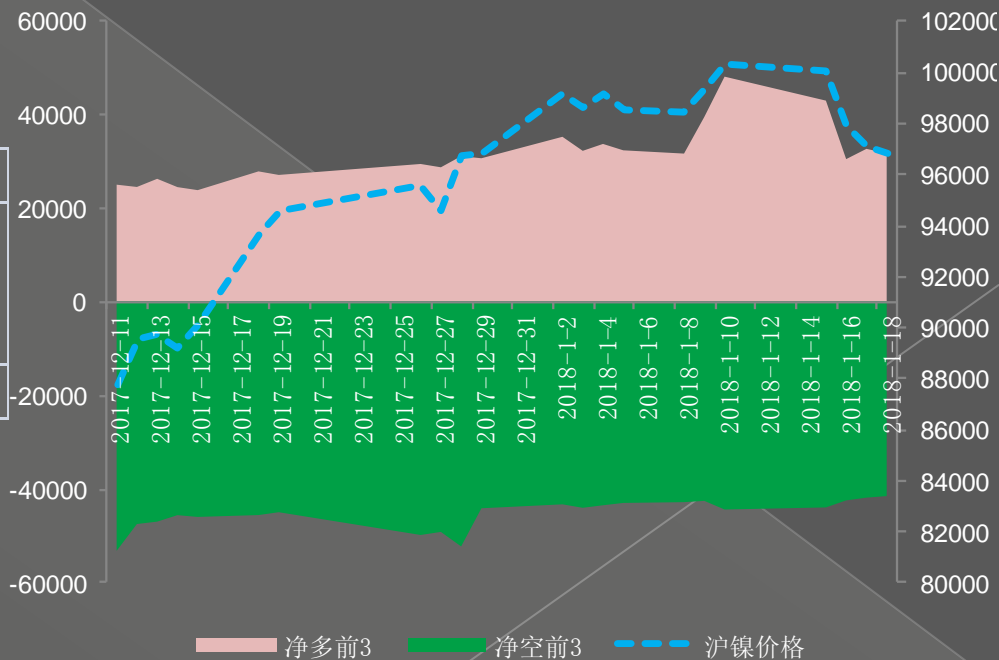
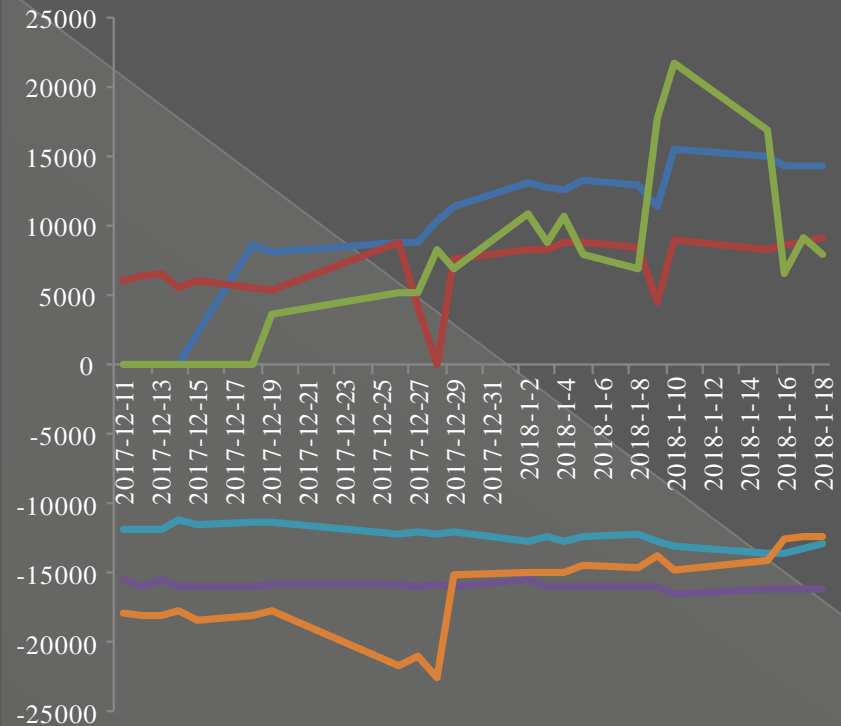
金属板块：Cu



变动幅度		当日	最近5日	平均变化	波动率
cu持仓	多头前3	5.47%	-13.63%	-2.73%	17.44%
	空头前3	0.61%	2.11%	0.42%	
cu涨幅		0.17%	-2.30%	-0.46%	
震荡幅度	0.88%	1.17%(月均值)	投机度	0.54	0.52(月均值)

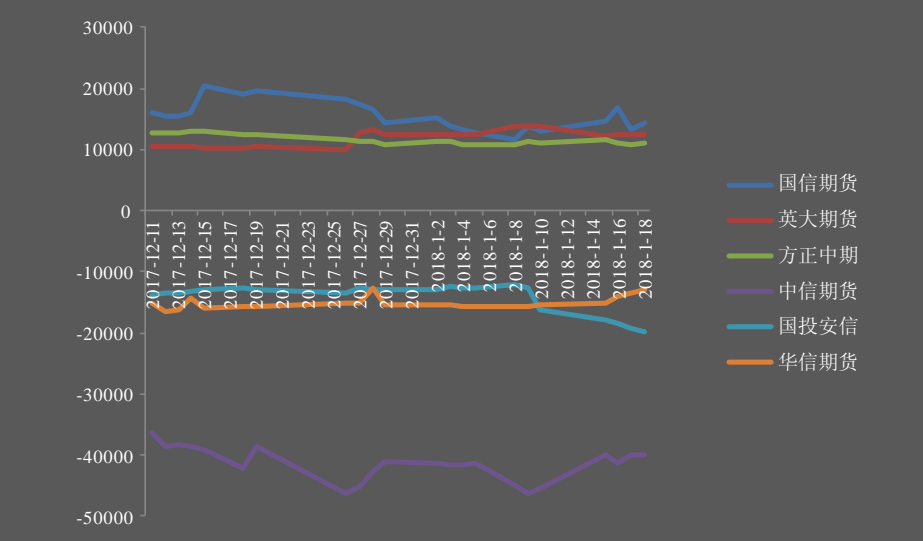
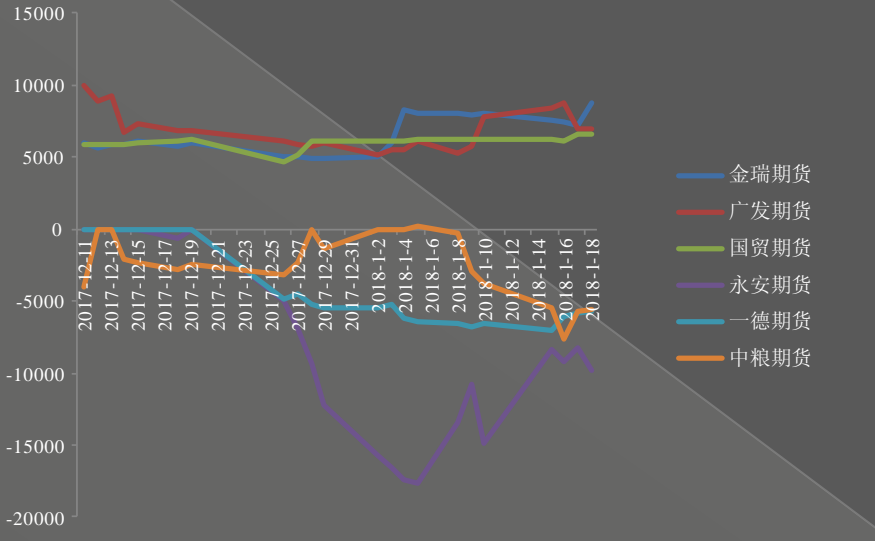
金属板块：Ni

- 国贸期货
- 华泰期货
- 永安期货
- 兴业期货
- 信达期货
- 建信期货



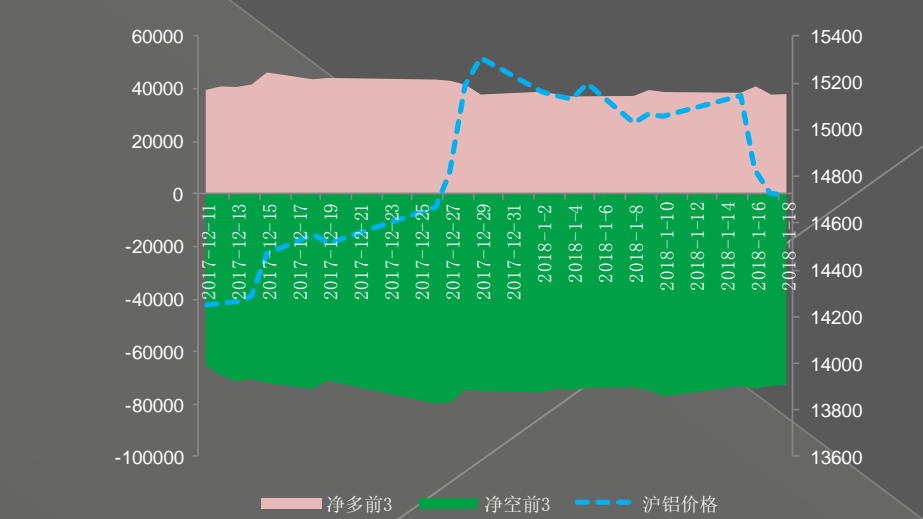
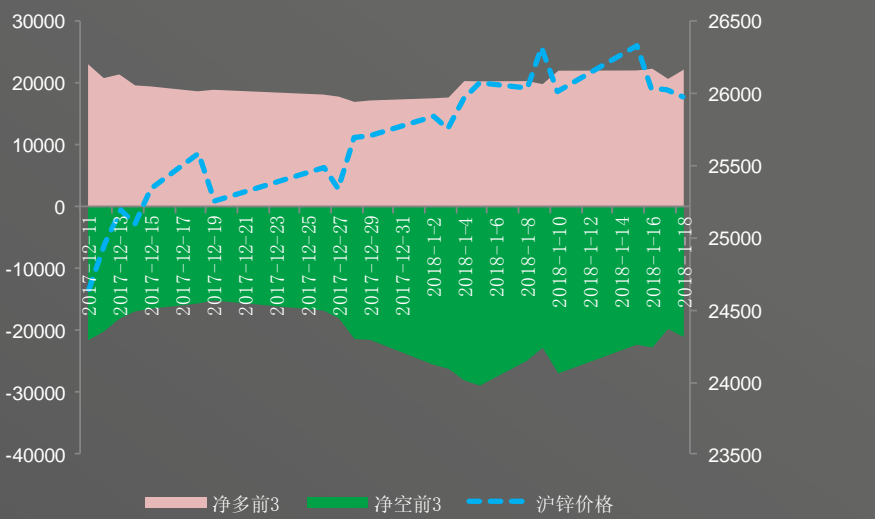
变动幅度		当日	最近5日	平均变化	波动率
ni持仓	多头前3	-2.93%	-19.77%	-3.95%	22.27%
	空头前3	-0.81%	-2.40%	-0.48%	
ni涨幅		-0.23%	-2.46%	-0.49%	
震荡幅度	0.96%	2.12%(月均值)	投机度	1.07	1.22(月均值)

金属板块：Zn & Al

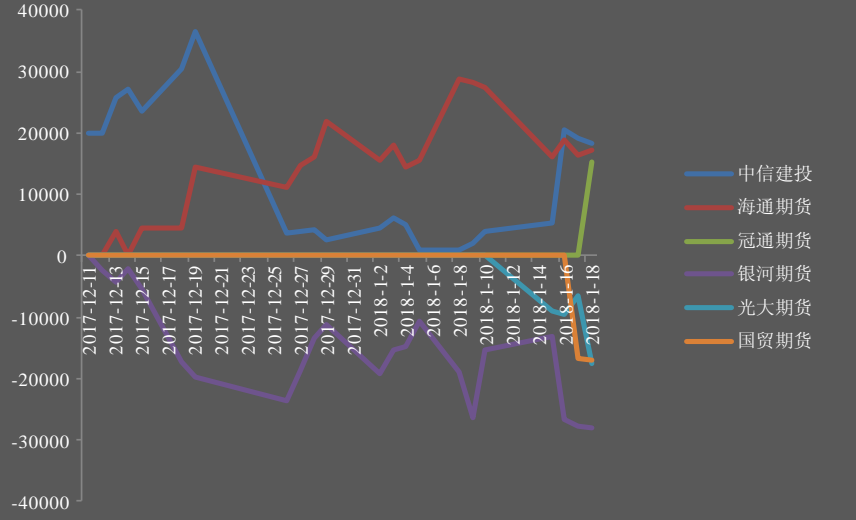
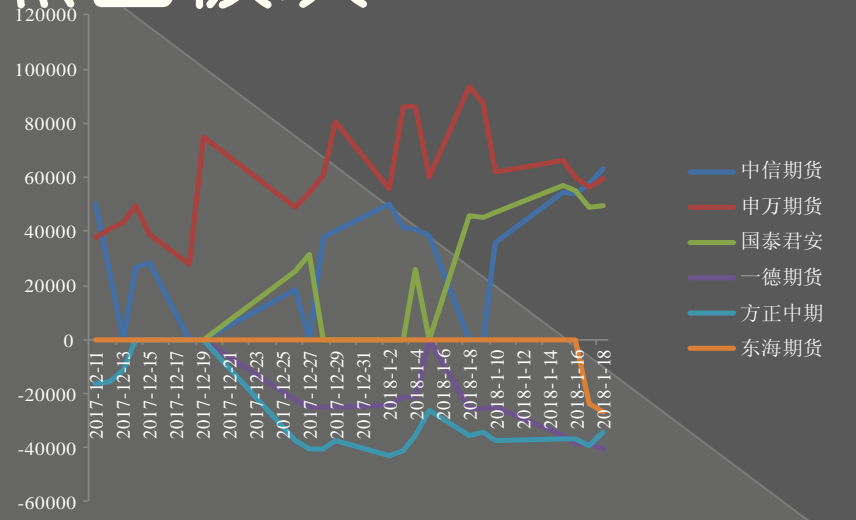


变动幅度		当日	最近5日	平均变化	波动率
zn持仓	多头前3	7.24%	11.77%	2.35%	13.37%
	空头前3	6.55%	-7.73%	-1.55%	
zn涨幅		-0.21%	-1.33%	-0.27%	
震荡幅度	0.76%	1.32%(月均值)	投机度	0.79	1.16(月均值)

变动幅度		当日	最近5日	平均变化	波动率
al持仓	多头前3	0.51%	-3.95%	-0.79%	14.92%
	空头前3	-0.47%	-2.71%	-0.54%	
al涨幅		-0.05%	-2.29%	-0.46%	
震荡幅度	1.23%	1.45%(月均值)	投机度	0.47	0.54(月均值)

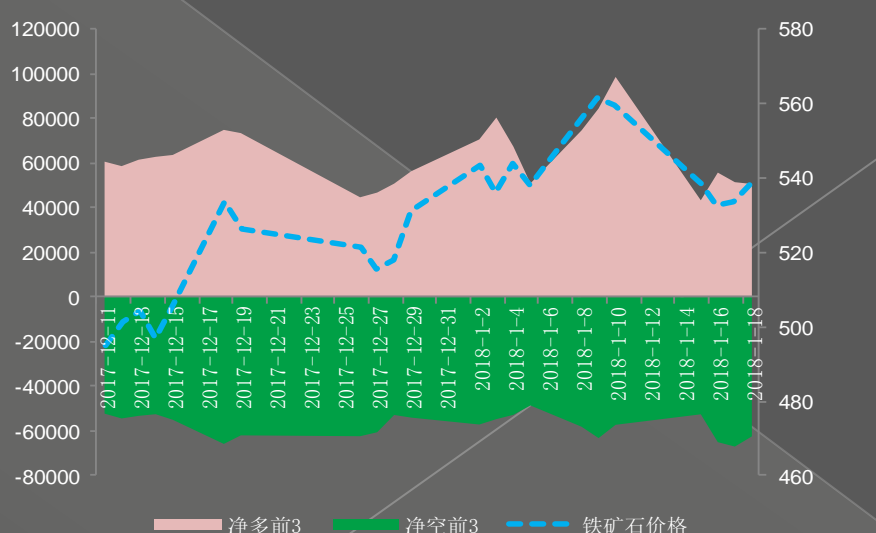
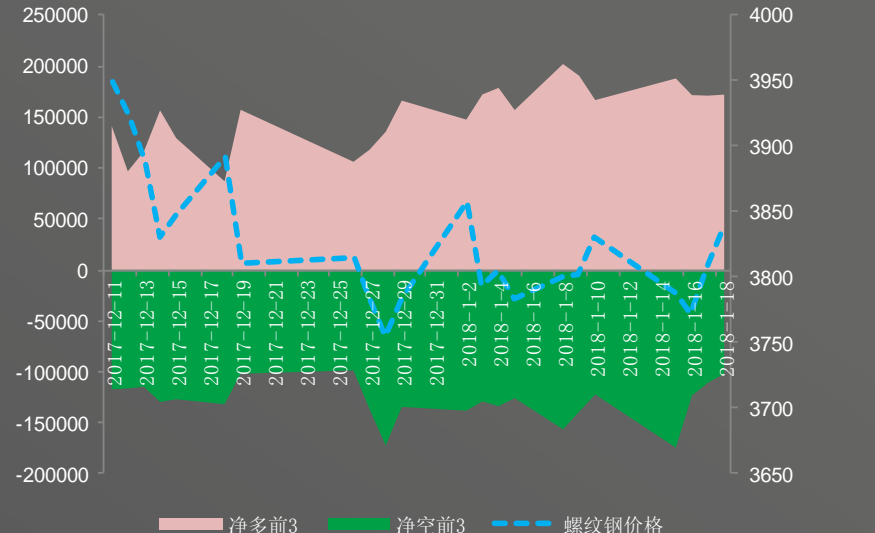


黑色板块：Rb & I

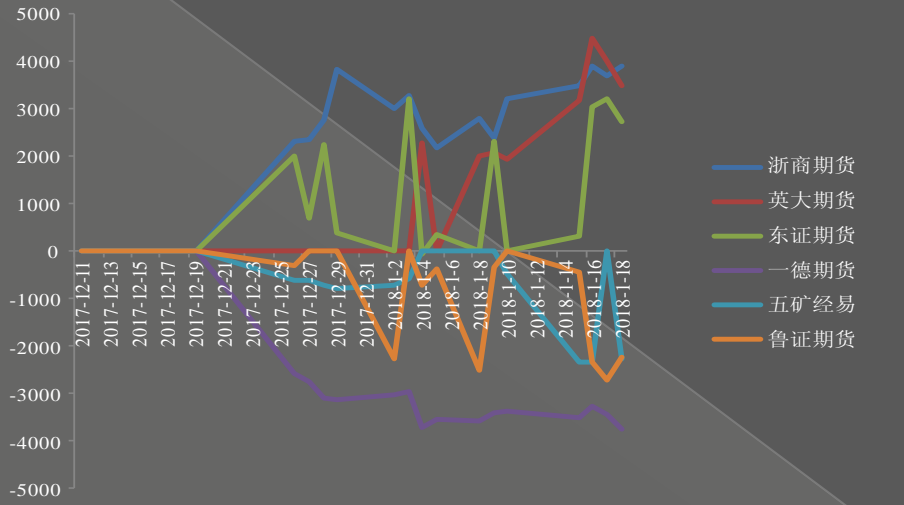


变动幅度		当日	最近5日	平均变化	波动率
rb持仓	多头前3	0.58%	-9.75%	-1.95%	16.14%
	空头前3	-7.97%	-26.81%	-5.36%	
rb涨幅		0.80%	0.95%	0.19%	
震荡幅度	1.33%	1.91%(月均值)	投机度	1.11	1.40(月均值)

变动幅度		当日	最近5日	平均变化	波动率
I持仓	多头前3	-1.57%	-39.99%	-8.00%	32.44%
	空头前3	-6.83%	-1.22%	-0.24%	
I涨幅		0.90%	-4.12%	-0.82%	
震荡幅度	1.88%	3.00%(月均值)	投机度	0.96	1.41(月均值)

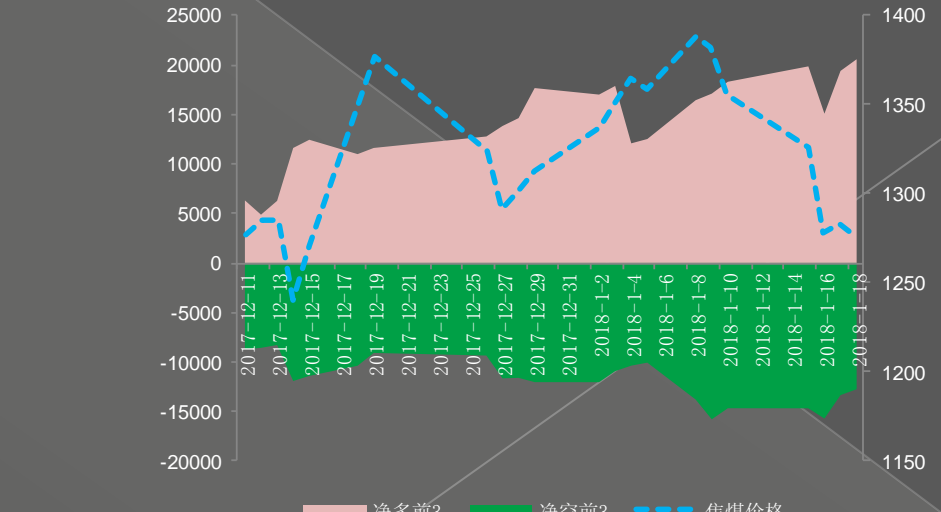
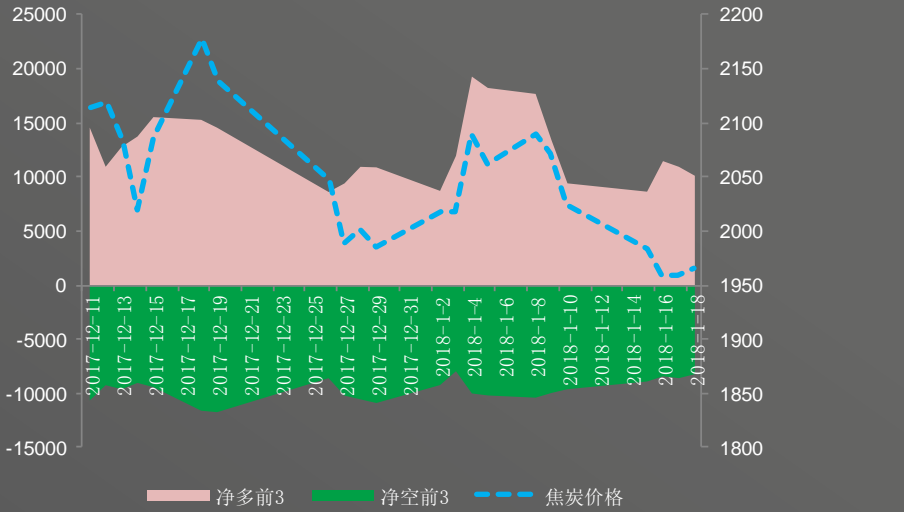


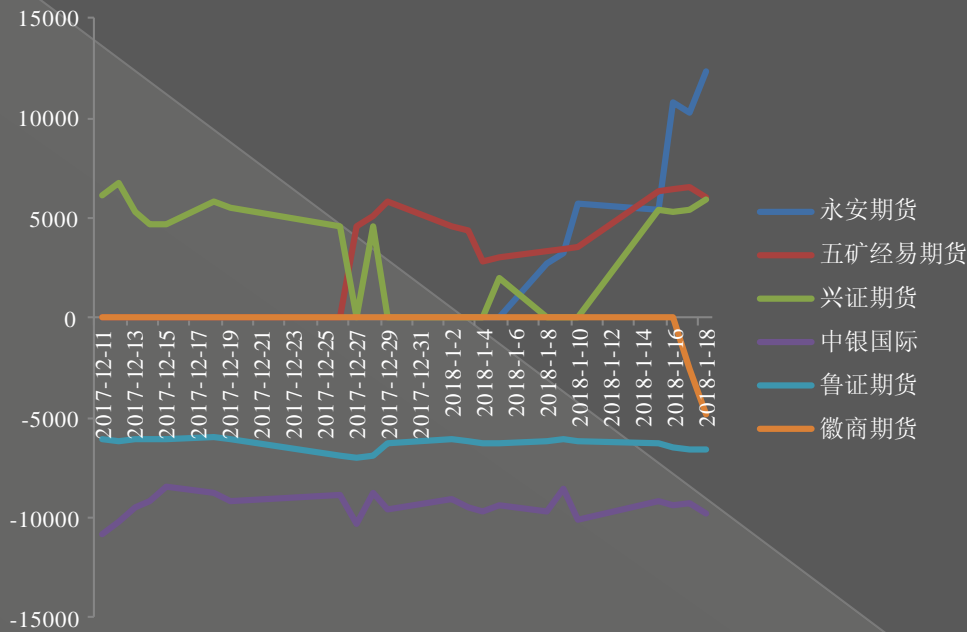
黑色板块：J & JM



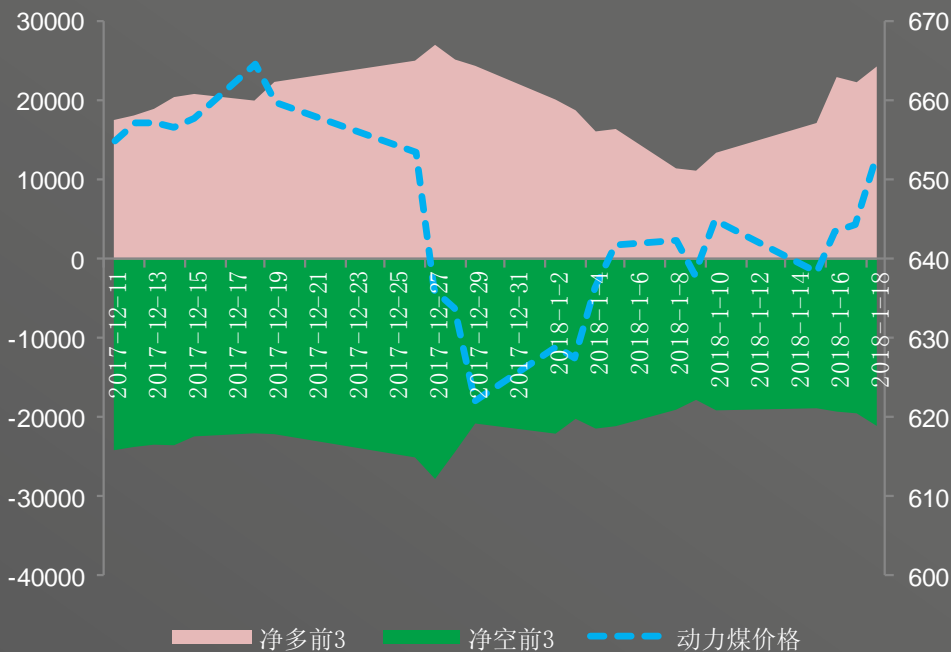
变动幅度		当日	最近5日	平均变化	波动率
j持仓	多头前3	-7.54%	-24.50%	-4.90%	35.76%
	空头前3	-4.27%	-17.39%	-3.48%	
j涨幅		0.36%	-5.13%	-1.03%	
震荡幅度	1.50%	3.24%(月均值)	投机度	0.90	1.61(月均值)

变动幅度		当日	最近5日	平均变化	波动率
jm持仓	多头前3	6.07%	20.31%	4.06%	37.40%
	空头前3	-4.44%	-19.23%	-3.85%	
jm涨幅		-0.62%	-7.69%	-1.54%	
震荡幅度	2.05%	3.39%(月均值)	投机度	1.10	1.68(月均值)



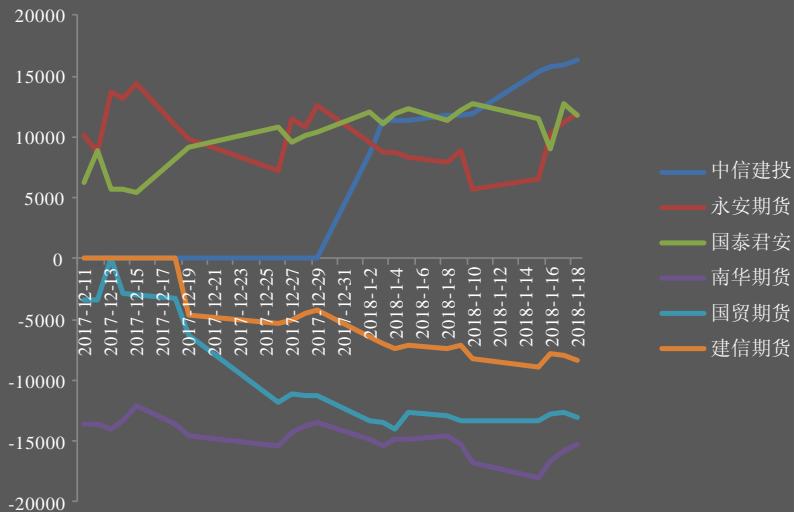
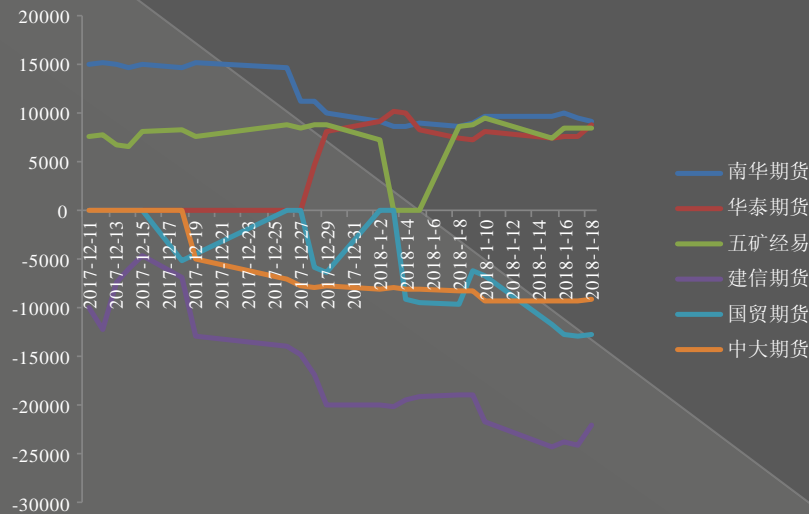


黑色：动力煤



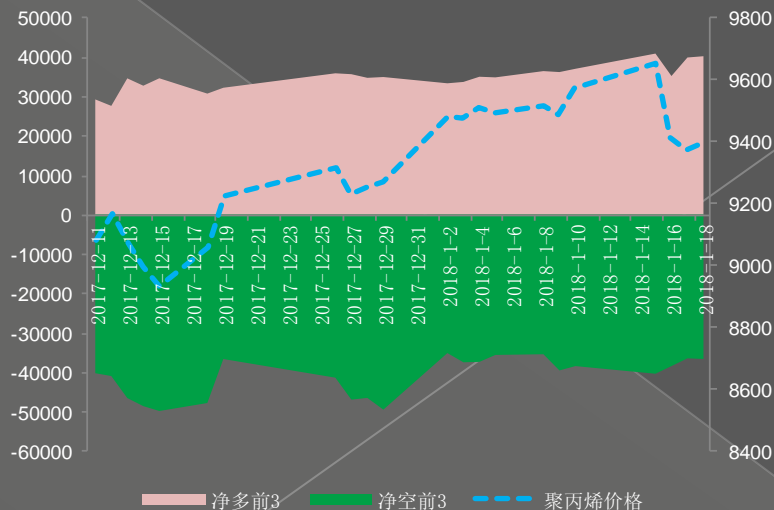
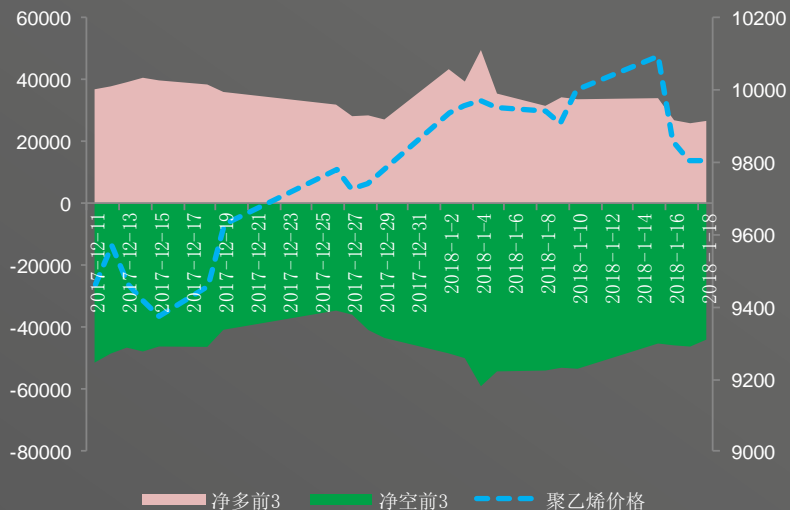
变动幅度		当日	最近5日	平均变化	波动率
zc持仓	多头前3	8.88%	117.13%	23.43%	16.63%
	空头前3	8.20%	18.61%	3.72%	
zc涨幅		1.28%	2.30%	0.46%	
震荡幅度	2.02%	1.68% (月均值)	投机度	0.95	0.64 (月均值)

化工：塑料 & PP

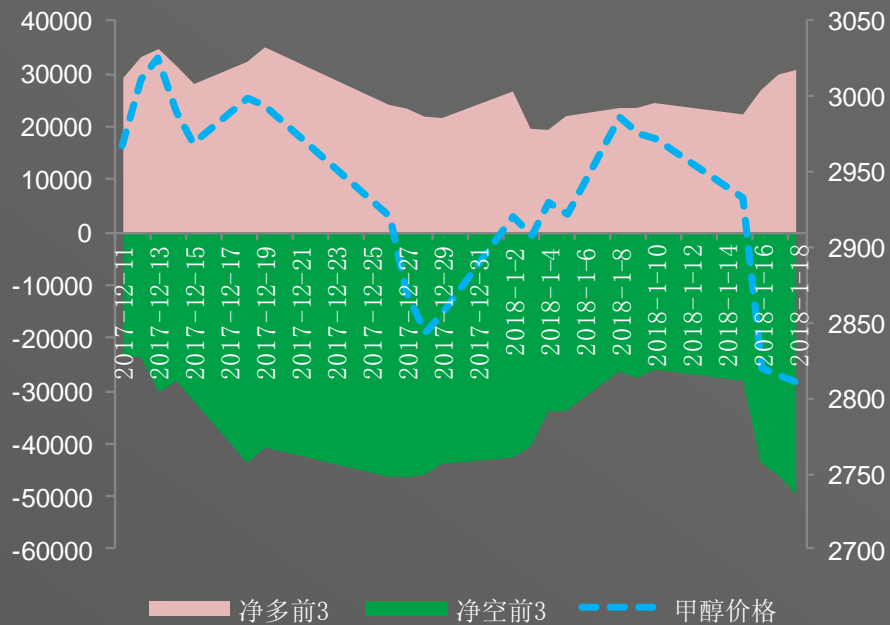
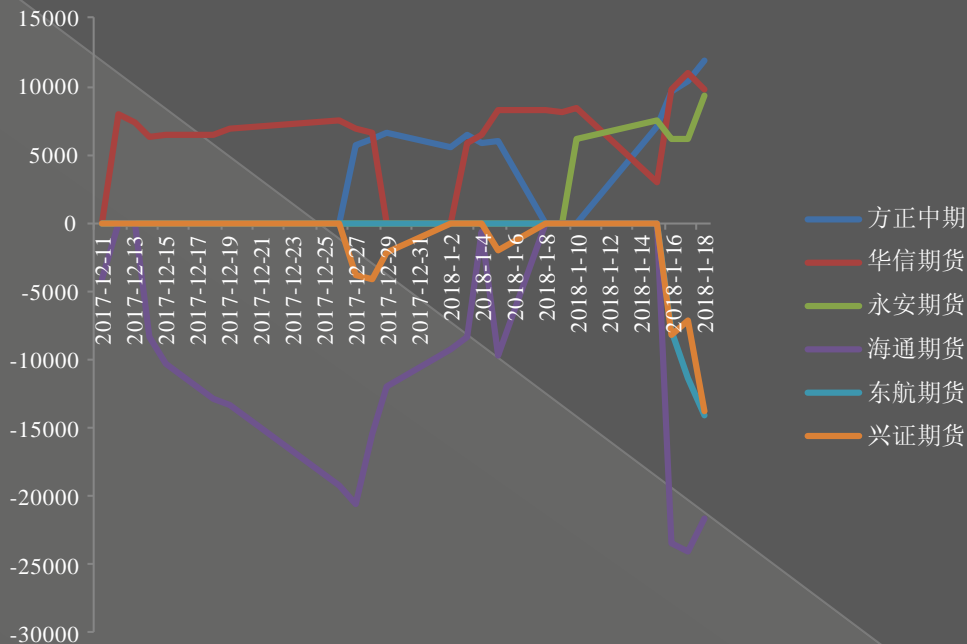


变动幅度		当日	最近5日	平均变化	波动率
I持仓	多头前3	2.89%	-22.13%	-4.43%	15.39%
	空头前3	-4.88%	-17.18%	-3.44%	
I涨幅		0.03%	-1.04%	-0.21%	
震荡幅度	0.80%	1.56% (月均值)	投机度	0.37	0.78 (月均值)

变动幅度		当日	最近5日	平均变化	波动率
pp持仓	多头前3	0.81%	11.13%	2.23%	16.68%
	空头前3	0.46%	-7.33%	-1.47%	
pp涨幅		0.22%	-0.96%	-0.19%	
震荡幅度	0.93%	1.63% (月均值)	投机度	0.50	0.88 (月均值)

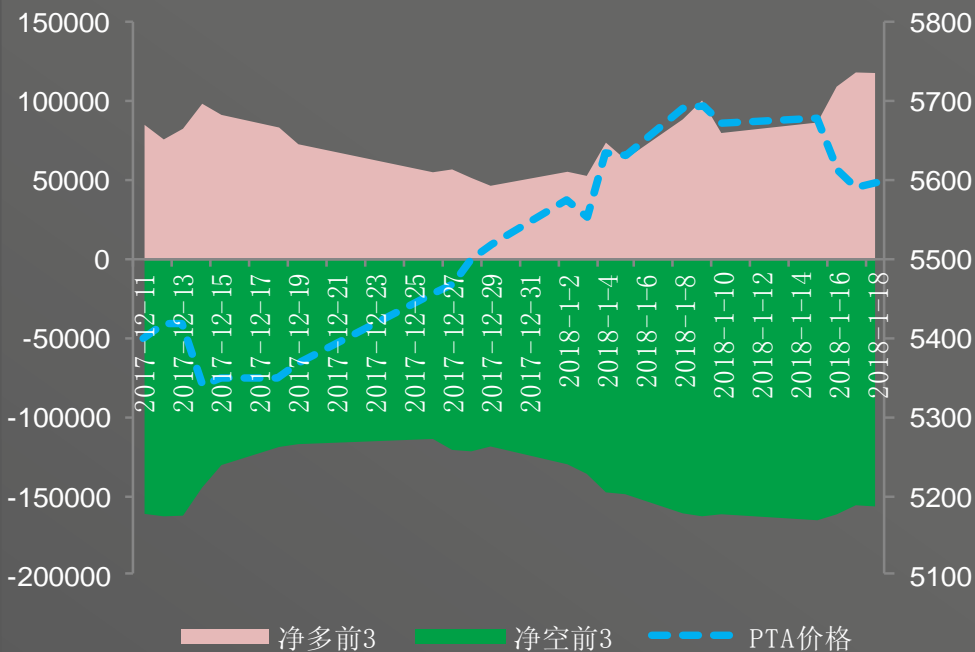
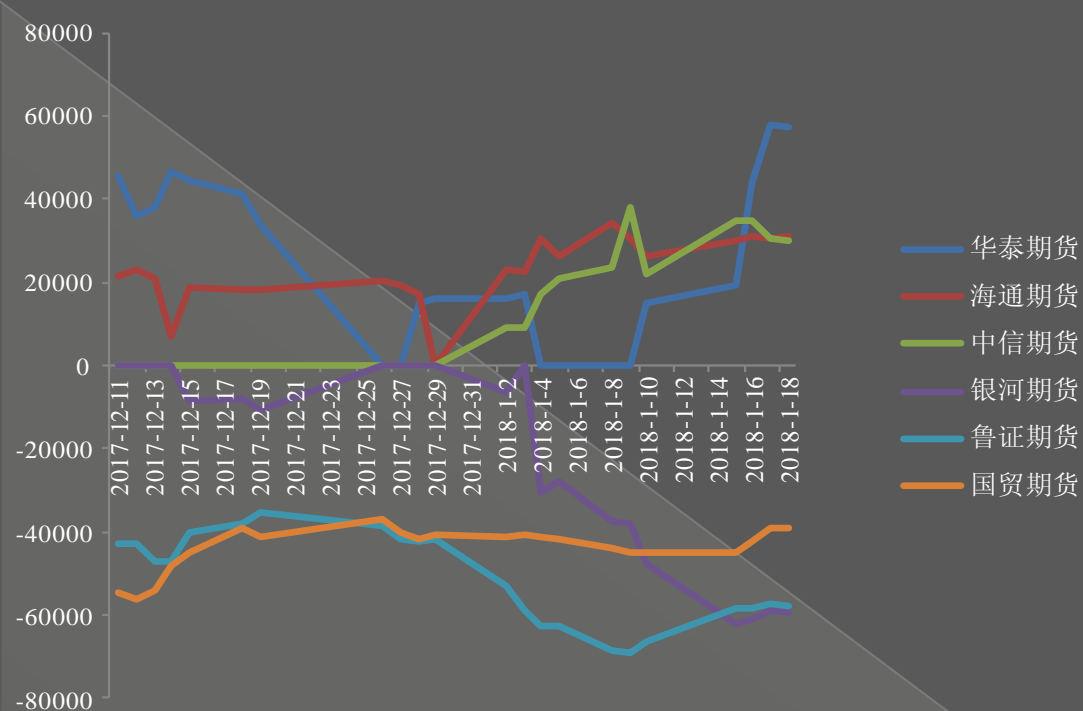


化工：甲醇



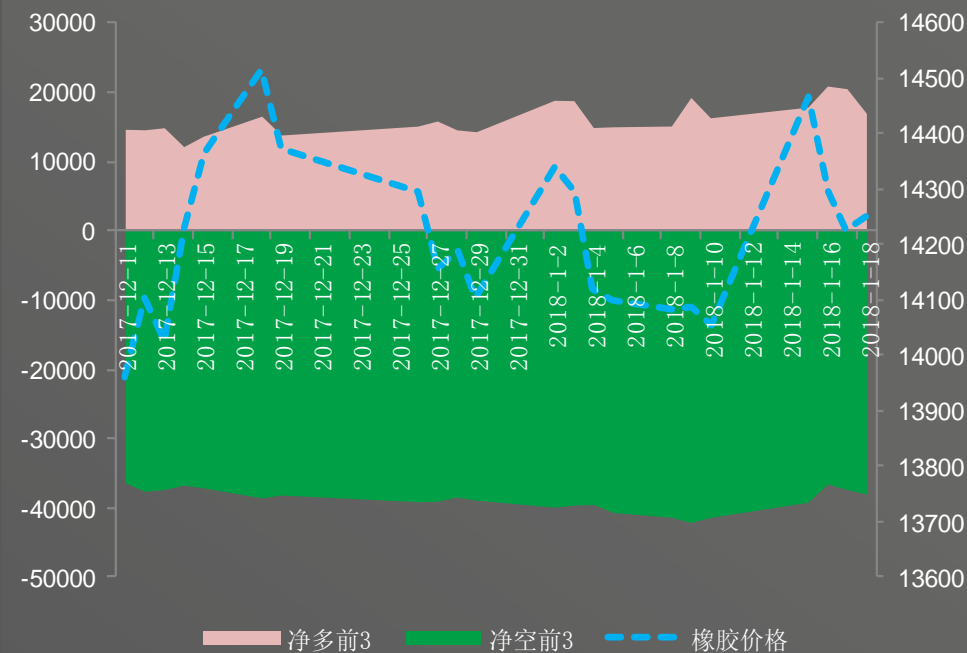
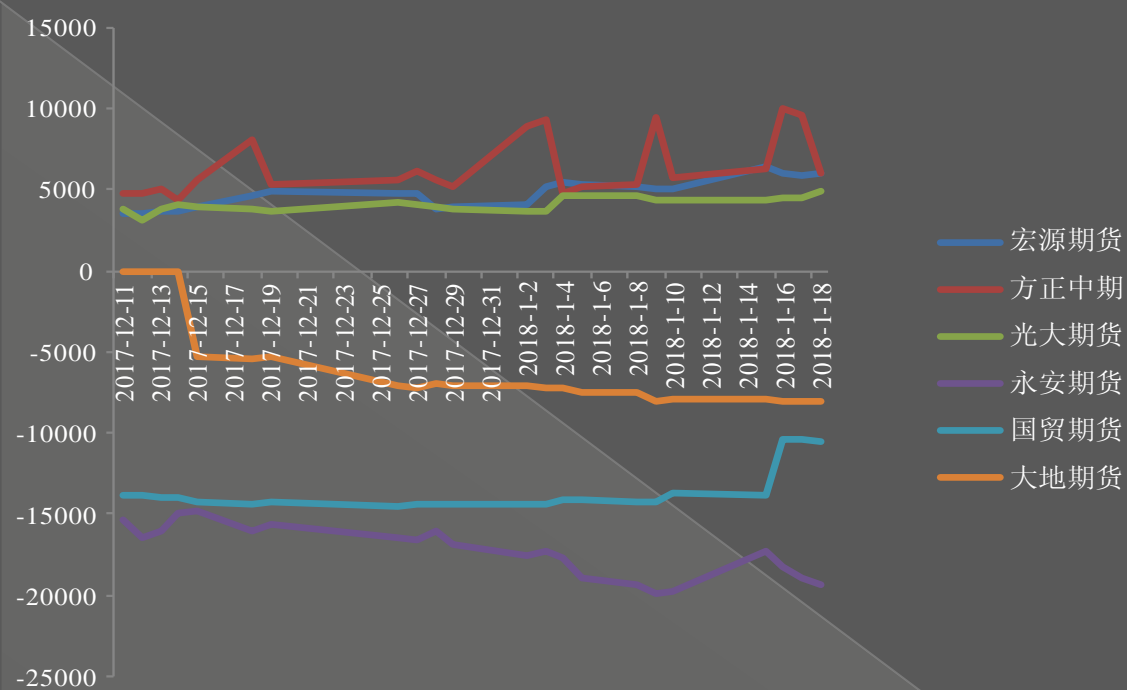
变动幅度		当日	最近5日	平均变化	波动率
ma持仓	多头前3	2.87%	30.54%	6.11%	22.48%
	空头前3	7.92%	79.98%	16.00%	
ma涨幅		-0.15%	-5.55%	-1.11%	
震荡幅度	1.25%	2.16%(月均值)	投机度	1.08	1.48(月均值)

化工：PTA



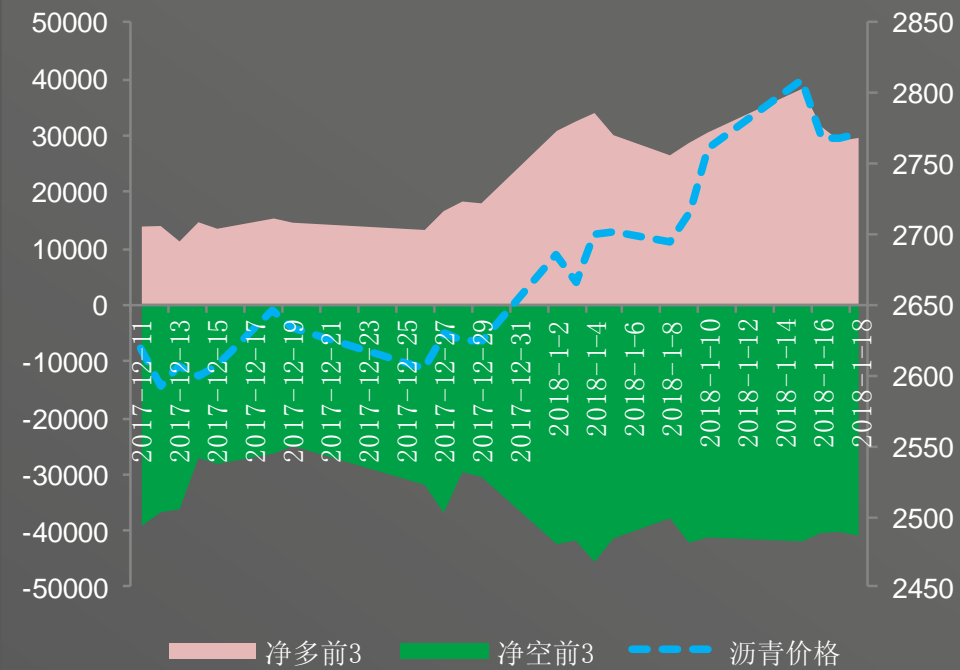
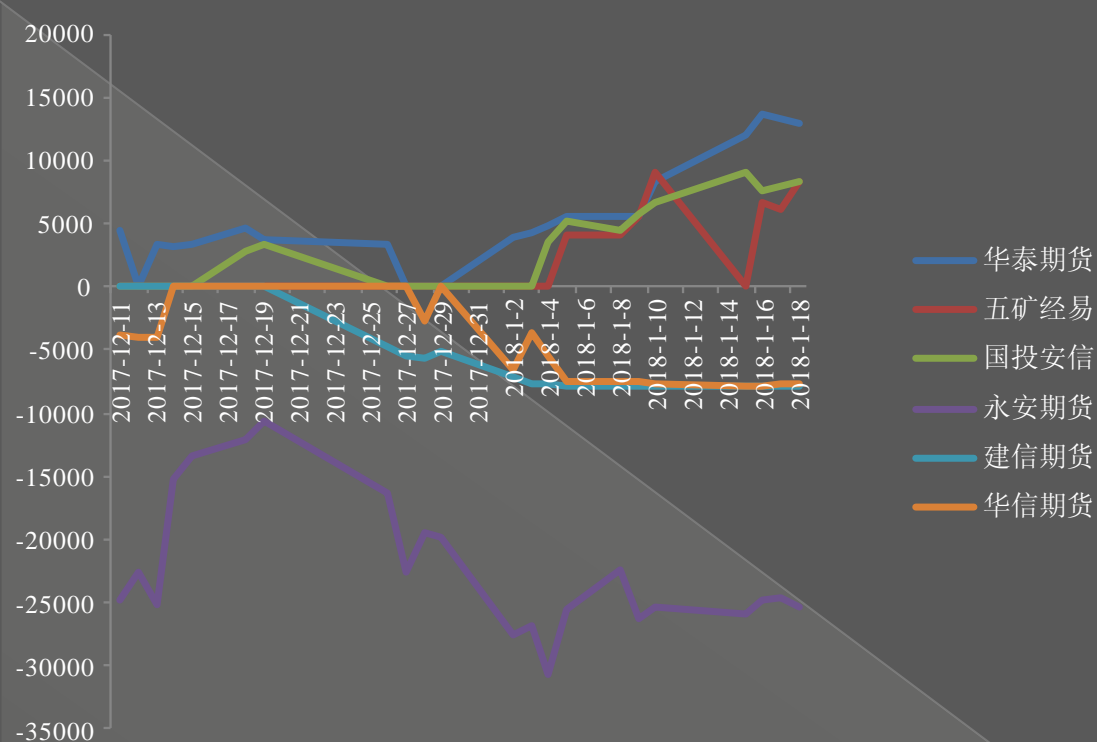
变动幅度		当日	最近5日	平均变化	波动率
pta持仓	多头前3	-0.28%	17.20%	3.44%	11.54%
	空头前3	0.49%	-3.85%	-0.77%	
pta涨幅		0.09%	-1.73%	-0.35%	
震荡幅度	0.82%	1.18%(月均值)	投机度	0.36	0.50(月均值)

化工：橡胶



变动幅度		当日	最近5日	平均变化	波动率
ru持仓	多头前3	-17.37%	-11.91%	-2.38%	16.27%
	空头前3	1.71%	-9.78%	-1.96%	
ru涨幅		0.15%	1.14%	0.23%	
震荡幅度	1.12%	2.11%(月均值)	投机度	0.73	1.15(月均值)

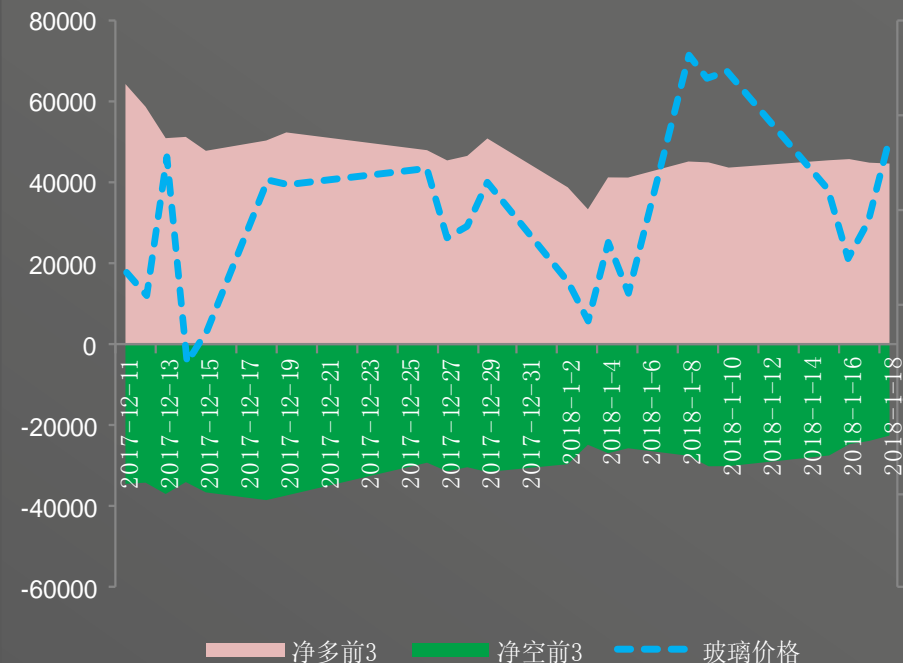
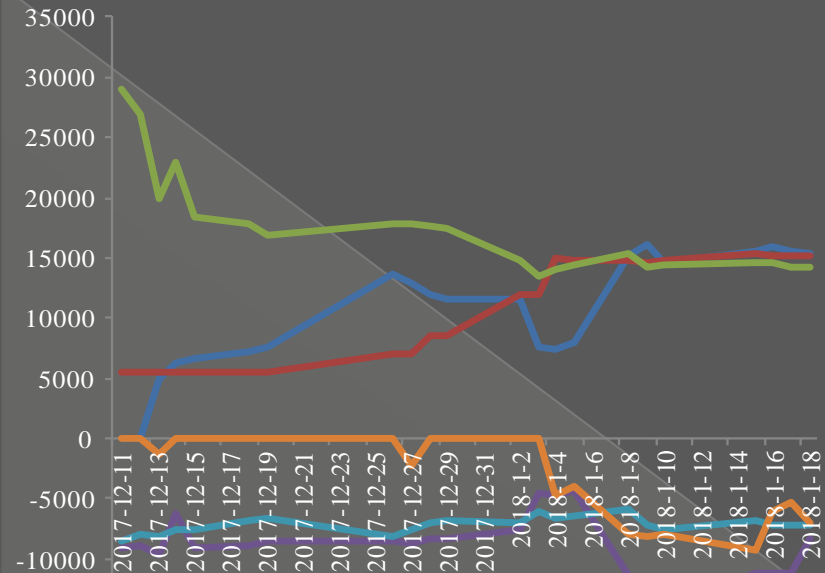
化工：沥青



变动幅度		当日	最近5日	平均变化	波动率
bu持仓	多头前3	1.80%	3.19%	0.64%	15.85%
	空头前3	1.66%	-2.95%	-0.59%	
bu涨幅		0.12%	2.05%	0.41%	
震荡幅度	1.29%	1.82%(月均值)	投机度	0.61	0.88(月均值)

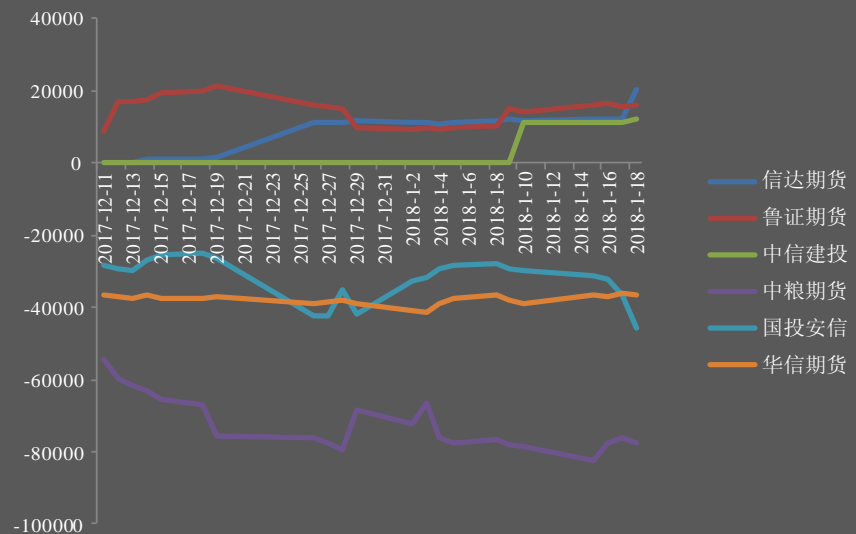
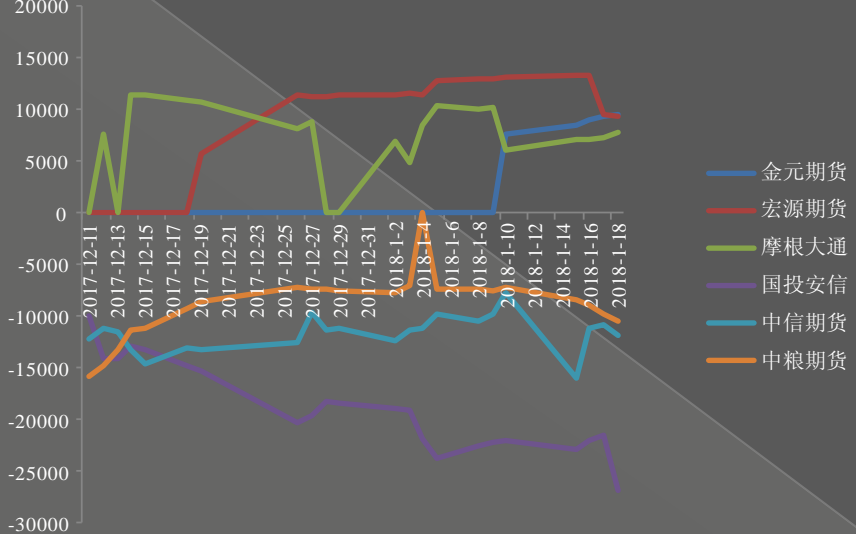
化工：玻璃

- 中信期货
- 中金期货
- 华鑫期货
- 徽商期货
- 长江期货
- 方正中期



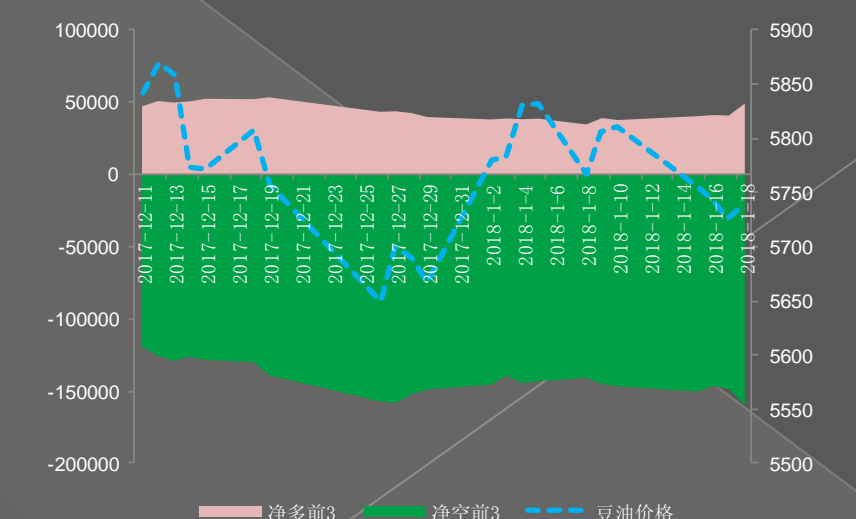
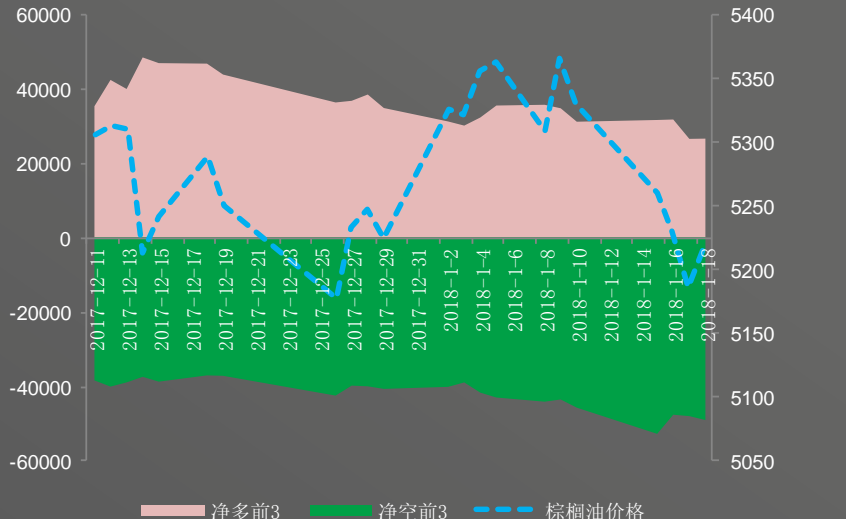
变动幅度		当日	最近5日	平均变化	波动率
fg持仓	多头前3	-0.49%	-0.65%	-0.13%	21.85%
	空头前3	-5.53%	-25.36%	-5.07%	
fg涨幅		1.11%	-0.90%	-0.18%	
震荡幅度	1.94%	1.78%(月均值)	投机度	0.53	0.57(月均值)

农产品：P & Y

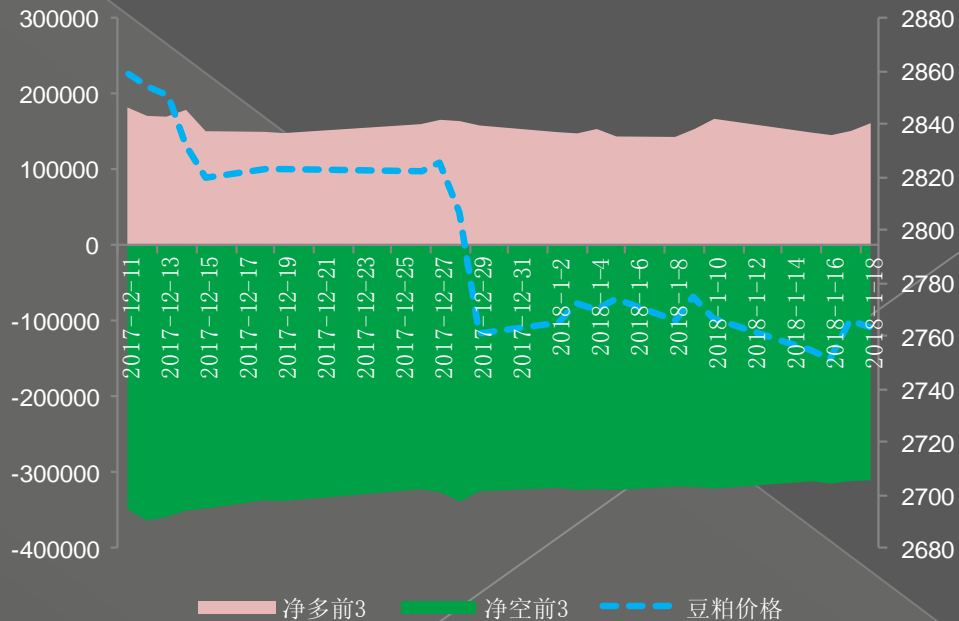
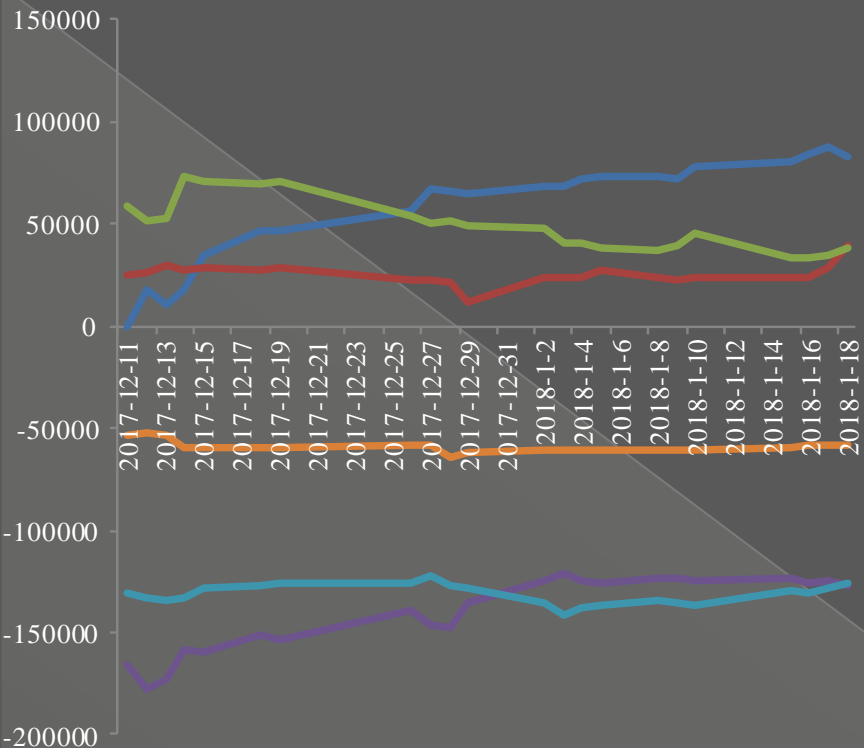


变动幅度		当日	最近5日	平均变化	波动率
p持仓	多头前3	0.25%	-23.47%	-4.69%	14.76%
	空头前3	2.20%	12.70%	2.54%	
p涨幅		0.62%	-2.74%	-0.55%	
震荡幅度	0.89%	1.06%(月均值)	投机度	0.52	0.49(月均值)

变动幅度		当日	最近5日	平均变化	波动率
y持仓	多头前3	20.16%	25.64%	5.13%	13.53%
	空头前3	7.53%	10.11%	2.02%	
y涨幅		0.24%	-1.14%	-0.23%	
震荡幅度	0.73%	1.03%(月均值)	投机度	0.25	0.31(月均值)

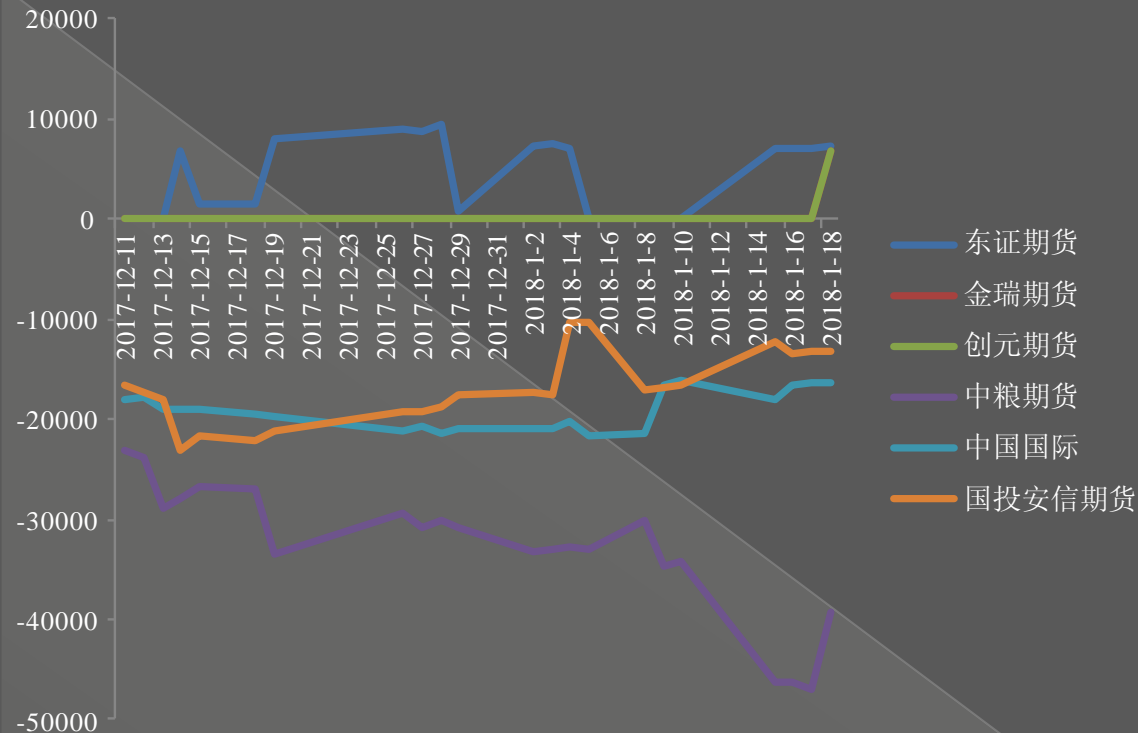


农产品：豆粕

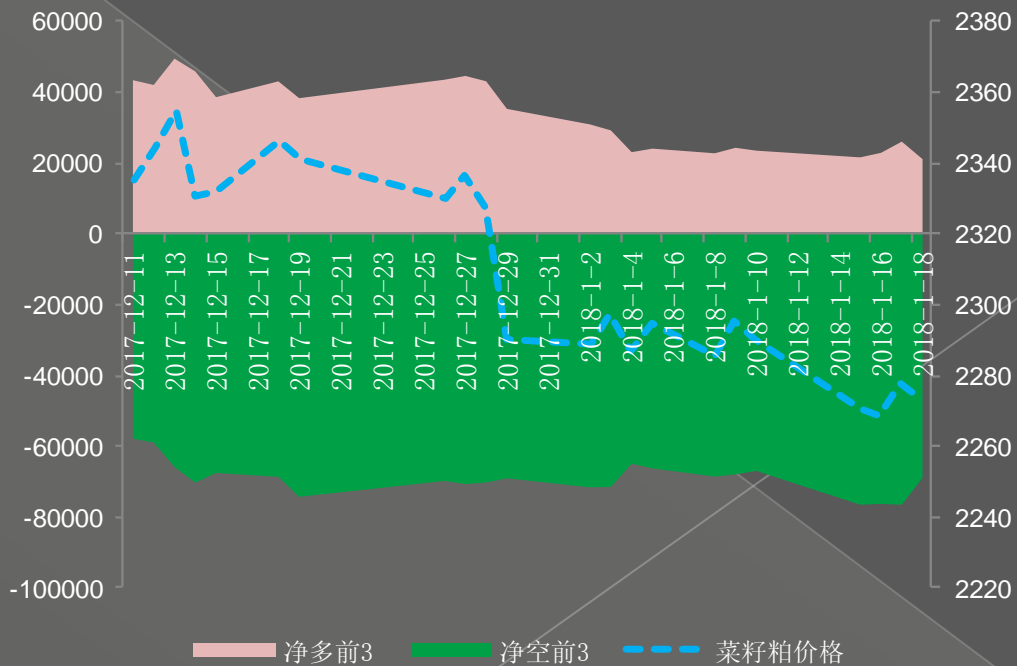


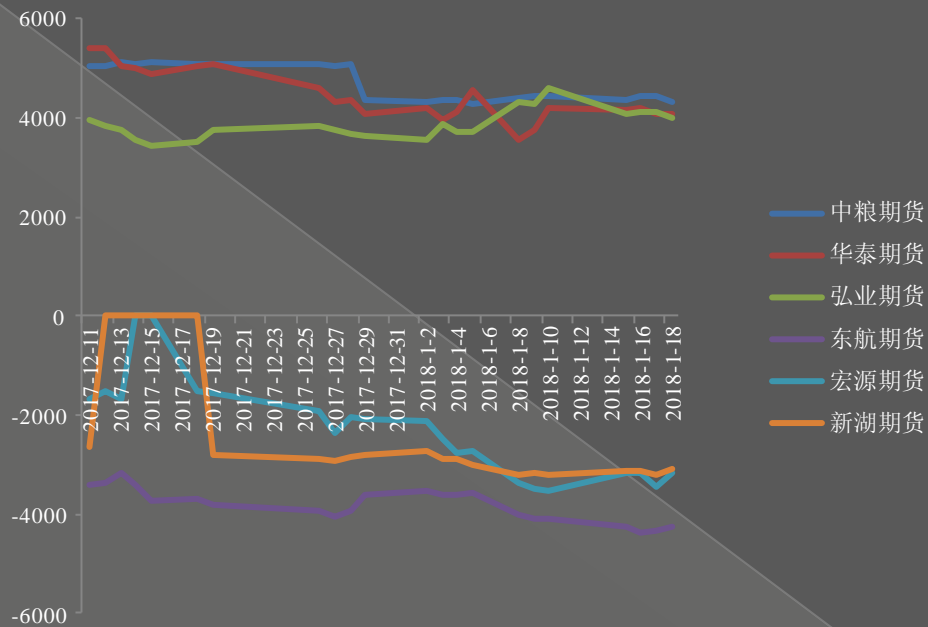
变动幅度		当日	最近5日	平均变化	波动率
m持仓	多头前3	6.70%	4.97%	0.99%	7.53%
	空头前3	-0.33%	-2.73%	-0.55%	
m涨幅		-0.09%	-0.41%	-0.08%	
震荡幅度	0.74%	0.89% (月均值)	投机度	0.27	0.34 (月均值)

农产品：菜粕



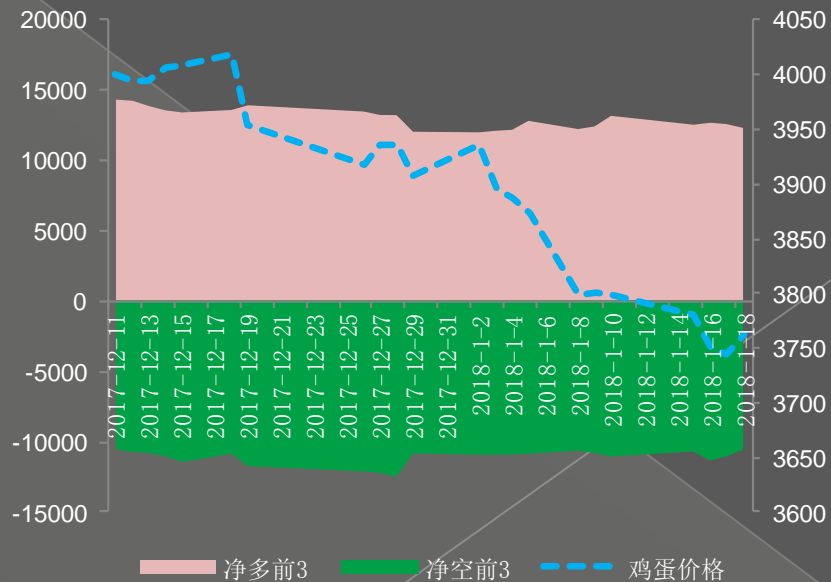
变动幅度		当日	最近5日	平均变化	波动率
rm持仓	多头前3	-18.87%	-13.10%	-2.62%	8.93%
	空头前3	-9.87%	1.52%	0.30%	
rm涨幅		-0.20%	-0.96%	-0.19%	
震荡幅度	0.69%	1.10%(月均值)	投机度	0.35	0.49(月均值)

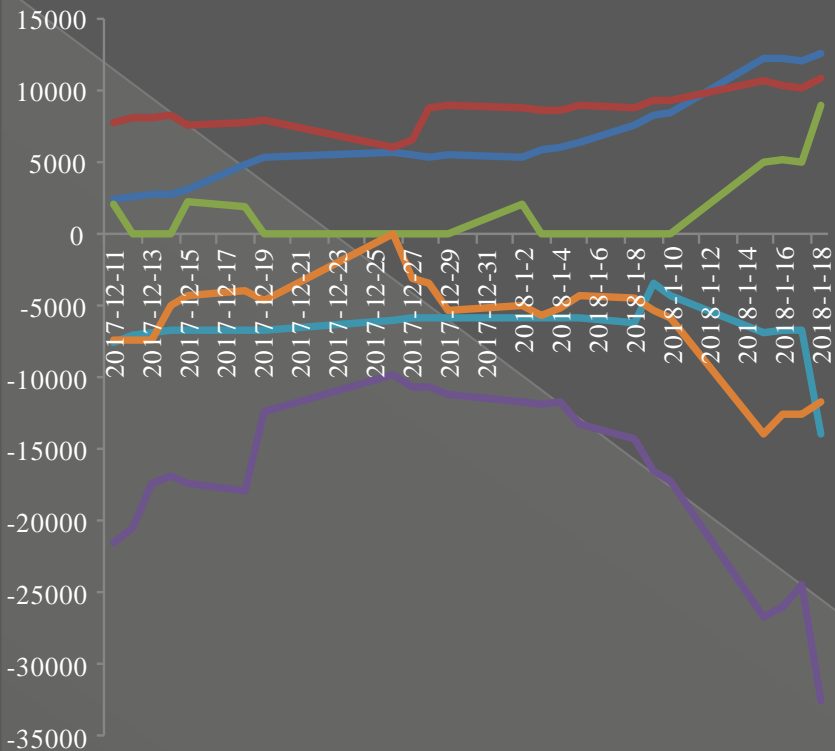




农产品：鸡蛋

变动幅度		当日	最近5日	平均变化	波动率
jd持仓	多头前3	-2.16%	-0.84%	-0.17%	11.77%
	空头前3	-4.16%	-2.10%	-0.42%	
jd涨幅		0.51%	-0.97%	-0.19%	
震荡幅度	1.25%	1.21%(月均值)	投机度	0.30	0.42(月均值)

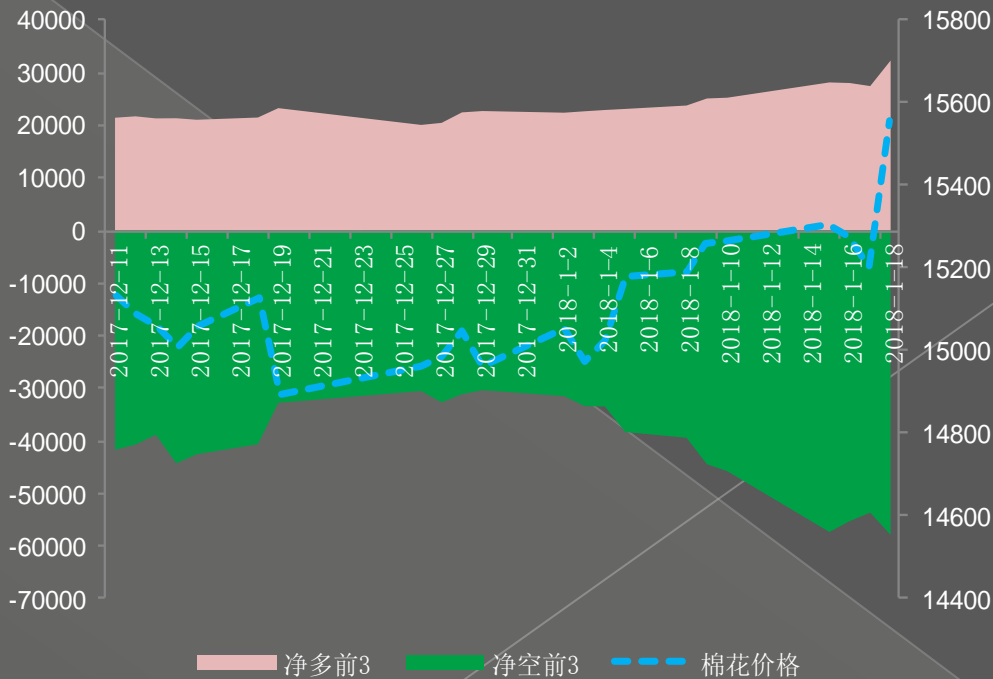




- 方正中期
- 银河期货
- 宏源期货
- 华信期货
- 中国国际
- 东证期货

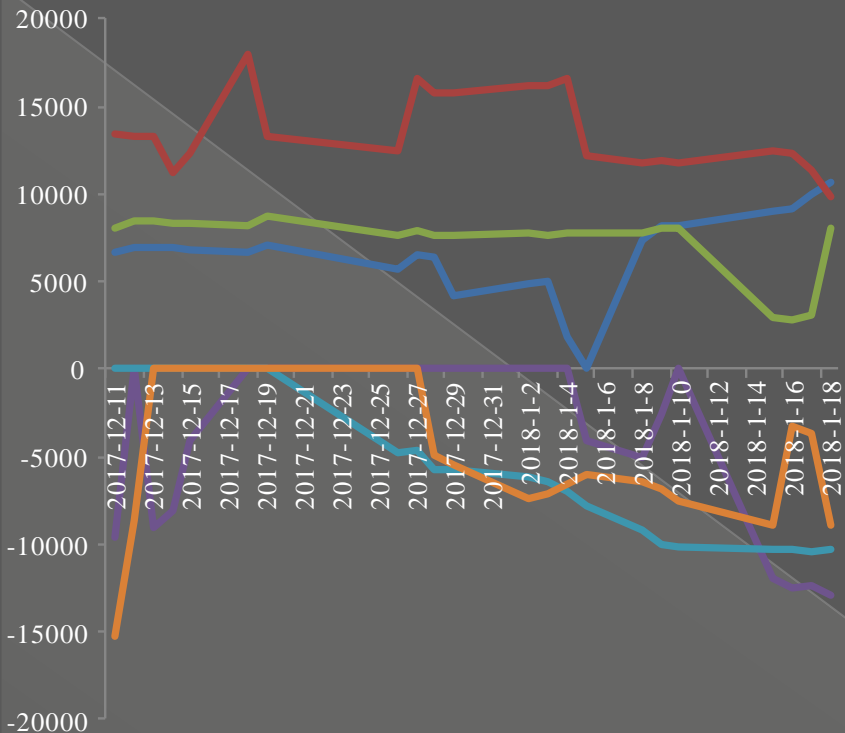
农产品：棉花

变动幅度		当日	最近5日	平均变化	波动率
cf持仓	多头前3	17.69%	28.74%	5.75%	13.42%
	空头前3	7.94%	30.26%	6.05%	
cf涨幅		2.34%	1.95%	0.39%	
震荡幅度	2.54%	1.07%(月均值)	投机度	0.99	0.46(月均值)



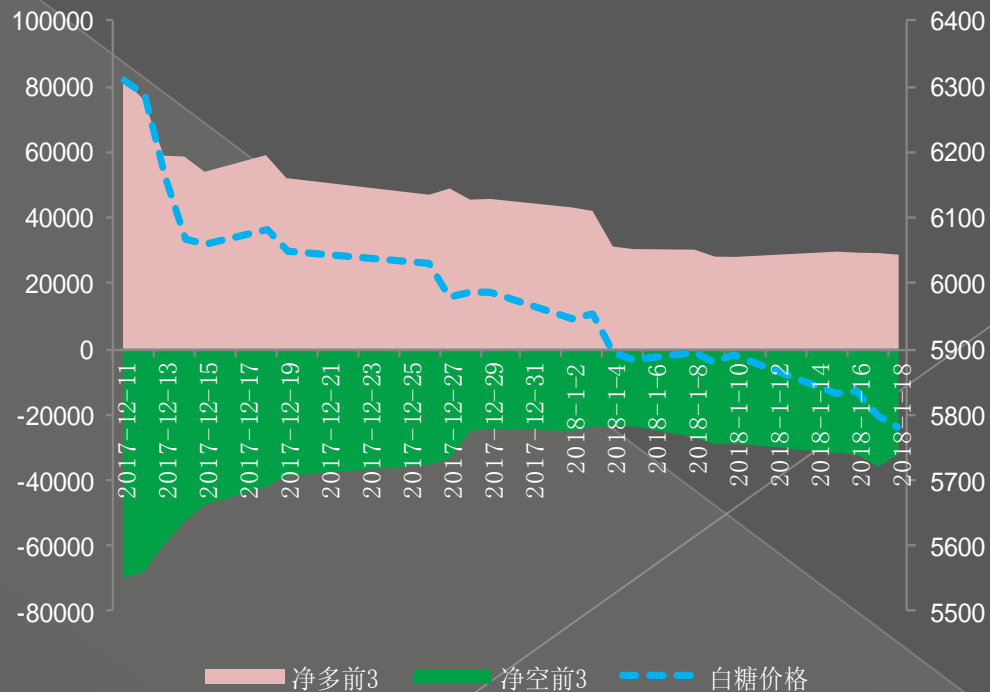
- 净多前3
- 净空前3
- 棉花价格

农产品：白糖

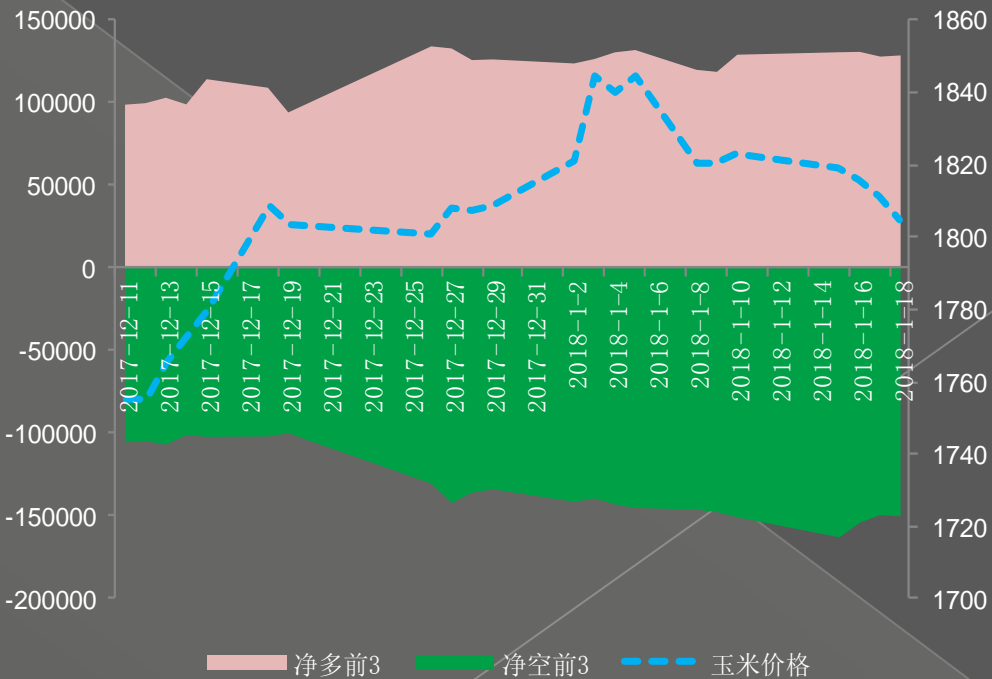
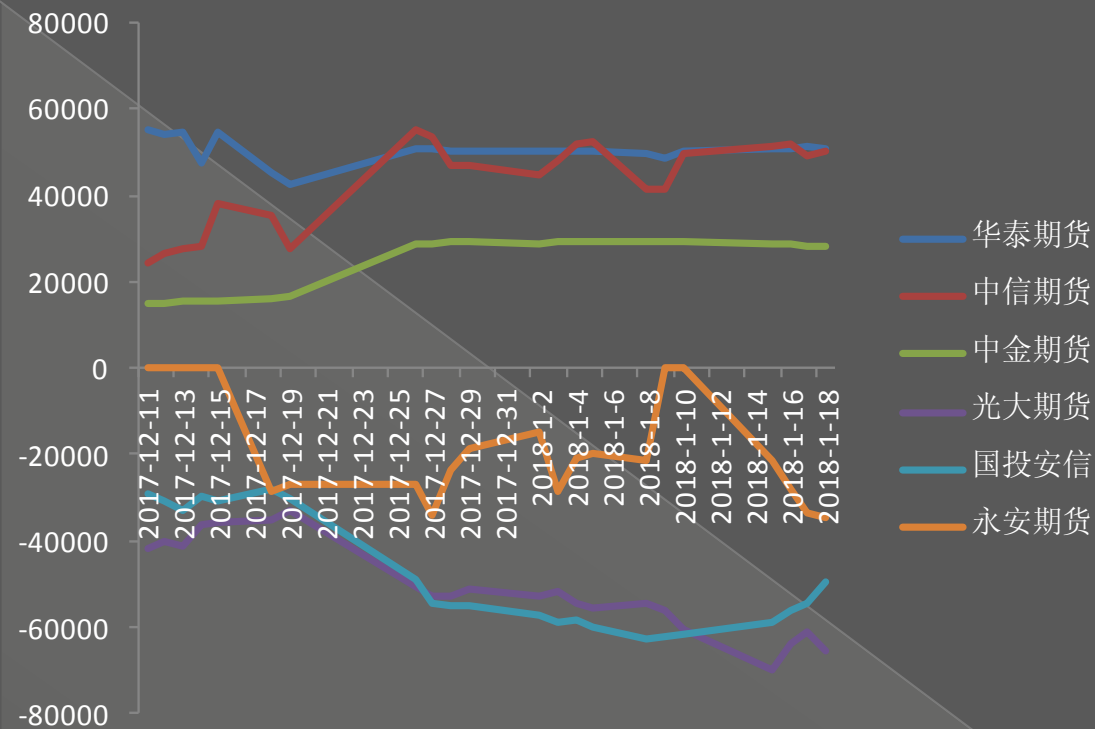


- 南华期货
- 宏源期货
- 一德期货
- 中信期货
- 招金期货
- 海通期货

变动幅度		当日	最近5日	平均变化	波动率
sr持仓	多头前3	-1.68%	2.08%	0.42%	9.49%
	空头前3	-10.73%	10.25%	2.05%	
sr涨幅		-0.30%	-1.69%	-0.34%	
震荡幅度	0.64%	0.93% (月均值)	投机度	0.40	0.48 (月均值)



农产品：玉米



变动幅度		当日	最近5日	平均变化	波动率
c持仓	多头前3	0.56%	8.37%	1.67%	9.51%
	空头前3	0.55%	1.75%	0.35%	
c涨幅		-0.37%	-0.87%	-0.17%	
震荡幅度	0.79%	0.77%(月均值)	投机度	0.39	0.35(月均值)

部分机构资金变动表

制表日期：2018年1月18日

单位：万

	当日保证金流入 (流出)	当日保证金增幅	5日保证金流入 (流出)	5日保证金增幅
永安期货	-22188.23	-10.79%	-102416.78	-35.82%
南华期货	12578.78	34.80%	8667.58	21.64%
混沌天成	27.35	0.09%	142.41	0.47%
海通期货	-15743.95	-13.43%	-23304.22	-18.68%
上海大陆	9227.68	129.94%	16329.28	--
中信期货	6759.24	3.76%	65112.40	53.63%
新湖期货	-124.78	-0.24%	-7929.16	-13.35%

中粮期货	1497.29	0.89%	-5712.41	-3.26%
中信建投	12844.26	27.22%	21051.85	54.01%
申银万国	3618.15	13.07%	-679.68	-2.13%
华泰期货	-12742.43	-11.85%	18018.40	23.46%
光大期货	2154.59	4.10%	6100.81	12.54%
一德期货	9804.25	9.07%	21562.02	22.38%
国投期货	3545.98	3.48%	25414.31	31.78%
金瑞期货	3004.27	3.21%	19888.18	25.89%
鲁证期货	-3397.92	-3.94%	-11591.75	-12.28%
中国国际	13985.36	35.79%	11564.21	27.87%

部分机构持仓一览

机构	永安期货					
日期	2018-1-9	2018-1-10	2018-1-15	2018-1-16	2018-1-17	2018-1-18
黄金			3646		4572	4378
白银						
沪铜	16958	16959	15530	15114	14439	16525
沪铝	7751	7921	7503			
沪镍	17870	21754	16918	6682	9243	8074
沪锌	-10779	-14896	-8346	-9174	-8292	-9767
沪铅			-461			
螺纹钢	-68516	-55791	-101685	-48460	-32594	
铁矿石	38249	50403		6051	2733	3590
焦煤	4291	2297	6397	3872	9065	9935
焦炭	7397	4011		1589	-1879	
豆油	-6201	-5666				
棕榈油	-11484	-13199	-11431	-9808	-11609	
菜籽油	22938	22992	19158	15913	14305	14001
豆粕	71830	77865	80271	83973	87789	83180
菜籽粕	-2677	-1639				868
棉花	-13577	-14146	-8845	-10050	-10089	
白糖						2680
玉米			-21175	-27815	-33375	-34937
鸡蛋				993	881	841
PTA	23172	24238	18366	24663	27249	26505
聚乙烯	-20123	-22448				-4514
聚丙烯	8843	5710	6587	10235	11192	11973
甲醇		6158	7463	6142	6134	9337
玻璃	-9028					-4700
橡胶	-19958	-19777	-17366	-18230	-18940	-19431
沥青	-26314	-25366	-25927	-24707	-24643	-25287
动力煤	3307	5719	5409	10768	10247	12356

部分机构持仓一览

机构	南华期货					
日期	2018-1-9	2018-1-10	2018-1-15	2018-1-16	2018-1-17	2018-1-18
黄金						
白银	6422	6464		6530	6191	6006
沪铜						
沪铝						-4055
沪镍		-6471	-6094			-5949
沪锌	-4206	-3712	-4156	-3463	-3458	-2988
沪铅			-506	-645	1398	1087
螺纹钢						
铁矿石						
焦煤						
焦炭		-2280				
豆油						
棕榈油						
菜籽油						
豆粕						
菜籽粕	-12143	-13040	-11041	-9976	-9950	-9546
棉花						
白糖	8141	8262	9101	9241	9960	10748
玉米						
鸡蛋	2568	2474				2417
PTA	-15245	-14322		-15669		-15047
聚乙烯	8987	9795	9681	10105	9654	9283
聚丙烯	-15281	-16818	-18060	-16572	-15833	-15272
甲醇	-5764	-6434	-6724	-6441	-6285	-6357
玻璃						
橡胶		5660	5130	278		
沥青						
动力煤		-279	-840			

部分机构持仓一览

机构	国泰君安					
日期	2018-1-9	2018-1-10	2018-1-15	2018-1-16	2018-1-17	2018-1-18
黄金		-789			3397	
白银	-14724	-14686	-13140	-12683	-11852	-12218
沪铜	-5315	-5662	-4845	-6096	-5572	-5002
沪铝				2619	2635	2900
沪镍	-10331	-10715	-10865	-8176	-8570	-8976
沪锌	-3685	-3018	-3157	-2954	-2879	-3083
沪铅	1200	1339	422			
螺纹钢	44918	46946	57211	54866	49011	49323
铁矿石	7942	9636	7476	6812	5594	6171
焦煤			2621			
焦炭		-2819	-2240	-2382	-2466	
豆油	3724	3803		3221	3201	
棕榈油	-8857	-10480	-13853	-14393	-14883	-6270
菜籽油	23439	24407	24005	24052	24134	23499
豆粕		-20009	-22064	-21876	-18722	
菜籽粕	8802	8426	6620	6475	5969	
棉花	3548	3284			3437	
白糖	-5161	-5063	-5447	-5693	-5777	-5804
玉米	17226	16494	13625	14231	20577	26314
鸡蛋						
PTA	32496	29811	22396			
聚乙烯						
聚丙烯	12221	12727	11575	9091	12747	11811
甲醇				2957	3217	2307
玻璃	10291	10181	9378	9096	8473	8183
橡胶						
沥青	-7212	-6584	-5855	-4728	-4557	-4460
动力煤						

部分机构持仓一览

机构	混沌天成					
日期	2018-1-9	2018-1-10	2018-1-15	2018-1-16	2018-1-17	2018-1-18
黄金						
白银						
沪铜	-9594	-9569	-9542	-9822	-9958	-9959
沪铝	5325	5321	5356	5268	5162	5136
沪镍						
沪锌						
沪铅						
螺纹钢						
铁矿石						
焦煤						
焦炭						
豆油						
棕榈油						
菜籽油						
豆粕						
菜籽粕						
棉花						
白糖						
玉米						
鸡蛋						
PTA						
聚乙烯						
聚丙烯						
甲醇						
玻璃						
橡胶						
沥青						
动力煤						

部分机构持仓一览

机构	海通期货					
日期	2018-1-9	2018-1-10	2018-1-15	2018-1-16	2018-1-17	2018-1-18
黄金	4861	4239	3992	3806	3473	
白银			10032	7845	10863	11389
沪铜	-4799	-4787	-5679	-6137	-6574	-6802
沪铝	9241	8896	7727			
沪镍	5125	4561	4226	4426		
沪锌		3566	4262		4219	4847
沪铅	2175	2144	1551	1295	989	804
螺纹钢	-36328	-26619	-26304		-15708	-10705
铁矿石	28385	27551	16035	18939	16337	17176
焦煤	3462				1098	1143
焦炭	3561	399		-1145		
豆油		-7696	-9982	-12597	-12849	-12646
棕榈油						
菜籽油	-6736	-6824	-6999	-6955	-6277	-5879
豆粕	23203	23600	23755	24102	29073	40031
菜籽粕						
棉花			4185	3692	3589	
白糖	-6849	-7480	-8940	-3260	-3696	-8918
玉米	23918	23203	23208	22199	22053	17715
鸡蛋		916		506	560	1139
PTA	30473	26484	30147	30971	30677	31143
聚乙烯	7925	10957	4640	8300	6625	
聚丙烯	-10928			-9056	-6154	-7491
甲醇				-23360	-24109	-21626
玻璃	8964	7881	8781	11312	10979	13067
橡胶						
沥青			6879	6721	7852	7519
动力煤	-433		-2396		3365	

部分机构持仓一览

机构	上海大陆					
日期	2018-1-9	2018-1-10	2018-1-15	2018-1-16	2018-1-17	2018-1-18
黄金						
白银						
沪铜						
沪铝						
沪镍						
沪锌						
沪铅						
螺纹钢		20396		15505	18650	22177
铁矿石						
焦煤						
焦炭						
豆油						
棕榈油						
菜籽油						
豆粕						
菜籽粕						
棉花						5024
白糖						
玉米						
鸡蛋						
PTA						
聚乙烯						
聚丙烯						
甲醇						
玻璃						
橡胶						
沥青						
动力煤						

部分机构持仓一览

机构	中粮期货					
日期	2018-1-9	2018-1-10	2018-1-15	2018-1-16	2018-1-17	2018-1-18
黄金						
白银				-3444		
沪铜	-5735		-6440	-6168	-3342	-4607
沪铝						
沪镍	10152	10838	10936	7220	6699	7617
沪锌	-2940	-3776	-5506	-7609	-5701	-5627
沪铅	-970	-914	-635	-619	-605	-950
螺纹钢						25895
铁矿石						
焦煤	2795	2707	3200			
焦炭						
豆油	-78064	-78624	-82536	-77410	-75978	-77594
棕榈油	-7428	-7146	-8323	-8925	-9672	-10484
菜籽油	-13409	-13397	-16437	-16228	-16408	-15806
豆粕	-123610	-124051	-122883	-126162	-124551	-126652
菜籽粕	-34684	-34287	-46217	-46353	-46933	-39338
棉花	-14427	-14496	-16866	-16945	-16897	-7976
白糖						
玉米	-27217	-27767	-17471	-17557	-15881	-16125
鸡蛋	4452	4459	4374	4440	4446	4316
PTA						
聚乙烯						
聚丙烯	6633	6468	6816			
甲醇						
玻璃						
橡胶	-7158	-7638	-7500	-7014	-7095	-7365
沥青						
动力煤	4067	4100	3948	4264	4558	4238

部分机构持仓一览

机构	中信期货					
日期	2018-1-9	2018-1-10	2018-1-15	2018-1-16	2018-1-17	2018-1-18
黄金	3637	4453	5742	7071	11397	10960
白银	-14638	-15663	-24392	-22453	-24587	-27083
沪铜					-6138	-6782
沪铝	-46245	-45437	-40026	-41384	-40042	-40029
沪镍						
沪锌	-3495	-4964	-7000	-4536	-3351	-3904
沪铅	-1247	-1518	-1374	-1054	-2334	-2515
螺纹钢		36004	54581	53725	57618	63083
铁矿石				571	940	
焦煤	2424	4932	5454	6177	5978	6239
焦炭	-3872	-3445	-2720	-1760		
豆油					1420	
棕榈油	-9815	-7601	-16034	-11137	-10791	-11776
菜籽油	-10921	-12510	-10310	-10582	-10421	-10210
豆粕	39268	45502	33889	32957	34320	38431
菜籽粕	5542					
棉花						
白糖	-2612		-11926	-12492	-12312	-12900
玉米	41446	49810	51354	51894	48933	50351
鸡蛋	-1058	-794				
PTA	38088	21714	34610	34915	30421	29780
聚乙烯						
聚丙烯			6629	4722	4192	5236
甲醇			3561			2261
玻璃	16196	14559	15546	16032	15622	15387
橡胶						
沥青	7614					
动力煤		2189	2737	4050	4103	4509

部分机构持仓一览

机构	中信建投					
日期	2018-1-9	2018-1-10	2018-1-15	2018-1-16	2018-1-17	2018-1-18
黄金						
白银			-4163			6690
沪铜						
沪铝						
沪镍		-5014			6316	6249
沪锌						
沪铅				409		
螺纹钢						
铁矿石	1941	4000	5499	20684	19174	18251
焦煤	586	1539		3405		
焦炭						
豆油		11359	11511	11492	11381	12386
棕榈油	11331	7431				-9533
菜籽油						
豆粕					20580	18639
菜籽粕						
棉花			4271	4004	4009	7650
白糖						
玉米						
鸡蛋				-895	-831	-593
PTA						
聚乙烯	16426	12879	16558			
聚丙烯	11803	11905	15420	15742	15918	16397
甲醇			4811	6987	5722	6051
玻璃	-4811	-5158	-4614	-4206	-5071	-5059
橡胶	3956	3814				
沥青	8899	8775	5063		5889	
动力煤						

部分机构持仓一览

机构	新湖期货					
日期	2018-1-9	2018-1-10	2018-1-15	2018-1-16	2018-1-17	2018-1-18
黄金				1253	-1365	585
白银						
沪铜						
沪铝						
沪镍	-5454					
沪锌						
沪铅						
螺纹钢						
铁矿石						
焦煤						
焦炭						
豆油		-5012				
棕榈油	6345	6332	6612	6810	6996	6845
菜籽油	-4416		-4784	-4812	-5132	-5636
豆粕	-60707	-60475	-59426	-58666	-58686	-58491
菜籽粕						
棉花	3293	3239				
白糖						
玉米	11503	11620	13199	13049	12920	12888
鸡蛋	-3151	-3218	-3101	-3132	-3211	-3096
PTA	-26198	-26188	-24503	-23829	-20208	-20274
聚乙烯	-5030	-5383	-5362	-5052	-5374	-5337
聚丙烯		-4452	-4632		-3980	-3738
甲醇						-7269
玻璃	-4645					
橡胶	-4797	-4686	-4846	-4540	-4484	-4450
沥青	-6830	-6837	-6653	-6578	-6560	-6668
动力煤						

谢谢!

上海大陆期货研究所
量化研究中心

欢迎交流与讨论，联系我们：

电话：021-54071958

微信：DLQH-YJS

邮箱：dlqhyfb@126.com

▼ 扫描下方二维码 ▼

让大陆期货成为你的伙伴

大陆期货

