



市场持仓分析

2018/1/25

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	34.46%	29.22%	24.55%	-30.12%	-24.97%	-21.62%	64.57%	☆☆☆☆☆
甲醇	11.34%	10.40%	6.99%	-6.71%	-6.29%	-4.47%	18.05%	☆☆☆
焦煤	-9.21%	-11.20%	-9.01%	6.66%	8.49%	7.49%	-15.88%	☆☆☆
动力煤	-4.52%	0.82%	2.96%	2.10%	0.27%	-1.89%	-6.62%	☆☆
铁矿石	5.97%	12.56%	5.95%	12.51%	3.74%	-1.33%	-6.54%	☆☆
玻璃	5.26%	3.29%	6.73%	-15.29%	-12.44%	-10.72%	20.55%	☆☆☆☆
豆粕	-1.16%	-1.11%	-0.31%	-5.98%	-5.04%	-1.79%	4.82%	☆
玉米	-1.03%	-1.08%	-0.05%	4.11%	3.19%	0.75%	-5.14%	☆☆
棕榈油	5.81%	5.01%	2.51%	-6.60%	-5.77%	-3.40%	12.41%	☆☆☆
鸡蛋	-4.02%	-2.57%	-0.68%	-1.76%	-2.00%	-4.57%	-2.27%	☆
沪镍	49.98%	36.91%	25.38%	-12.93%	-12.49%	-17.82%	62.90%	☆☆☆☆☆
菜籽粕	9.20%	8.62%	4.83%	-4.28%	-2.32%	-5.06%	13.48%	☆☆☆
橡胶	1.00%	1.01%	1.16%	-1.07%	-0.30%	-0.10%	2.07%	☆
豆油	12.78%	7.78%	1.20%	0.31%	0.36%	0.00%	12.47%	☆☆☆
沪铜	23.96%	21.44%	14.22%	-13.78%	-12.65%	-8.02%	37.75%	☆☆☆☆
棉花	1.11%	-1.17%	-1.37%	0.42%	0.41%	-0.15%	0.70%	☆
白糖	-2.00%	-0.27%	-0.21%	0.66%	0.07%	1.07%	-2.66%	☆
沪锌	-1.84%	-0.79%	-2.82%	1.90%	0.43%	4.71%	-3.74%	☆
聚乙烯	4.99%	4.80%	3.15%	-0.30%	-1.03%	0.51%	5.29%	☆☆
聚丙烯	14.08%	9.13%	4.82%	-14.04%	-10.03%	-7.05%	28.12%	☆☆☆☆
沥青	15.30%	11.59%	9.45%	2.82%	0.72%	-1.09%	12.48%	☆☆☆
沪银	-10.19%	-5.04%	-1.88%	-1.17%	-1.20%	1.28%	-9.02%	☆☆
PTA	-1.29%	-2.44%	-0.92%	-0.42%	-0.21%	-2.16%	-0.86%	☆
沪金	-5.93%	-4.74%	-2.66%	2.54%	1.76%	-1.43%	-8.47%	☆☆
沪铝	-0.62%	-1.30%	0.64%	0.56%	0.36%	-0.66%	-1.17%	☆
螺纹钢	0.55%	0.91%	1.51%	2.24%	1.68%	-2.49%	-1.69%	☆

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	20.56%	12.50%	1.52%	10.67%	11.87%	7.62%	9.90%	☆
玉米	-6.75%	-3.29%	-2.73%	17.00%	16.81%	11.11%	-23.75%	☆☆
棕榈油	16.85%	12.94%	5.32%	-13.56%	-7.37%	-3.48%	30.41%	☆☆☆
动力煤	26.99%	32.23%	27.38%	-12.05%	-15.06%	-22.42%	39.04%	☆☆☆
聚丙烯	23.45%	18.06%	10.39%	-21.38%	-17.16%	-13.36%	44.83%	☆☆☆
橡胶	26.17%	25.93%	19.97%	-20.79%	-20.16%	-17.03%	46.97%	☆☆☆
棉花	35.16%	30.92%	20.63%	-15.86%	-12.63%	-14.06%	51.02%	☆☆☆☆
鸡蛋	-5.04%	-1.48%	3.26%	-2.19%	-3.07%	-8.39%	-2.86%	☆
菜籽粕	-19.22%	-12.44%	-1.41%	11.77%	11.62%	4.24%	-30.98%	☆☆☆
铁矿石	-0.07%	0.71%	4.84%	3.48%	-0.96%	-2.13%	-3.55%	☆
豆油	19.74%	7.64%	3.75%	5.89%	5.94%	2.26%	13.84%	☆☆
沪镍	76.08%	53.77%	32.91%	-13.80%	-11.07%	-16.18%	89.88%	☆☆☆☆☆
焦炭	33.59%	28.44%	18.80%	-3.46%	-6.99%	-8.93%	37.05%	☆☆☆
沥青	58.89%	42.23%	28.88%	-1.38%	-3.00%	-11.66%	60.27%	☆☆☆☆
沪银	-0.83%	2.53%	3.36%	-1.94%	-3.02%	-4.72%	1.11%	☆
沪铝	-4.51%	-3.11%	-1.57%	18.88%	13.00%	4.73%	-23.39%	☆☆
沪金	2.20%	0.51%	-0.23%	-8.55%	-3.57%	-4.59%	10.76%	☆☆
焦煤	-24.20%	-18.79%	-13.09%	-9.13%	-3.69%	3.51%	-15.07%	☆☆
沪锌	-0.94%	-2.50%	-2.01%	6.95%	5.19%	1.85%	-7.89%	☆
聚乙烯	-0.04%	3.41%	6.34%	-4.50%	-3.56%	-1.31%	4.47%	☆
沪铜	28.83%	25.77%	19.06%	-32.66%	-25.39%	-19.75%	61.49%	☆☆☆☆
豆粕	-0.54%	0.40%	-1.73%	-4.16%	-3.18%	-1.34%	3.62%	☆
螺纹钢	-3.06%	-0.02%	1.32%	-4.96%	-7.73%	-7.06%	1.90%	☆
PTA	0.31%	7.88%	12.60%	-3.64%	-8.07%	-13.31%	3.96%	☆
白糖	1.49%	4.89%	4.15%	-3.52%	-8.77%	-5.24%	5.00%	☆
玻璃	3.03%	0.10%	-7.31%	2.57%	0.32%	-0.09%	0.46%	☆

2018年1月25日机构持仓异动表

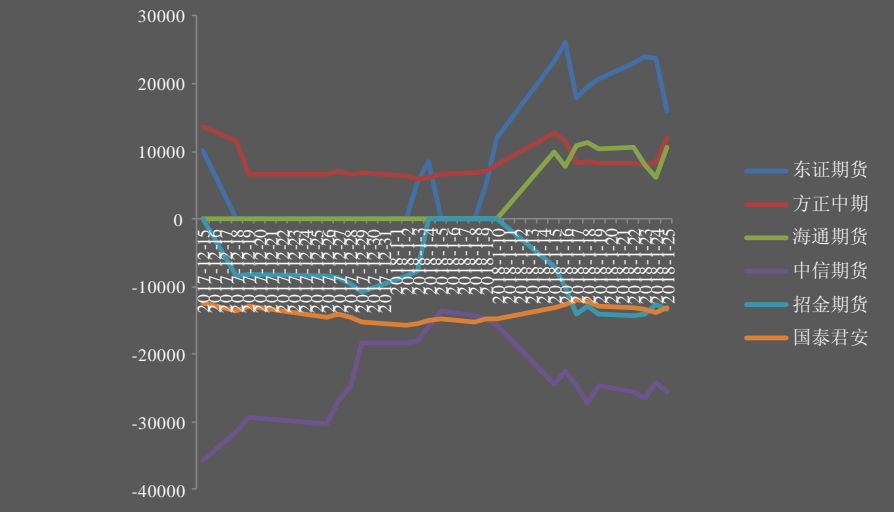
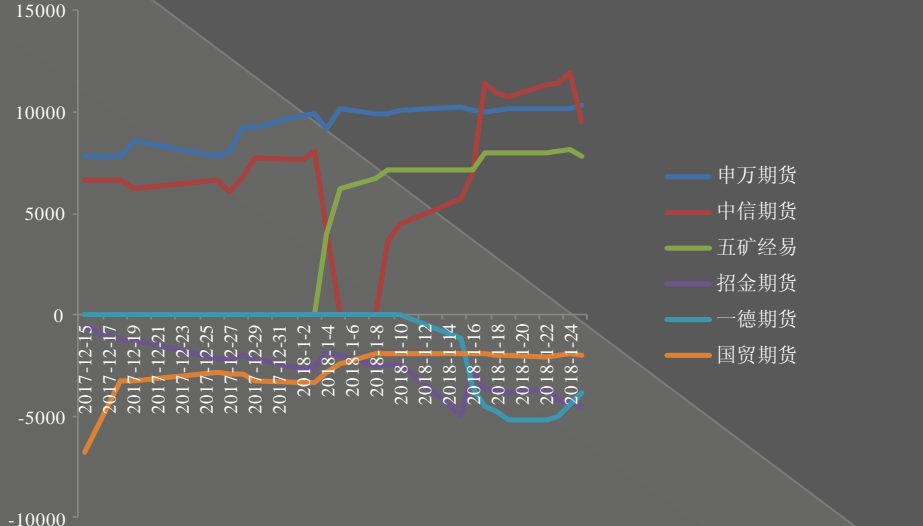
金属

东证期货	白银净多单变动幅度为：-7767手
方正中期	白银净多单变动幅度为：3748手
海通期货	白银净多单变动幅度为：4473手
铜冠金源	沪铜净多单变动幅度为：-4067手
格林大华	沪铜净多单变动幅度为：15130手
永安期货	沪铜净多单变动幅度为：9909手
华泰期货	沪镍净多单变动幅度为：-10162手
永安期货	沪镍净多单变动幅度为：17331手
海通期货	沪镍净多单变动幅度为：4252手
建信期货	沪镍净空单变动幅度为：4408手
建信期货	沪锌净多单变动幅度为：-2102手

黑色

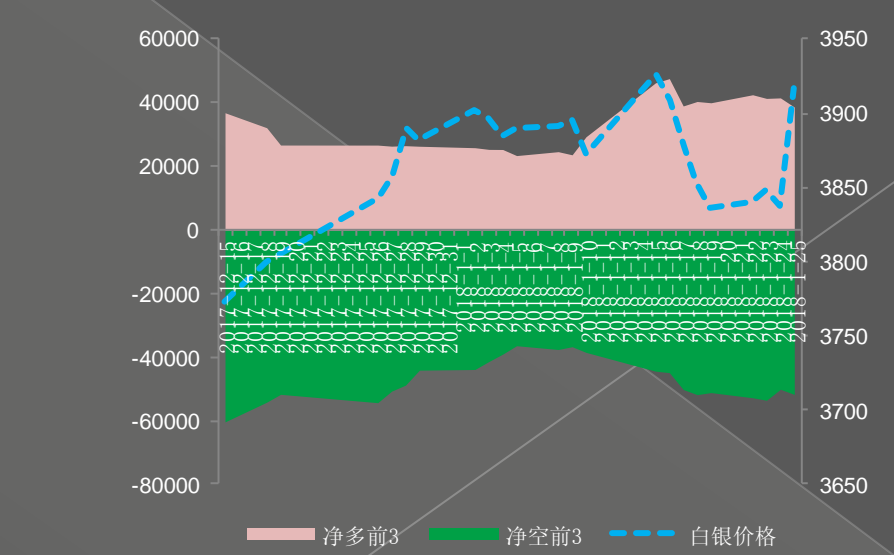
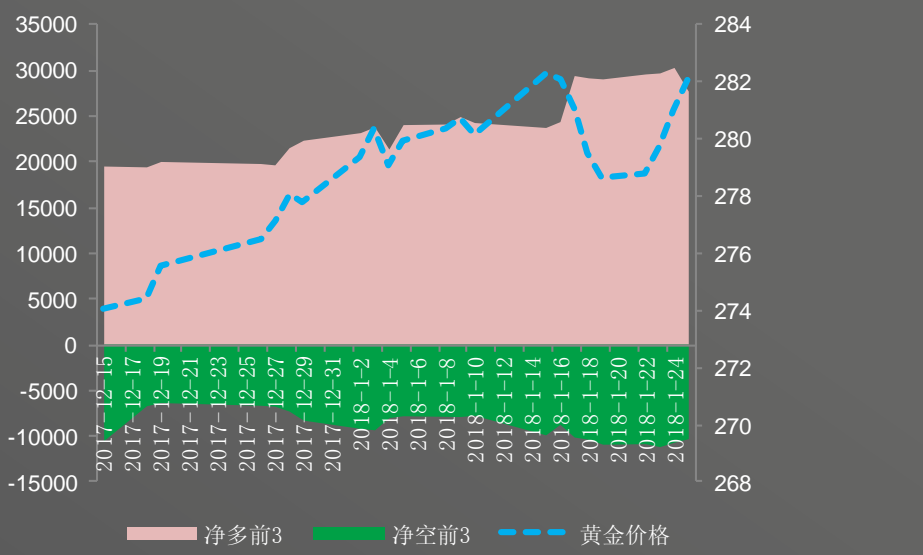
鲁证期货	螺纹钢净多单变动幅度为：-27900手
申万期货	螺纹钢净多单变动幅度为：32812手
东海期货	螺纹钢净空单变动幅度为：9524手
中信建投	铁矿石净多单变动幅度为：-19119手
中辉期货	铁矿石净多单变动幅度为：-17781手
浙商期货	铁矿石净空单变动幅度为：-19294手
申银万国	铁矿石净空单变动幅度为：4916手
国泰君安	焦炭净空单变动幅度为：-2233手
中信期货	焦炭净空单变动幅度为：1022手
中辉期货	焦炭净空单变动幅度为：1276手
中信期货	动力煤净多单变动幅度为：-2319手

金属板块：AU & AG

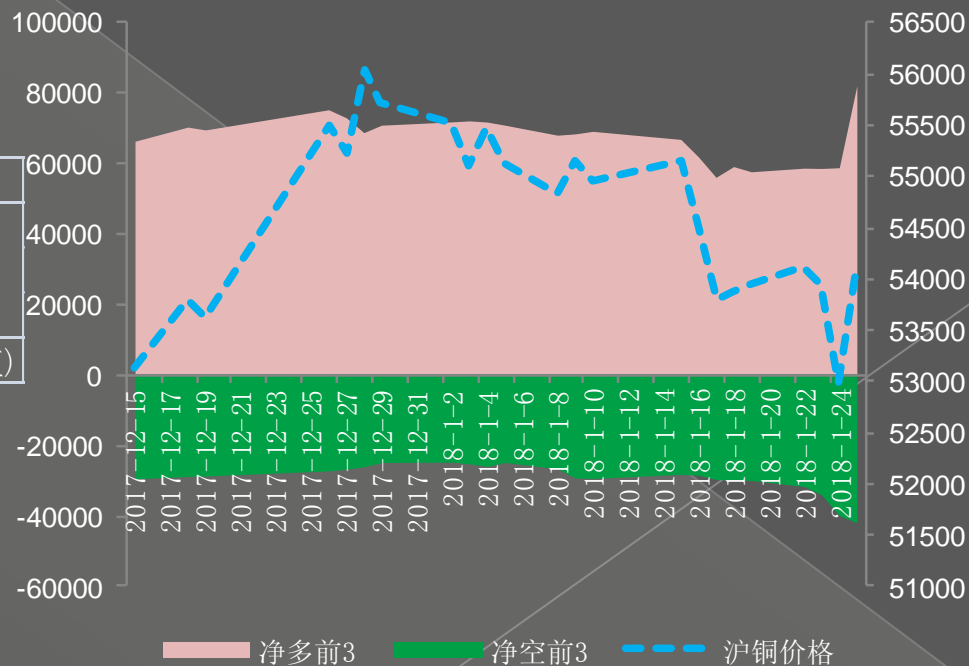
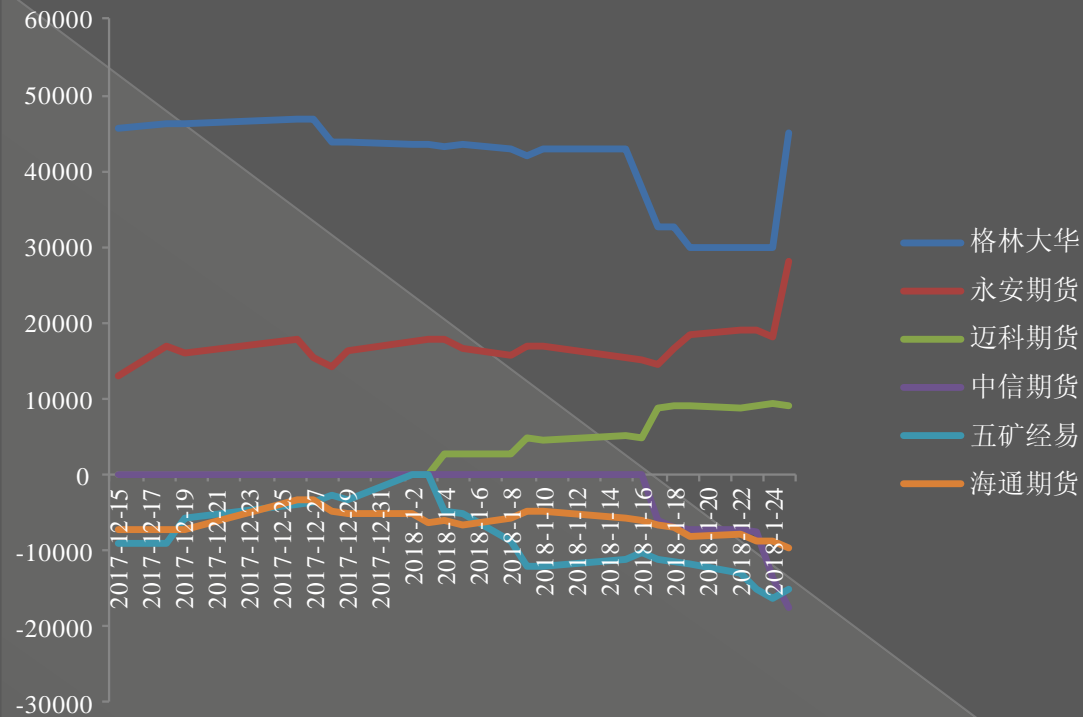


变动幅度		当日	最近5日	平均变化	波动率
au持仓	多头前3	-8.56%	-5.00%	-1.00%	5.49%
	空头前3	-3.58%	-0.61%	-0.12%	
au涨幅		0.38%	0.92%	0.18%	
震荡幅度	0.46%	0.49%(月均值)	投机度	0.48	0.36(月均值)

变动幅度		当日	最近5日	平均变化	波动率
ag持仓	多头前3	-6.90%	-4.31%	-0.86%	10.95%
	空头前3	3.24%	-0.13%	-0.03%	
ag涨幅		2.06%	1.65%	0.33%	
震荡幅度	1.66%	0.77%(月均值)	投机度	0.90	0.47(月均值)



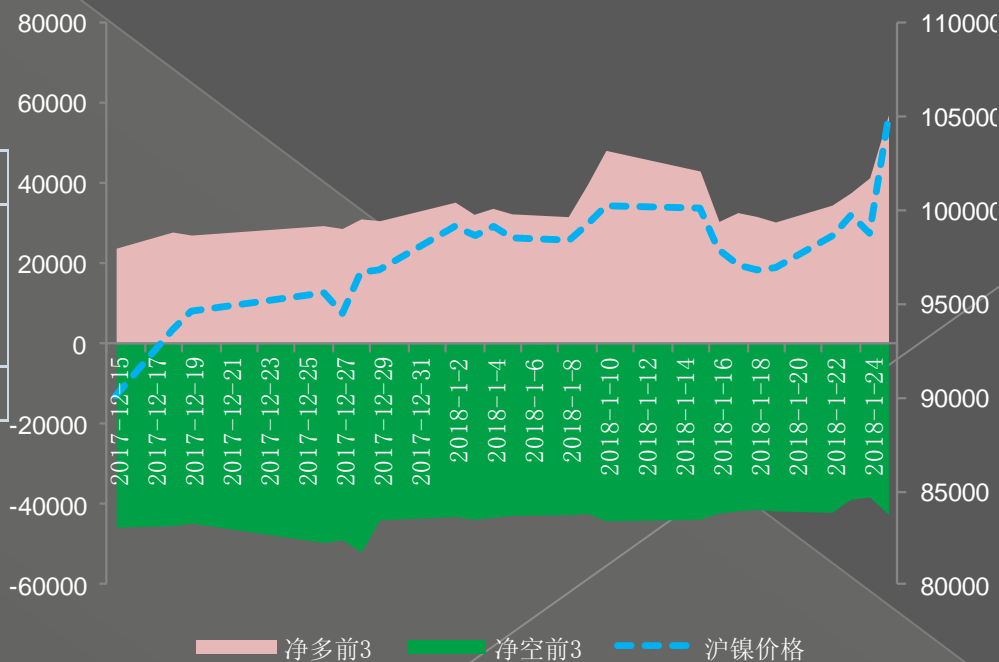
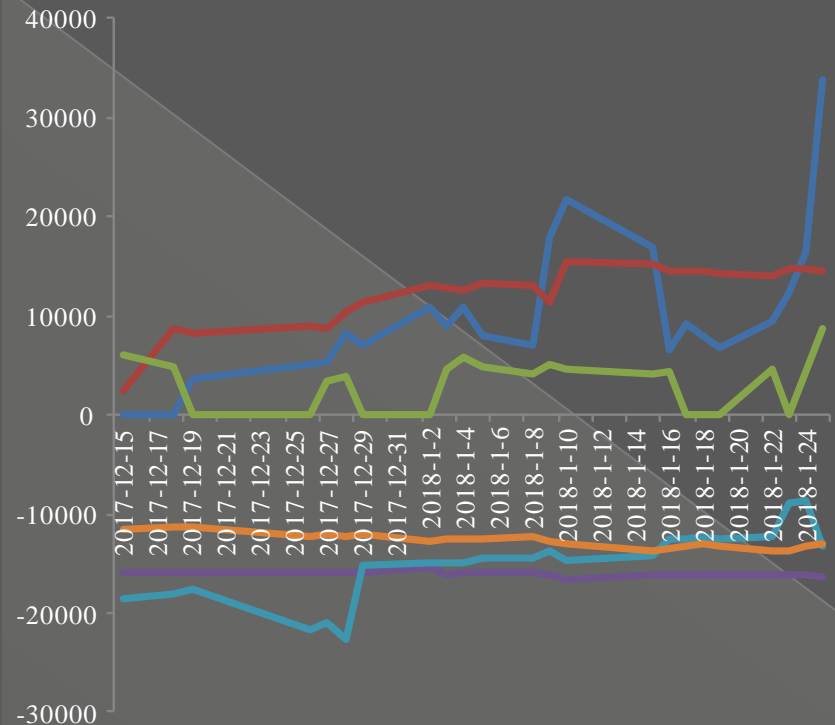
金属板块：Cu



变动幅度		当日	最近5日	平均变化	波动率
cu持仓	多头前3	39.85%	39.08%	7.82%	18.72%
	空头前3	5.11%	40.05%	8.01%	
cu涨幅		2.11%	0.39%	0.08%	
震荡幅度	2.64%	1.25%(月均值)	投机度	1.05	0.54(月均值)

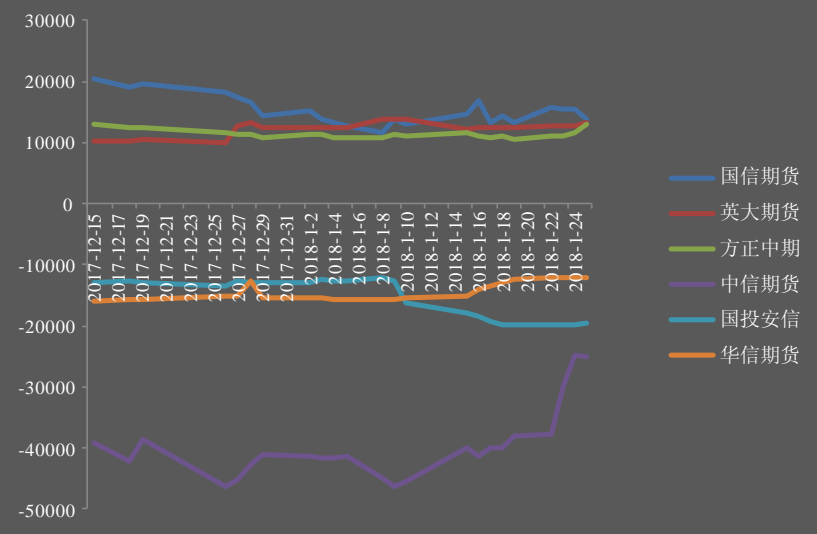
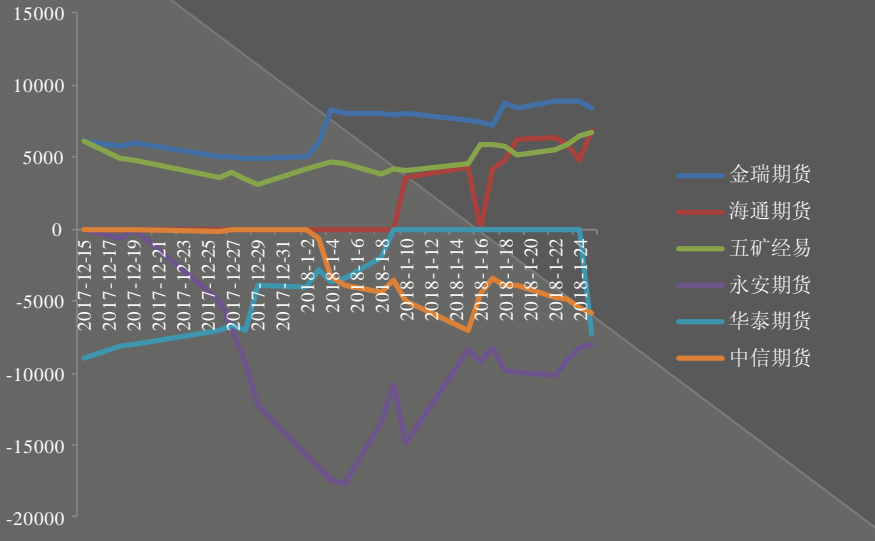
金属板块：Ni

- 永安期货
- 国贸期货
- 海通期货
- 兴业期货
- 建信期货
- 信达期货



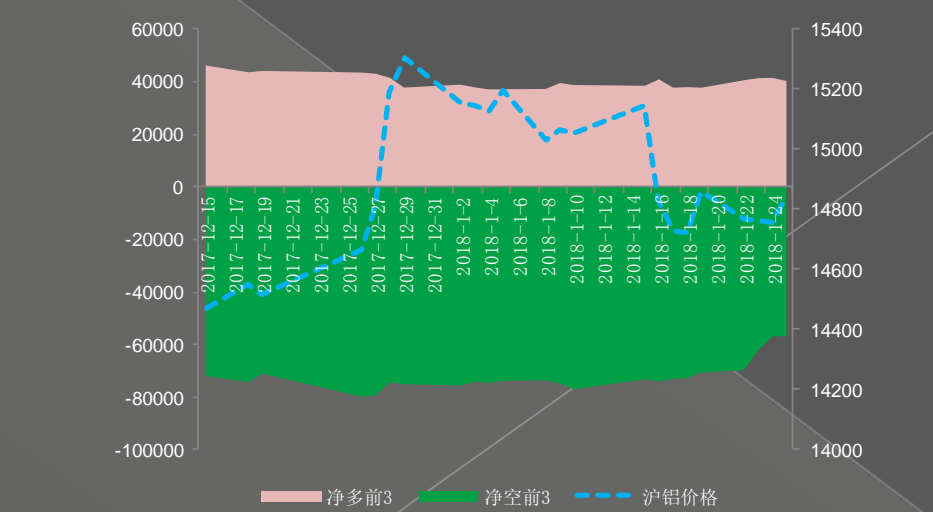
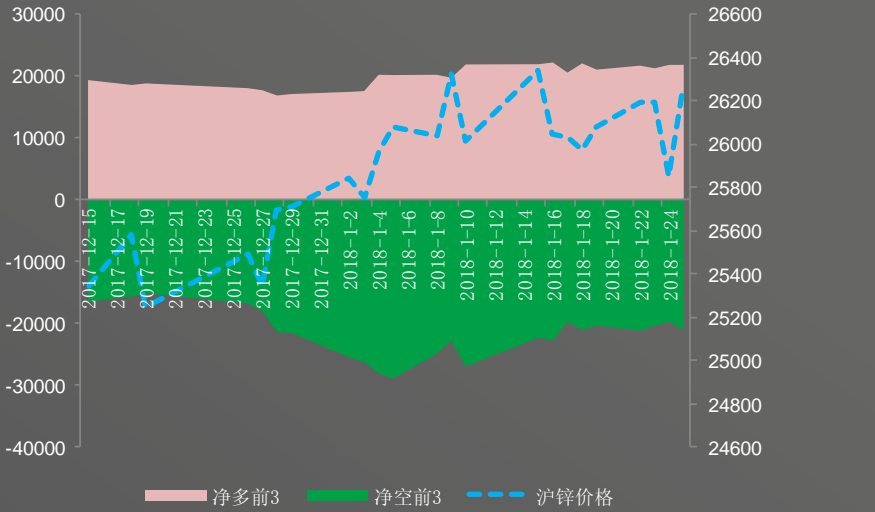
变动幅度		当日	最近5日	平均变化	波动率
ni持仓	多头前3	37.90%	79.76%	15.95%	28.51%
	空头前3	11.38%	3.03%	0.61%	
ni涨幅		6.15%	8.20%	1.64%	
震荡幅度	5.28%	2.32%(月均值)	投机度	2.07	1.29(月均值)

金属板块：Zn & Al

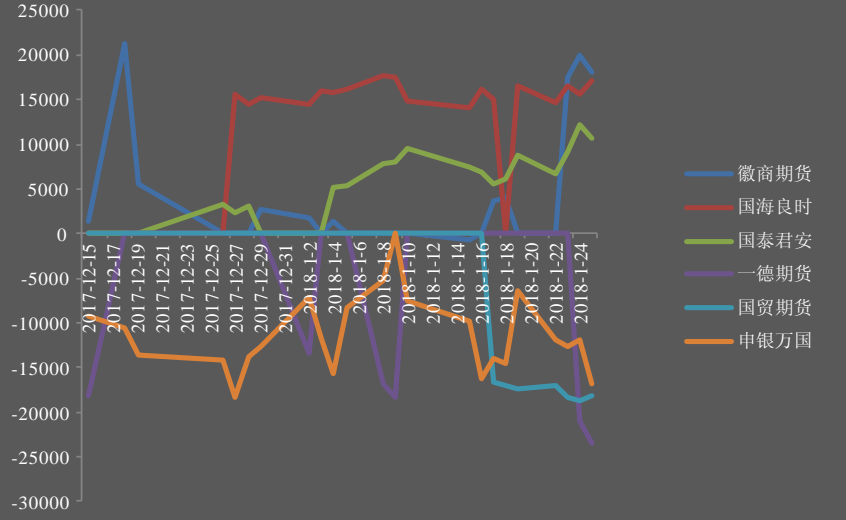
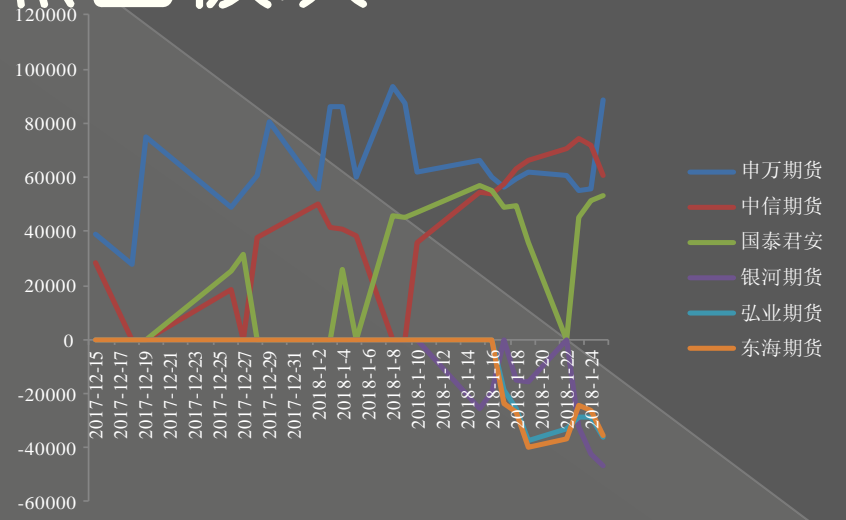


变动幅度		当日	最近5日	平均变化	波动率
zn持仓	多头前3	0.03%	-1.09%	-0.22%	13.96%
	空头前3	6.82%	0.21%	0.04%	
zn涨幅		1.59%	1.11%	0.22%	
震荡幅度	2.22%	1.21%(月均值)	投机度	1.33	1.00(月均值)

变动幅度		当日	最近5日	平均变化	波动率
al持仓	多头前3	-2.86%	6.17%	1.23%	14.78%
	空头前3	-0.05%	-21.87%	-4.37%	
al涨幅		0.56%	0.79%	0.16%	
震荡幅度	1.81%	1.45%(月均值)	投机度	0.63	0.54(月均值)

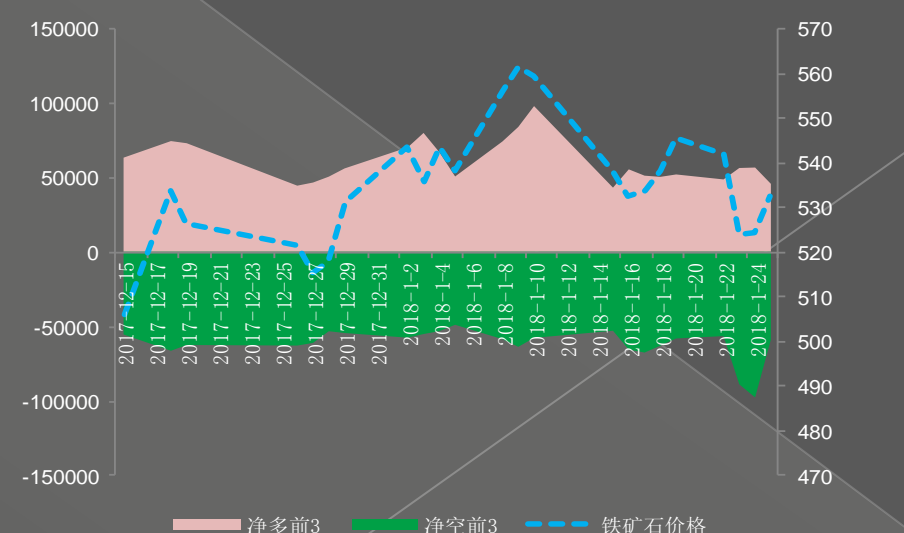
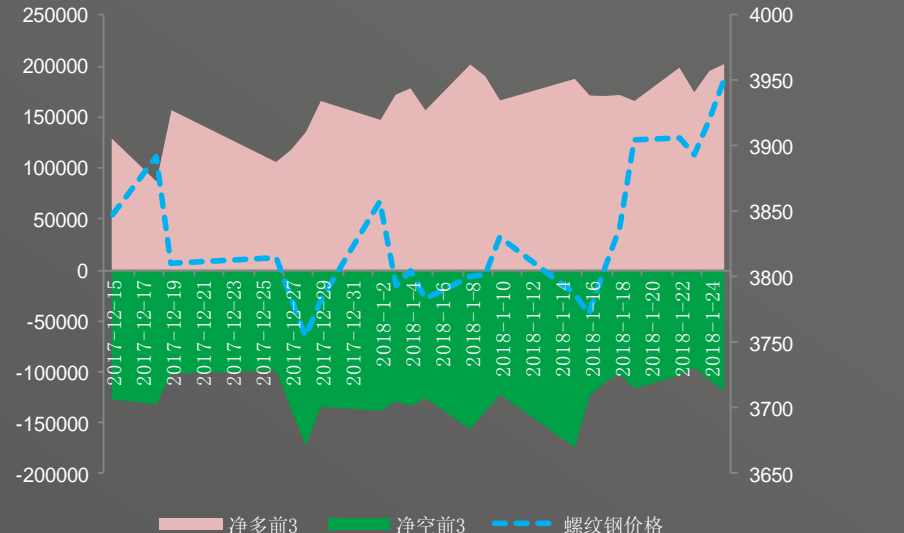


黑色板块：Rb & I

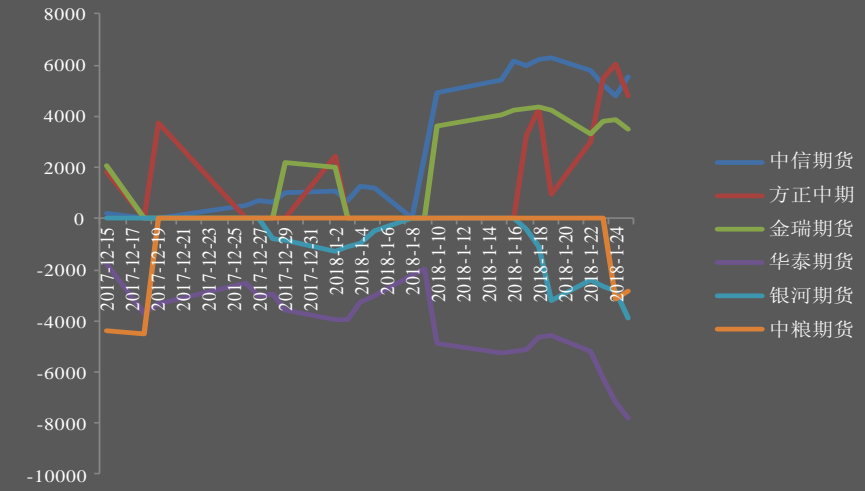
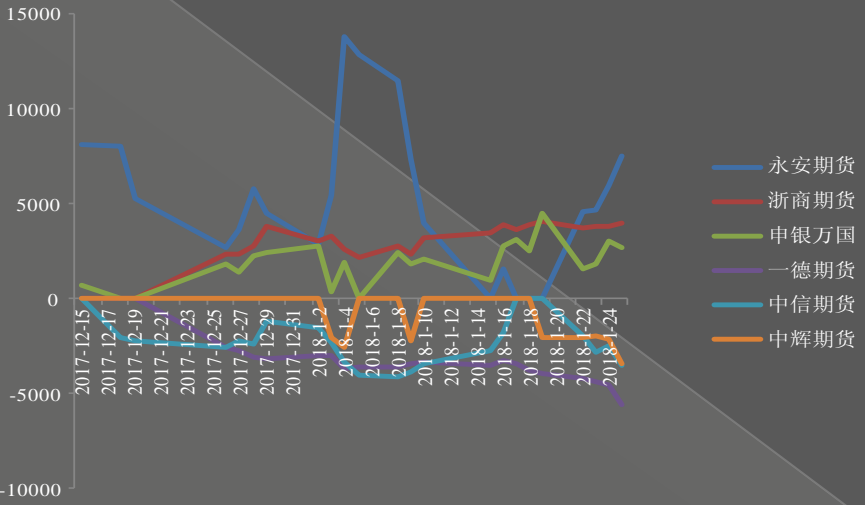


变动幅度		当日	最近5日	平均变化	波动率
rb持仓	多头前3	3.53%	17.70%	3.54%	16.19%
	空头前3	9.78%	16.52%	3.30%	
rb涨幅		0.74%	2.88%	0.58%	
震荡幅度	2.06%	1.69%(月均值)	投机度	1.13	1.28(月均值)

变动幅度		当日	最近5日	平均变化	波动率
I持仓	多头前3	-19.38%	-9.33%	-1.87%	33.40%
	空头前3	-39.64%	-6.40%	-1.28%	
I涨幅		1.58%	-1.09%	-0.22%	
震荡幅度	3.31%	2.78%(月均值)	投机度	1.19	1.26(月均值)

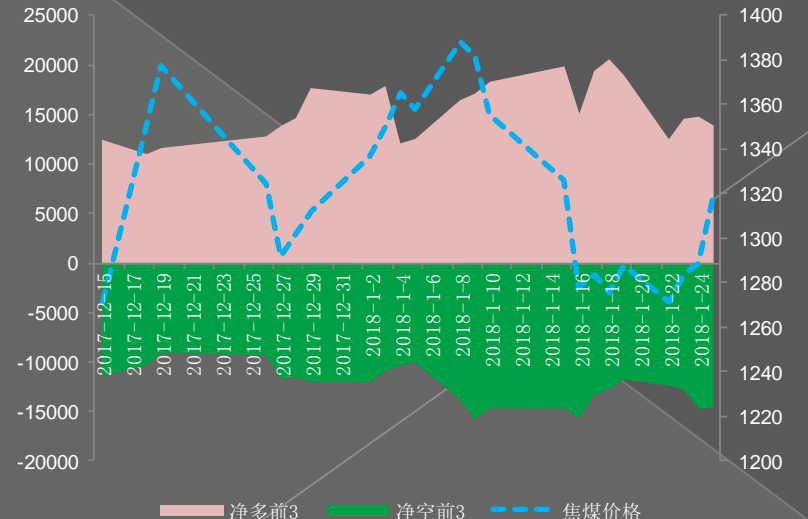
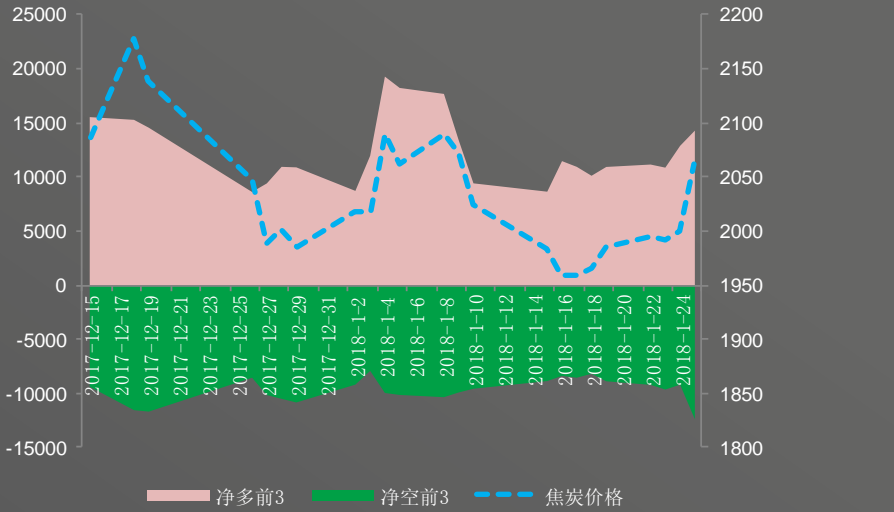


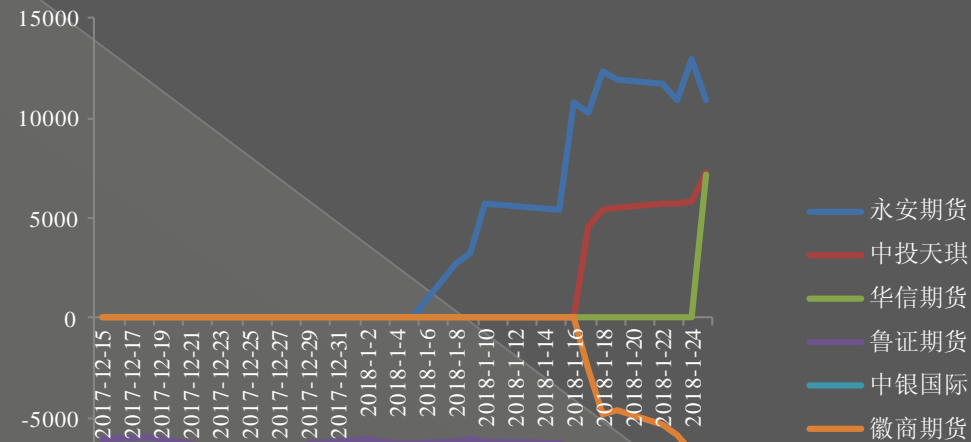
黑色板块：J & JM



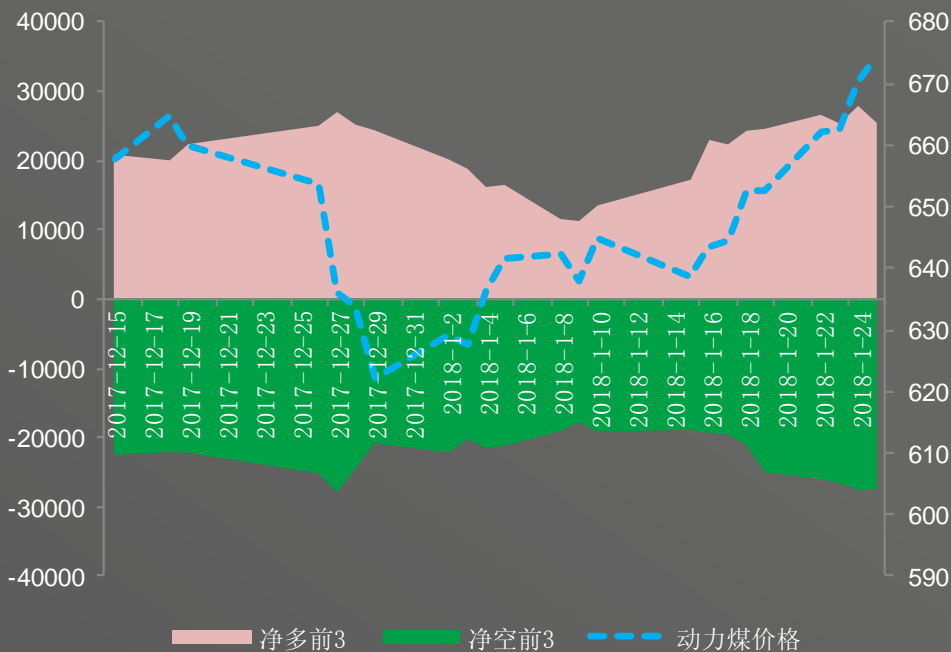
变动幅度		当日	最近5日	平均变化	波动率
j持仓	多头前3	10.95%	41.31%	8.26%	33.09%
	空头前3	34.65%	51.24%	10.25%	
j涨幅		3.15%	4.92%	0.98%	
震荡幅度	3.91%	2.87%(月均值)	投机度	1.33	1.40(月均值)

变动幅度		当日	最近5日	平均变化	波动率
jm持仓	多头前3	-6.10%	-32.57%	-6.51%	35.36%
	空头前3	-0.91%	14.29%	2.86%	
jm涨幅		2.28%	3.30%	0.66%	
震荡幅度	3.24%	3.05%(月均值)	投机度	1.44	1.44(月均值)



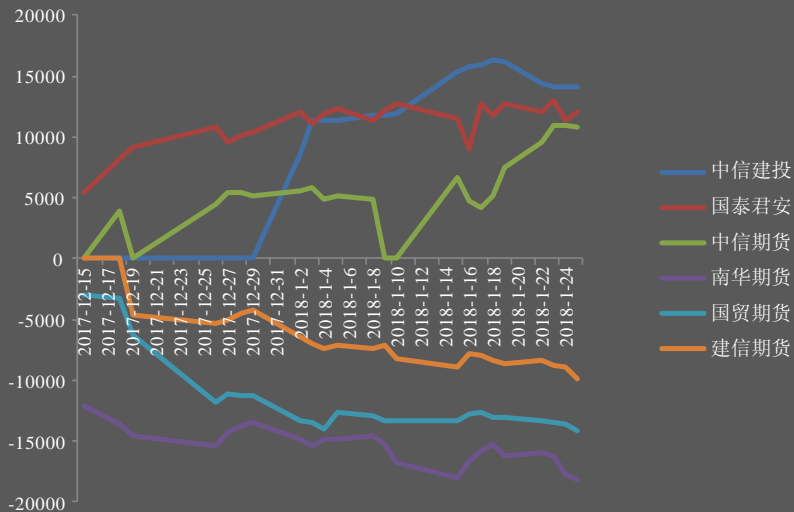
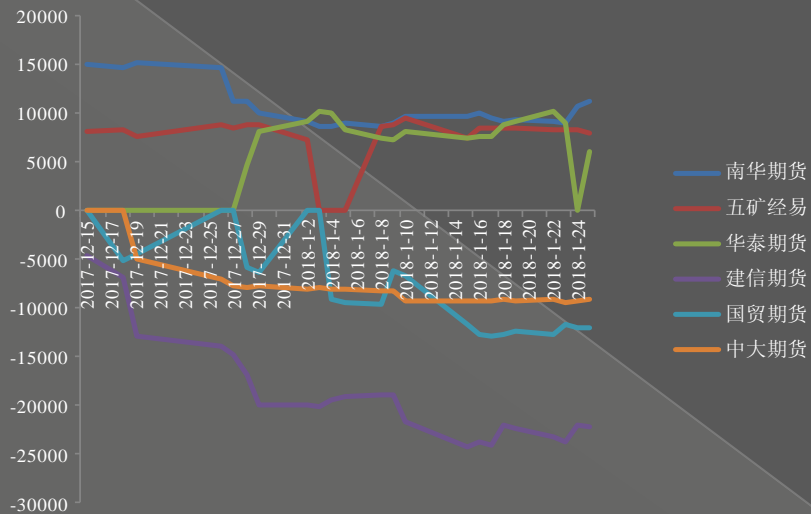


黑色：动力煤



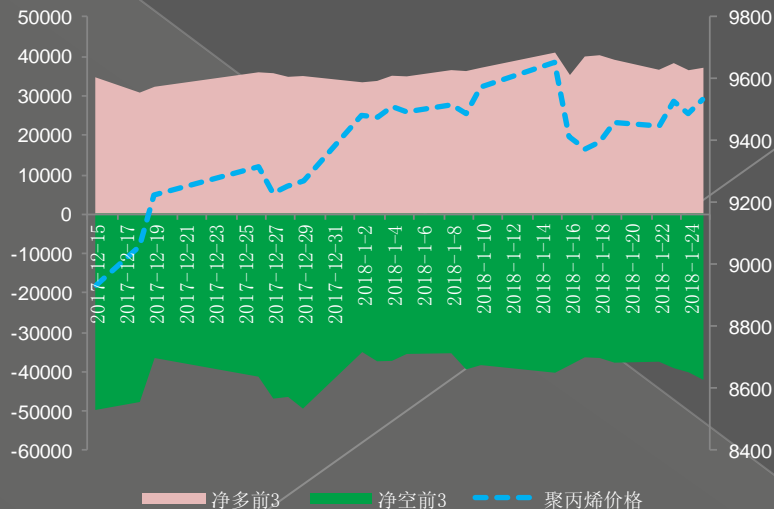
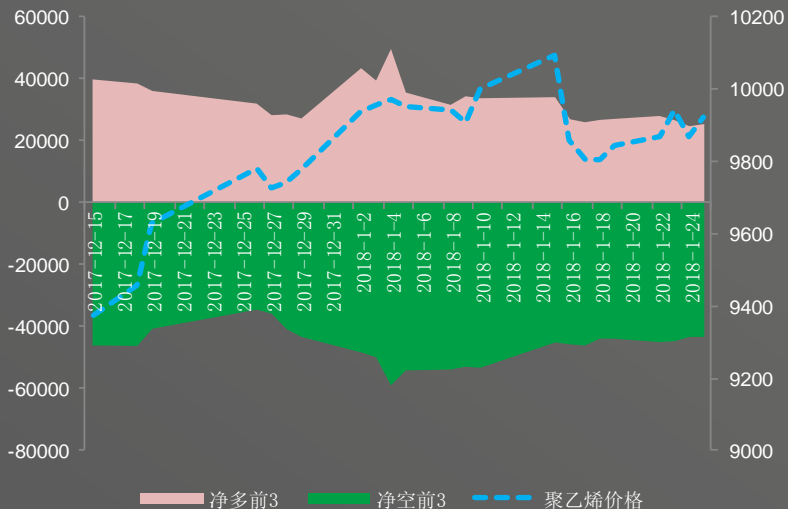
变动幅度		当日	最近5日	平均变化	波动率
zc持仓	多头前3	-8.85%	4.69%	0.94%	17.55%
	空头前3	-0.35%	29.64%	5.93%	
zc涨幅		0.57%	3.28%	0.66%	
震荡幅度	1.37%	1.54%(月均值)	投机度	0.78	0.67(月均值)

化工：塑料 & PP

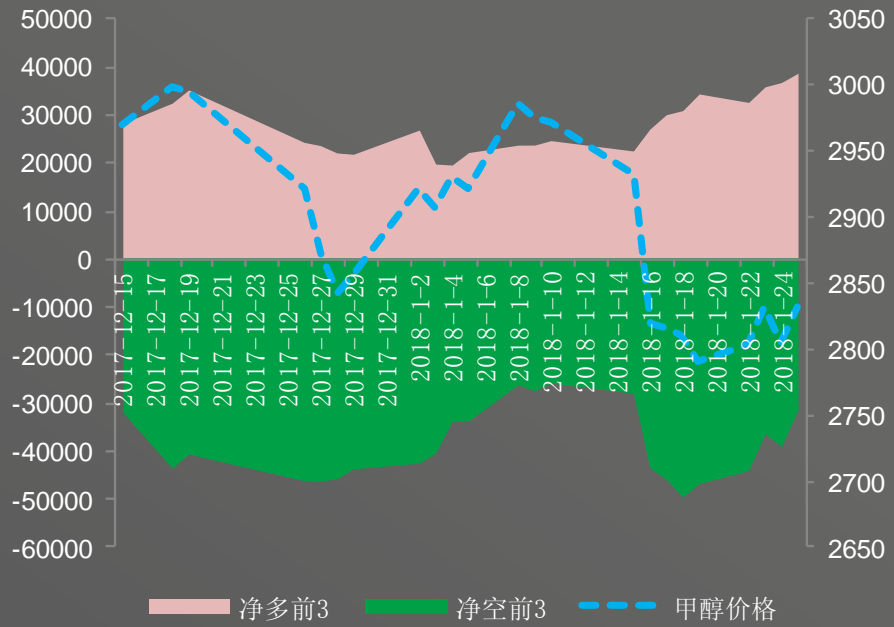
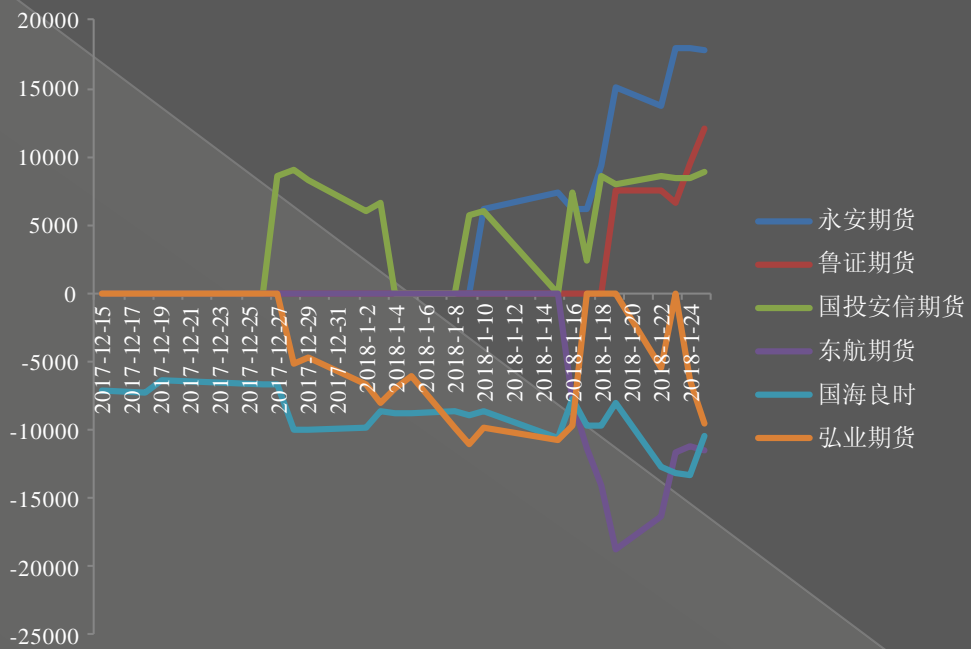


变动幅度		当日	最近5日	平均变化	波动率
I持仓	多头前3	2.81%	-4.98%	-1.00%	14.41%
	空头前3	-0.05%	-1.27%	-0.25%	
I涨幅		0.53%	1.17%	0.23%	
震荡幅度	1.26%	1.44%(月均值)	投机度	0.69	0.71(月均值)

变动幅度		当日	最近5日	平均变化	波动率
pp持仓	多头前3	1.73%	-7.91%	-1.58%	15.43%
	空头前3	4.79%	15.20%	3.04%	
pp涨幅		0.50%	1.49%	0.30%	
震荡幅度	1.01%	1.50%(月均值)	投机度	0.71	0.76(月均值)

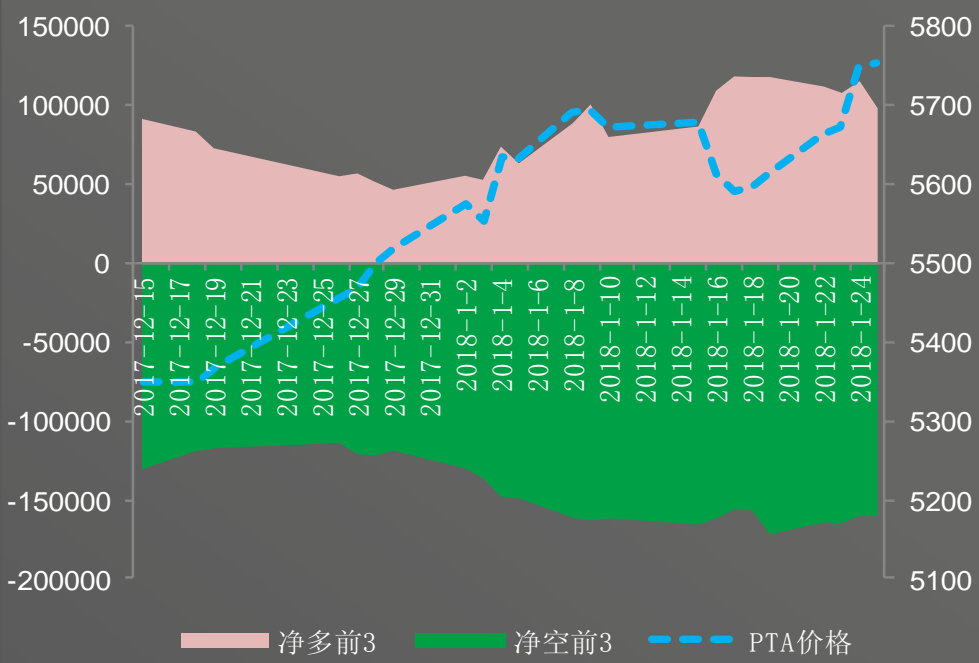
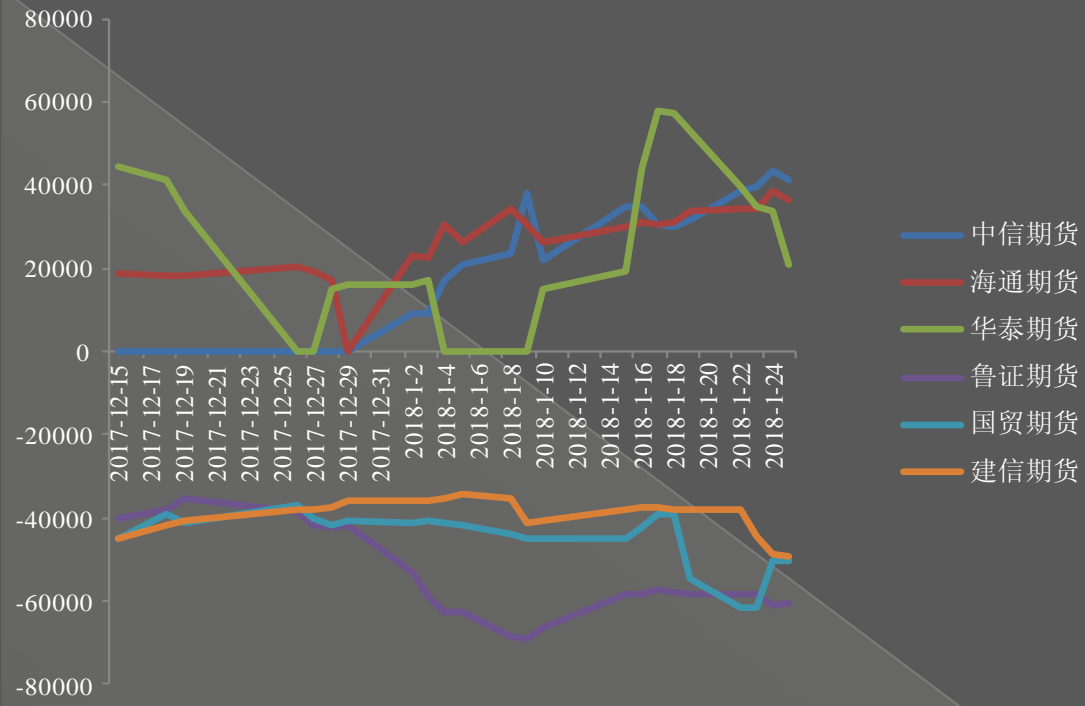


化工：甲醇



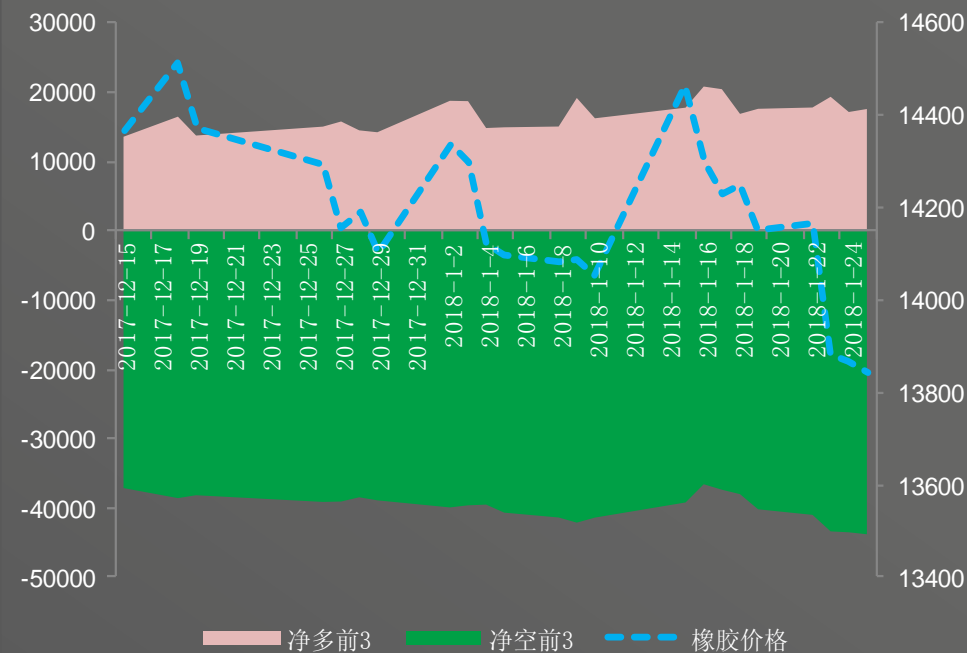
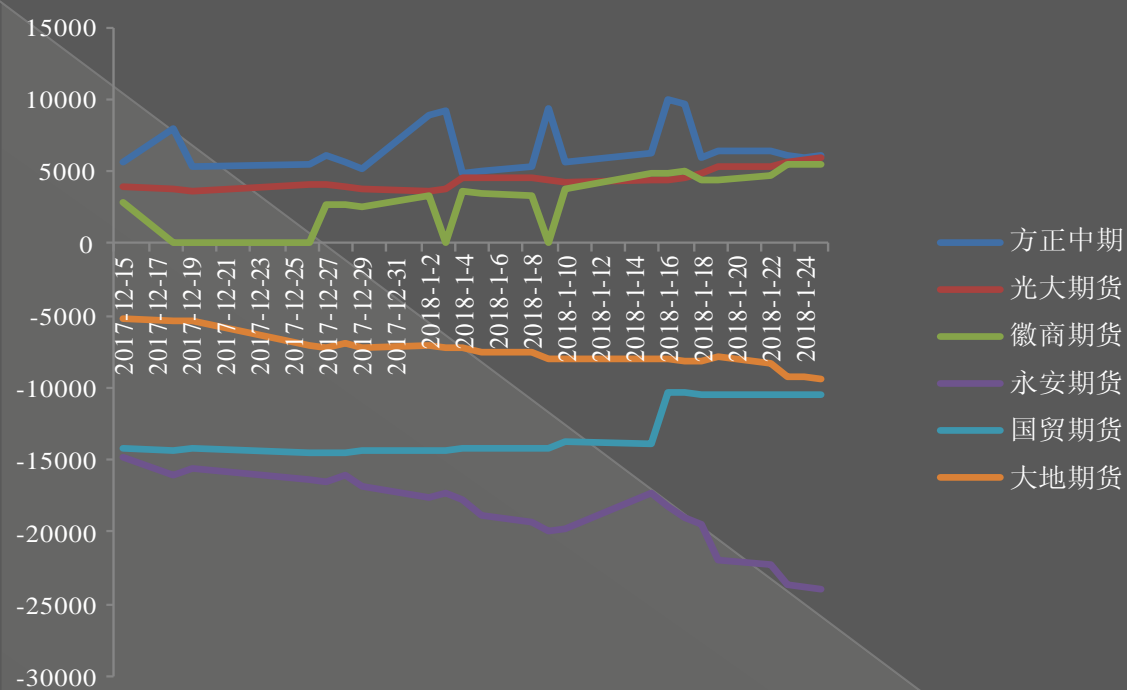
变动幅度		当日	最近5日	平均变化	波动率
ma持仓	多头前3	5.26%	25.35%	5.07%	22.40%
	空头前3	-19.48%	-36.49%	-7.30%	
ma涨幅		0.94%	0.75%	0.15%	
震荡幅度	1.40%	1.87%(月均值)	投机度	1.33	1.27(月均值)

化工：PTA



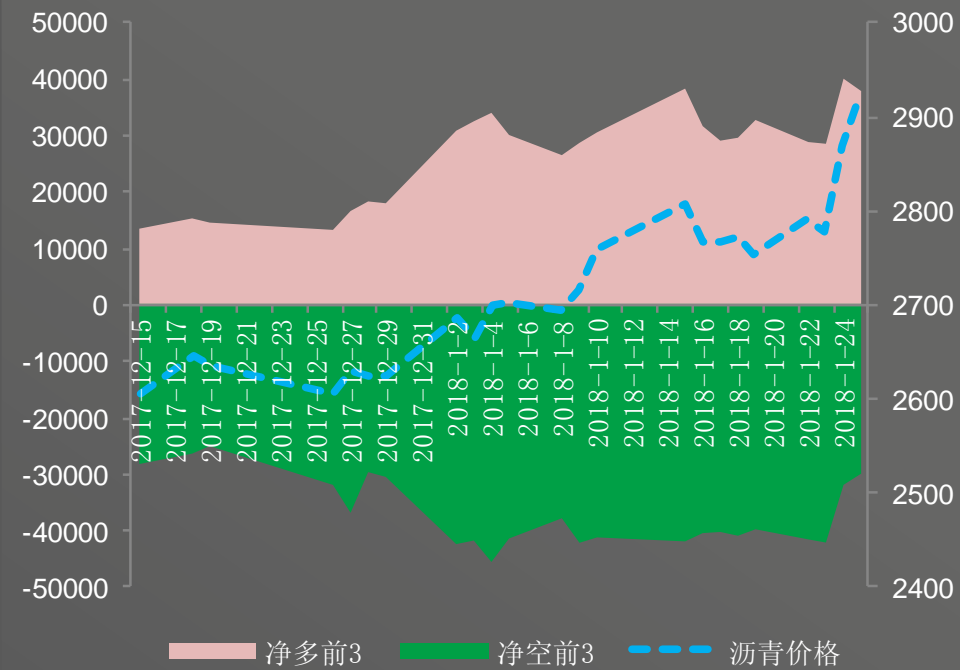
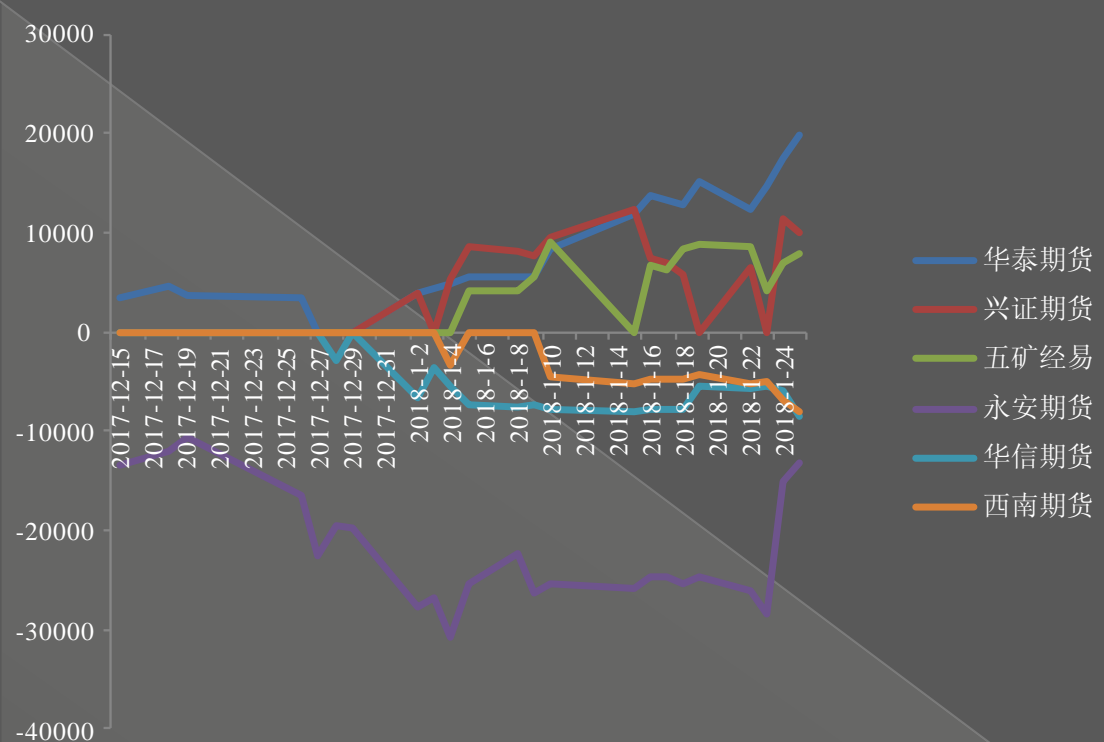
变动幅度		当日	最近5日	平均变化	波动率
pta持仓	多头前3	-14.80%	-16.71%	-3.34%	10.76%
	空头前3	-0.12%	2.00%	0.40%	
pta涨幅		0.12%	2.83%	0.57%	
震荡幅度	1.01%	1.14%(月均值)	投机度	0.41	0.48(月均值)

化工：橡胶



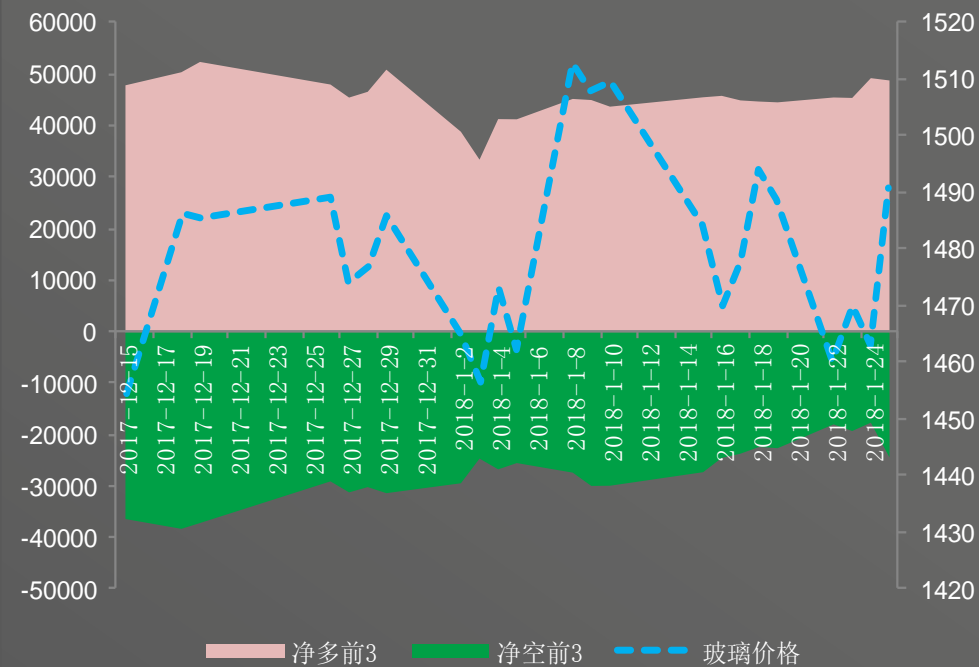
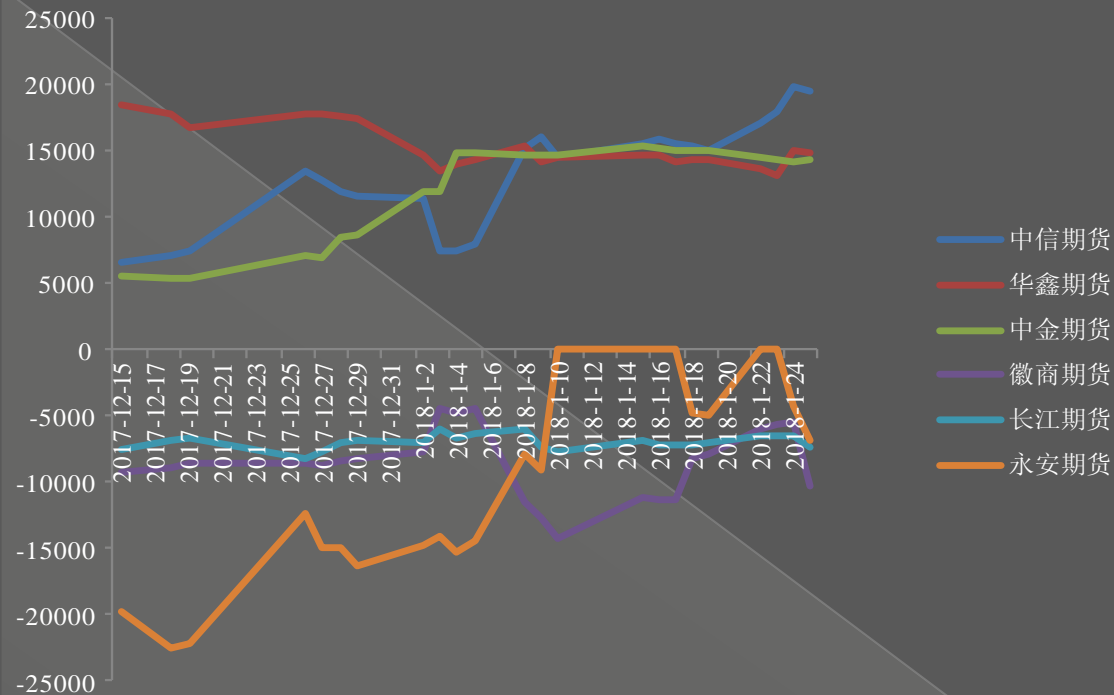
变动幅度		当日	最近5日	平均变化	波动率
ru持仓	多头前3	2.49%	4.12%	0.82%	16.21%
	空头前3	0.65%	15.26%	3.05%	
ru涨幅		-0.17%	-2.84%	-0.57%	
震荡幅度	1.45%	1.92%(月均值)	投机度	0.74	0.98(月均值)

化工：沥青



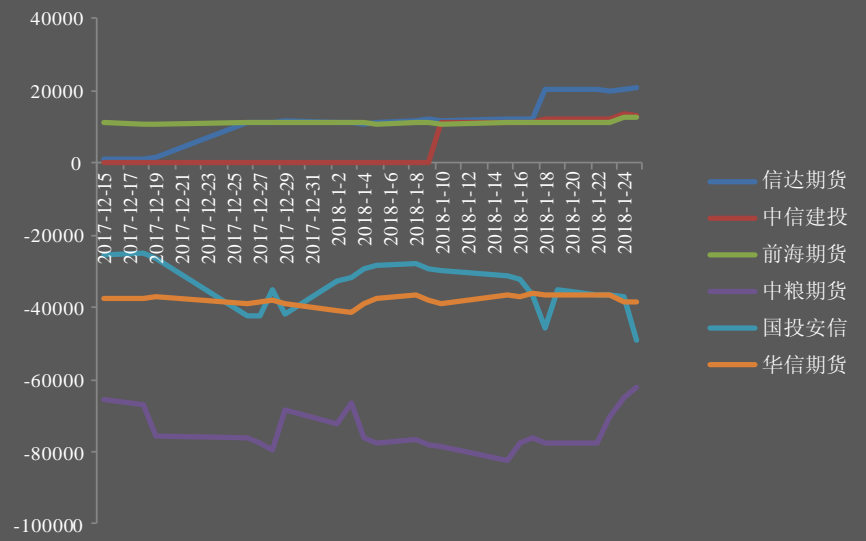
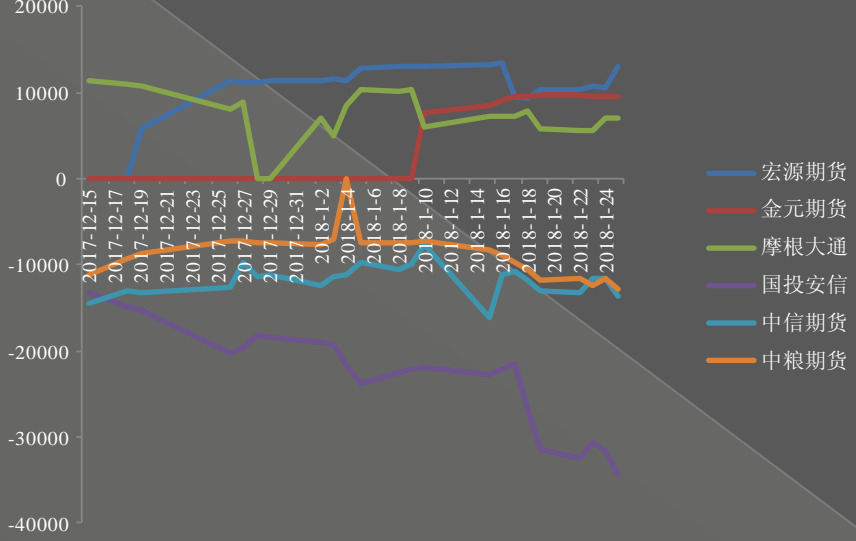
变动幅度		当日	最近5日	平均变化	波动率
bu持仓	多头前3	-5.48%	28.09%	5.62%	19.23%
	空头前3	-6.19%	-26.77%	-5.35%	
bu涨幅		1.89%	5.48%	1.10%	
震荡幅度	3.17%	1.67%(月均值)	投机度	1.12	0.80(月均值)

化工：玻璃



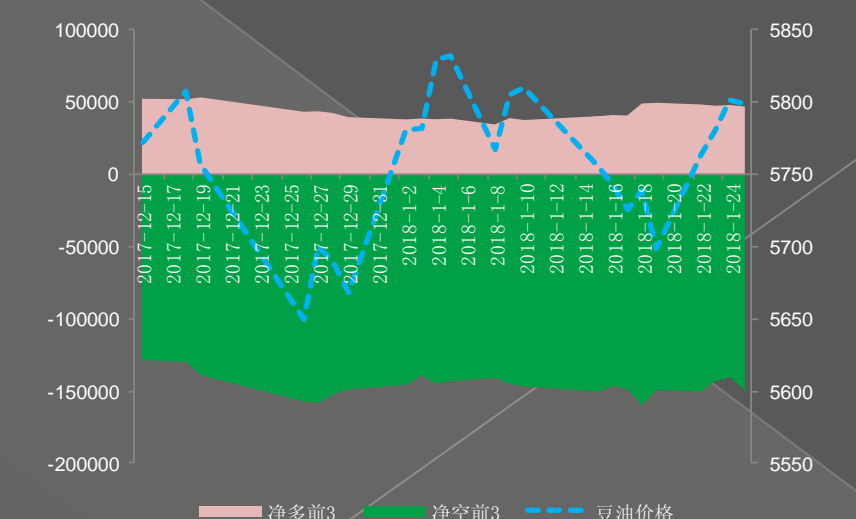
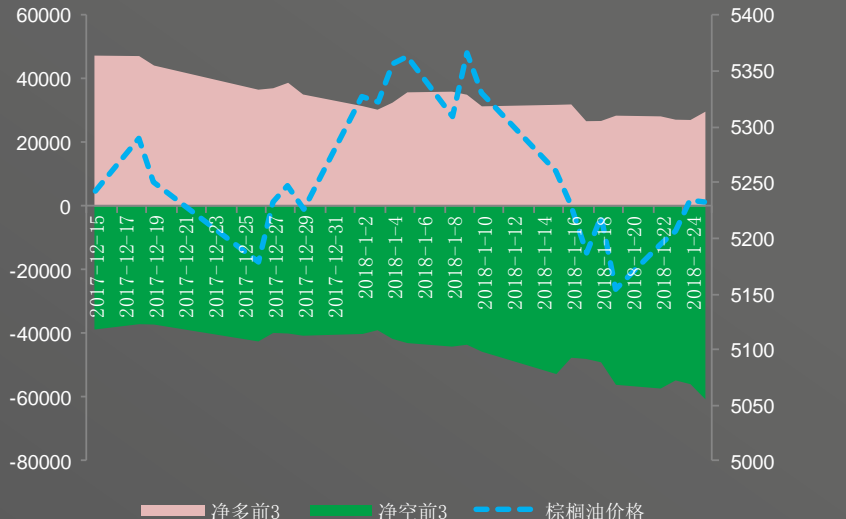
变动幅度		当日	最近5日	平均变化	波动率
fg持仓	多头前3	-0.90%	9.14%	1.83%	20.40%
	空头前3	38.47%	9.11%	1.82%	
fg涨幅		1.89%	-0.23%	-0.05%	
震荡幅度	2.68%	1.75%(月均值)	投机度	0.75	0.55(月均值)

农产品：P & Y

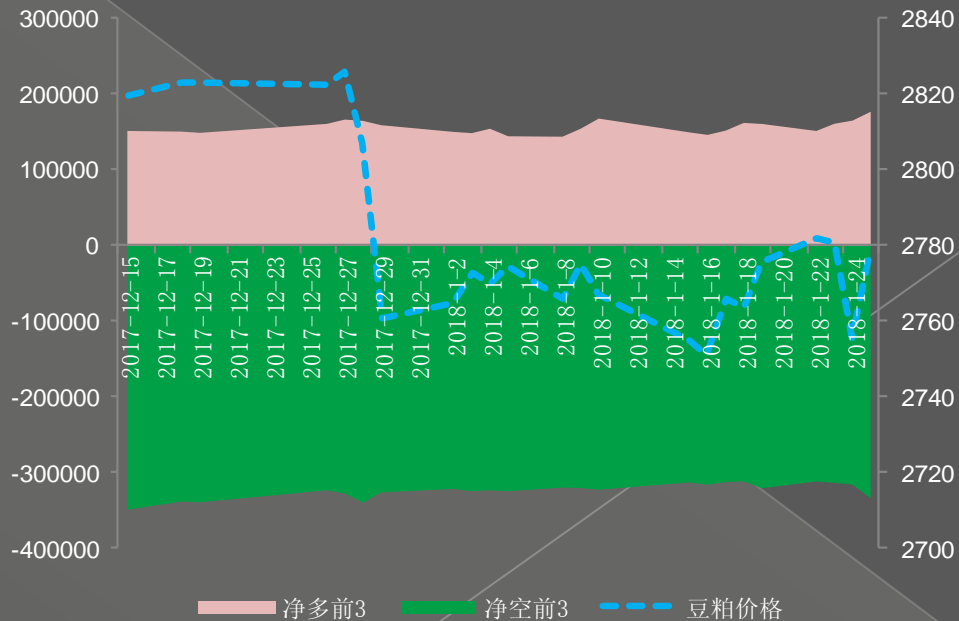
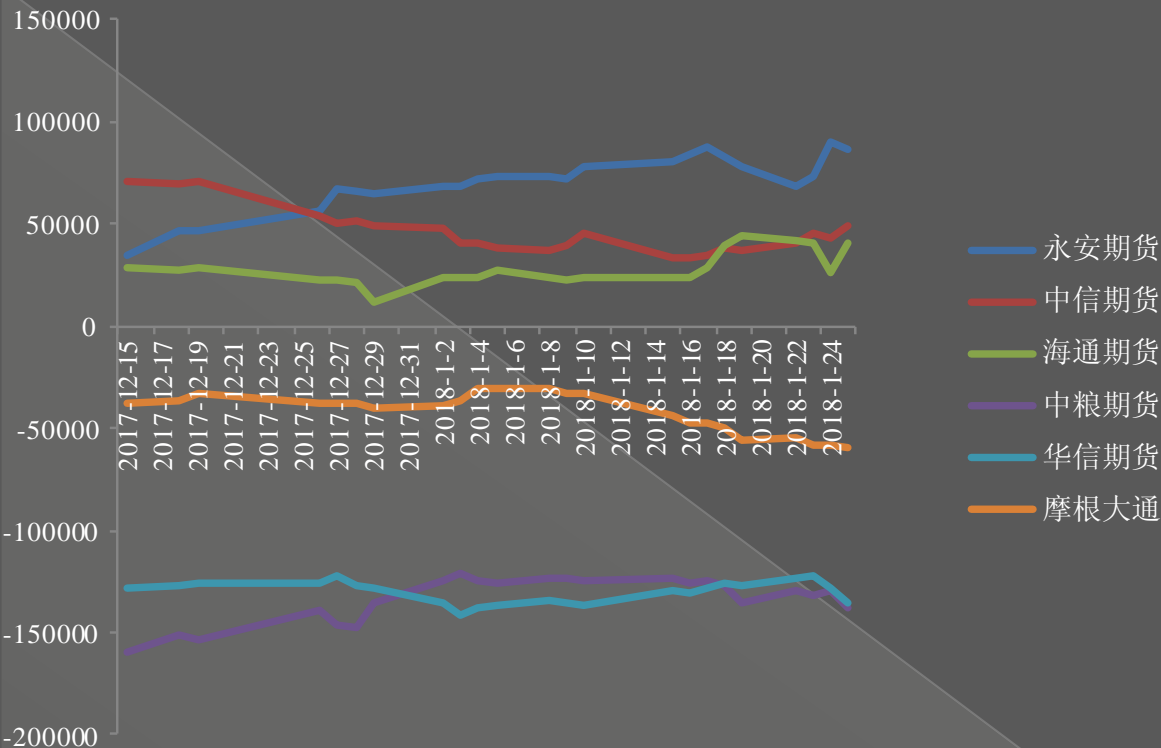


变动幅度		当日	最近5日	平均变化	波动率
p持仓	多头前3	9.56%	10.86%	2.17%	14.27%
	空头前3	8.51%	23.77%	4.75%	
p涨幅		-0.06%	0.24%	0.05%	
震荡幅度	0.79%	1.00%(月均值)	投机度	0.55	0.48(月均值)

变动幅度		当日	最近5日	平均变化	波动率
y持仓	多头前3	-2.23%	-4.29%	-0.86%	13.37%
	空头前3	6.26%	-6.58%	-1.32%	
y涨幅		-0.03%	1.04%	0.21%	
震荡幅度	0.64%	0.95%(月均值)	投机度	0.26	0.29(月均值)

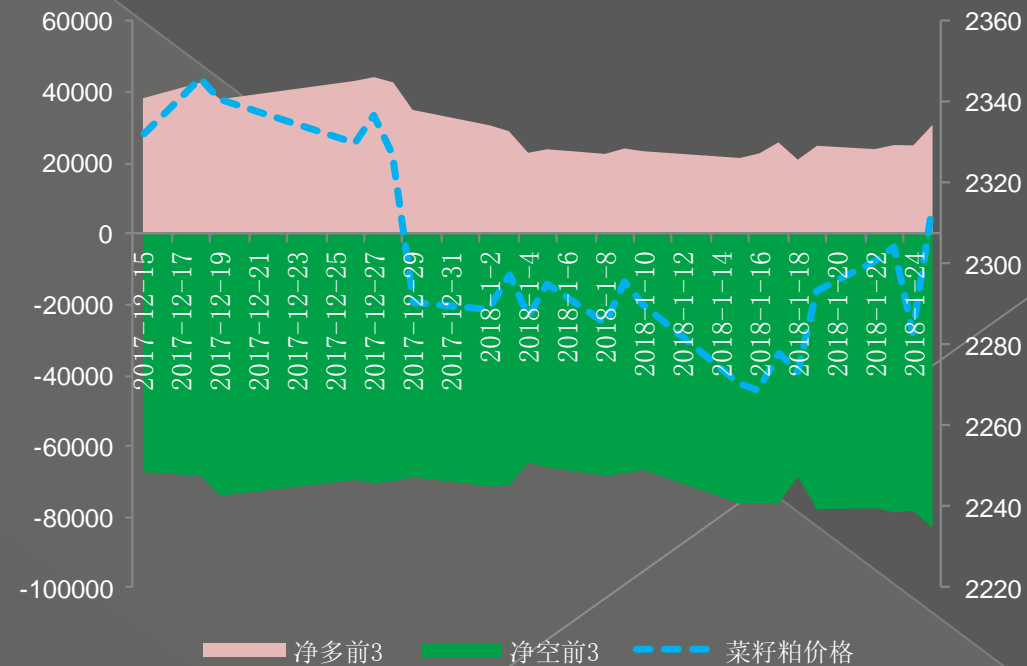
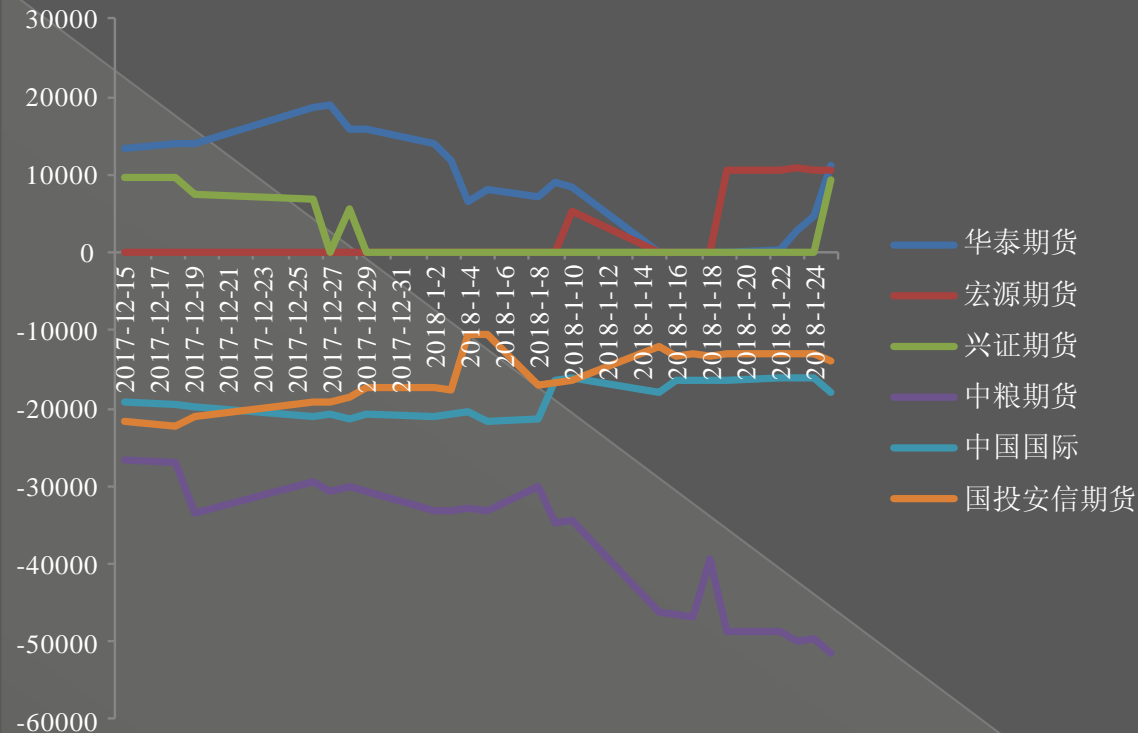


农产品：豆粕

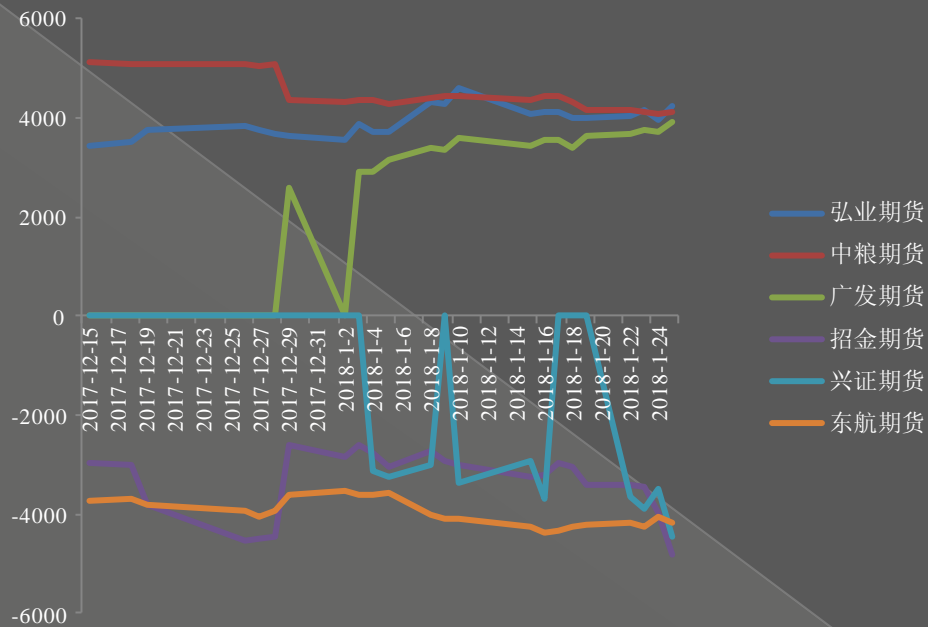


变动幅度		当日	最近5日	平均变化	波动率
m持仓	多头前3	7.06%	9.07%	1.81%	8.29%
	空头前3	5.61%	7.11%	1.42%	
m涨幅		0.81%	0.53%	0.11%	
震荡幅度	0.87%	0.82% (月均值)	投机度	0.30	0.31 (月均值)

农产品：菜粕

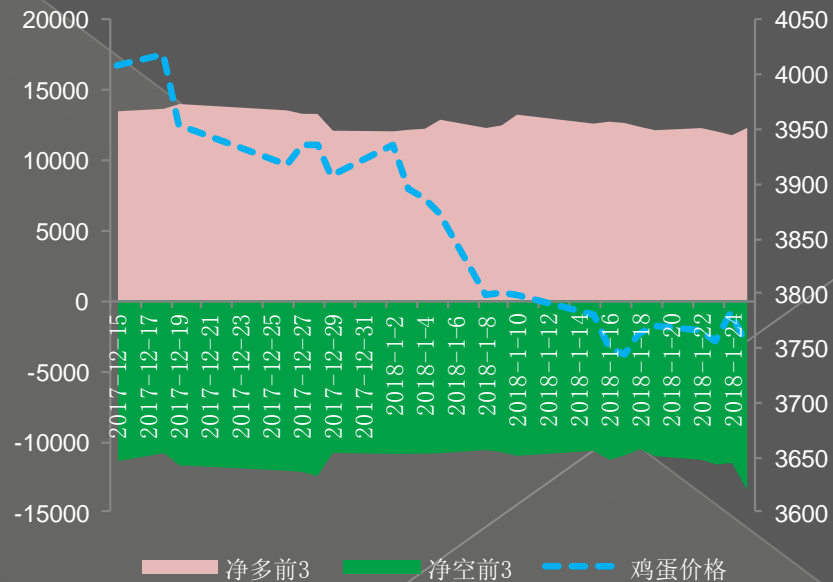


变动幅度		当日	最近5日	平均变化	波动率
rm持仓	多头前3	23.16%	46.80%	9.36%	10.14%
	空头前3	6.09%	20.89%	4.18%	
rm涨幅		1.30%	1.74%	0.35%	
震荡幅度	1.45%	1.00%(月均值)	投机度	0.56	0.46(月均值)

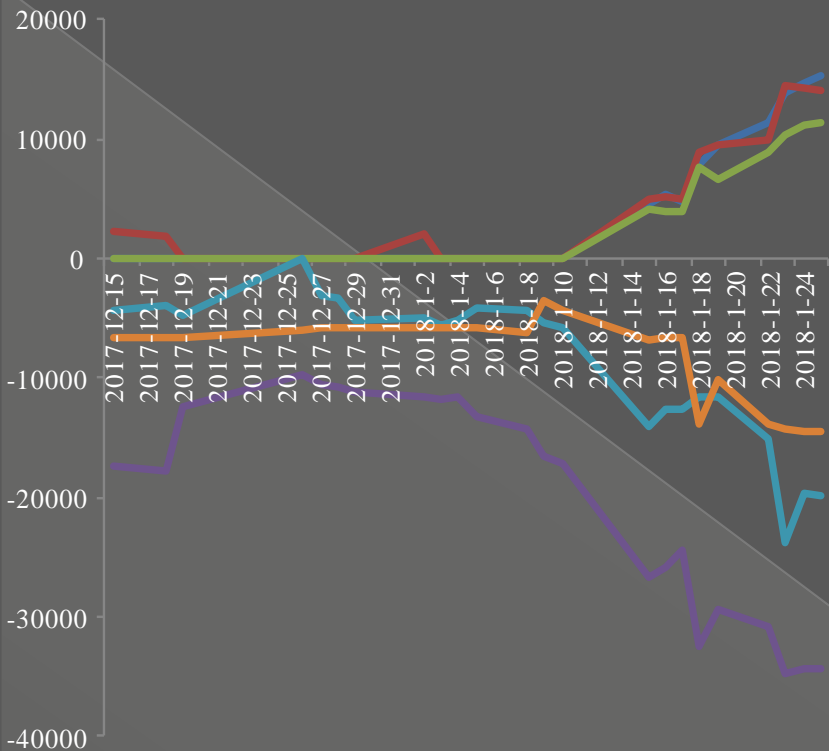


农产品：鸡蛋

变动幅度		当日	最近5日	平均变化	波动率
jd持仓	多头前3	4.48%	-0.59%	-0.12%	11.15%
	空头前3	16.66%	27.55%	5.51%	
jd涨幅		-0.76%	-0.22%	-0.04%	
震荡幅度	1.35%	1.16%(月均值)	投机度	0.40	0.40(月均值)

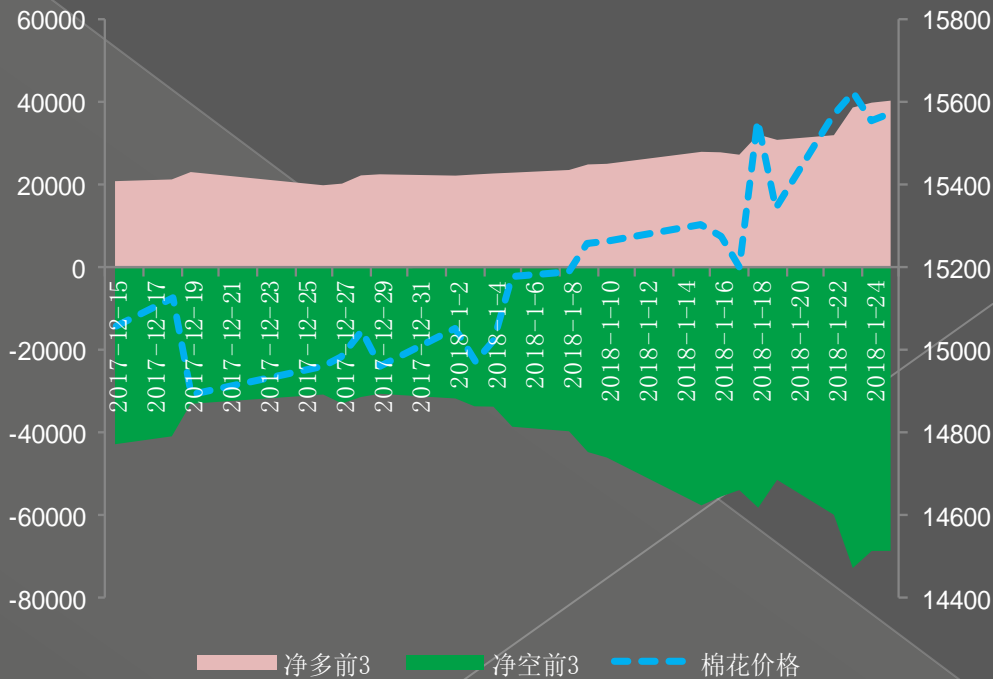


农产品：棉花



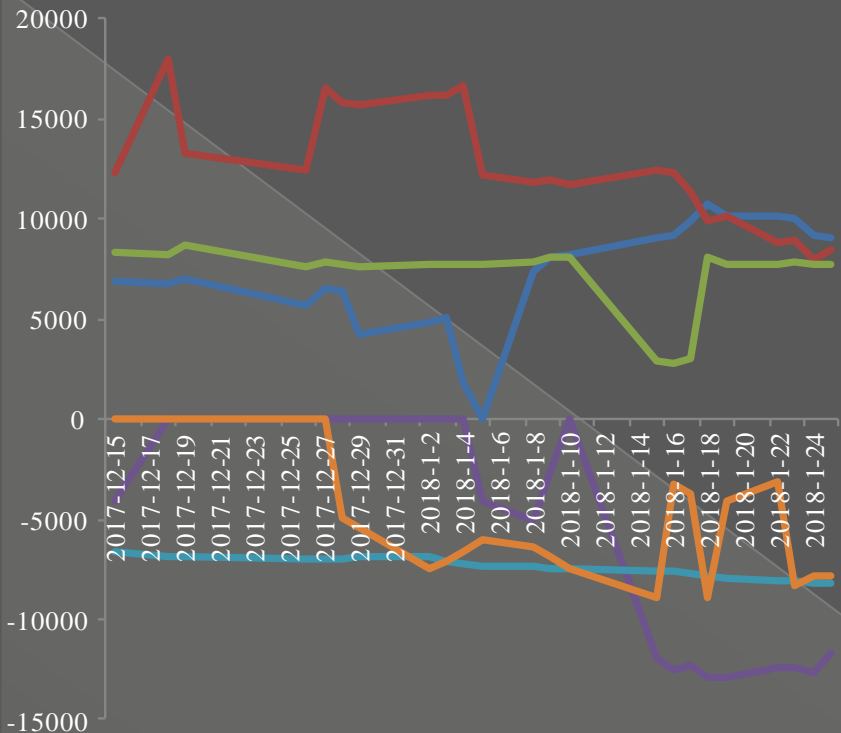
- 华泰期货
- 宏源期货
- 中信建投
- 华信期货
- 东证期货
- 中国国际

变动幅度		当日	最近5日	平均变化	波动率
cf持仓	多头前3	1.20%	25.40%	5.08%	13.30%
	空头前3	-0.05%	18.01%	3.60%	
cf涨幅		0.13%	0.11%	0.02%	
震荡幅度	0.83%	1.05%(月均值)	投机度	0.32	0.45(月均值)



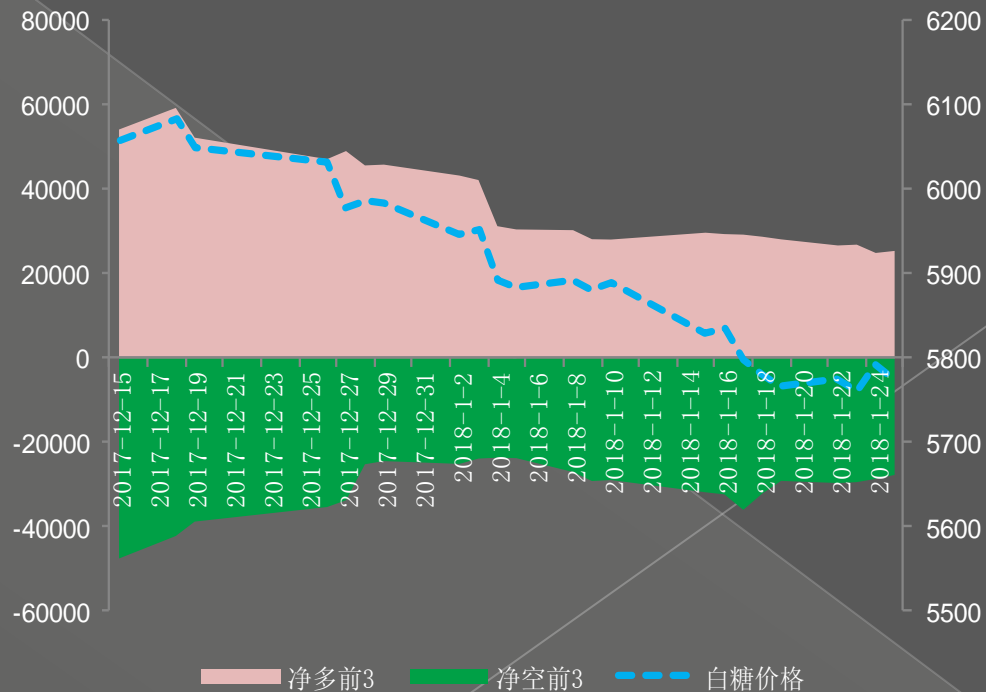
- 净多前3
- 净空前3
- 棉花价格

农产品：白糖

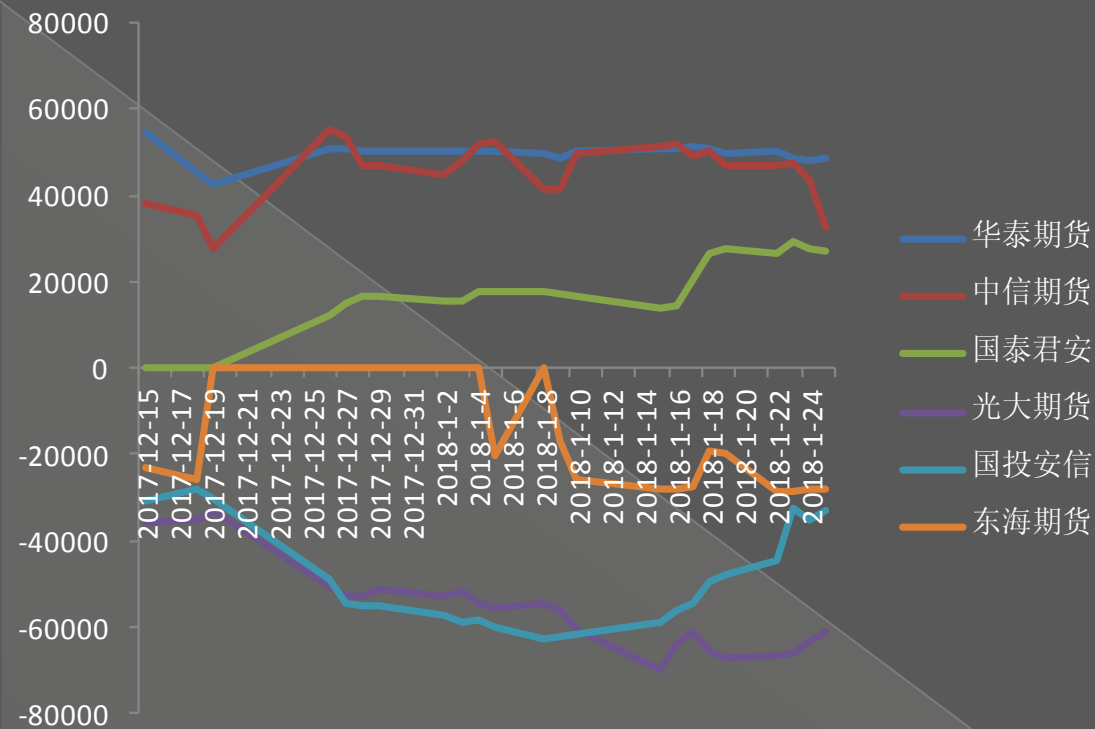


- 南华期货
- 宏源期货
- 一德期货
- 中信期货
- 中金期货
- 海通期货

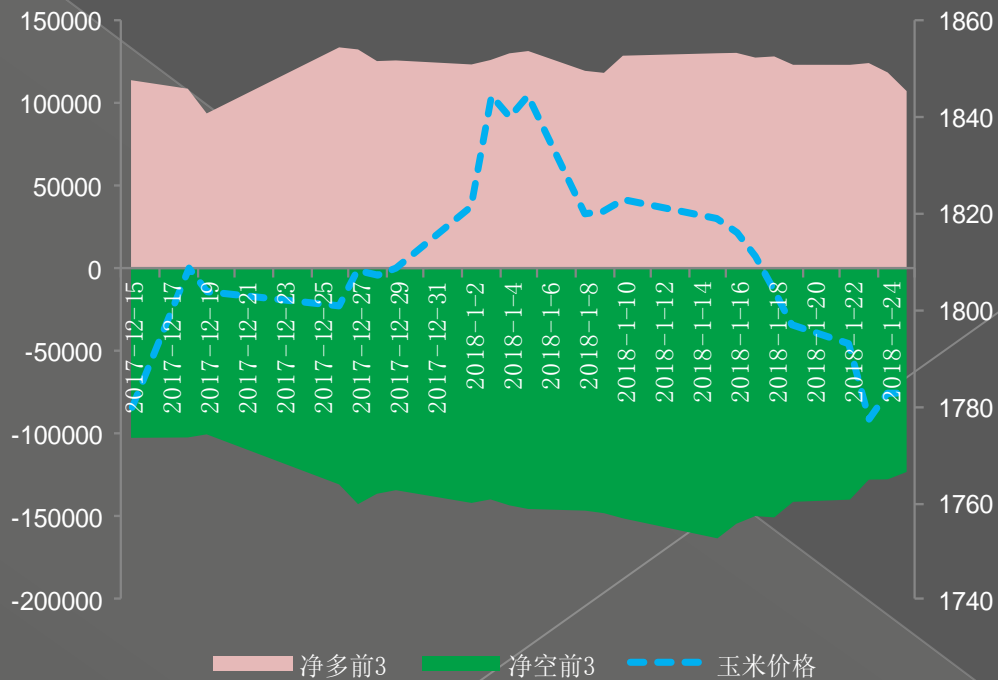
变动幅度		当日	最近5日	平均变化	波动率
sr持仓	多头前3	1.93%	-11.66%	-2.33%	6.92%
	空头前3	-3.29%	-13.83%	-2.77%	
sr涨幅		-0.34%	-0.13%	-0.03%	
震荡幅度	0.65%	0.79%(月均值)	投机度	0.36	0.45(月均值)



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	-9.45%	-16.29%	-3.26%	9.95%
	空头前3	-3.53%	-18.32%	-3.66%	
c涨幅		-0.02%	-1.21%	-0.24%	
震荡幅度	0.56%	0.80%(月均值)	投机度	0.28	0.35(月均值)



部分机构资金变动表

制表日期：2018年1月25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	5838.31	2.65%	20123.44	9.78%
南华期货	10685.50	21.94%	23250.08	64.33%
混沌天成	-525.15	-1.82%	-2314.07	-7.57%
海通期货	-13143.02	-12.09%	-21656.68	-18.48%
上海大陆	-134.75	-0.64%	13772.21	193.93%
中信期货	6338.38	3.12%	29706.05	16.52%
新湖期货	11503.34	27.40%	1918.38	3.72%

中粮期货	2886.11	1.92%	-15322.71	-9.11%
中信建投	2251.49	3.00%	30068.51	63.73%
申银万国	9443.10	28.80%	14556.96	52.60%
华泰期货	-2424.06	-2.33%	-5907.28	-5.49%
光大期货	6750.90	13.74%	3265.89	6.21%
一德期货	-3753.78	-3.76%	-12162.61	-11.25%
国投期货	-16263.51	-13.31%	4107.76	4.03%
金瑞期货	27673.75	31.92%	20667.85	22.06%
鲁证期货	642.78	0.67%	10582.44	12.27%
中国国际	-1813.29	-3.52%	10667.76	27.30%

部分机构持仓一览

机构	永安期货					
日期	2018-1-17	2018-1-18	2018-1-19	2018-1-22	2018-1-23	2018-1-24
黄金	4572	4378	5342	5448	5468	5178
白银			-4020			
沪铜	14439	16525	18372	19075	19165	18288
沪铝						-6248
沪镍	9243	8074	6807	9396	12469	16404
沪锌	-8292	-9767	-9934	-10118	-9114	-8241
沪铅						
螺纹钢	-32594			67355		
铁矿石	2733	3590	-10002	-20590	-47445	-56578
焦煤	9065	9935	8360	3367	2400	3556
焦炭	-1879			4586	4737	6013
豆油						
棕榈油	-11609			-4660		
菜籽油	14305	14001	14061	13007	14101	14466
豆粕	87789	83180	78146	68288	73600	90254
菜籽粕		868	-1031	-1684	1815	2048
棉花	-10089			-5322		
白糖		2680				-3855
玉米	-33375	-34937	-19856	-16412	-17615	
鸡蛋	881	841	828			
PTA	27249	26505	25290	19194	16979	
聚乙烯		-4514	-6980	-7292	-8536	-2869
聚丙烯	11192	11973	9062	7787		6956
甲醇	6134	9337	15096	13696	18010	17950
玻璃		-4700	-4832			-4300
橡胶	-18940	-19431	-21893	-22209	-23734	-23869
沥青	-24643	-25287	-24773	-26050	-28354	-15052
动力煤	10247	12356	11918	11769	10894	13031

部分机构持仓一览

机构	南华期货					
日期	2018-1-17	2018-1-18	2018-1-19	2018-1-22	2018-1-23	2018-1-24
黄金				-616		-761
白银	6191	6006	6174	6164	6472	
沪铜						
沪铝		-4055	-8073	-9335	-7100	-8593
沪镍		-5949				
沪锌	-3458	-2988	-2504		-3571	-4143
沪铅	1398	1087	814			
螺纹钢						-28795
铁矿石						
焦煤			2313			
焦炭						
豆油					4055	
棕榈油						
菜籽油						
豆粕						
菜籽粕	-9950	-9546	-9466	-10106	-9805	-10754
棉花						
白糖	9960	10748	10129	10117	10082	9163
玉米					-13579	-13098
鸡蛋		2417		2586	2559	
PTA		-15047	-15366	-16253	-16365	-17500
聚乙烯	9654	9283	9316	9295	8972	10858
聚丙烯	-15833	-15272	-16156	-15915	-16168	-17757
甲醇	-6285	-6357				
玻璃						
橡胶						
沥青						
动力煤						

部分机构持仓一览

机构	国泰君安					
日期	2018-1-17	2018-1-18	2018-1-19	2018-1-22	2018-1-23	2018-1-24
黄金	3397					
白银	-11852	-12218	-12825	-13144	-13311	-13720
沪铜	-5572	-5002	-4852	-5307	-5373	
沪铝	2635	2900				
沪镍	-8570	-8976	-8966	-8316	-8506	-5630
沪锌	-2879	-3083	-2916	-3308	-4020	-5878
沪铅				711		
螺纹钢	49011	49323	35906		45012	51158
铁矿石	5594	6171	8868	6650	9081	12112
焦煤						
焦炭	-2466			-2038		-2233
豆油	3201		2974	2790		
棕榈油	-14883	-6270				
菜籽油	24134	23499	23621	23274	23644	24505
豆粕	-18722					
菜籽粕	5969					7372
棉花	3437		3942	4386		
白糖	-5777	-5804	-5760	-5676	-6690	-6191
玉米	20577	26314	27458	26597	29319	27558
鸡蛋				904	901	1068
PTA						
聚乙烯						
聚丙烯	12747	11811	12794	12061	13061	11358
甲醇	3217	2307	901			
玻璃	8473	8183	7542		5849	4232
橡胶						-4513
沥青	-4557	-4460	-4280	-4483		
动力煤						

部分机构持仓一览

机构	混沌天成					
日期	2018-1-17	2018-1-18	2018-1-19	2018-1-22	2018-1-23	2018-1-24
黄金						
白银						
沪铜	-9958	-9959	-9969	-10673	-10675	-10672
沪铝	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	2018-1-17	2018-1-18	2018-1-19	2018-1-22	2018-1-23	2018-1-24
黄金	3473		3380	3459	3971	3933
白银	10863	11389	10328	10577	8091	6089
沪铜	-6574	-6802	-8015	-7724	-8738	-8848
沪铝						
沪镍				4531		4440
沪锌	4219	4847	6218	6388	5876	4807
沪铅	989	804				955
螺纹钢	-15708	-10705	-19650	-26713	-21556	
铁矿石	16337	17176	16598	11742		4394
焦煤	1098	1143	1066	-1676		2131
焦炭			169	-1113		
豆油	-12849	-12646	-13563			
棕榈油				3006		
菜籽油	-6277	-5879	-6630	-6136	-5993	-5972
豆粕	29073	40031	44809	42460	41079	26375
菜籽粕						
棉花	3589		4578	4369		4904
白糖	-3696	-8918	-4115	-3152	-8315	-7872
玉米	22053	17715	17177	13691	7456	
鸡蛋	560	1139	1129	1235		1378
PTA	30677	31143	33776	33995	34308	38785
聚乙烯	6625			5681	8652	
聚丙烯	-6154	-7491		-4348		
甲醇	-24109	-21626	-17266	-14921	-11635	-14575
玻璃	10979	13067	11789	5119	5700	5992
橡胶			-4932		-4791	
沥青	7852	7519	6571	6560	6642	4106
动力煤	3365					

部分机构持仓一览

机构	上海大陆					
日期	2018-1-17	2018-1-18	2018-1-19	2018-1-22	2018-1-23	2018-1-24
黄金						
白银						
沪铜						
沪铝						
沪镍						
沪锌						
沪铅						
螺纹钢	18650	22177	22723	26212	25116	26925
铁矿石						
焦煤				2461	2472	
焦炭						
豆油						
棕榈油						
菜籽油						
豆粕						
菜籽粕						
棉花		5024			5969	6634
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	2018-1-17	2018-1-18	2018-1-19	2018-1-22	2018-1-23	2018-1-24
黄金						
白银						
沪铜	-3342	-4607	-3954	-3521		-4110
沪铝						
沪镍	6699	7617	6456	6461	6525	7923
沪锌	-5701	-5627	-4204	-4343	-4096	
沪铅	-605	-950			-926	-1074
螺纹钢		25895		23799		
铁矿石						
焦煤						-3158
焦炭						
豆油	-75978	-77594	-77557	-77536	-70266	-65149
棕榈油	-9672	-10484	-11702	-11555	-12440	-11647
菜籽油	-16408	-15806	-14486	-11064	-10198	-6770
豆粕	-124551	-126652	-134839	-129686	-131894	-129604
菜籽粕	-46933	-39338	-48684	-48811	-50000	-49706
棉花	-16897	-7976	-9485	-10072	-13377	-13168
白糖			3889			598
玉米	-15881	-16125				
鸡蛋	4446	4316	4179	4154	4121	4093
PTA						
聚乙烯						
聚丙烯						
甲醇						
玻璃			-5328	-5322	-5576	-5667
橡胶	-7095	-7365	-7337	-7339	-8021	-8088
沥青						
动力煤	4558	4238	4357			

部分机构持仓一览

机构	中信期货					
日期	2018-1-17	2018-1-18	2018-1-19	2018-1-22	2018-1-23	2018-1-24
黄金	11397	10960	10772	11332	11399	11905
白银	-24587	-27083	-24544	-25565	-26598	-24101
沪铜	-6138	-6782	-7155	-7108	-7588	-13408
沪铝	-40042	-40029	-38136	-37716	-30016	-24655
沪镍						
沪锌	-3351	-3904	-3876	-4764	-4866	-5398
沪铅	-2334	-2515	-2163	-2270	-2612	-1965
螺纹钢	57618	63083	66085	70732	74354	71859
铁矿石	940		1454		-2920	
焦煤	5978	6239	6306	5767	5235	4812
焦炭				-1948	-2771	-2469
豆油	1420					
棕榈油	-10791	-11776	-13002	-13113	-11592	-11603
菜籽油	-10421	-10210	-10582	-10807	-10764	-9629
豆粕	34320	38431	37346	40342	45891	42731
菜籽粕						
棉花						
白糖	-12312	-12900	-12914	-12388	-12406	-12604
玉米	48933	50351	46959	46828	47574	43757
鸡蛋						
PTA	30421	29780	31380	38778	39468	43170
聚乙烯						
聚丙烯	4192	5236	7536	9531	11030	10903
甲醇		2261				
玻璃	15622	15387	15100	17204	18003	19996
橡胶						
沥青			3888		4008	
动力煤	4103	4509	4828	6779	7337	7635

部分机构持仓一览

机构	中信建投					
日期	2018-1-17	2018-1-18	2018-1-19	2018-1-22	2018-1-23	2018-1-24
黄金					955	
白银		6690				6451
沪铜						
沪铝						
沪镍	6316	6249	6242	6019	6625	6424
沪锌						
沪铅						
螺纹钢			-26147	-26435	-26438	-27899
铁矿石	19174	18251	19054	20000	19756	19119
焦煤						
焦炭						
豆油	11381	12386	12282	12311	12221	13510
棕榈油		-9533	-11014	-11744	-11646	-12690
菜籽油						
豆粕	20580	18639	23376	22789	22421	23583
菜籽粕				6539	6731	
棉花	4009	7650	6758	8928	10355	11140
白糖						
玉米						
鸡蛋	-831	-593	-409			
PTA						
聚乙烯						
聚丙烯	15918	16397	16265	14427	14085	14114
甲醇	5722	6051				
玻璃	-5071	-5059	-5148	-5514	-4313	-4200
橡胶			4362	4466		
沥青	5889					
动力煤						

部分机构持仓一览

机构	新湖期货					
日期	2018-1-17	2018-1-18	2018-1-19	2018-1-22	2018-1-23	2018-1-24
黄金	-1365	585	796			
白银						
沪铜						
沪铝						
沪镍						
沪锌						
沪铅						
螺纹钢						29058
铁矿石						
焦煤						
焦炭						
豆油						
棕榈油	6996	6845	6864	6812	6878	
菜籽油	-5132	-5636	-3863	-3788	-3769	-6934
豆粕	-58686	-58491	-58031	-58242	-58320	-36378
菜籽粕						
棉花						
白糖						
玉米	12920	12888	13642	14580	18504	18331
鸡蛋	-3211	-3096	-3422	-3387	-3458	-586
PTA	-20208	-20274	-18855	-19553	-19071	-20734
聚乙烯	-5374	-5337	-5230	-5087	-5105	-5604
聚丙烯	-3980	-3738	-4256		-4326	-4695
甲醇		-7269	-6660	-6524	-5698	-5775
玻璃						
橡胶	-4484	-4450	-4263	-4309		-4749
沥青	-6560	-6668	-6777	-6840	-3501	-7326
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

