



市场持仓分析

2018/2/6

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 | 29.72% | 23.35% | 9.55% | -24.90% | -19.27% | -9.56% | 54.62% | ☆☆☆☆☆ |
| 甲醇 | -0.16% | 2.29% | -0.78% | 2.40% | -0.20% | 2.93% | -2.57% | ☆ |
| 焦煤 | -5.12% | -5.42% | -3.79% | 2.80% | 4.06% | 6.03% | -7.93% | ☆☆ |
| 动力煤 | -11.09% | -9.78% | -7.06% | 2.84% | 2.66% | 3.49% | -13.93% | ☆☆☆ |
| 铁矿石 | -5.47% | -5.94% | -3.01% | 3.98% | 6.63% | 6.81% | -9.44% | ☆☆ |
| 玻璃 | -0.59% | -1.47% | 0.58% | 8.86% | 4.75% | -0.02% | -9.45% | ☆☆ |
| 豆粕 | 1.36% | 2.23% | 3.30% | -1.41% | -1.20% | -1.94% | 2.77% | ☆ |
| 玉米 | -10.91% | -8.54% | -5.93% | 11.43% | 7.87% | 4.54% | -22.34% | ☆☆☆☆☆ |
| 棕榈油 | -3.19% | -2.05% | -0.96% | 1.53% | 1.09% | 2.06% | -4.72% | ☆ |
| 鸡蛋 | 2.38% | -0.16% | -1.61% | 2.27% | 1.56% | 1.52% | 0.11% | ☆ |
| 沪镍 | 5.91% | 4.77% | 0.70% | -1.91% | 3.40% | 5.65% | 7.83% | ☆☆ |
| 菜籽粕 | -4.51% | -2.97% | -1.46% | 4.88% | 3.69% | 1.68% | -9.39% | ☆☆ |
| 橡胶 | 2.06% | 1.78% | 2.27% | -1.70% | -2.38% | -1.50% | 3.76% | ☆ |
| 豆油 | 2.45% | 1.28% | -1.15% | 1.83% | 1.08% | 1.86% | 0.62% | ☆ |
| 沪铜 | -1.54% | -1.07% | -0.19% | -1.98% | -2.58% | -2.60% | 0.44% | ☆ |
| 棉花 | 1.62% | 2.17% | -0.10% | 1.60% | 1.76% | 1.58% | 0.02% | ☆ |
| 白糖 | -0.30% | -0.66% | -0.13% | 0.65% | 0.69% | 0.56% | -0.95% | ☆ |
| 沪锌 | 0.42% | -0.77% | 2.00% | -4.01% | -2.81% | -2.59% | 4.43% | ☆ |
| 聚乙烯 | 0.15% | -0.59% | -3.68% | -3.65% | -3.18% | 1.87% | 3.80% | ☆ |
| 聚丙烯 | -0.42% | -0.70% | -4.90% | 3.55% | 1.98% | 4.61% | -3.98% | ☆ |
| 沥青 | -2.02% | -3.22% | -5.47% | 1.42% | 1.31% | -0.77% | -3.44% | ☆ |
| 沪银 | -5.27% | -3.71% | -1.92% | -2.71% | 0.13% | 0.59% | -2.56% | ☆ |
| PTA | -3.01% | -3.86% | -5.03% | 2.83% | 3.47% | 1.48% | -5.85% | ☆☆ |
| 沪金 | 1.21% | 1.21% | 1.41% | 0.64% | 3.94% | 2.04% | 0.56% | ☆ |
| 沪铝 | 3.02% | 1.98% | 2.07% | -1.49% | -1.19% | -1.26% | 4.51% | ☆ |
| 螺纹钢 | -3.49% | -6.88% | -3.52% | -0.56% | 0.42% | 2.06% | -2.93% | ☆ |

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 | -0.39% | -2.26% | -2.09% | 15.10% | 10.00% | 6.15% | -15.50% | ☆☆ |
| 玉米 | 0.03% | -2.92% | 0.48% | -8.25% | -8.54% | -3.06% | 8.28% | ☆ |
| 棕榈油 | -7.77% | -5.07% | -4.53% | 9.20% | 2.25% | 3.94% | -16.97% | ☆☆ |
| 动力煤 | 1.77% | 0.65% | -6.72% | -8.41% | -1.44% | 3.70% | 10.18% | ☆☆ |
| 聚丙烯 | 6.19% | 4.92% | 0.53% | 6.66% | 4.84% | 4.70% | -0.47% | ☆ |
| 橡胶 | -2.52% | -2.48% | 0.77% | -2.16% | -2.55% | 0.24% | -0.36% | ☆ |
| 棉花 | 4.74% | -3.22% | -11.47% | 12.86% | 12.52% | 15.18% | -8.11% | ☆ |
| 鸡蛋 | -6.77% | -4.93% | -2.80% | 4.87% | 1.46% | 1.93% | -11.64% | ☆☆ |
| 菜籽粕 | -9.94% | -5.83% | -1.80% | 2.66% | 0.14% | 0.91% | -12.61% | ☆☆ |
| 铁矿石 | 7.66% | 2.38% | 2.26% | 0.40% | 0.67% | 2.49% | 7.26% | ☆ |
| 豆油 | 3.93% | 2.29% | -3.07% | 2.50% | -0.36% | 2.66% | 1.44% | ☆ |
| 沪镍 | -18.29% | -12.40% | -10.50% | 5.35% | 7.62% | 11.06% | -23.64% | ☆☆ |
| 焦炭 | 41.89% | 34.81% | 25.32% | -23.34% | -22.73% | -18.87% | 65.23% | ☆☆☆☆ |
| 沥青 | -16.21% | -11.44% | -18.44% | 3.10% | 3.76% | 3.86% | -19.30% | ☆☆ |
| 沪银 | 5.99% | 8.92% | 4.97% | -19.02% | -12.23% | -12.42% | 25.01% | ☆☆ |
| 沪铝 | 6.09% | 5.65% | 3.94% | -6.72% | -4.89% | -1.20% | 12.81% | ☆☆ |
| 沪金 | 1.93% | 1.49% | -0.65% | 10.91% | 2.92% | -4.26% | -8.98% | ☆ |
| 焦煤 | 17.91% | 22.21% | 21.31% | -17.88% | -18.95% | -15.91% | 35.79% | ☆☆☆ |
| 沪锌 | 2.01% | 0.35% | -3.21% | -0.27% | 0.52% | 0.47% | 2.29% | ☆ |
| 聚乙烯 | 0.59% | -5.79% | -10.23% | -8.14% | -4.07% | 5.51% | 8.73% | ☆ |
| 沪铜 | -2.51% | -1.27% | 1.48% | -3.21% | -0.98% | -3.10% | 0.71% | ☆ |
| 豆粕 | 10.05% | 9.30% | 3.69% | -4.83% | -3.55% | -1.42% | 14.88% | ☆☆ |
| 螺纹钢 | -0.76% | -5.35% | -4.65% | 6.58% | 5.65% | 4.32% | -7.33% | ☆ |
| PTA | -10.04% | -12.86% | -12.31% | 12.90% | 14.11% | 10.51% | -22.93% | ☆☆ |
| 白糖 | -5.04% | -6.63% | -3.09% | 5.06% | 0.26% | 2.60% | -10.10% | ☆☆ |
| 玻璃 | -22.43% | -17.94% | -6.41% | 7.57% | 7.13% | 4.70% | -30.00% | ☆☆☆ |

2018年2月6日机构持仓异动表

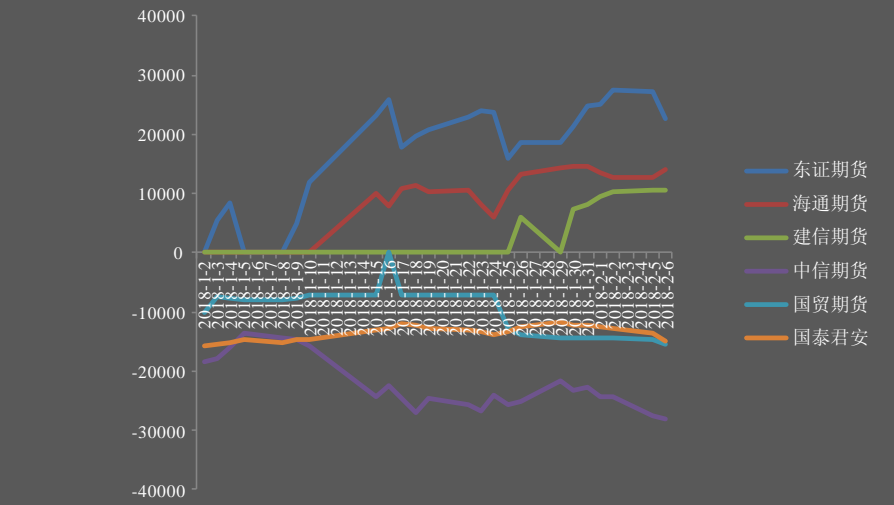
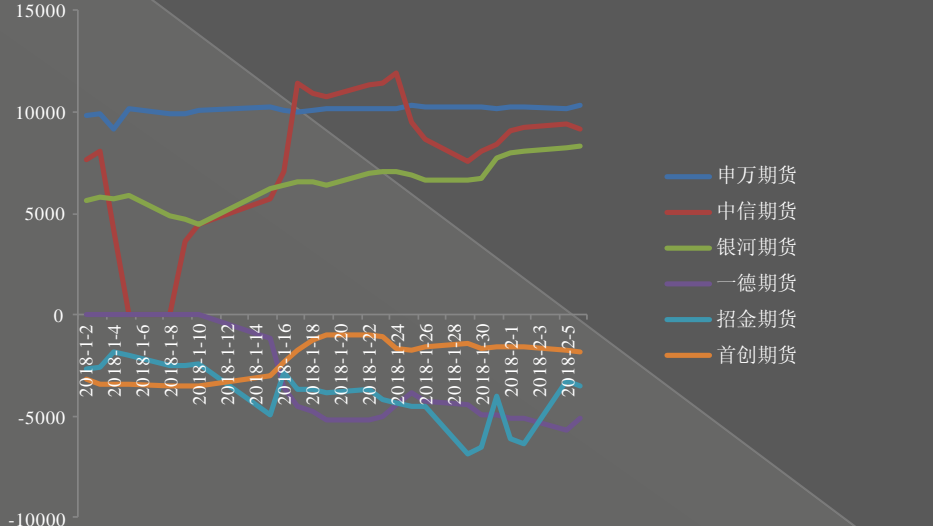
金属

| 金属 | |
|------|-------------------|
| 永安期货 | 沪镍净多单变动幅度为：10549手 |
| 上海中期 | 沪铍净多单变动幅度为：2539手 |
| 中信期货 | 沪铍净空单变动幅度为：2379手 |
| 银河期货 | 沪铅净多单变动幅度为：-351手 |
| | |
| | |
| | |
| | |
| | |
| | |
| | |
| | |
| | |
| | |
| | |
| | |
| | |
| | |
| | |

黑色

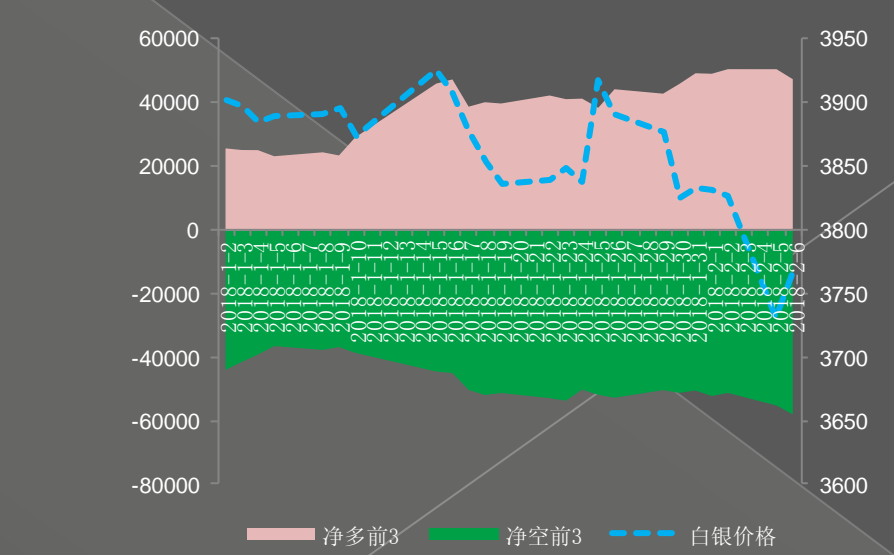
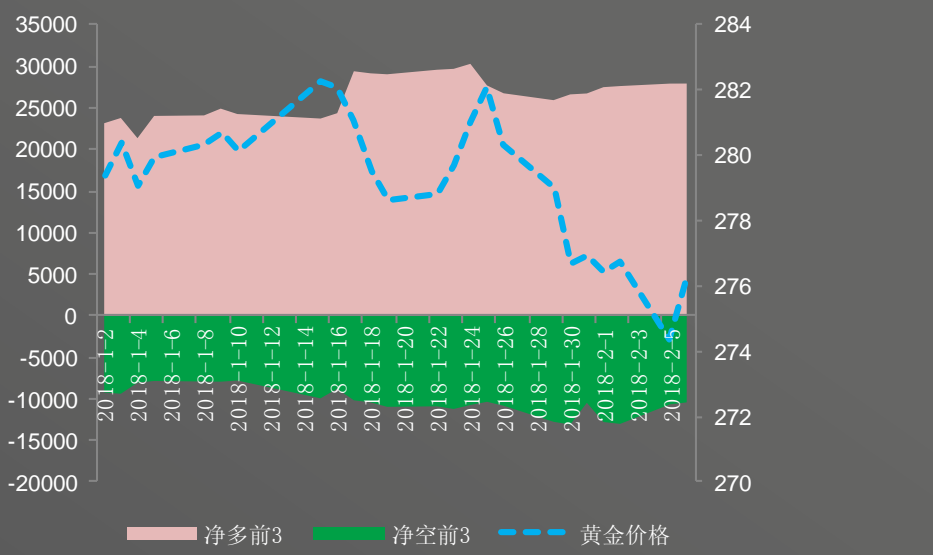
| 黑色 | |
|------|---------------------|
| 徽商期货 | 铁矿石净多单变动幅度为：-18159手 |
| 长安期货 | 铁矿石净多单变动幅度为：19920手 |
| 集成期货 | 焦煤净多单变动幅度为：3813手 |
| 兴证期货 | 焦炭净多单变动幅度为：-2401手 |
| 浙商期货 | 焦炭净多单变动幅度为：-1423手 |
| 永安期货 | 焦炭净多单变动幅度为：5796手 |
| 华安期货 | 焦炭净多单变动幅度为：3722手 |
| 浙商期货 | 焦炭净多单变动幅度为：-1423手 |
| 中信期货 | 焦炭净空单变动幅度为：3135手 |
| 兴业期货 | 焦炭净空单变动幅度为：2604手 |
| 永安期货 | 动力煤净多单变动幅度为：-5515手 |

金属板块：AU & AG

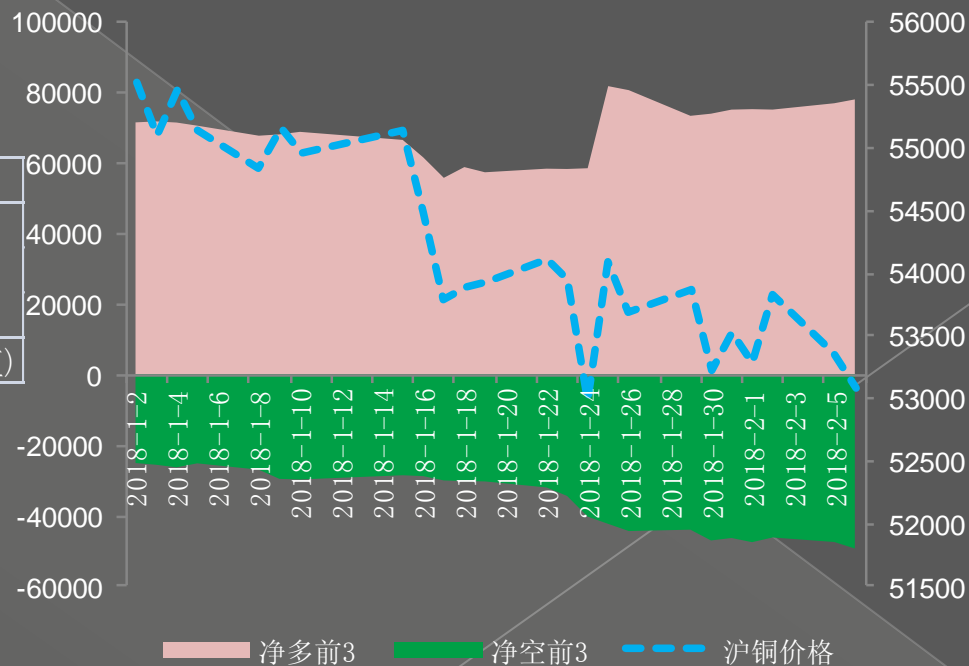
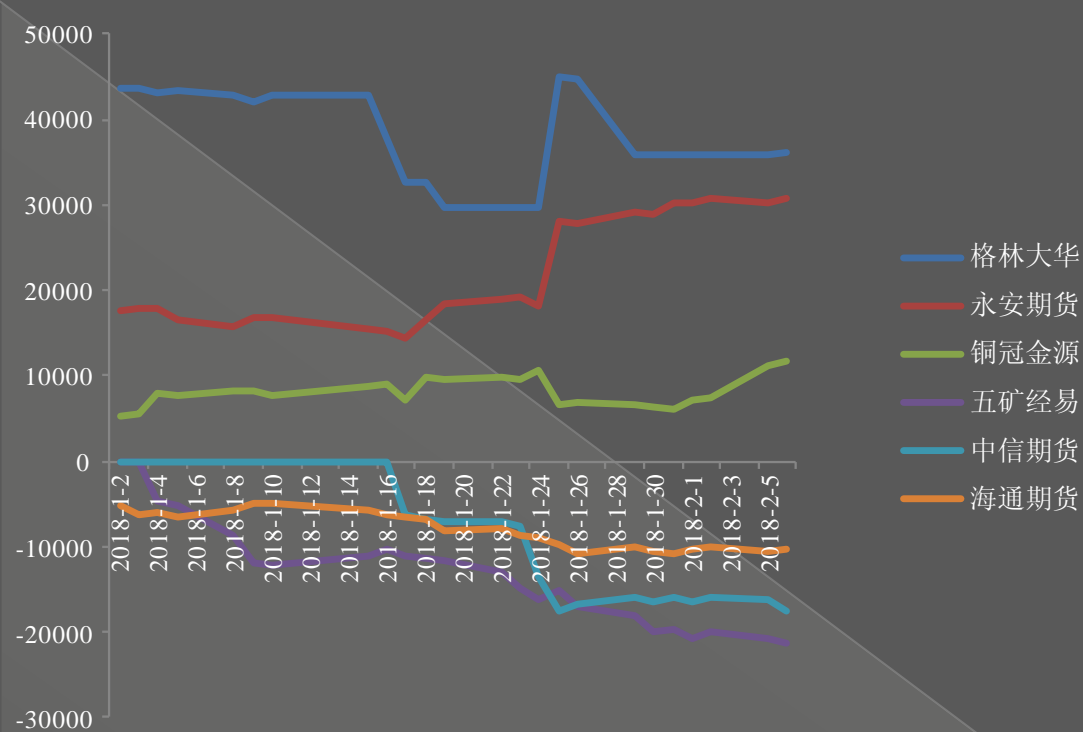


| 变动幅度 | | 当日 | 最近5日 | 平均变化 | 波动率 |
|------|-------|------------|---------|--------|-----------|
| au持仓 | 多头前3 | 0.03% | 4.89% | 0.98% | 7.36% |
| | 空头前3 | -2.20% | -20.39% | -4.08% | |
| au涨幅 | | 0.73% | -0.12% | -0.02% | |
| 震荡幅度 | 1.30% | 0.60%(月均值) | 投机度 | 0.49 | 0.41(月均值) |

| 变动幅度 | | 当日 | 最近5日 | 平均变化 | 波动率 |
|------|-------|------------|--------|--------|-----------|
| ag持仓 | 多头前3 | -6.18% | 3.24% | 0.65% | 14.40% |
| | 空头前3 | 5.07% | 13.31% | 2.66% | |
| ag涨幅 | | 1.02% | -1.45% | -0.29% | |
| 震荡幅度 | 1.90% | 0.95%(月均值) | 投机度 | 0.67 | 0.52(月均值) |



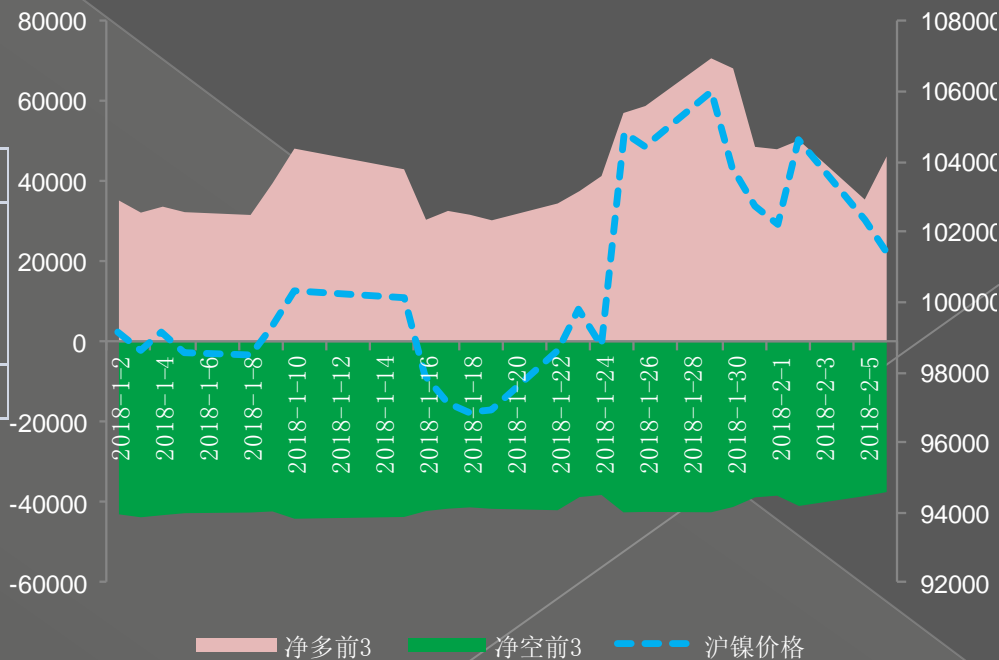
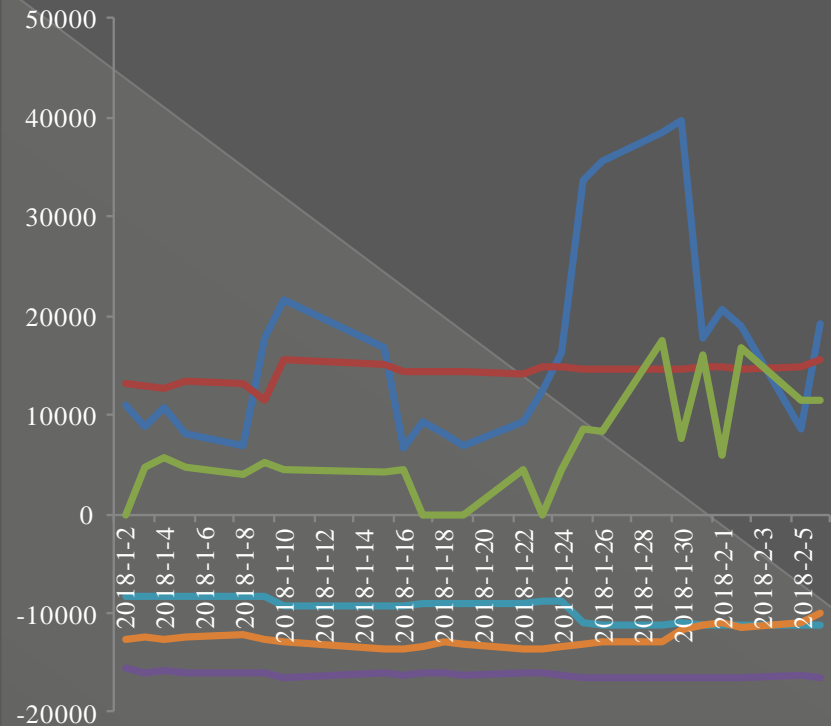
金属板块：Cu



| 变动幅度 | | 当日 | 最近5日 | 平均变化 | 波动率 |
|------|-------|------------|--------|--------|-----------|
| cu持仓 | 多头前3 | 1.42% | 5.49% | 1.10% | 14.06% |
| | 空头前3 | 3.88% | 4.85% | 0.97% | |
| cu涨幅 | | -0.53% | -0.26% | -0.05% | |
| 震荡幅度 | 2.30% | 1.23%(月均值) | 投机度 | 0.83 | 0.55(月均值) |

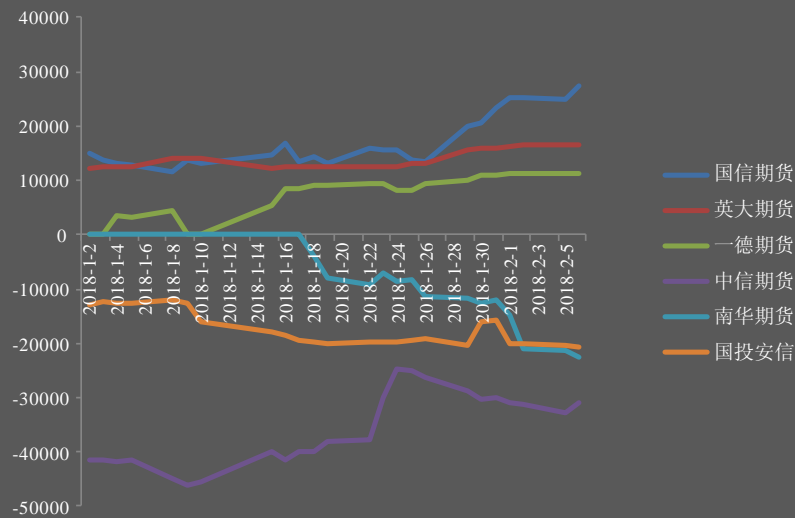
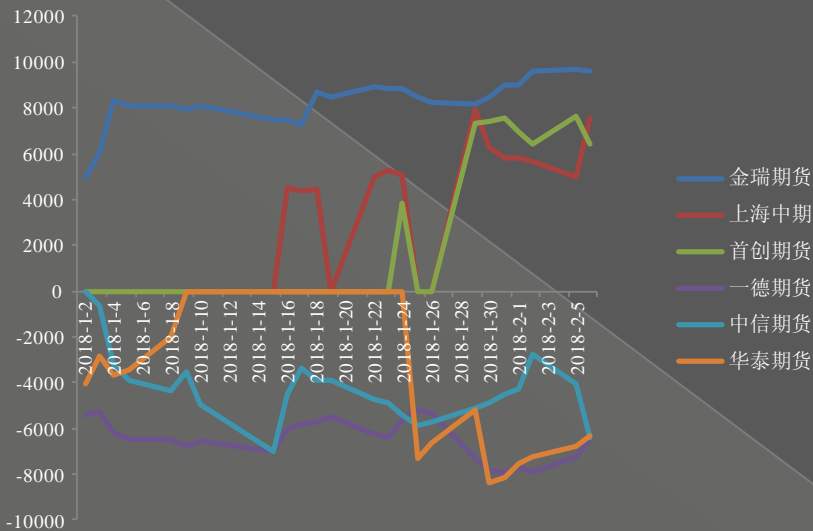
金属板块：Ni

- 永安期货
- 国贸期货
- 海通期货
- 兴业期货
- 江海汇鑫
- 信达期货



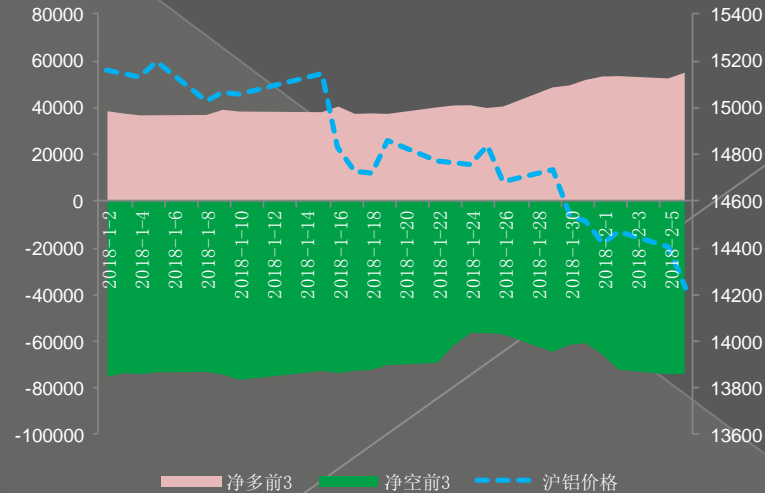
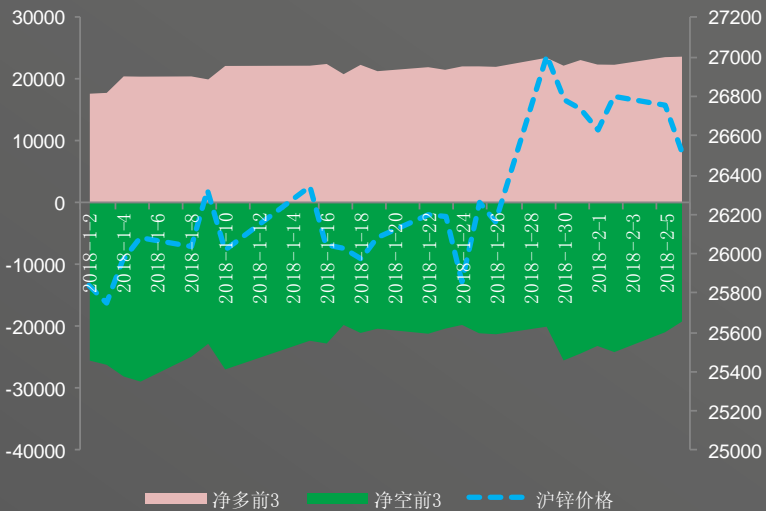
| 变动幅度 | | 当日 | 最近5日 | 平均变化 | 波动率 |
|------|-------|------------|---------|--------|-----------|
| ni持仓 | 多头前3 | 30.16% | -32.12% | -6.42% | 28.48% |
| | 空头前3 | -2.61% | -9.04% | -1.81% | |
| ni涨幅 | | -0.92% | -2.39% | -0.48% | |
| 震荡幅度 | 3.65% | 2.43%(月均值) | 投机度 | 2.57 | 1.48(月均值) |

金属板块：Zn & Al

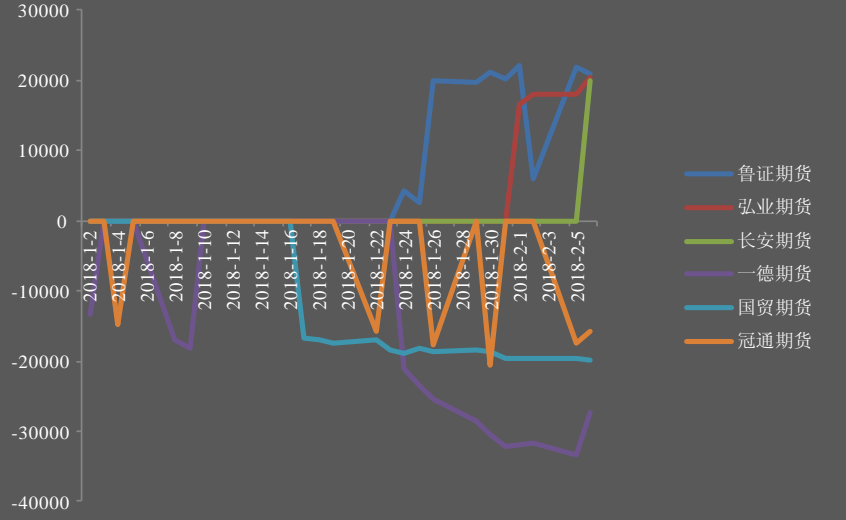
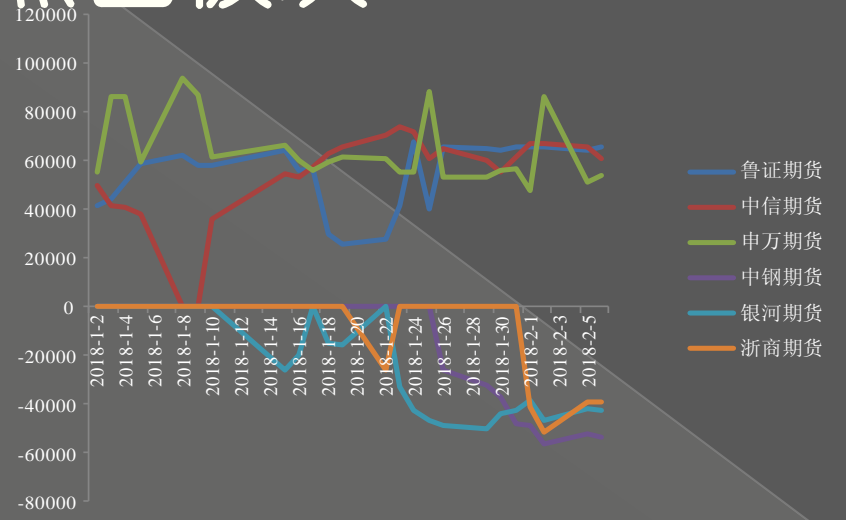


| 变动幅度 | | 当日 | 最近5日 | 平均变化 | 波动率 |
|------|-------|------------|---------|--------|-----------|
| zn持仓 | 多头前3 | 0.34% | 6.55% | 1.31% | 16.55% |
| | 空头前3 | -8.32% | -24.76% | -4.95% | |
| zn涨幅 | | -0.96% | -1.05% | -0.21% | |
| 震荡幅度 | 2.17% | 1.33%(月均值) | 投机度 | 1.33 | 0.96(月均值) |

| 变动幅度 | | 当日 | 最近5日 | 平均变化 | 波动率 |
|------|-------|------------|--------|--------|-----------|
| al持仓 | 多头前3 | 4.60% | 10.94% | 2.19% | 11.91% |
| | 空头前3 | -0.26% | 20.32% | 4.06% | |
| al涨幅 | | -1.20% | -2.14% | -0.43% | |
| 震荡幅度 | 1.87% | 1.36%(月均值) | 投机度 | 0.64 | 0.53(月均值) |

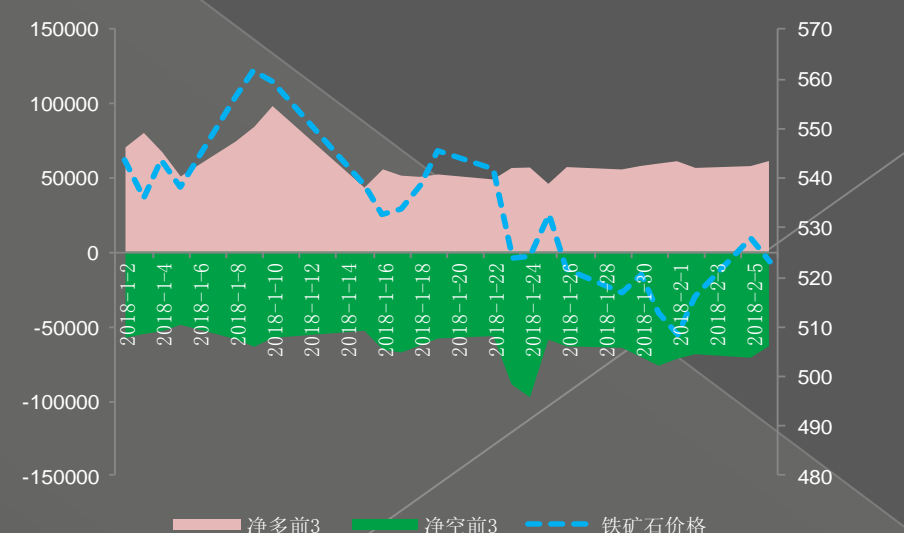
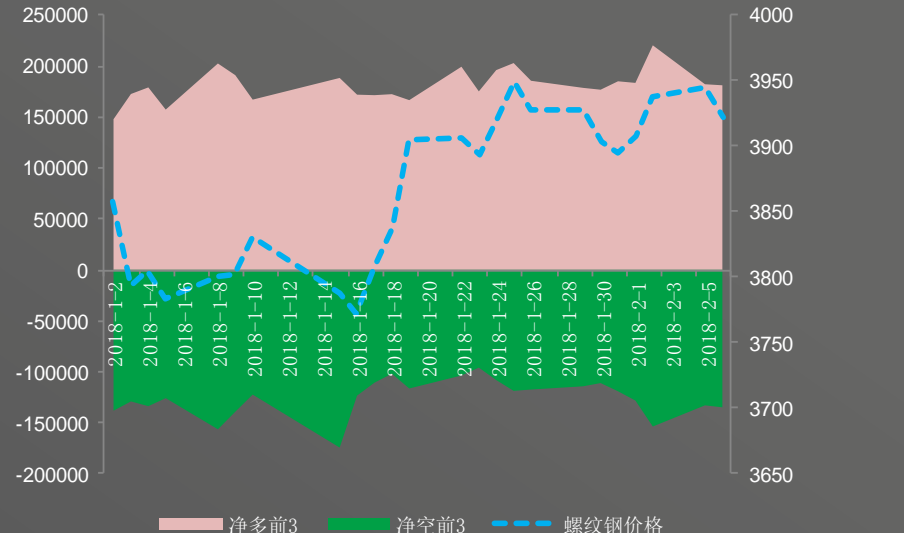


黑色板块：Rb & I

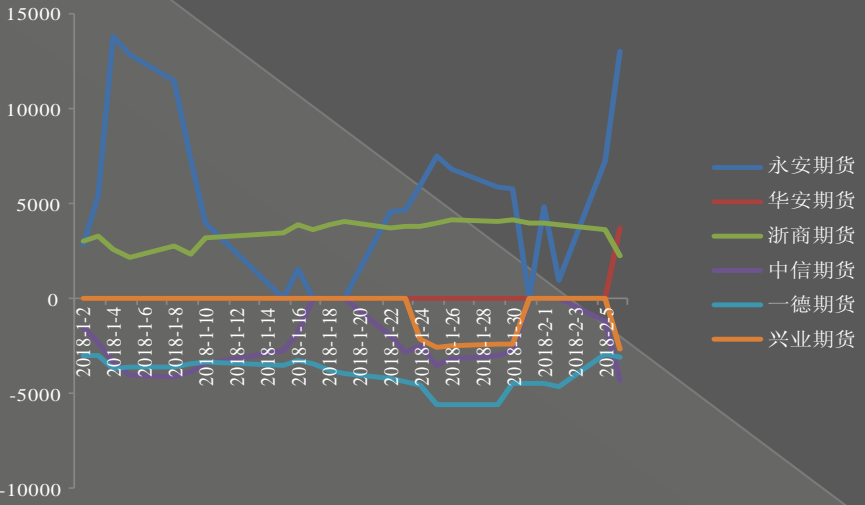


| 变动幅度 | | 当日 | 最近5日 | 平均变化 | 波动率 |
|------|-------|------------|--------|-------|-----------|
| rb持仓 | 多头前3 | -0.56% | 2.46% | 0.49% | 10.66% |
| | 空头前3 | 1.43% | 21.40% | 4.28% | |
| rb涨幅 | | -0.60% | 0.48% | 0.10% | |
| 震荡幅度 | 1.65% | 1.50%(月均值) | 投机度 | 1.04 | 1.09(月均值) |

| 变动幅度 | | 当日 | 最近5日 | 平均变化 | 波动率 |
|------|-------|------------|---------|--------|-----------|
| I持仓 | 多头前3 | 5.87% | 5.82% | 1.16% | 27.82% |
| | 空头前3 | -10.93% | -10.00% | -2.00% | |
| I涨幅 | | -0.94% | 0.49% | 0.10% | |
| 震荡幅度 | 2.49% | 2.45%(月均值) | 投机度 | 1.05 | 1.08(月均值) |

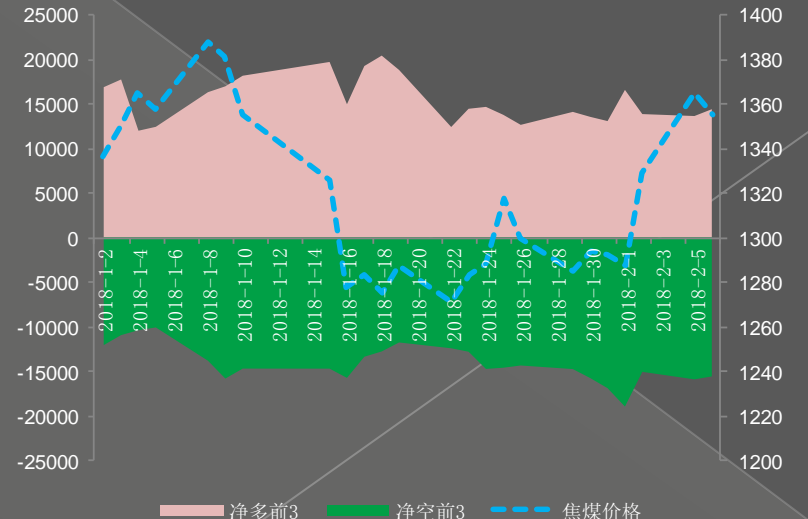
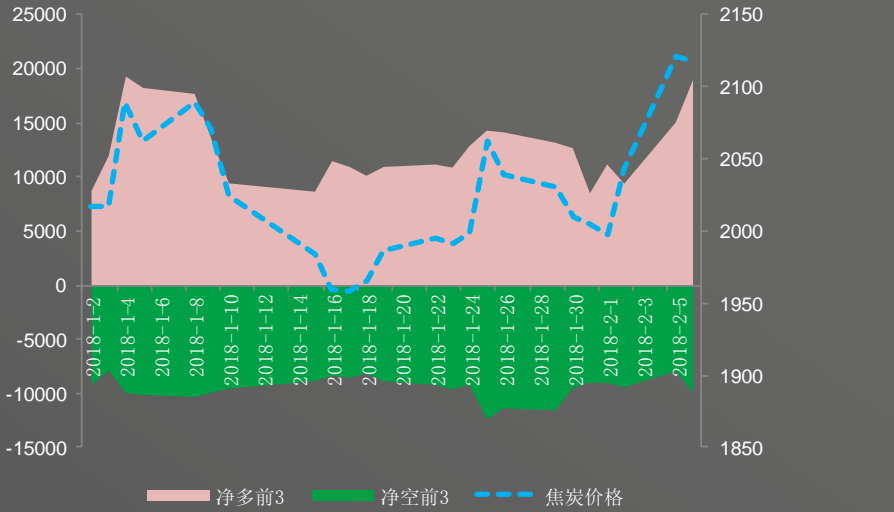


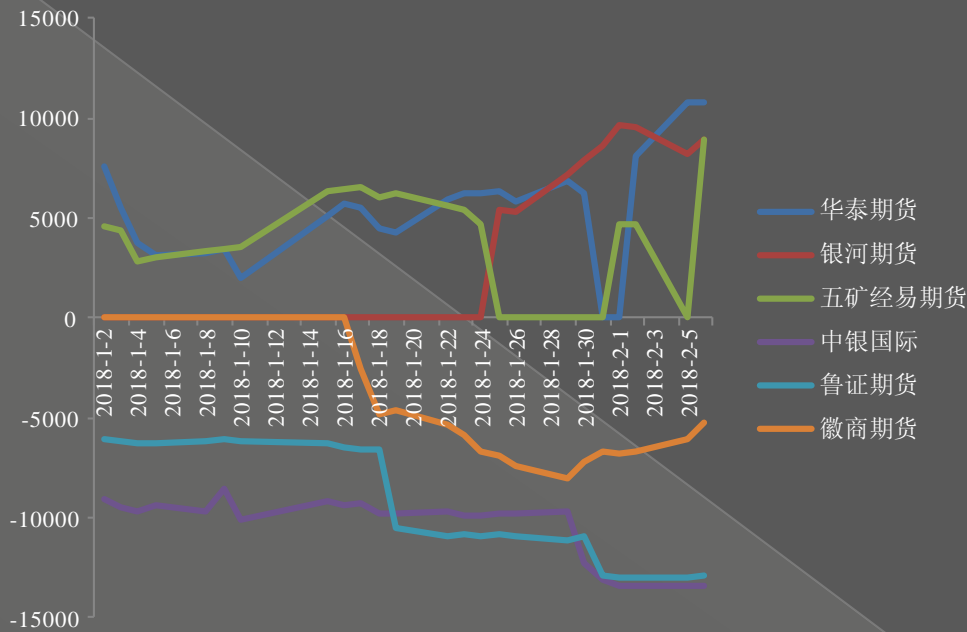
黑色板块：J & JM



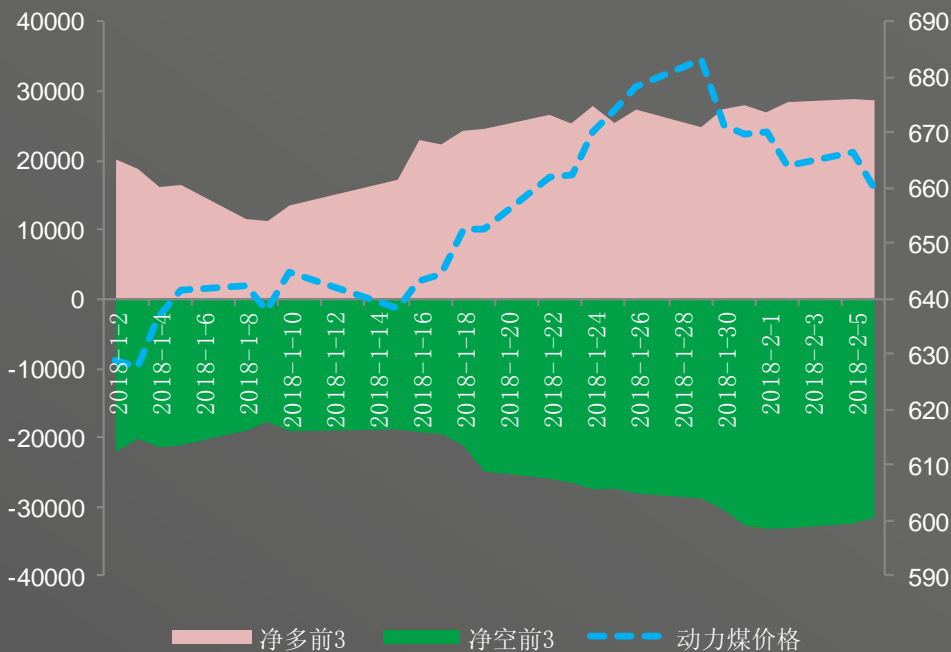
| 变动幅度 | | 当日 | 最近5日 | 平均变化 | 波动率 |
|------|-------|------------|--------|-------|-----------|
| j持仓 | 多头前3 | 26.09% | 49.88% | 9.98% | 26.65% |
| | 空头前3 | 24.48% | 4.04% | 0.81% | |
| j涨幅 | | -0.16% | 5.34% | 1.07% | |
| 震荡幅度 | 2.15% | 2.50%(月均值) | 投机度 | 1.28 | 1.22(月均值) |

| 变动幅度 | | 当日 | 最近5日 | 平均变化 | 波动率 |
|------|-------|------------|--------|--------|-----------|
| jm持仓 | 多头前3 | 5.62% | 6.34% | 1.27% | 26.60% |
| | 空头前3 | -2.06% | -1.15% | -0.23% | |
| jm涨幅 | | -0.75% | 4.74% | 0.95% | |
| 震荡幅度 | 1.90% | 2.66%(月均值) | 投机度 | 1.10 | 1.27(月均值) |



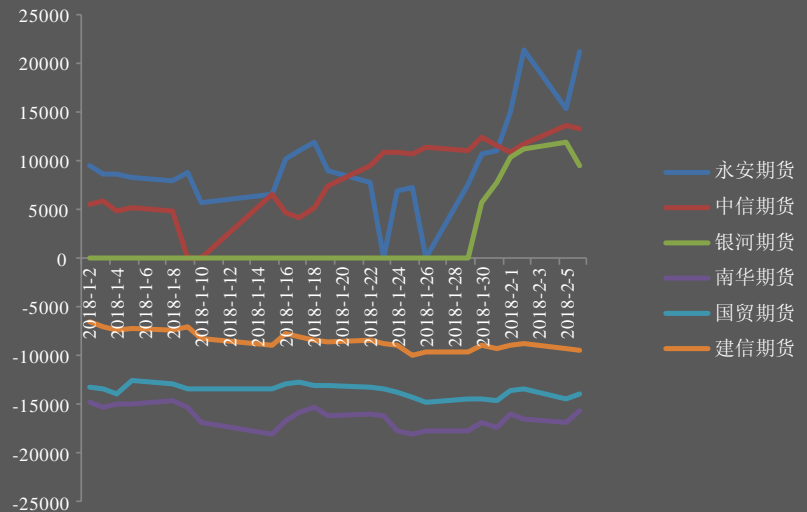
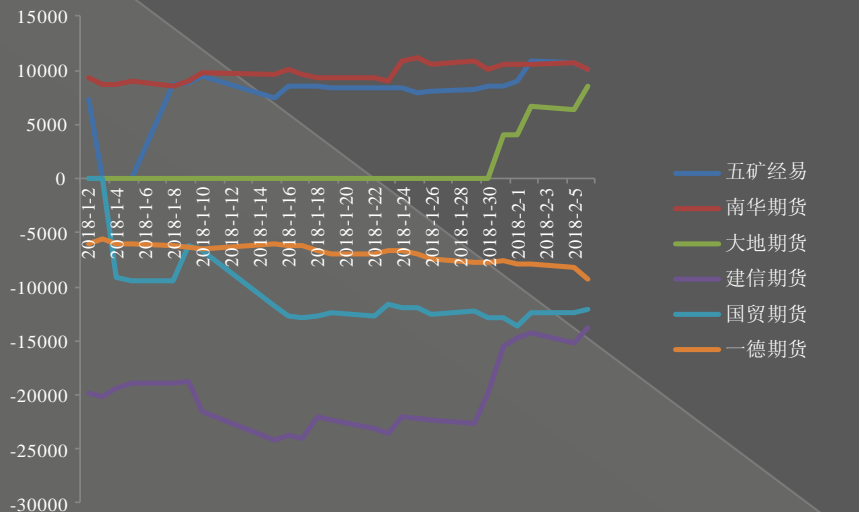


黑色：动力煤



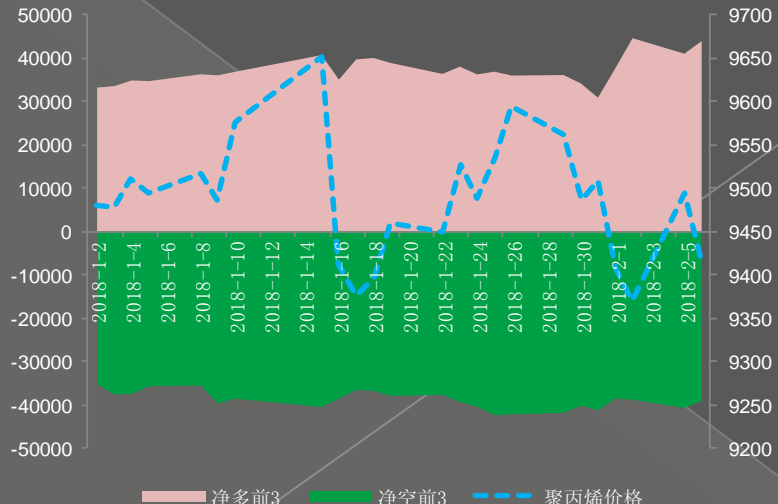
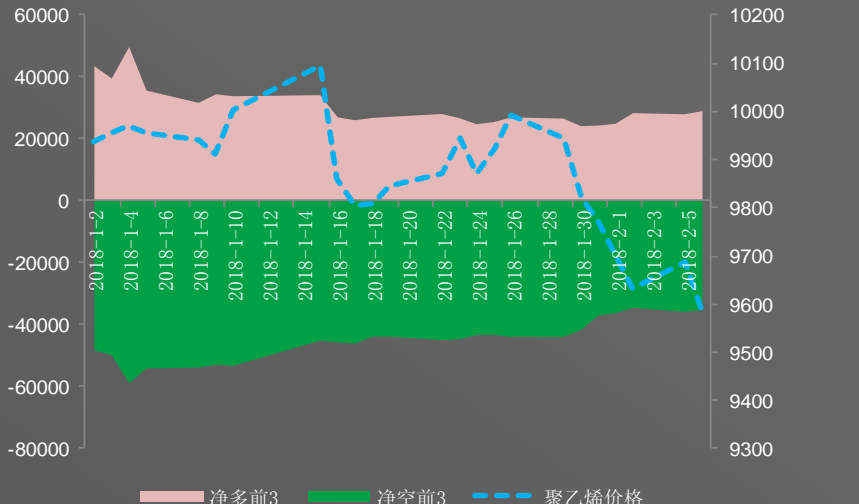
| 变动幅度 | | 当日 | 最近5日 | 平均变化 | 波动率 |
|------|-------|-------------|--------|--------|------------|
| zc持仓 | 多头前3 | -0.59% | 4.74% | 0.95% | 13.85% |
| | 空头前3 | -2.65% | 3.94% | 0.79% | |
| zc涨幅 | | -1.03% | -1.76% | -0.35% | |
| 震荡幅度 | 1.26% | 1.38% (月均值) | 投机度 | 0.69 | 0.68 (月均值) |

化工：塑料 & PP

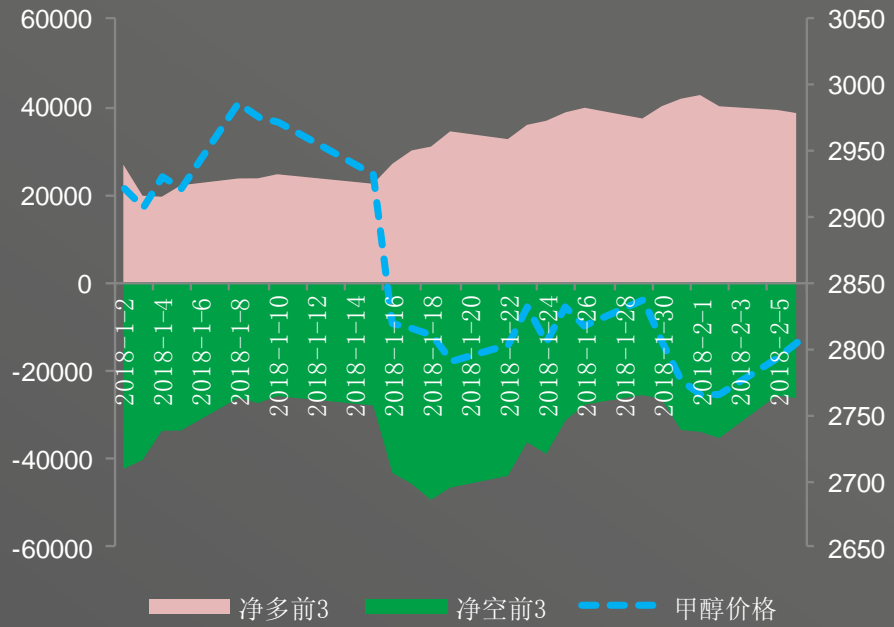
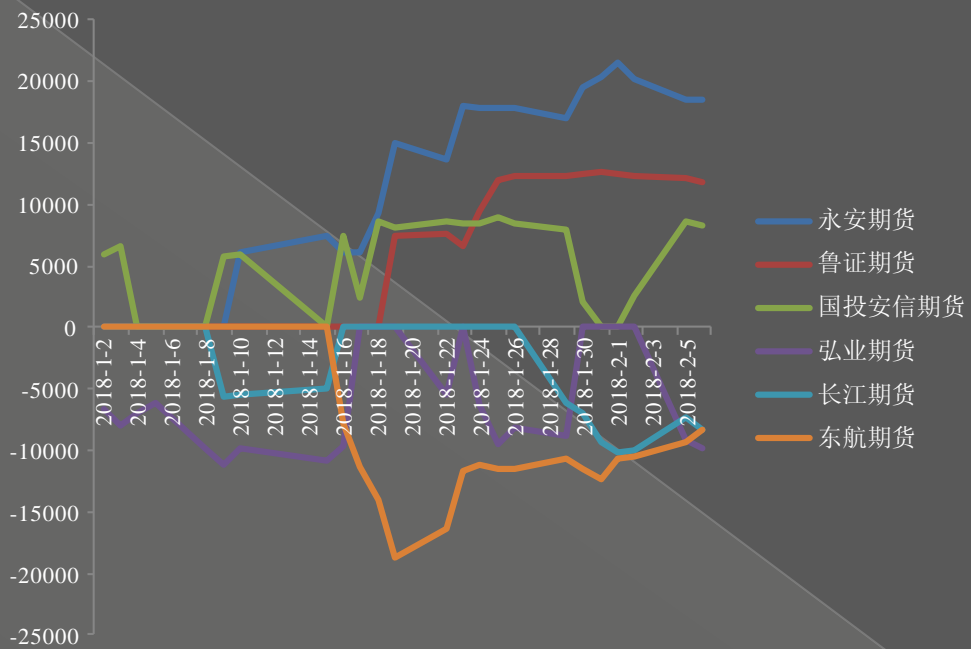


| 变动幅度 | | 当日 | 最近5日 | 平均变化 | 波动率 |
|------|-------|------------|---------|--------|-----------|
| I持仓 | 多头前3 | 3.67% | 20.02% | 4.00% | 12.91% |
| | 空头前3 | -1.58% | -15.57% | -3.11% | |
| I涨幅 | | -1.13% | -2.49% | -0.50% | |
| 震荡幅度 | 1.37% | 1.30%(月均值) | 投机度 | 0.61 | 0.57(月均值) |

| 变动幅度 | | 当日 | 最近5日 | 平均变化 | 波动率 |
|------|-------|------------|--------|--------|-----------|
| pp持仓 | 多头前3 | 7.13% | 28.62% | 5.72% | 13.29% |
| | 空头前3 | -3.99% | -2.81% | -0.56% | |
| pp涨幅 | | -0.89% | -0.82% | -0.16% | |
| 震荡幅度 | 1.05% | 1.32%(月均值) | 投机度 | 0.64 | 0.64(月均值) |

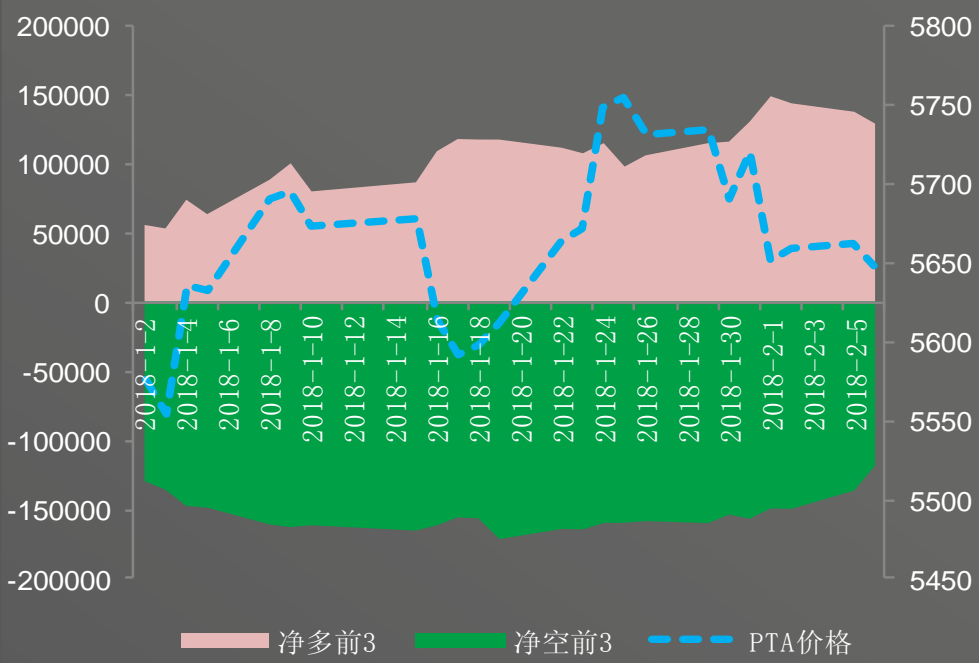
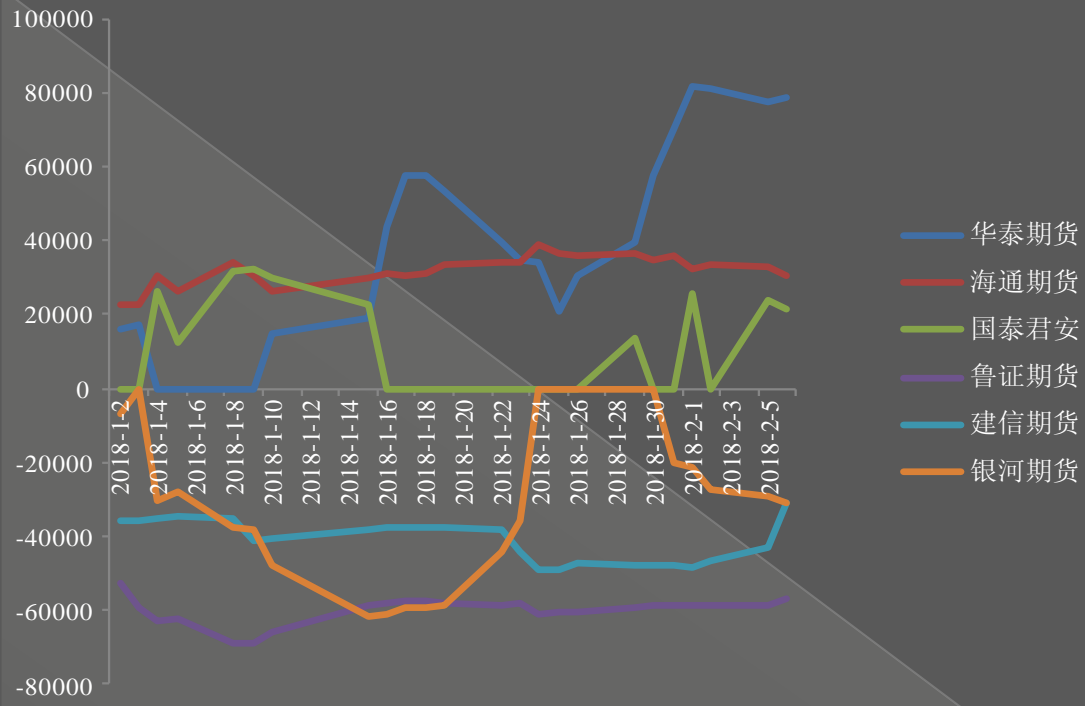


化工：甲醇



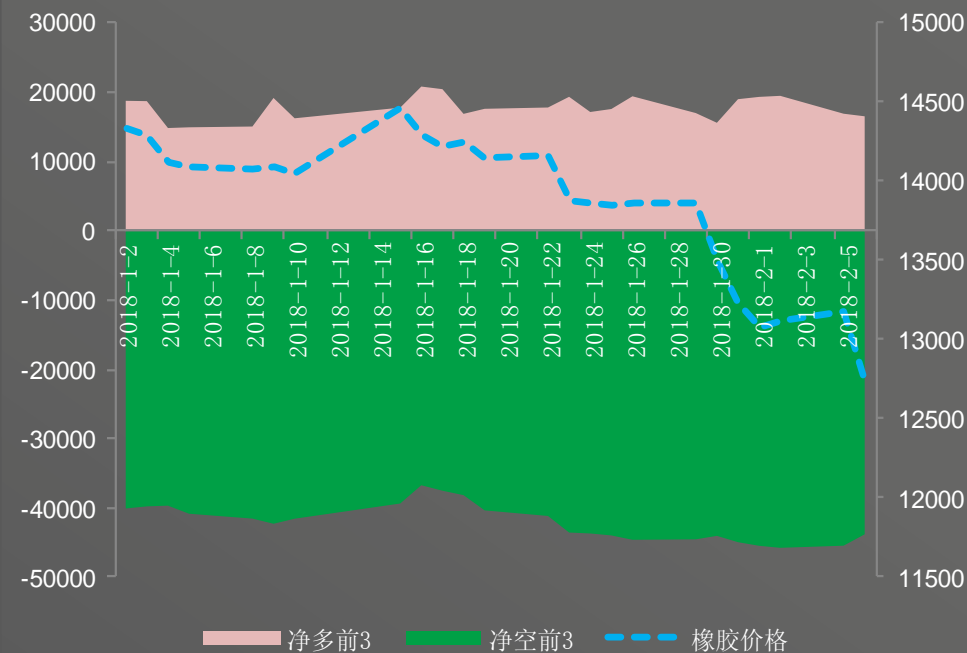
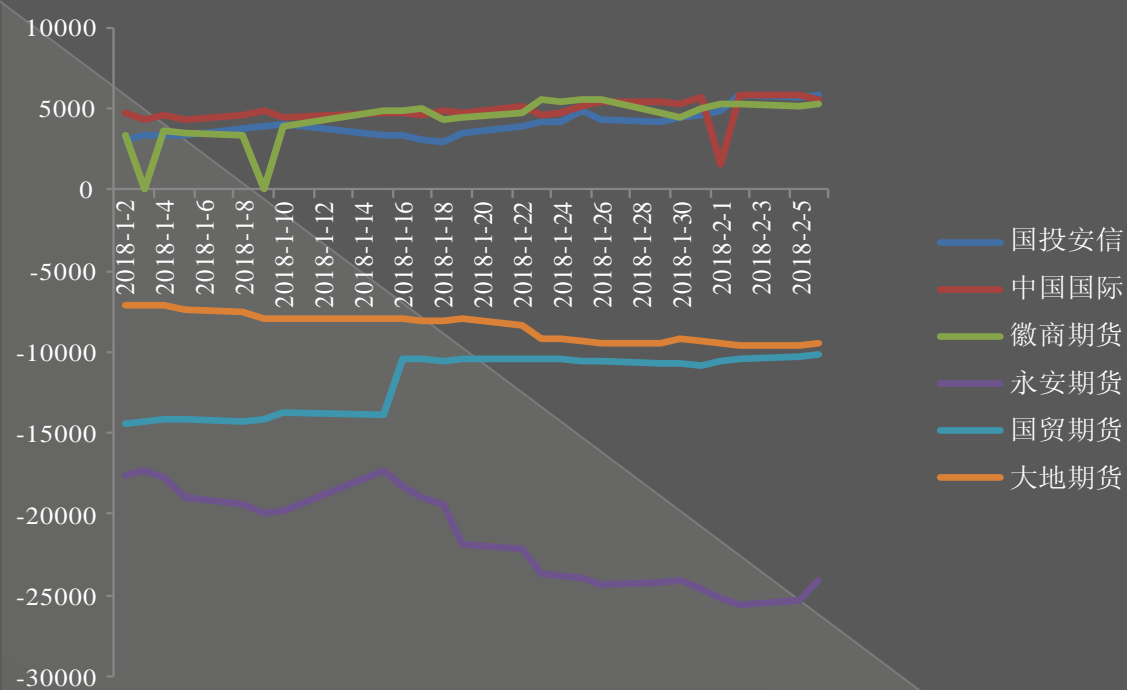
| 变动幅度 | | 当日 | 最近5日 | 平均变化 | 波动率 |
|------|-------|------------|--------|--------|-----------|
| ma持仓 | 多头前3 | -1.81% | -3.85% | -0.77% | 19.01% |
| | 空头前3 | 2.21% | -0.88% | -0.18% | |
| ma涨幅 | | 0.42% | -0.01% | 0.00% | |
| 震荡幅度 | 1.38% | 1.78%(月均值) | 投机度 | 1.44 | 1.19(月均值) |

化工：PTA



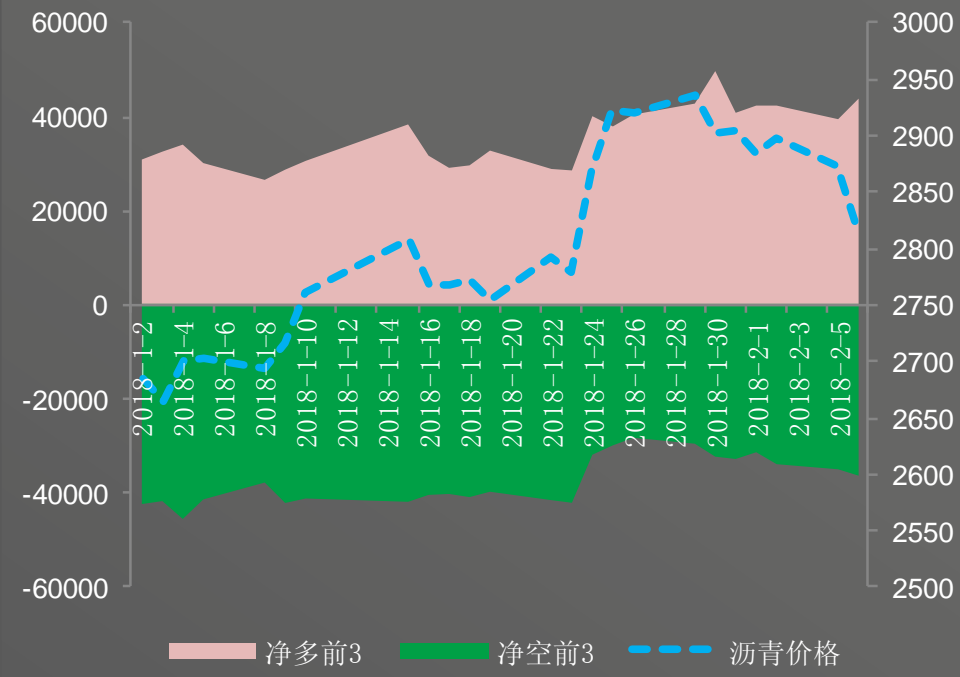
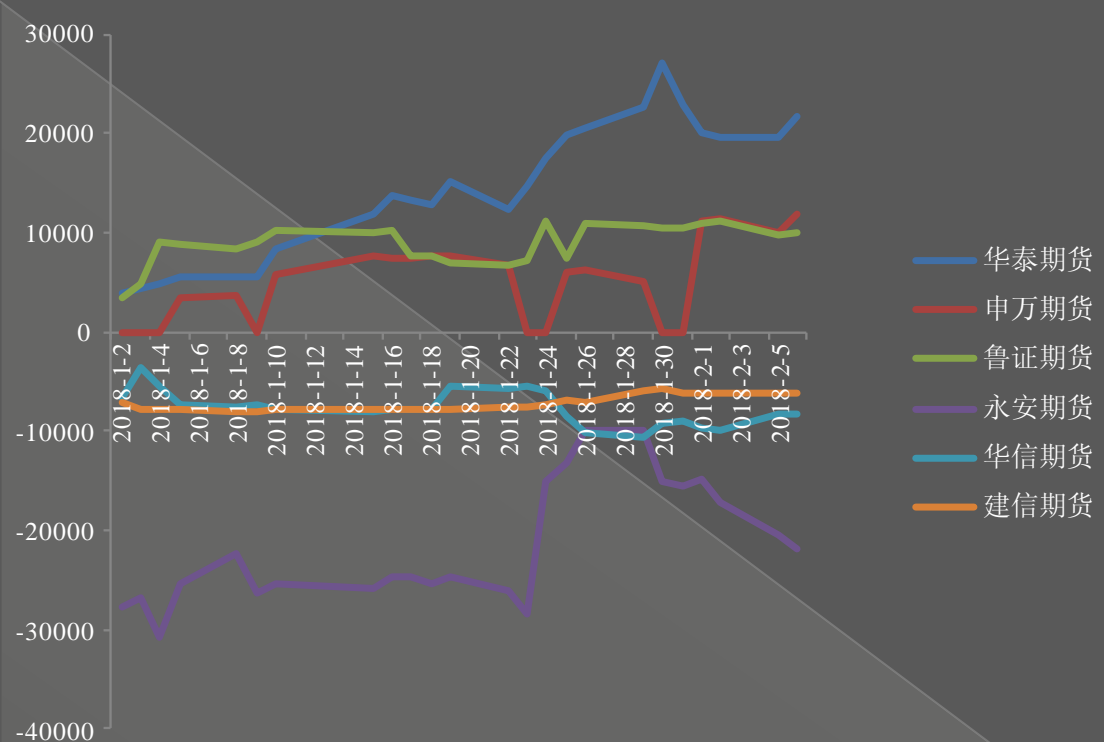
| 变动幅度 | | 当日 | 最近5日 | 平均变化 | 波动率 |
|-------|-------|------------|---------|--------|-----------|
| pta持仓 | 多头前3 | -6.25% | 11.28% | 2.26% | 10.94% |
| | 空头前3 | -13.18% | -23.03% | -4.61% | |
| pta涨幅 | | -0.26% | -0.75% | -0.15% | |
| 震荡幅度 | 1.70% | 1.24%(月均值) | 投机度 | 0.64 | 0.46(月均值) |

化工：橡胶



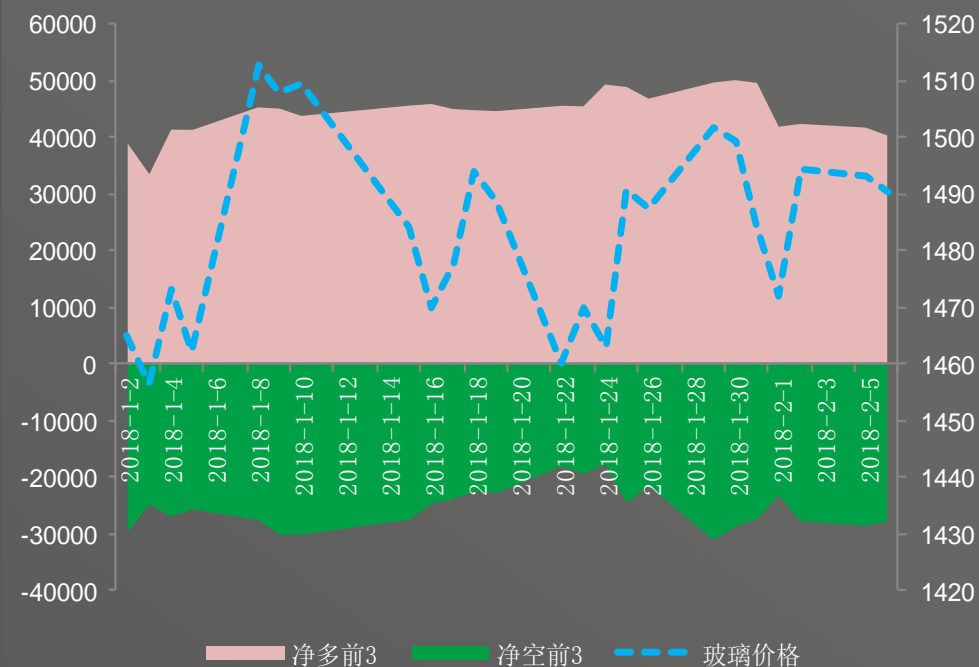
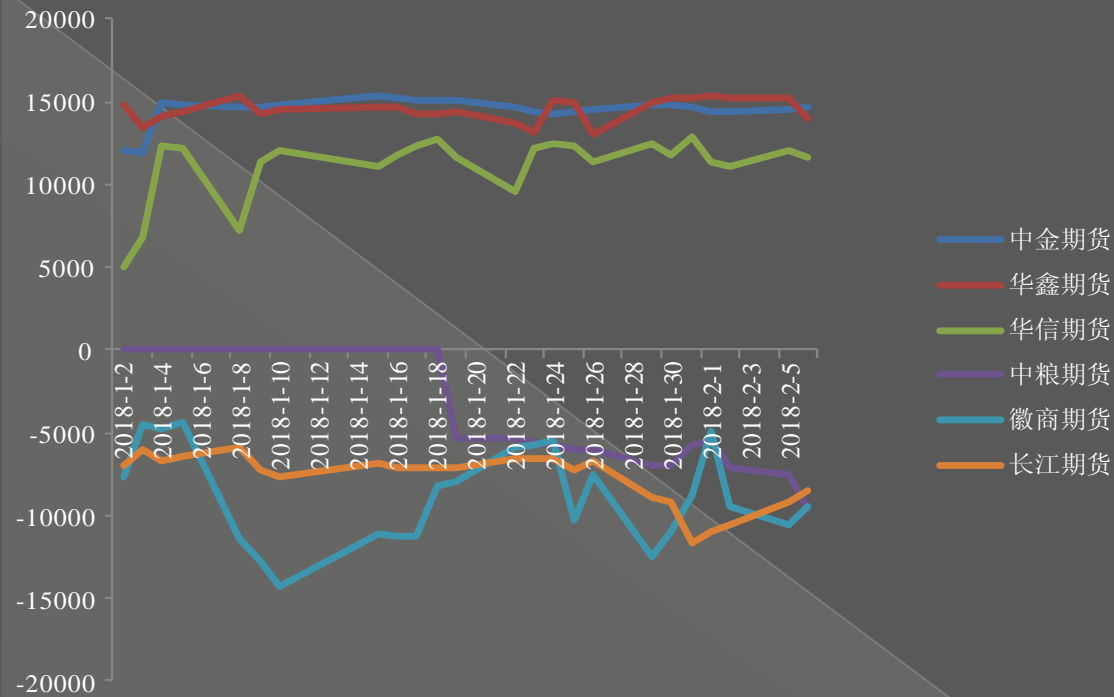
| 变动幅度 | | 当日 | 最近5日 | 平均变化 | 波动率 |
|------|-------|------------|--------|--------|-----------|
| ru持仓 | 多头前3 | -2.22% | 5.98% | 1.20% | 20.49% |
| | 空头前3 | -3.61% | -0.50% | -0.10% | |
| ru涨幅 | | -3.46% | -5.73% | -1.15% | |
| 震荡幅度 | 4.83% | 2.07%(月均值) | 投机度 | 1.07 | 0.84(月均值) |

化工：沥青



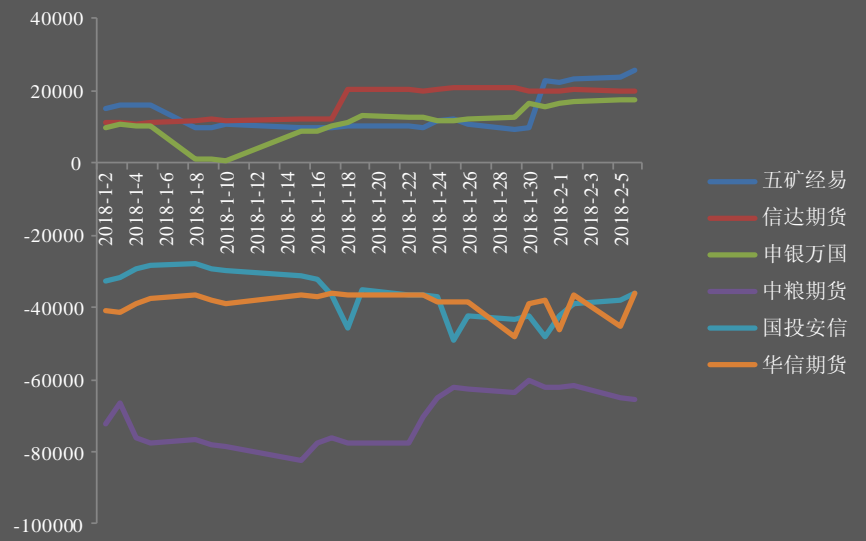
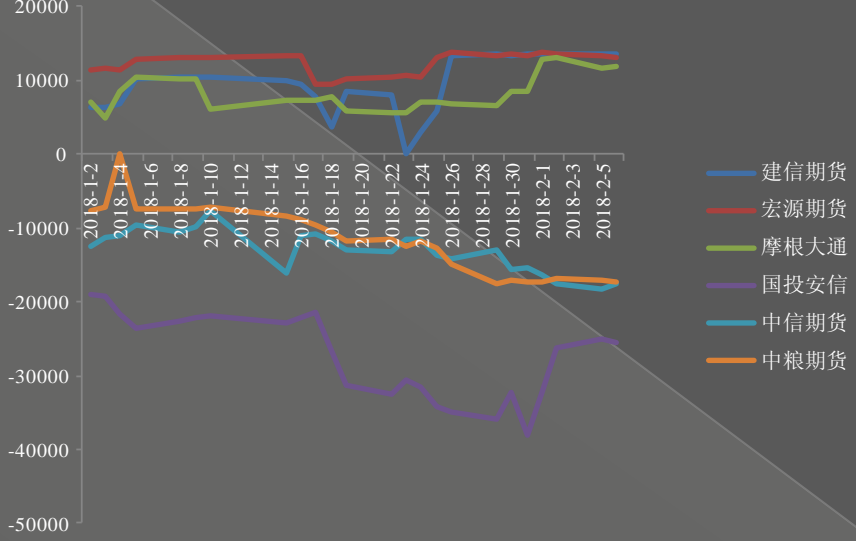
| 变动幅度 | | 当日 | 最近5日 | 平均变化 | 波动率 |
|------|-------|------------|---------|--------|-----------|
| bu持仓 | 多头前3 | 11.13% | -11.82% | -2.36% | 19.46% |
| | 空头前3 | 3.87% | 12.46% | 2.49% | |
| bu涨幅 | | -1.93% | -2.90% | -0.58% | |
| 震荡幅度 | 2.73% | 1.78%(月均值) | 投机度 | 1.05 | 0.80(月均值) |

化工：玻璃



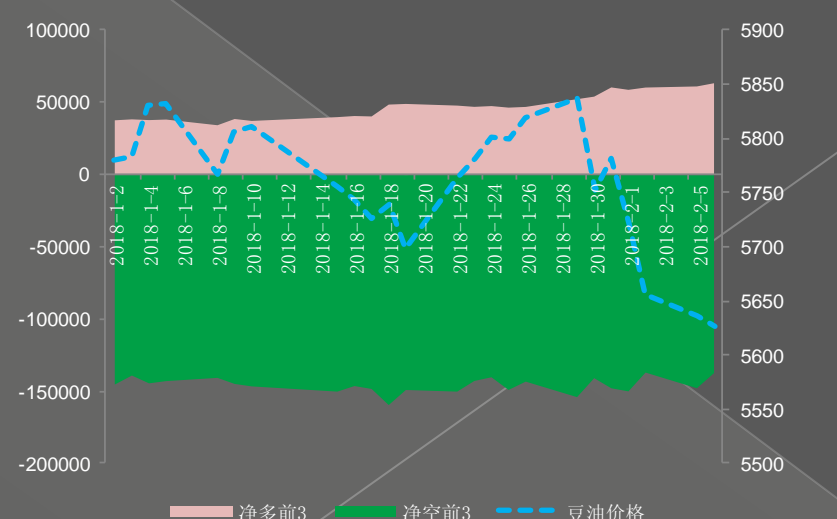
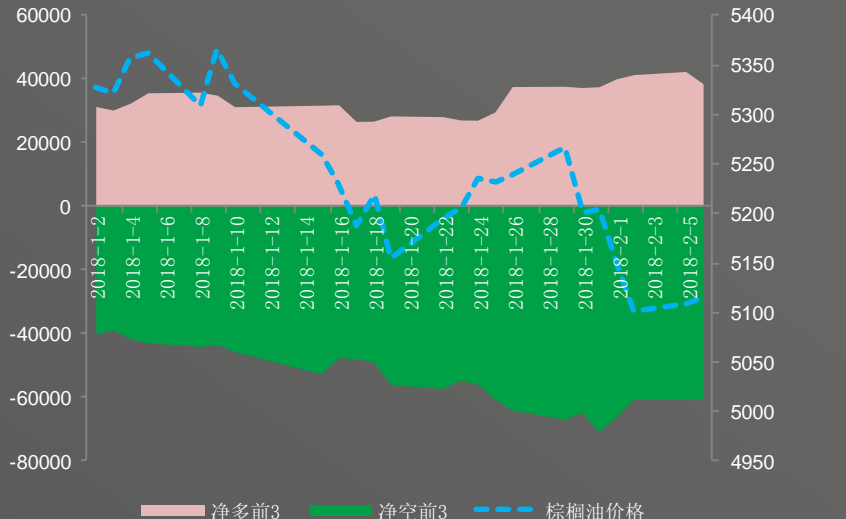
| 变动幅度 | | 当日 | 最近5日 | 平均变化 | 波动率 |
|------|-------|------------|---------|--------|-----------|
| fg持仓 | 多头前3 | -3.34% | -19.46% | -3.89% | 19.38% |
| | 空头前3 | -2.65% | -3.22% | -0.64% | |
| fg涨幅 | | -0.21% | -0.60% | -0.12% | |
| 震荡幅度 | 1.24% | 1.60%(月均值) | 投机度 | 0.41 | 0.50(月均值) |

农产品：P & Y

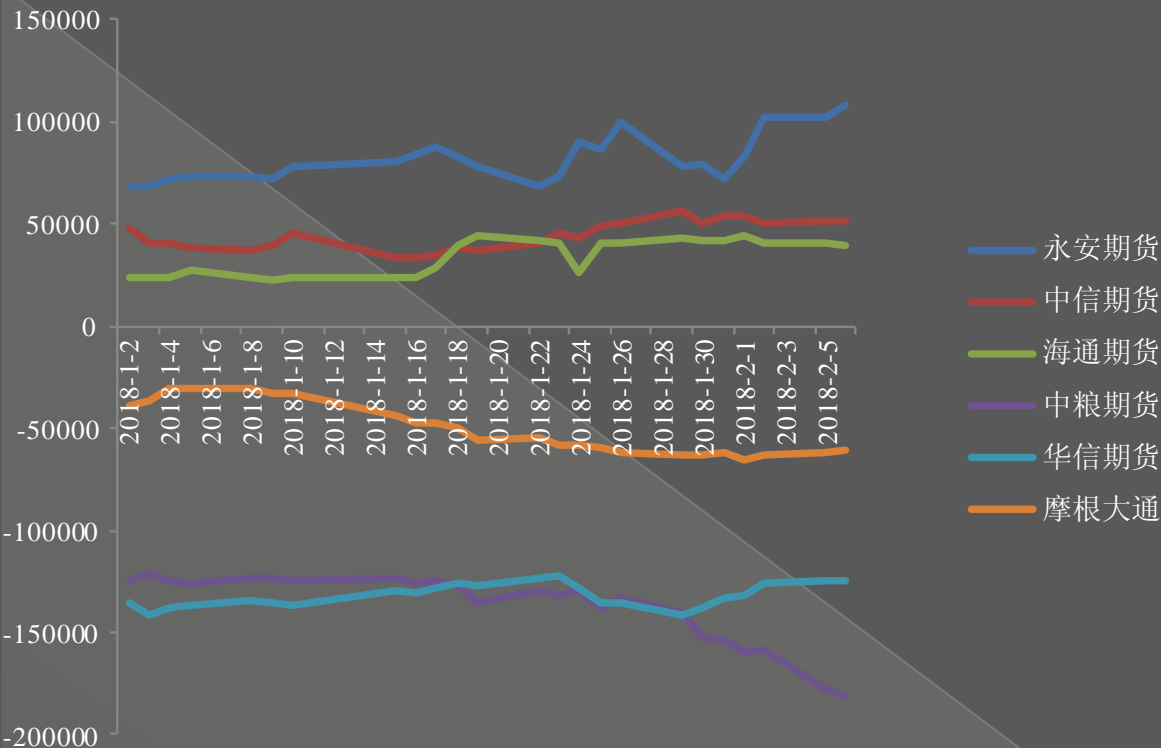


| 变动幅度 | | 当日 | 最近5日 | 平均变化 | 波动率 |
|------|-------|------------|--------|--------|-----------|
| p持仓 | 多头前3 | -9.06% | 3.24% | 0.65% | 11.95% |
| | 空头前3 | -0.05% | -6.90% | -1.38% | |
| p涨幅 | | 0.13% | -1.63% | -0.33% | |
| 震荡幅度 | 1.17% | 1.08%(月均值) | 投机度 | 0.58 | 0.49(月均值) |

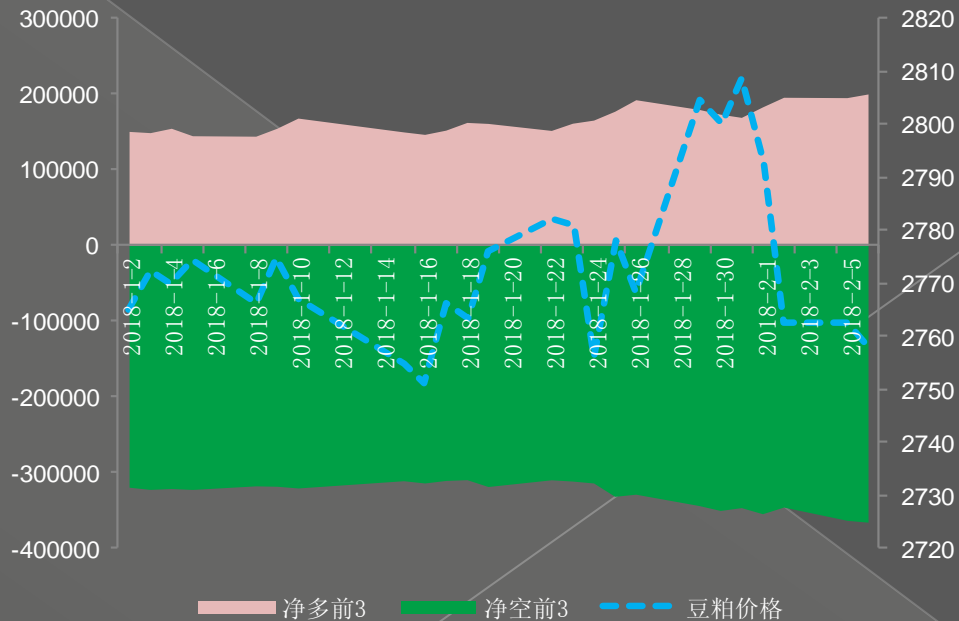
| 变动幅度 | | 当日 | 最近5日 | 平均变化 | 波动率 |
|------|-------|------------|--------|--------|-----------|
| y持仓 | 多头前3 | 3.60% | 17.08% | 3.42% | 11.15% |
| | 空头前3 | -7.09% | -2.50% | -0.50% | |
| y涨幅 | | -0.17% | -2.18% | -0.44% | |
| 震荡幅度 | 1.16% | 1.00%(月均值) | 投机度 | 0.31 | 0.30(月均值) |



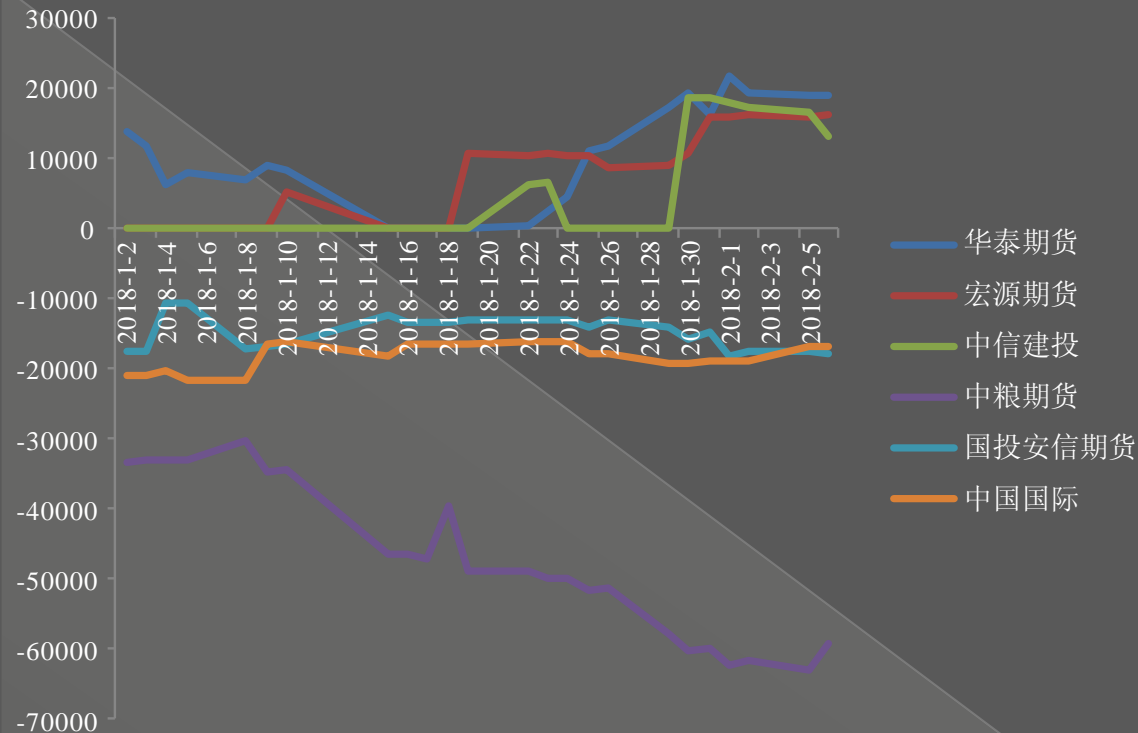
农产品：豆粕



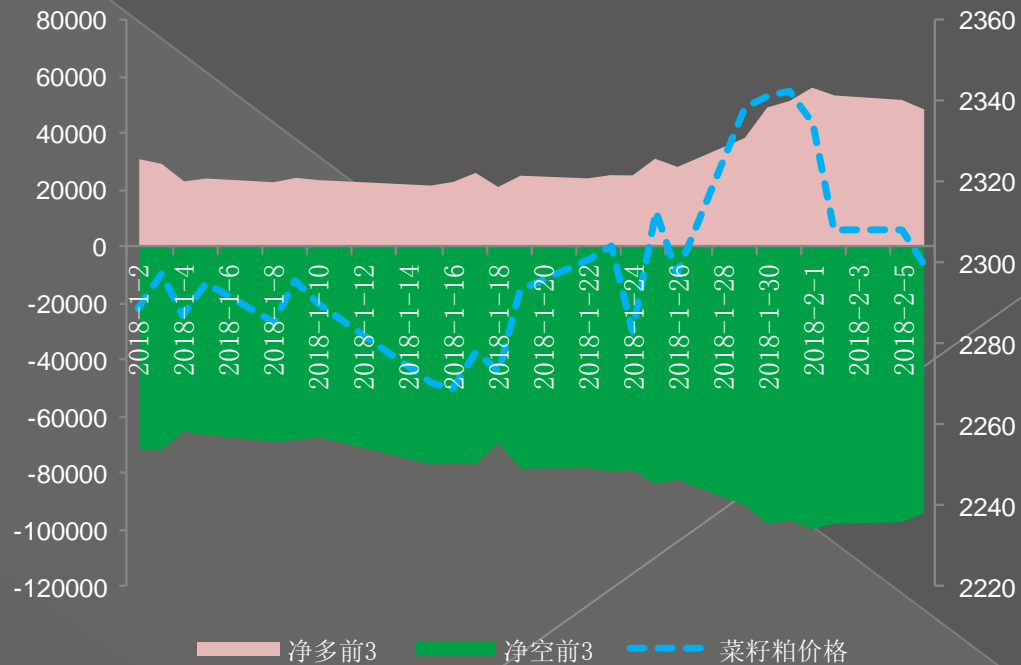
| 变动幅度 | | 当日 | 最近5日 | 平均变化 | 波动率 |
|------|-------|------------|--------|--------|-----------|
| m持仓 | 多头前3 | 2.49% | 15.43% | 3.09% | 8.49% |
| | 空头前3 | 0.69% | 4.43% | 0.89% | |
| m涨幅 | | -0.19% | -1.52% | -0.30% | |
| 震荡幅度 | 0.65% | 0.81%(月均值) | 投机度 | 0.27 | 0.29(月均值) |

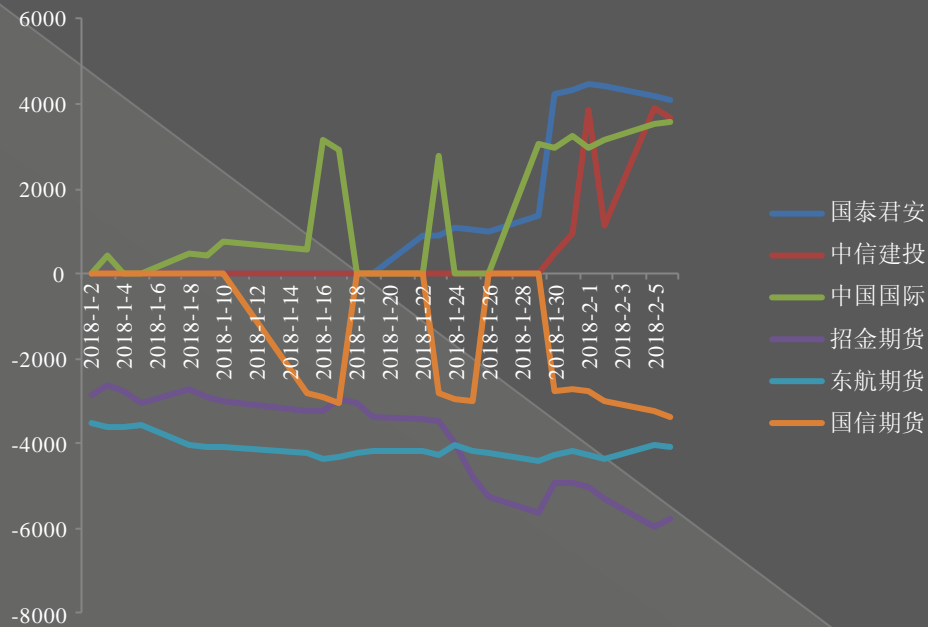


农产品：菜粕



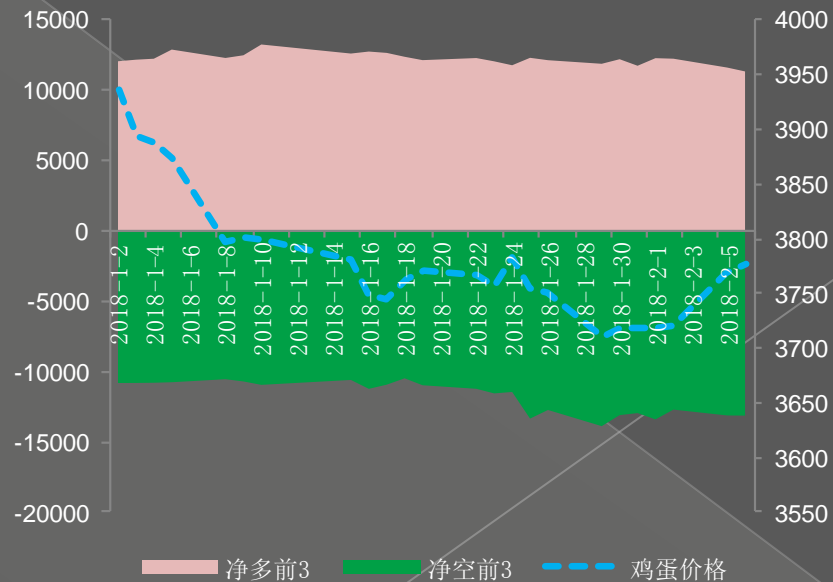
| 变动幅度 | | 当日 | 最近5日 | 平均变化 | 波动率 |
|------|-------|------------|--------|--------|-----------|
| rm持仓 | 多头前3 | -6.43% | -1.36% | -0.27% | 11.08% |
| | 空头前3 | -3.29% | -3.81% | -0.76% | |
| rm涨幅 | | -0.39% | -1.80% | -0.36% | |
| 震荡幅度 | 0.70% | 0.94%(月均值) | 投机度 | 0.41 | 0.46(月均值) |

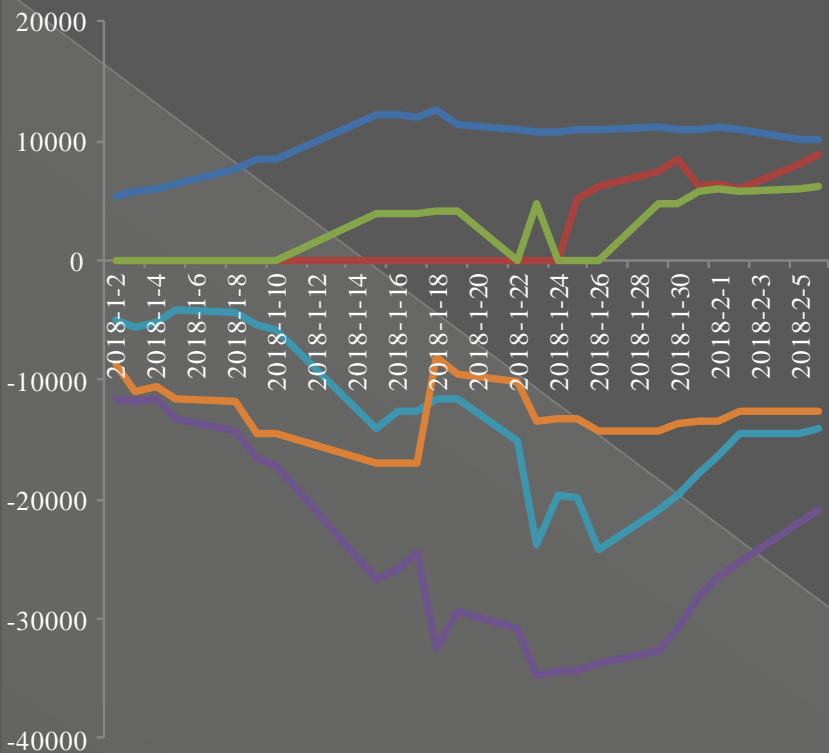




农产品：鸡蛋

| 变动幅度 | | 当日 | 最近5日 | 平均变化 | 波动率 |
|------|-------|------------|--------|--------|-----------|
| jd持仓 | 多头前3 | -2.35% | -7.07% | -1.41% | 10.27% |
| | 空头前3 | 0.10% | 0.28% | 0.06% | |
| jd涨幅 | | 0.26% | 1.57% | 0.31% | |
| 震荡幅度 | 0.85% | 1.12%(月均值) | 投机度 | 0.31 | 0.37(月均值) |

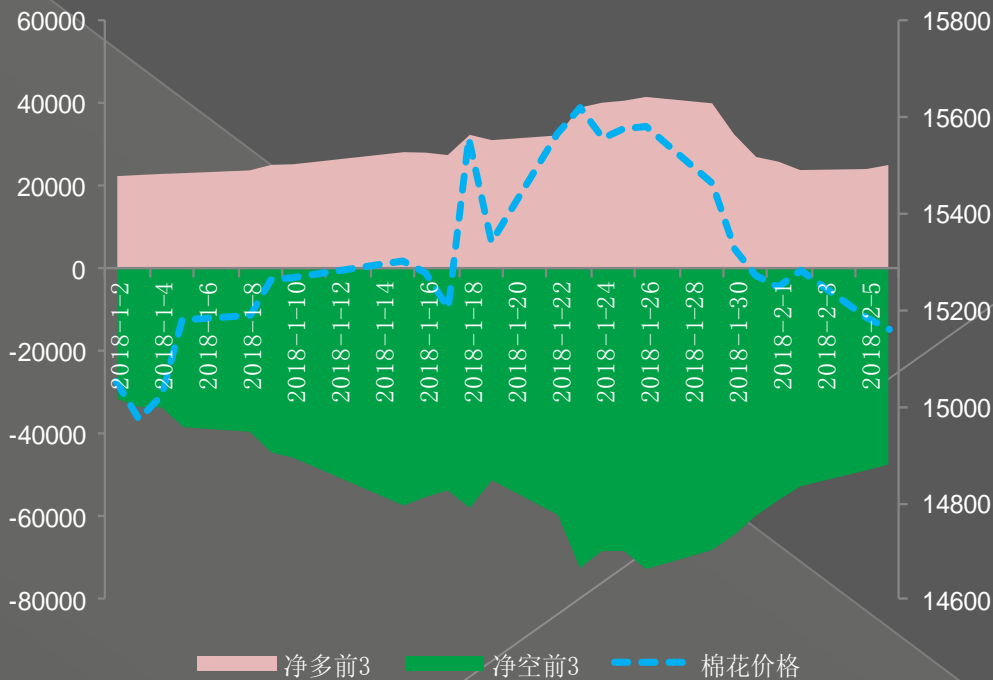




- 方正中期
- 永安期货
- 国金期货
- 华信期货
- 东证期货
- 中粮期货

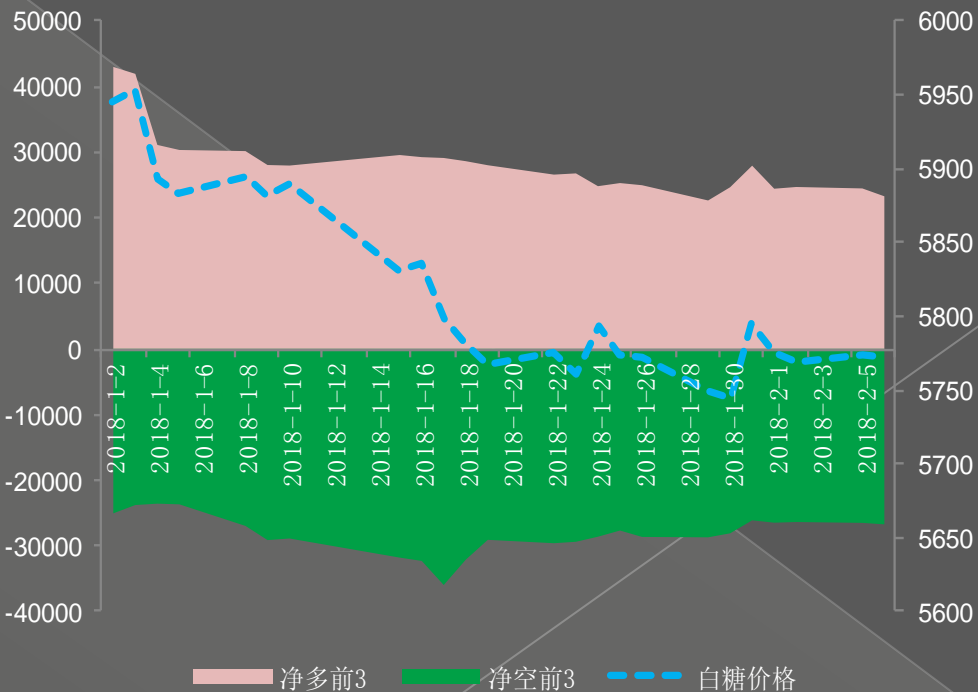
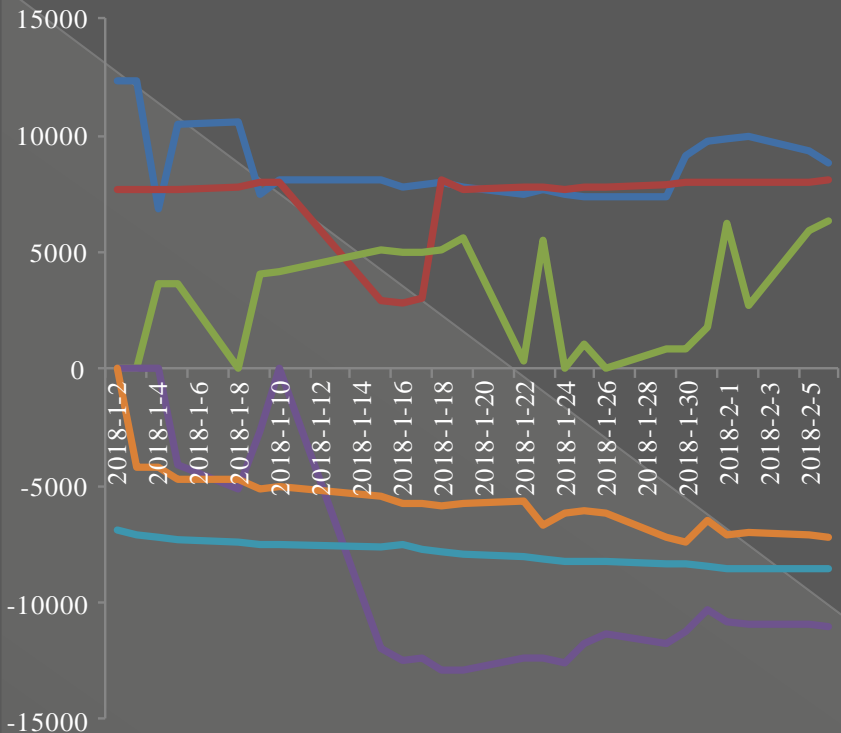
农产品：棉花

| 变动幅度 | | 当日 | 最近5日 | 平均变化 | 波动率 |
|------|-------|------------|---------|--------|-----------|
| cf持仓 | 多头前3 | 3.97% | -22.72% | -4.54% | 12.63% |
| | 空头前3 | -2.91% | -26.50% | -5.30% | |
| cf涨幅 | | -0.15% | -1.10% | -0.22% | |
| 震荡幅度 | 0.50% | 1.03%(月均值) | 投机度 | 0.24 | 0.43(月均值) |



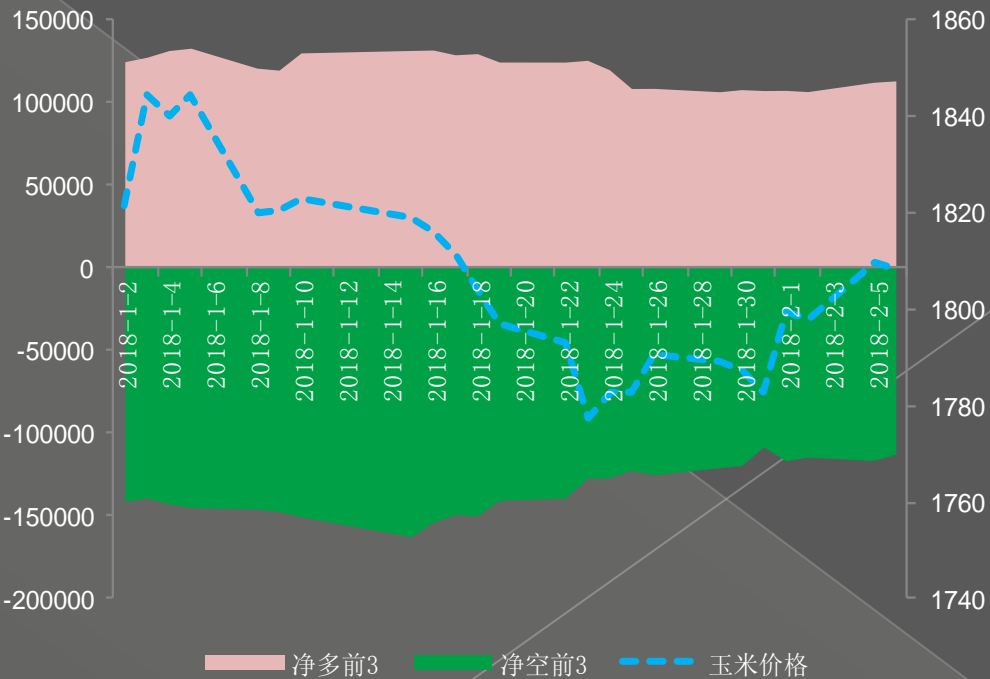
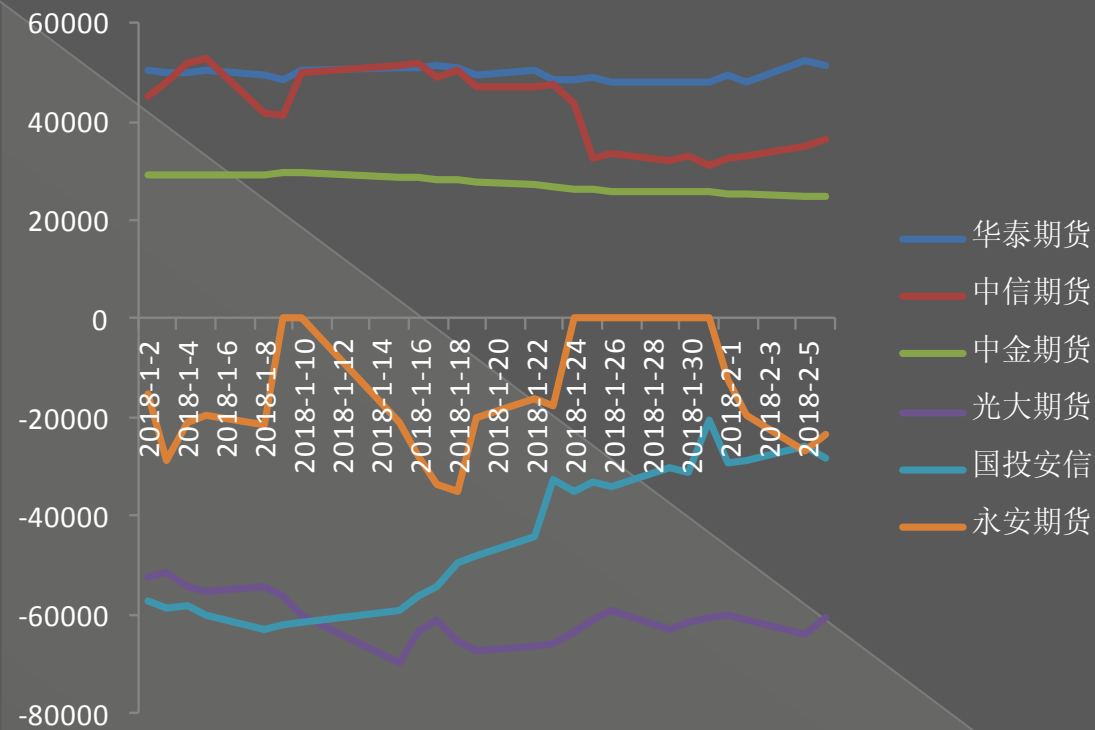
- 净多前3
- 净空前3
- 棉花价格

农产品：白糖



| 变动幅度 | | 当日 | 最近5日 | 平均变化 | 波动率 |
|------|-------|-------------|--------|--------|------------|
| sr持仓 | 多头前3 | -4.92% | -5.61% | -1.12% | 6.74% |
| | 空头前3 | 0.86% | -4.85% | -0.97% | |
| sr涨幅 | | -0.05% | 0.46% | 0.09% | |
| 震荡幅度 | 0.61% | 0.77% (月均值) | 投机度 | 0.43 | 0.46 (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 | 0.73% | 4.90% | 0.98% | 7.48% |
| | 空头前3 | -3.29% | -5.76% | -1.15% | |
| c涨幅 | | -0.10% | 1.18% | 0.24% | |
| 震荡幅度 | 0.52% | 0.73%(月均值) | 投机度 | 0.33 | 0.35(月均值) |

部分机构资金变动表

制表日期：2018年2月6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 | 25580.52 | 9.55% | 35146.25 | 13.61% |
| 南华期货 | 3004.91 | 5.94% | 6662.50 | 14.19% |
| 混沌天成 | -302.00 | -0.93% | 5254.43 | 19.41% |
| 海通期货 | -15.39 | -0.01% | -18182.07 | -14.63% |
| 上海大陆 | 1012.03 | 8.46% | 1772.14 | 15.82% |
| 中信期货 | 2679.72 | 1.20% | 14027.32 | 6.64% |
| 新湖期货 | -2110.64 | -4.57% | -11074.40 | -20.09% |

| | | | | |
|------|-----------|---------|-----------|---------|
| 中粮期货 | 13596.49 | 7.97% | 19213.87 | 11.65% |
| 中信建投 | -3957.32 | -7.83% | 2734.94 | 6.23% |
| 申银万国 | -6252.09 | -15.30% | -5431.22 | -13.56% |
| 华泰期货 | 4619.24 | 4.48% | -26674.98 | -19.85% |
| 光大期货 | -13199.23 | -20.48% | 2930.82 | 6.07% |
| 一德期货 | -8080.23 | -7.24% | -17301.78 | -14.33% |
| 国投期货 | -2686.16 | -3.08% | -11940.99 | -12.37% |
| 金瑞期货 | -1375.33 | -1.79% | -13875.37 | -15.52% |
| 鲁证期货 | 3134.57 | 2.75% | 19358.71 | 19.82% |
| 中国国际 | 5704.75 | 12.48% | -7240.14 | -12.34% |

部分机构持仓一览

| 机构 | 永安期货 | | | | | |
|-----|-----------|-----------|----------|----------|----------|----------|
| 日期 | 2018-1-30 | 2018-1-31 | 2018-2-1 | 2018-2-2 | 2018-2-5 | 2018-2-6 |
| 黄金 | 5205 | 5206 | 5161 | 5221 | 5272 | 5471 |
| 白银 | | | | | | |
| 沪铜 | 28911 | 30198 | 30328 | 30811 | 30148 | 30800 |
| 沪铝 | | -6978 | -7653 | -7441 | -8609 | -9639 |
| 沪镍 | 39656 | 17728 | 20686 | 18933 | 8597 | 19146 |
| 沪锌 | | | | | | -2480 |
| 沪铅 | | | | | | |
| 螺纹钢 | | -18696 | | | | |
| 铁矿石 | | | | -2611 | -12677 | -2279 |
| 焦煤 | 2986 | 4508 | 8320 | 4740 | 2528 | 2143 |
| 焦炭 | 5850 | -1913 | 4887 | 1002 | 7242 | 13038 |
| 豆油 | 17700 | 17729 | 15803 | 13181 | 14045 | 13262 |
| 棕榈油 | -6848 | -7190 | -7460 | -9463 | -10128 | -9274 |
| 菜籽油 | 14665 | 15269 | 15325 | 16538 | 16320 | 15385 |
| 豆粕 | 79388 | 72415 | 83602 | 102883 | 101942 | 108006 |
| 菜籽粕 | -4381 | -3863 | -5497 | -6040 | -9153 | -11215 |
| 棉花 | 8464 | 6177 | 6498 | 6097 | 8034 | 8860 |
| 白糖 | -3723 | -7428 | -5453 | -5127 | -5344 | -5630 |
| 玉米 | | | -12254 | -19669 | -26666 | -23452 |
| 鸡蛋 | 496 | 592 | 765 | | | |
| PTA | | | | | | |
| 聚乙烯 | | | -4506 | -7855 | -5591 | -7325 |
| 聚丙烯 | 10735 | 11176 | 15138 | 21408 | 15464 | 21256 |
| 甲醇 | 19575 | 20354 | 21485 | 20302 | 18477 | 18464 |
| 玻璃 | -8047 | -6794 | -6478 | -7534 | -8532 | -6840 |
| 橡胶 | -24054 | -24595 | -25229 | -25566 | -25380 | -24124 |
| 沥青 | -15042 | -15638 | -14908 | -17155 | -20488 | -21806 |
| 动力煤 | 8327 | 5938 | 9246 | 10735 | 9885 | 4370 |

部分机构持仓一览

| 机构 | 南华期货 | | | | | |
|-----|-----------|-----------|----------|----------|----------|----------|
| 日期 | 2018-1-30 | 2018-1-31 | 2018-2-1 | 2018-2-2 | 2018-2-5 | 2018-2-6 |
| 黄金 | -766 | | -1040 | -967 | | -958 |
| 白银 | 7949 | 6872 | 6651 | 6812 | | |
| 沪铜 | | | 2681 | | | |
| 沪铝 | -12645 | -11911 | -14885 | -21133 | -21394 | -22476 |
| 沪镍 | | | | | | -4995 |
| 沪锌 | | | | -2485 | | |
| 沪铅 | | -513 | | 675 | | |
| 螺纹钢 | | | -24667 | | | |
| 铁矿石 | | | | | | |
| 焦煤 | | | | | | 2128 |
| 焦炭 | | | 1741 | 2343 | 2454 | |
| 豆油 | | | | | 2529 | |
| 棕榈油 | | | | | | |
| 菜籽油 | | 14 | | | | |
| 豆粕 | | | | | | |
| 菜籽粕 | -11065 | -11409 | -11572 | -12678 | -11308 | -11681 |
| 棉花 | | | | | | |
| 白糖 | 5644 | 10282 | 5181 | 5181 | 5416 | 5079 |
| 玉米 | -13675 | -14425 | -14652 | | -14398 | -13963 |
| 鸡蛋 | | | | | | |
| PTA | -17523 | -18288 | -16364 | -14634 | | |
| 聚乙烯 | 10035 | 10629 | 10575 | 10590 | 10784 | 10056 |
| 聚丙烯 | -16769 | -17307 | -16026 | -16445 | -16793 | -15643 |
| 甲醇 | | -5688 | | -5274 | -6466 | -5848 |
| 玻璃 | | | | | | |
| 橡胶 | | | | | | |
| 沥青 | | | | | | -4977 |
| 动力煤 | -3912 | | -3786 | | | |

部分机构持仓一览

| 机构 | 国泰君安 | | | | | |
|-----|-----------|-----------|----------|----------|----------|----------|
| 日期 | 2018-1-30 | 2018-1-31 | 2018-2-1 | 2018-2-2 | 2018-2-5 | 2018-2-6 |
| 黄金 | | | | | | |
| 白银 | -12225 | -12291 | -12404 | -12849 | -13454 | -14928 |
| 沪铜 | | | | | | |
| 沪铝 | 3546 | 2378 | 2997 | 3535 | 3187 | 1761 |
| 沪镍 | -6463 | | -5172 | -5798 | | |
| 沪锌 | -5022 | -5335 | -5597 | -5769 | -5445 | -4446 |
| 沪铅 | 763 | | 1002 | 1013 | | 508 |
| 螺纹钢 | 43692 | 47341 | 49477 | 47354 | 45708 | 23162 |
| 铁矿石 | 11216 | 13061 | 13659 | 11590 | 12415 | 9713 |
| 焦煤 | 2723 | | | 1775 | 4018 | 4527 |
| 焦炭 | | | | | | |
| 豆油 | 14217 | | | 2647 | | |
| 棕榈油 | | | | | | |
| 菜籽油 | 26463 | 27186 | 27119 | 28287 | 30701 | 30678 |
| 豆粕 | | 22599 | 22214 | | | |
| 菜籽粕 | | 8591 | 8888 | 8287 | 8880 | 9194 |
| 棉花 | | | | | | 2733 |
| 白糖 | -7376 | -6423 | -7121 | -7027 | -7125 | -7237 |
| 玉米 | 26552 | 27747 | 15281 | 16061 | 12228 | 13446 |
| 鸡蛋 | 4228 | 4333 | 4473 | 4432 | 4199 | 4094 |
| PTA | | | 25719 | | 23863 | 21387 |
| 聚乙烯 | | | | 678 | 1194 | 1014 |
| 聚丙烯 | 11143 | 7457 | 11592 | 11529 | 6598 | 6561 |
| 甲醇 | -1801 | -2925 | -2852 | -3147 | -3403 | -1983 |
| 玻璃 | 4259 | 6403 | 4202 | | | |
| 橡胶 | -4659 | -5495 | -5079 | -4433 | -5108 | -5046 |
| 沥青 | 5089 | | 6527 | | 5433 | |
| 动力煤 | | | | | | |

部分机构持仓一览

| 机构 | 混沌天成 | | | | | |
|-----|-----------|-----------|----------|----------|----------|----------|
| 日期 | 2018-1-30 | 2018-1-31 | 2018-2-1 | 2018-2-2 | 2018-2-5 | 2018-2-6 |
| 黄金 | | | | | | |
| 白银 | | | | | | |
| 沪铜 | -9037 | -8920 | -9012 | -8123 | -7982 | -7931 |
| 沪铝 | 4146 | 4114 | 4160 | 5116 | 5111 | 5431 |
| 沪镍 | | | | | -7466 | -7301 |
| 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 | 2018-1-30 | 2018-1-31 | 2018-2-1 | 2018-2-2 | 2018-2-5 | 2018-2-6 |
| 黄金 | 3308 | 2752 | | | | 3048 |
| 白银 | 14550 | 14568 | 13532 | 12665 | 12824 | 14002 |
| 沪铜 | -10473 | -10699 | -10161 | -10032 | -10670 | -10340 |
| 沪铝 | | | | | -3016 | -3447 |
| 沪镍 | 7596 | 16075 | 5887 | 16711 | 11537 | 11536 |
| 沪锌 | 4748 | 3727 | 6412 | 6165 | 5909 | 6143 |
| 沪铅 | 1384 | 1254 | 718 | 890 | 820 | |
| 螺纹钢 | -25922 | -24704 | | | | |
| 铁矿石 | 4980 | 3005 | 4597 | 2163 | 6826 | |
| 焦煤 | | | | 1897 | | |
| 焦炭 | | 470 | 857 | 728 | 1508 | 1089 |
| 豆油 | | 8727 | 9318 | | | |
| 棕榈油 | | | | | | |
| 菜籽油 | -5663 | -5401 | -5315 | -6334 | -6461 | -5550 |
| 豆粕 | 42060 | 42213 | 44607 | 40964 | 41000 | 39493 |
| 菜籽粕 | 9346 | 8951 | 8760 | 8563 | | |
| 棉花 | 4999 | 4473 | 4235 | 4254 | 3384 | |
| 白糖 | -8549 | -6079 | -6122 | -6180 | -6088 | -5946 |
| 玉米 | | 7109 | 9780 | 8664 | | |
| 鸡蛋 | | | | 664 | 540 | 801 |
| PTA | 34986 | 36157 | 32015 | 33440 | 33049 | 30242 |
| 聚乙烯 | | | | | | |
| 聚丙烯 | 5976 | 6119 | | -8396 | | |
| 甲醇 | -7403 | -11967 | -13188 | -14976 | -4762 | |
| 玻璃 | 6822 | 5862 | 5968 | 6876 | 10764 | 11118 |
| 橡胶 | | | | | | -4432 |
| 沥青 | 12061 | 6835 | 6309 | 7195 | 9604 | 7344 |
| 动力煤 | | -1796 | | -3104 | | |

部分机构持仓一览

| 机构 | 上海大陆 | | | | | |
|-----|-----------|-----------|----------|----------|----------|----------|
| 日期 | 2018-1-30 | 2018-1-31 | 2018-2-1 | 2018-2-2 | 2018-2-5 | 2018-2-6 |
| 黄金 | | | | | | |
| 白银 | | | | | | |
| 沪铜 | | | | | | |
| 沪铝 | | | | | | |
| 沪镍 | | | | | | |
| 沪锌 | | | | | | |
| 沪铅 | | | | | | |
| 螺纹钢 | 28705 | 20810 | 30198 | 27770 | 26959 | 29215 |
| 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 | | -5225 | -4852 | -4847 | -4621 | -5391 |
| 动力煤 | | | | | | |

部分机构持仓一览

| 机构 | 中粮期货 | | | | | |
|-----|-----------|-----------|----------|----------|----------|----------|
| 日期 | 2018-1-30 | 2018-1-31 | 2018-2-1 | 2018-2-2 | 2018-2-5 | 2018-2-6 |
| 黄金 | | | | | | |
| 白银 | | | | | 6842 | 7278 |
| 沪铜 | | | | | | -4506 |
| 沪铝 | | | | | | |
| 沪镍 | 8525 | 8394 | 8227 | 7097 | 8070 | 7925 |
| 沪锌 | -9329 | -8302 | -8025 | -9007 | -6914 | -5776 |
| 沪铅 | -1121 | -1107 | -775 | -727 | -855 | -473 |
| 螺纹钢 | | | | | | |
| 铁矿石 | | | | | | |
| 焦煤 | -3031 | | | | | |
| 焦炭 | | | | | | |
| 豆油 | -60024 | -62269 | -62101 | -61593 | -65058 | -65620 |
| 棕榈油 | -17101 | -17288 | -17318 | -16787 | -17138 | -17253 |
| 菜籽油 | -7522 | -7979 | -7671 | -6890 | -7034 | -7025 |
| 豆粕 | -151776 | -153007 | -159139 | -158514 | -177586 | -181817 |
| 菜籽粕 | -60180 | -59860 | -62324 | -61411 | -62966 | -59015 |
| 棉花 | -13607 | -13346 | -13345 | -12617 | -12530 | -12520 |
| 白糖 | | 2293 | 153 | -300 | | |
| 玉米 | | | -12868 | -14992 | | -17410 |
| 鸡蛋 | 4172 | 3710 | 3238 | 3198 | 3107 | 3189 |
| PTA | | | | | | |
| 聚乙烯 | | | | | | |
| 聚丙烯 | | | | | | |
| 甲醇 | | | | | -5014 | -5070 |
| 玻璃 | -6949 | -5675 | -5497 | -7154 | -7451 | -9579 |
| 橡胶 | -7980 | -7887 | -7943 | -8308 | -8364 | -8150 |
| 沥青 | | | | | | |
| 动力煤 | | | | | | |

部分机构持仓一览

| 机构 | 中信期货 | | | | | |
|-----|-----------|-----------|----------|----------|----------|----------|
| 日期 | 2018-1-30 | 2018-1-31 | 2018-2-1 | 2018-2-2 | 2018-2-5 | 2018-2-6 |
| 黄金 | 8068 | 8412 | 9060 | 9218 | 9449 | 9169 |
| 白银 | -23102 | -22638 | -24250 | -24204 | -27393 | -27952 |
| 沪铜 | -16562 | -15959 | -16552 | -16008 | -16045 | -17533 |
| 沪铝 | -30245 | -29894 | -30797 | -31161 | -32756 | -30971 |
| 沪镍 | | | | | | |
| 沪锌 | -4905 | -4483 | -4266 | -2736 | -4037 | -6416 |
| 沪铅 | -2803 | -2917 | -2963 | -3100 | -3261 | -3640 |
| 螺纹钢 | 55366 | 61819 | 67467 | 67002 | 65949 | 60983 |
| 铁矿石 | -12161 | -14082 | -14155 | -13015 | -10095 | -8117 |
| 焦煤 | 5026 | 5152 | 5094 | 5896 | 6104 | 6131 |
| 焦炭 | -2743 | | 651 | | -1166 | -4301 |
| 豆油 | | | | | | |
| 棕榈油 | -15609 | -15431 | -16423 | -17449 | -18219 | -17594 |
| 菜籽油 | -10978 | -11528 | -11801 | -11579 | -11972 | -11450 |
| 豆粕 | 50989 | 53633 | 53812 | 50853 | 51131 | 51542 |
| 菜籽粕 | 9782 | 8926 | 11620 | 9565 | 9680 | 1774 |
| 棉花 | | | | | | |
| 白糖 | -11220 | -10284 | -10827 | -10876 | -10891 | -11011 |
| 玉米 | 32997 | 31253 | 32361 | 33109 | 35108 | 36598 |
| 鸡蛋 | | | | | | |
| PTA | 24518 | 25037 | 36392 | 30255 | 27933 | 13136 |
| 聚乙烯 | | | | | -3735 | -4208 |
| 聚丙烯 | 12420 | 11594 | 11033 | 11841 | 13677 | 13290 |
| 甲醇 | | | -2524 | -1949 | 143 | 727 |
| 玻璃 | 20053 | 19705 | 12004 | 12744 | 11854 | 10797 |
| 橡胶 | | | | | | |
| 沥青 | | | | | | |
| 动力煤 | | 6056 | 5916 | 6389 | 5943 | 5047 |

部分机构持仓一览

| 机构 | 中信建投 | | | | | |
|-----|-----------|-----------|----------|----------|----------|----------|
| 日期 | 2018-1-30 | 2018-1-31 | 2018-2-1 | 2018-2-2 | 2018-2-5 | 2018-2-6 |
| 黄金 | | | | | | |
| 白银 | | 9914 | 9958 | 9856 | 6436 | |
| 沪铜 | | | | | | |
| 沪铝 | | | | | | |
| 沪镍 | | | | | 8946 | 8575 |
| 沪锌 | | | | | | |
| 沪铅 | | 511 | | | | |
| 螺纹钢 | | | | | -24655 | -22957 |
| 铁矿石 | | 17596 | 15895 | | | |
| 焦煤 | | -2261 | | -2420 | -2643 | -2202 |
| 焦炭 | | | | | | 2169 |
| 豆油 | 13242 | 13202 | 13184 | 13124 | 12504 | 12533 |
| 棕榈油 | -11419 | -11806 | -10848 | -9775 | -9289 | 5647 |
| 菜籽油 | | | | | | |
| 豆粕 | 27017 | 26440 | 26600 | 26892 | 26229 | 24664 |
| 菜籽粕 | 18849 | 18813 | 18089 | 17529 | 16771 | 13163 |
| 棉花 | 10892 | 5529 | | | | |
| 白糖 | | | | | | |
| 玉米 | | | | | | |
| 鸡蛋 | 461 | 956 | 3855 | 1151 | 3893 | 3673 |
| PTA | | | | | | |
| 聚乙烯 | | | | | | |
| 聚丙烯 | | | | | | |
| 甲醇 | | | | | | |
| 玻璃 | -4912 | -4511 | -4789 | -4484 | -5146 | -4601 |
| 橡胶 | | | | | | |
| 沥青 | | | | | | |
| 动力煤 | | | | | | -3441 |

部分机构持仓一览

| 机构 | 新湖期货 | | | | | |
|-----|-----------|-----------|----------|----------|----------|----------|
| 日期 | 2018-1-30 | 2018-1-31 | 2018-2-1 | 2018-2-2 | 2018-2-5 | 2018-2-6 |
| 黄金 | | | | | -1089 | -1114 |
| 白银 | | | | | | |
| 沪铜 | | | | | | |
| 沪铝 | | | | | | |
| 沪镍 | 4667 | | | | | |
| 沪锌 | | | | | | |
| 沪铅 | | | | | | |
| 螺纹钢 | 37957 | 34673 | 35353 | 29286 | 29353 | 30079 |
| 铁矿石 | | | | | | |
| 焦煤 | | | | | | |
| 焦炭 | | | | | | |
| 豆油 | | | | | | |
| 棕榈油 | 6567 | 6507 | 6699 | 6699 | 6798 | 6576 |
| 菜籽油 | -5073 | -4980 | -5307 | -8200 | -8429 | -8601 |
| 豆粕 | -30208 | -31263 | -32972 | -34778 | -34617 | -33581 |
| 菜籽粕 | | | | | | |
| 棉花 | | | | | | |
| 白糖 | | | | | | |
| 玉米 | 18753 | 18878 | 19385 | 19328 | 19842 | 13115 |
| 鸡蛋 | -3967 | -3898 | -4178 | -1378 | -1134 | -1258 |
| PTA | -19675 | -19524 | -17141 | -17169 | -15655 | -15615 |
| 聚乙烯 | -4604 | -4892 | -4871 | -4870 | -4828 | -3943 |
| 聚丙烯 | -4566 | | | | | |
| 甲醇 | -6318 | -6119 | -5703 | | | |
| 玻璃 | | | | | | |
| 橡胶 | | -4677 | | | | |
| 沥青 | -4865 | -4911 | -6860 | -6259 | | |
| 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

