



# 市场持仓分析

2018/2/28

# 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	-22.09%	-16.74%	-9.52%	3.46%	3.63%	3.29%	-25.55%	☆☆☆☆
甲醇	-3.24%	-3.13%	-3.01%	8.45%	5.60%	4.28%	-11.68%	☆☆☆
焦煤	5.73%	4.14%	6.71%	-13.27%	-10.72%	-7.46%	19.00%	☆☆☆
动力煤	2.95%	2.02%	-0.16%	-0.24%	-2.11%	-3.70%	3.19%	☆
铁矿石	-4.10%	-5.60%	-4.03%	-0.84%	2.90%	3.36%	-3.26%	☆
玻璃	12.78%	7.86%	5.51%	-6.94%	-5.64%	-5.99%	19.72%	☆☆☆
豆粕	8.16%	8.58%	5.74%	-2.52%	-2.86%	-2.97%	10.68%	☆☆☆
玉米	2.37%	2.60%	4.31%	-4.55%	-4.31%	-3.53%	6.92%	☆☆
棕榈油	8.64%	4.05%	3.35%	4.79%	3.87%	-0.09%	3.85%	☆
鸡蛋	-3.05%	-2.37%	-1.83%	-0.35%	0.69%	1.09%	-2.70%	☆
沪镍	-3.83%	-2.91%	-2.08%	1.34%	1.11%	0.92%	-5.16%	☆☆
菜籽粕	-3.26%	0.59%	2.17%	-0.80%	-0.58%	0.71%	-2.47%	☆
橡胶	1.04%	0.85%	1.62%	0.65%	1.22%	0.72%	0.40%	☆
豆油	7.12%	4.28%	-1.03%	-0.82%	-1.95%	-0.13%	7.94%	☆☆
沪铜	3.09%	2.95%	1.73%	-0.65%	-1.15%	-0.38%	3.74%	☆
棉花	-0.47%	-0.21%	0.29%	-0.79%	-0.58%	-0.07%	0.32%	☆
白糖	-2.84%	-1.52%	-0.96%	1.08%	0.39%	1.33%	-3.93%	☆
沪锌	-2.04%	-0.62%	-1.52%	0.62%	0.37%	2.11%	-2.66%	☆
聚乙烯	5.29%	3.89%	-0.34%	-1.67%	-1.61%	2.41%	6.96%	☆☆
聚丙烯	-0.29%	-1.72%	-0.72%	2.22%	1.75%	1.91%	-2.51%	☆
沥青	11.89%	6.84%	0.84%	-1.92%	-3.18%	-2.19%	13.82%	☆☆☆
沪银	-0.70%	-1.14%	1.15%	-0.32%	-1.65%	-1.38%	-0.38%	☆
PTA	1.79%	2.91%	0.42%	0.80%	1.48%	1.18%	0.99%	☆
沪金	-2.02%	-0.57%	-0.74%	-1.10%	-2.90%	1.90%	-0.92%	☆
沪铝	0.38%	-0.28%	2.07%	-1.07%	-2.53%	-2.50%	1.44%	☆
螺纹钢	-5.19%	-4.37%	-3.61%	-3.86%	-4.56%	-2.04%	-1.33%	☆

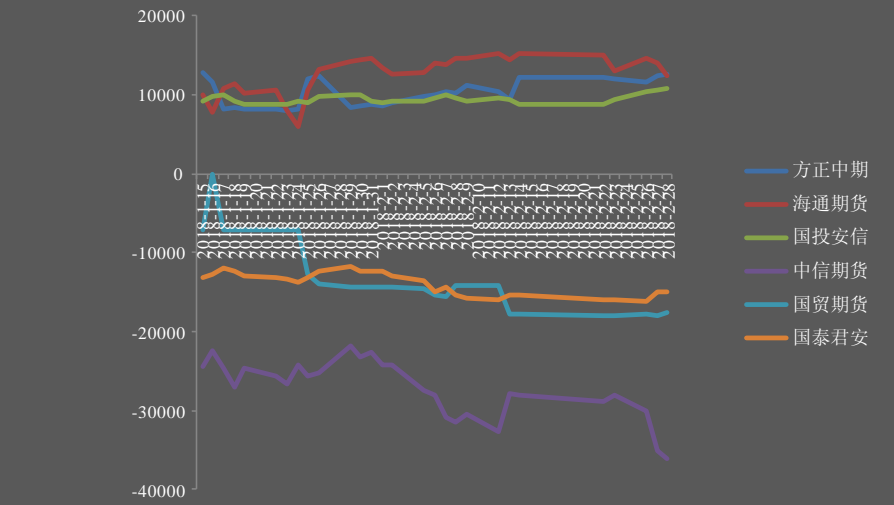
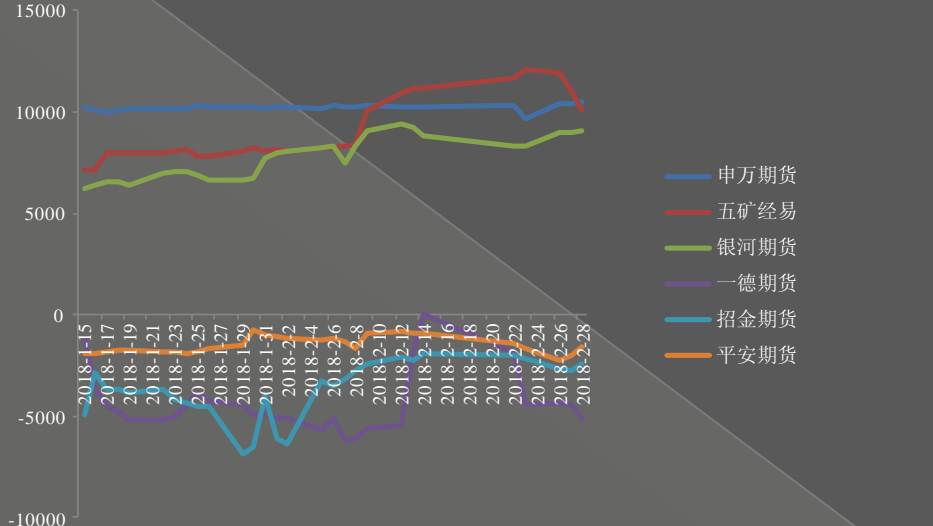
## 近5日持仓变化

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	9.98%	9.96%	17.81%	-8.54%	-10.37%	-19.99%	18.52%	☆☆
玉米	15.54%	16.68%	14.89%	-26.46%	-26.96%	-27.17%	42.01%	☆☆☆
棕榈油	-10.84%	-11.60%	-4.67%	2.79%	3.03%	-1.90%	-13.63%	☆☆
动力煤	18.01%	16.04%	11.85%	-18.67%	-19.68%	-20.08%	36.68%	☆☆☆
聚丙烯	-2.94%	-1.37%	1.97%	-8.68%	-8.20%	-7.22%	5.74%	☆
橡胶	-0.91%	-1.54%	0.21%	2.73%	2.36%	3.78%	-3.64%	☆
棉花	-8.19%	-3.71%	-3.13%	-1.68%	-1.26%	2.14%	-6.51%	☆
鸡蛋	13.44%	17.13%	11.40%	-0.99%	-5.21%	-7.15%	14.43%	☆☆
菜籽粕	16.62%	18.45%	15.63%	-1.37%	-2.22%	-7.26%	17.99%	☆☆
铁矿石	-2.90%	-8.04%	2.85%	-14.62%	-13.95%	-12.74%	11.71%	☆☆
豆油	5.91%	4.36%	2.79%	-2.17%	-5.51%	-3.54%	8.08%	☆
沪镍	11.91%	10.73%	13.27%	-8.11%	-11.46%	-10.76%	20.01%	☆☆
焦炭	3.64%	11.80%	25.44%	-9.52%	-17.71%	-22.86%	13.16%	☆☆
沥青	-3.72%	3.36%	3.12%	0.35%	-1.57%	-2.54%	-4.07%	☆
沪银	4.90%	-0.88%	6.14%	-9.21%	-11.37%	-15.87%	14.12%	☆☆
沪铝	6.20%	4.55%	-0.51%	-1.36%	-2.52%	-4.26%	7.56%	☆
沪金	-9.25%	-6.52%	-0.54%	-23.22%	-27.09%	-23.04%	13.97%	☆☆
焦煤	32.40%	28.64%	44.25%	-38.71%	-37.66%	-48.10%	71.10%	☆☆☆☆
沪锌	-10.83%	-2.72%	-6.03%	-0.13%	1.01%	2.21%	-10.70%	☆☆
聚乙烯	26.09%	20.13%	14.34%	-21.60%	-16.92%	-9.19%	47.68%	☆☆☆
沪铜	4.32%	2.95%	2.67%	-3.42%	-4.34%	-3.27%	7.73%	☆
豆粕	20.71%	21.96%	12.41%	-7.12%	-6.38%	-10.07%	27.83%	☆☆
螺纹钢	-0.29%	-6.26%	5.69%	-14.24%	-12.96%	-10.79%	13.95%	☆☆
PTA	-10.02%	-0.61%	10.26%	-5.35%	-7.53%	-18.73%	-4.67%	☆
白糖	3.51%	1.92%	3.32%	-7.37%	-6.44%	-7.69%	10.88%	☆☆
玻璃	38.06%	26.81%	17.40%	7.69%	4.06%	-10.66%	30.37%	☆☆☆



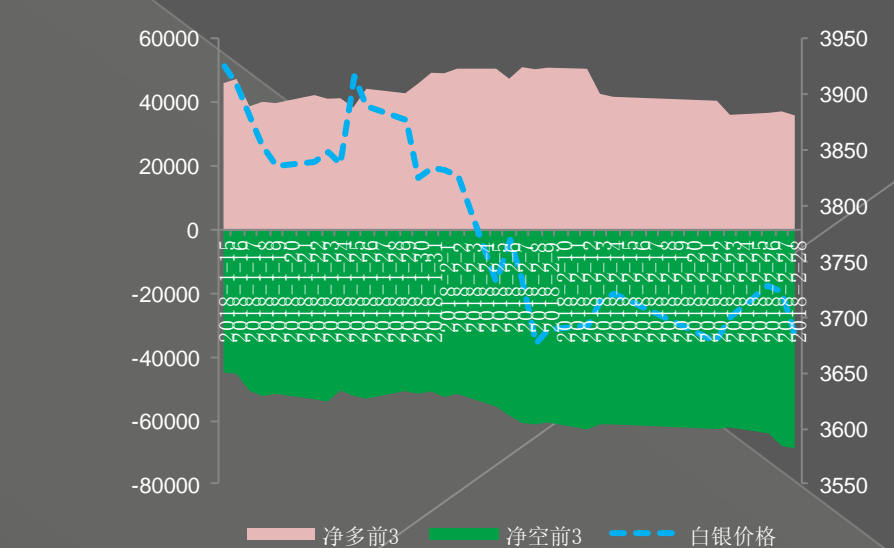
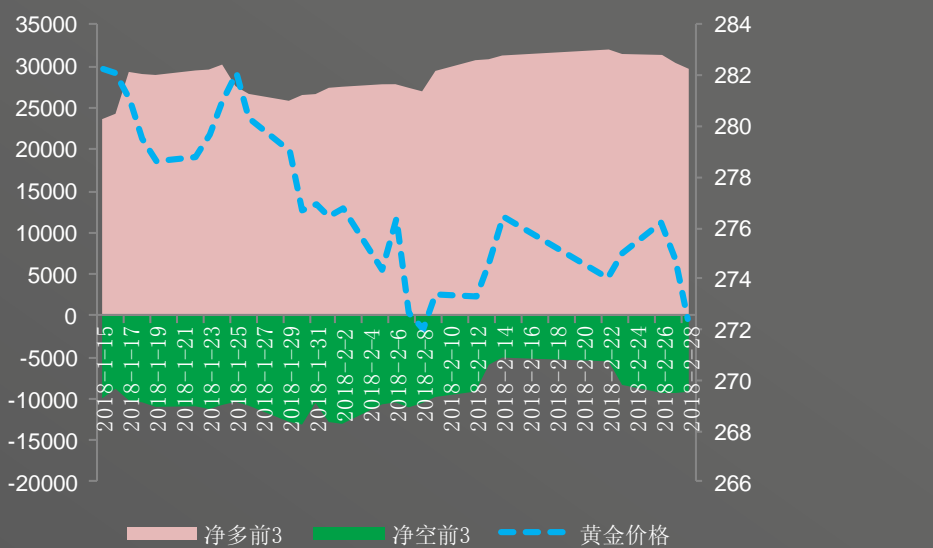


# 金属板块：AU & AG



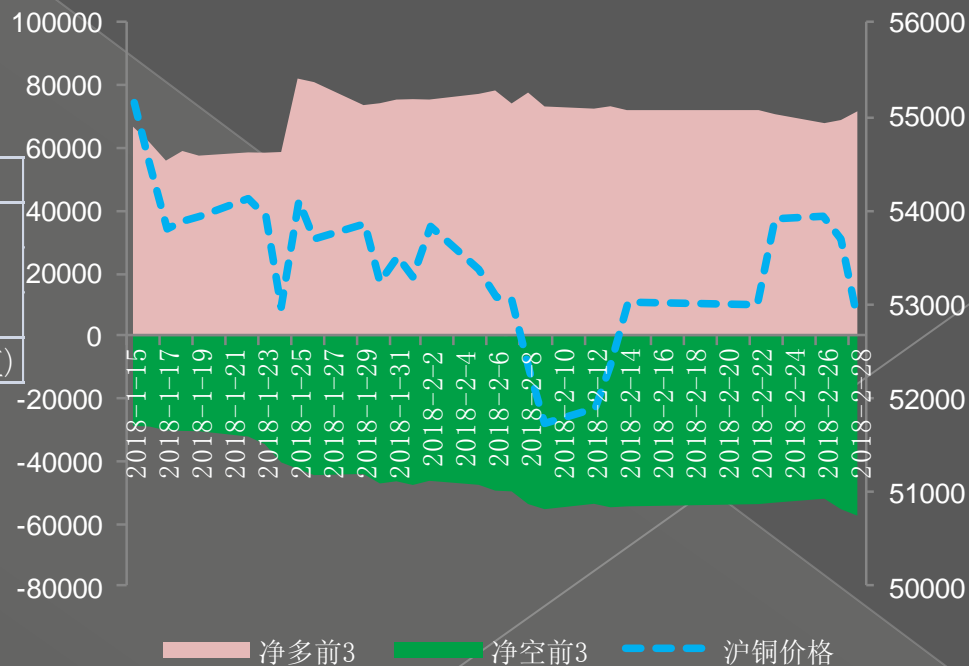
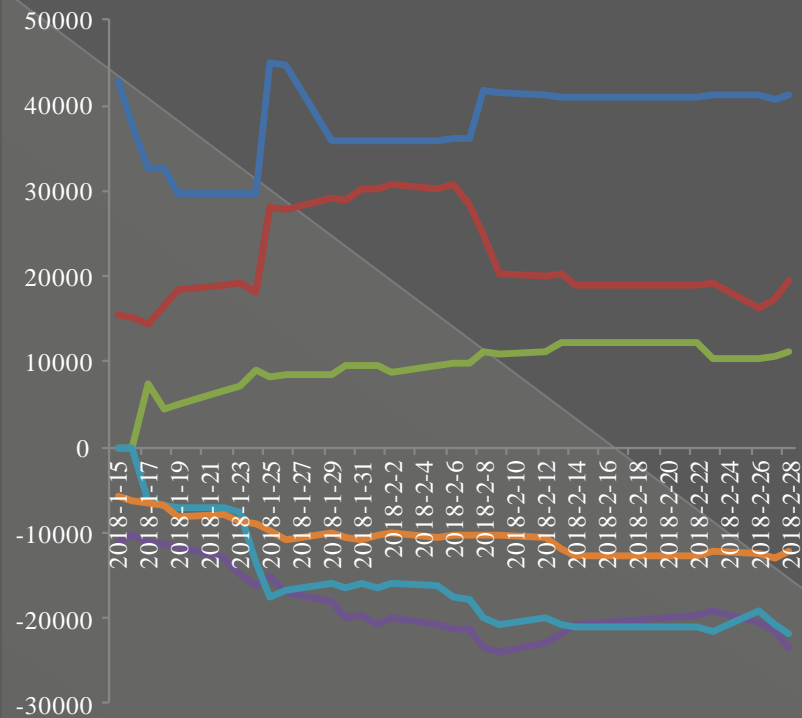
变动幅度		当日	最近5日	平均变化	波动率
au持仓	多头前3	-2.34%	-5.12%	-1.02%	9.63%
	空头前3	-1.66%	81.91%	16.38%	
au涨幅		-0.86%	-1.46%	-0.29%	
震荡幅度	0.98%	0.68%(月均值)	投机度	0.46	0.39(月均值)

变动幅度		当日	最近5日	平均变化	波动率
ag持仓	多头前3	-3.38%	-13.89%	-2.78%	15.60%
	空头前3	1.00%	12.37%	2.47%	
ag涨幅		-0.94%	-0.90%	-0.18%	
震荡幅度	1.32%	1.04%(月均值)	投机度	0.58	0.50(月均值)



# 金属板块：Cu

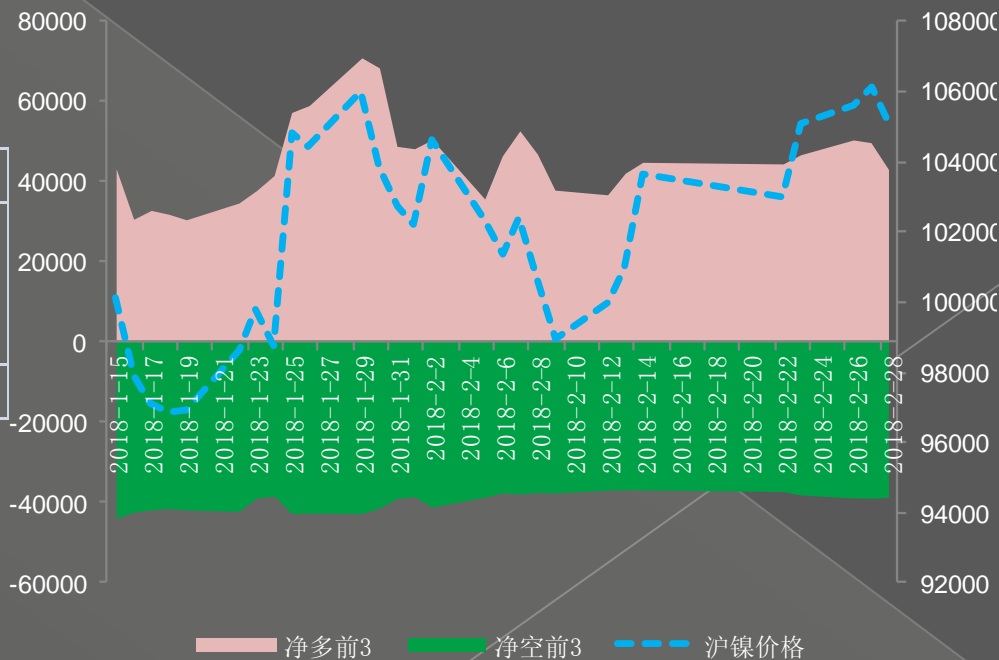
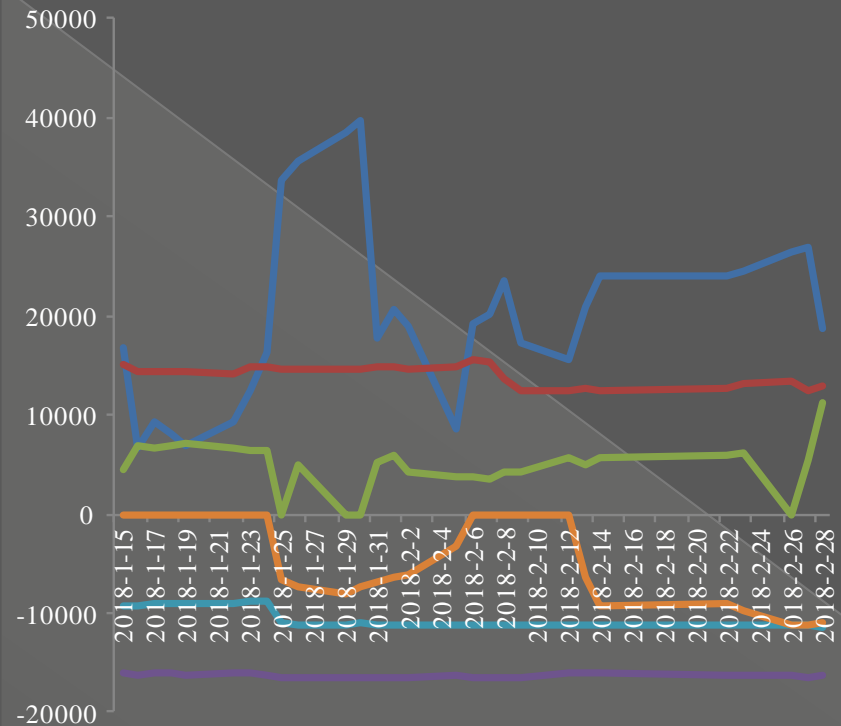
- 格林大华
- 永安期货
- 弘业期货
- 五矿经易
- 中信期货
- 海通期货



变动幅度		当日	最近5日	平均变化	波动率
cu持仓	多头前3	4.04%	-0.51%	-0.10%	16.56%
	空头前3	3.74%	5.46%	1.09%	
cu涨幅		-1.47%	-0.20%	-0.04%	
震荡幅度	1.35%	1.41%(月均值)	投机度	0.59	0.58(月均值)

# 金属板块：Ni

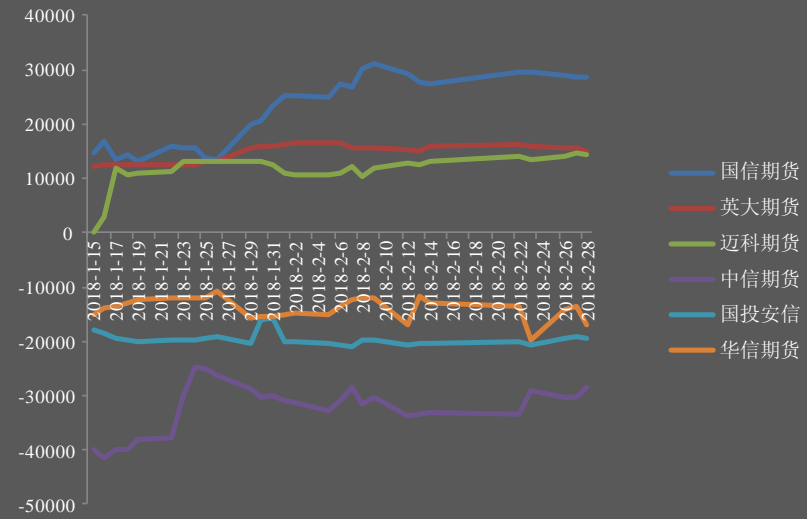
- 永安期货
- 国贸期货
- 方正中期
- 兴业期货
- 江海汇鑫
- 银河期货



变动幅度		当日	最近5日	平均变化	波动率
ni持仓	多头前3	-13.48%	-3.99%	-0.80%	30.30%
	空头前3	-0.47%	5.02%	1.00%	
ni涨幅		-0.93%	1.48%	0.30%	
震荡幅度	1.91%	2.67%(月均值)	投机度	1.23	1.56(月均值)

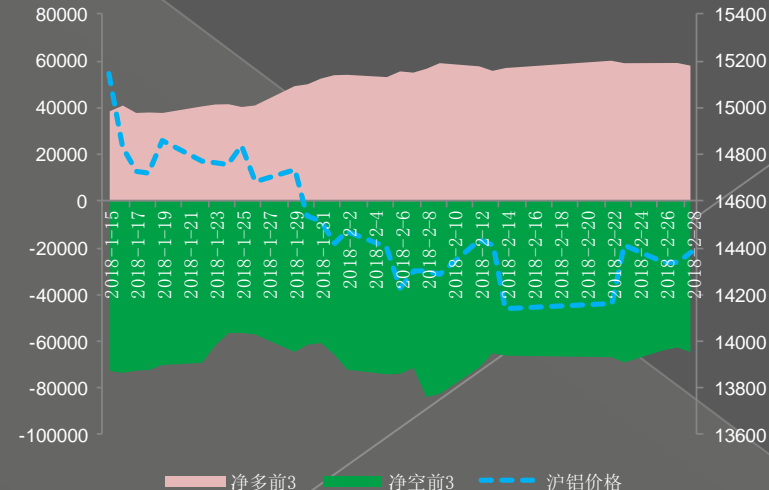
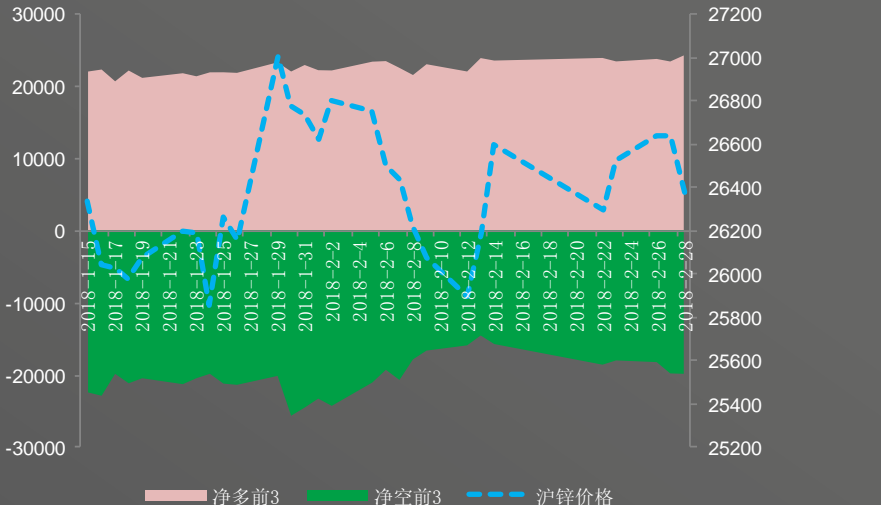


# 金属板块：Zn & Al

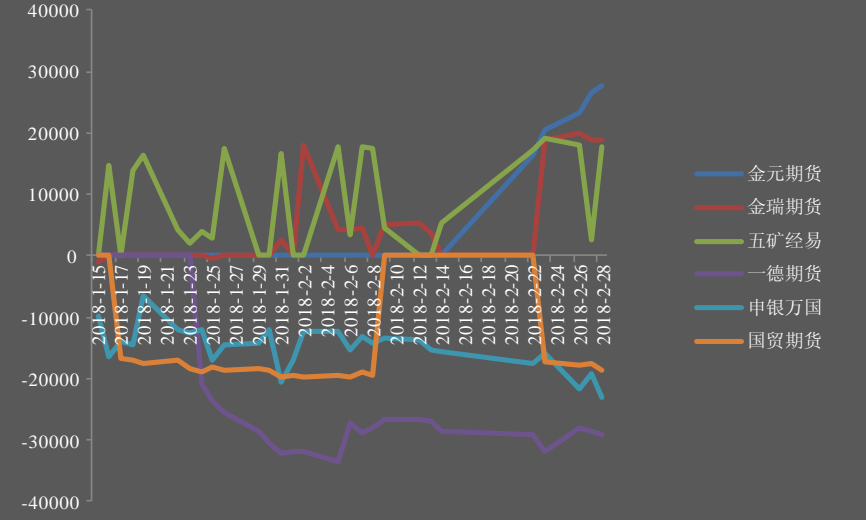
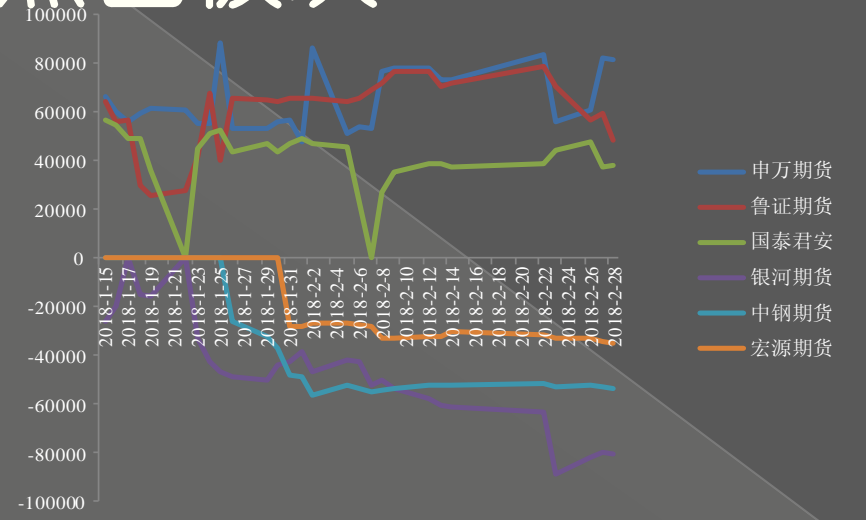


变动幅度		当日	最近5日	平均变化	波动率
zn持仓	多头前3	3.59%	3.02%	0.60%	17.28%
	空头前3	0.28%	26.16%	5.23%	
zn涨幅		-0.96%	-0.82%	-0.16%	
震荡幅度	1.22%	1.55% (月均值)	投机度	1.15	1.04 (月均值)

变动幅度		当日	最近5日	平均变化	波动率
al持仓	多头前3	-1.91%	1.80%	0.36%	12.73%
	空头前3	3.06%	-2.40%	-0.48%	
al涨幅		0.34%	1.72%	0.34%	
震荡幅度	1.10%	1.50% (月均值)	投机度	0.62	0.57 (月均值)

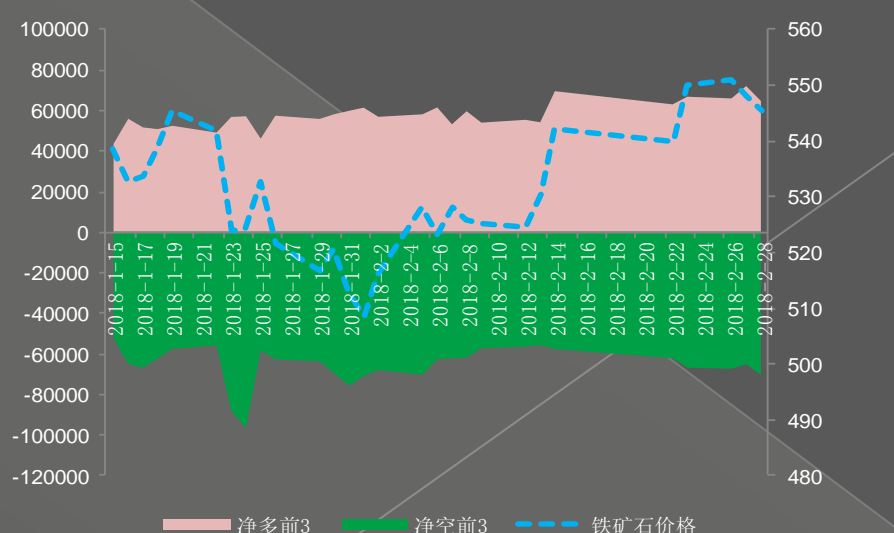
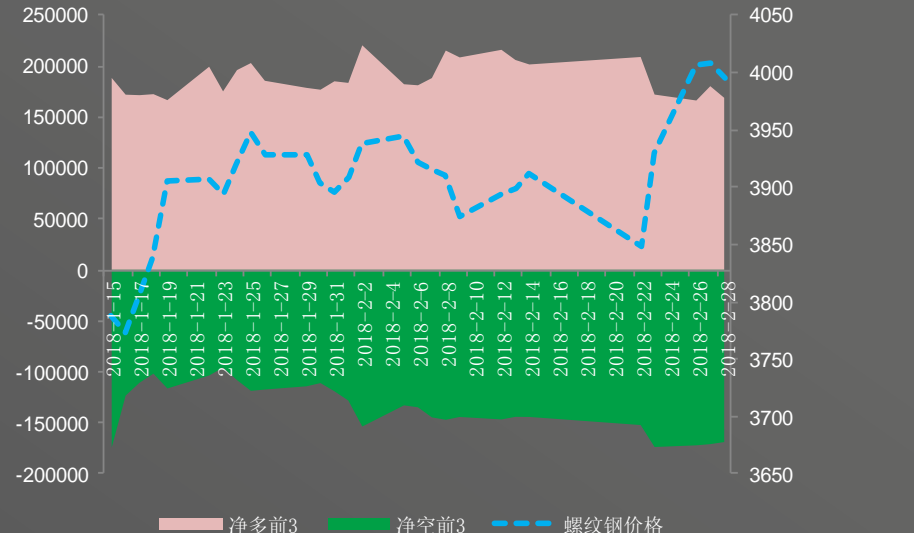


# 黑色板块：Rb & I

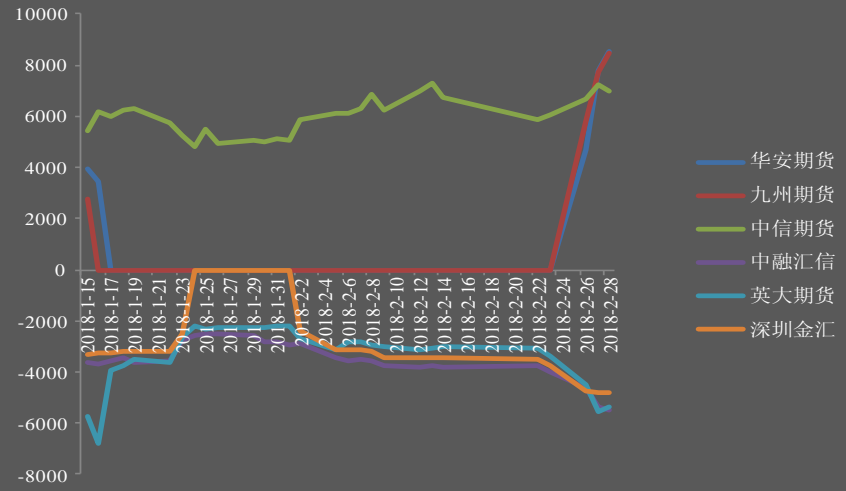
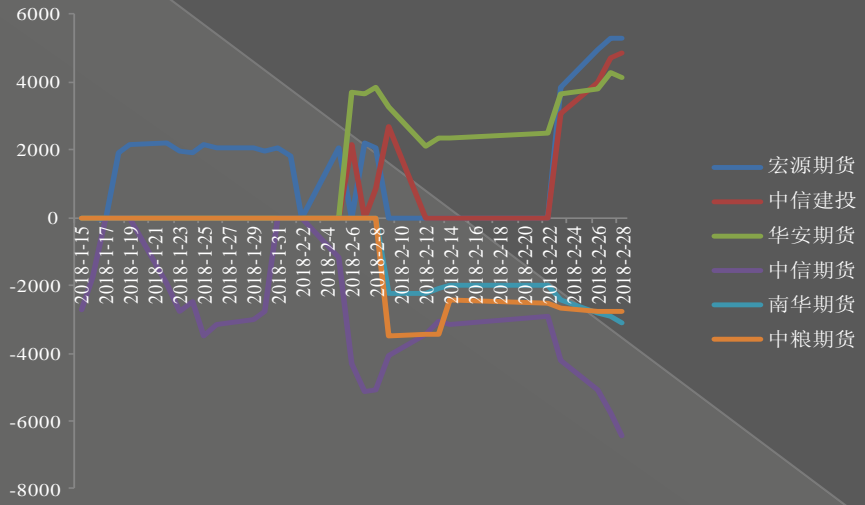


变动幅度		当日	最近5日	平均变化	波动率
rb持仓	多头前3	-6.33%	-16.24%	-3.25%	13.31%
	空头前3	-1.18%	17.08%	3.42%	
rb涨幅		-0.36%	2.13%	0.43%	
震荡幅度	0.69%	1.47%(月均值)	投机度	0.70	0.84(月均值)

变动幅度		当日	最近5日	平均变化	波动率
I持仓	多头前3	-10.23%	-6.96%	-1.39%	22.38%
	空头前3	8.08%	22.00%	4.40%	
I涨幅		-0.51%	0.60%	0.12%	
震荡幅度	1.11%	2.20%(月均值)	投机度	0.77	0.96(月均值)

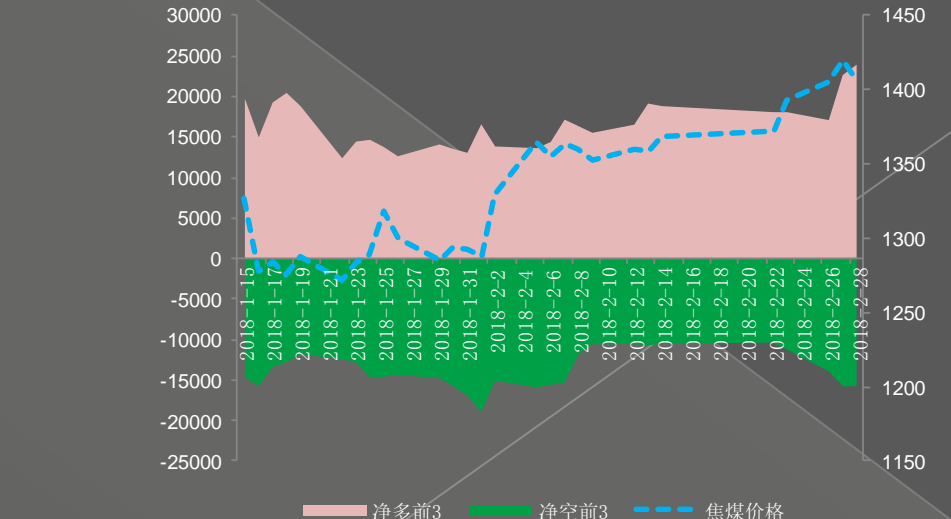
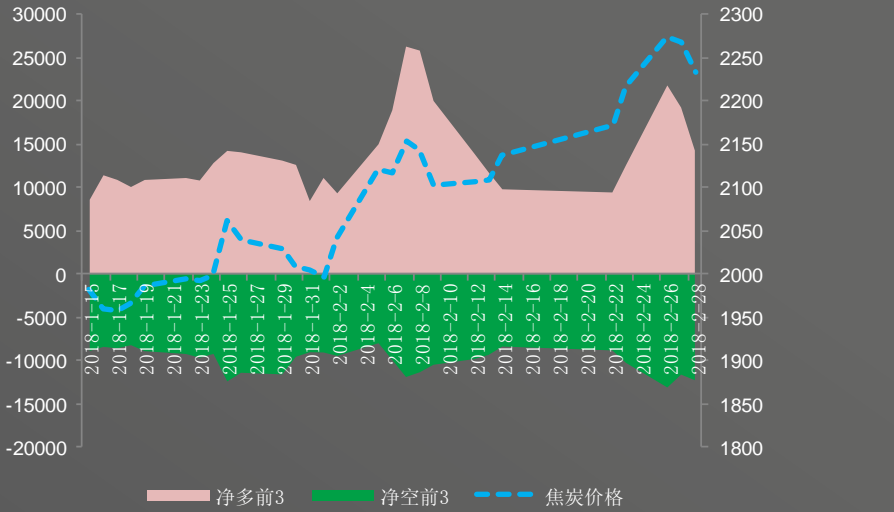


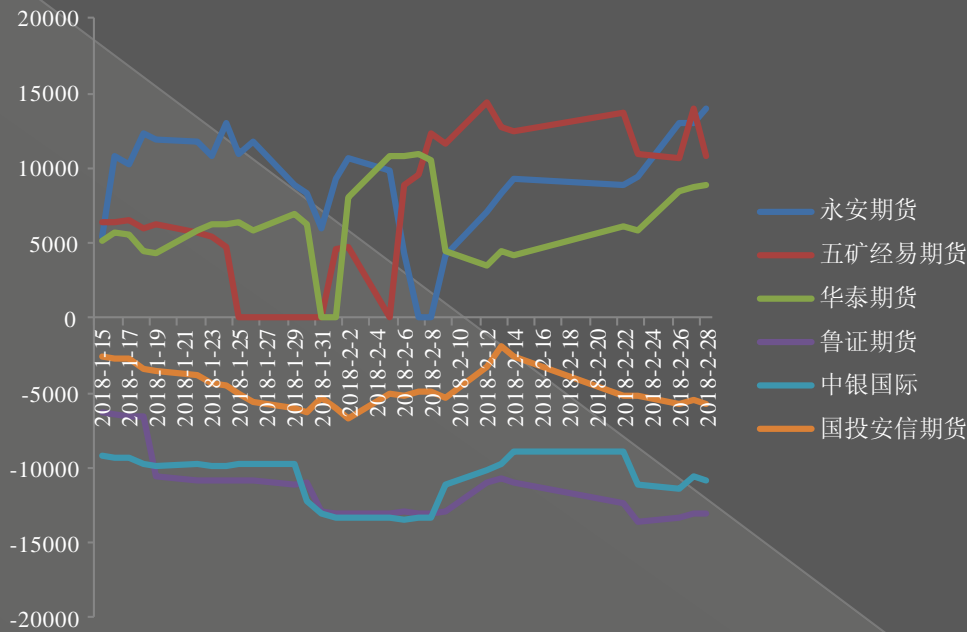
# 黑色板块：J & JM



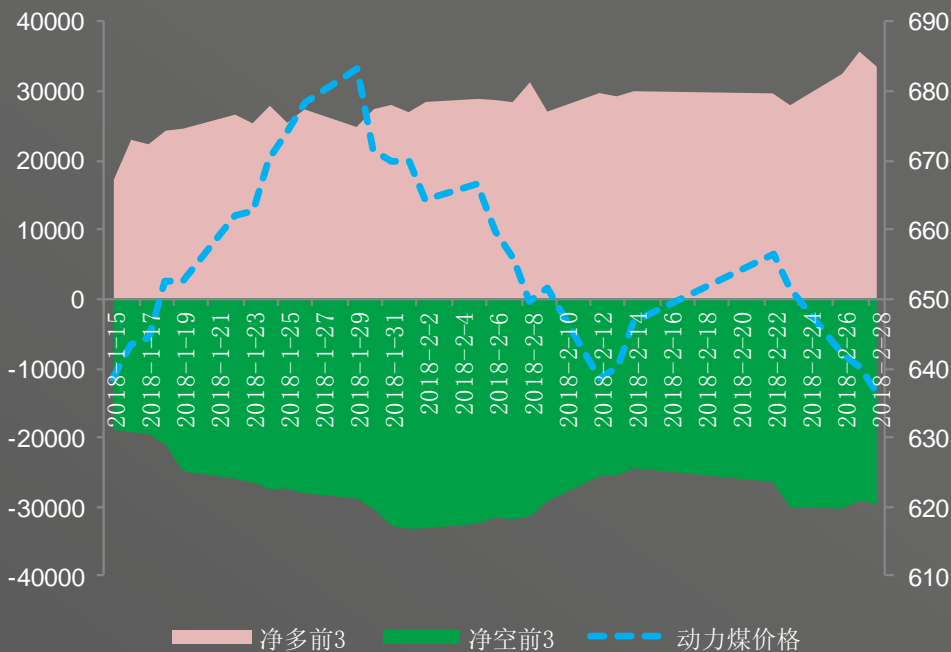
变动幅度		当日	最近5日	平均变化	波动率
j持仓	多头前3	-25.76%	45.48%	9.10%	24.41%
	空头前3	5.59%	46.67%	9.33%	
j涨幅		-1.49%	4.54%	0.91%	
震荡幅度	2.02%	2.42%(月均值)	投机度	0.93	1.03(月均值)

变动幅度		当日	最近5日	平均变化	波动率
jm持仓	多头前3	5.65%	27.06%	5.41%	18.90%
	空头前3	-0.27%	50.02%	10.00%	
jm涨幅		-1.05%	2.62%	0.52%	
震荡幅度	1.75%	2.37%(月均值)	投机度	0.84	1.06(月均值)



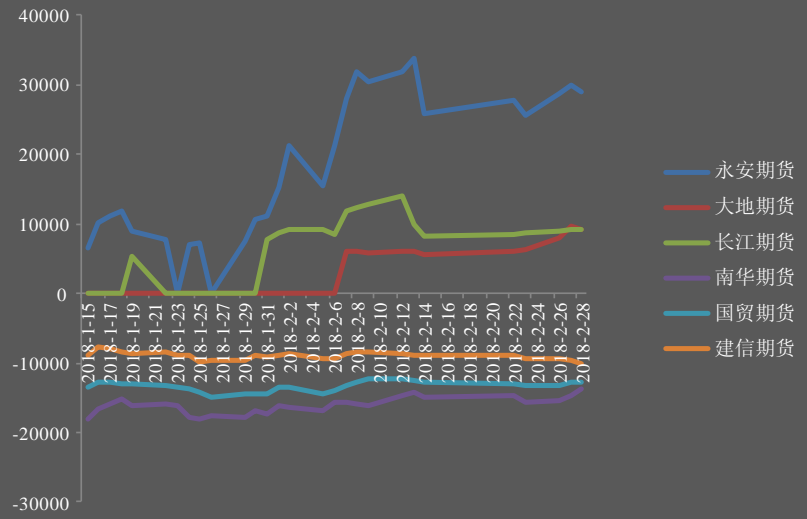
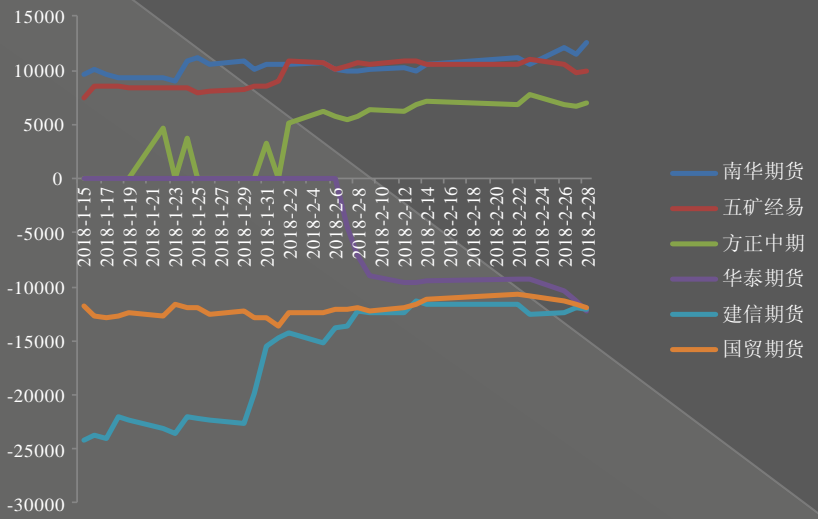


# 黑色：动力煤



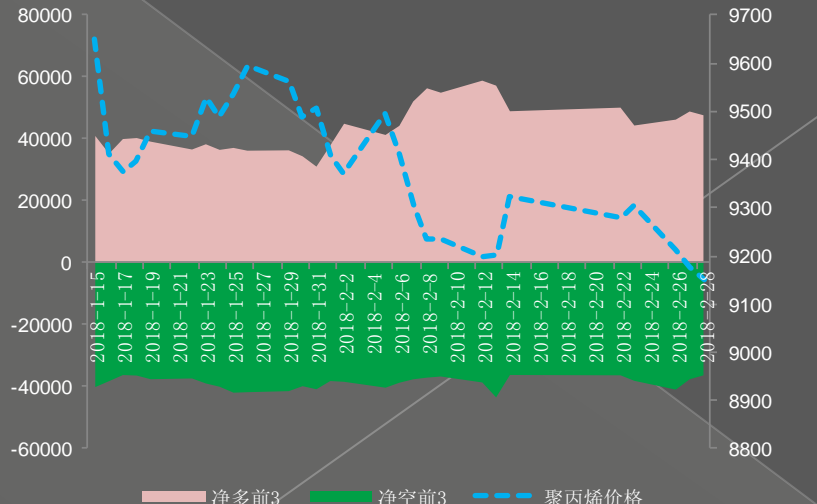
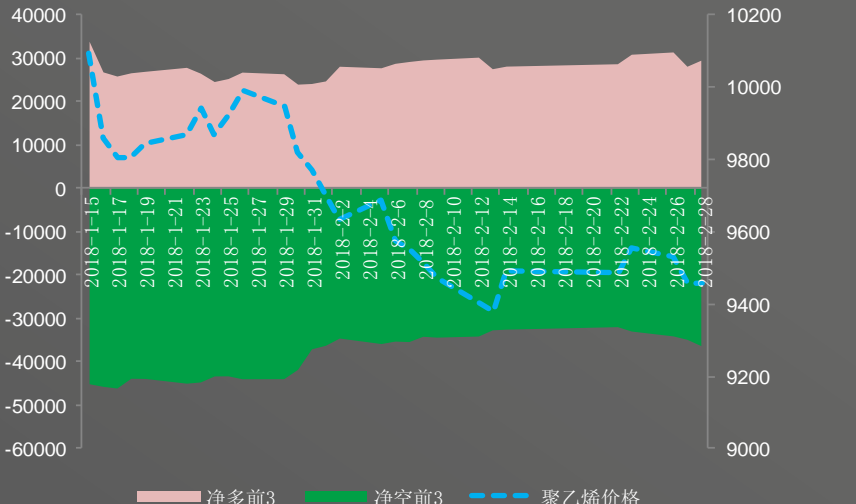
变动幅度		当日	最近5日	平均变化	波动率
zc持仓	多头前3	-6.10%	11.85%	2.37%	14.93%
	空头前3	1.48%	20.94%	4.19%	
zc涨幅		-0.61%	-1.62%	-0.32%	
震荡幅度	1.21%	1.43%(月均值)	投机度	0.66	0.69(月均值)

# 化工：塑料 & PP

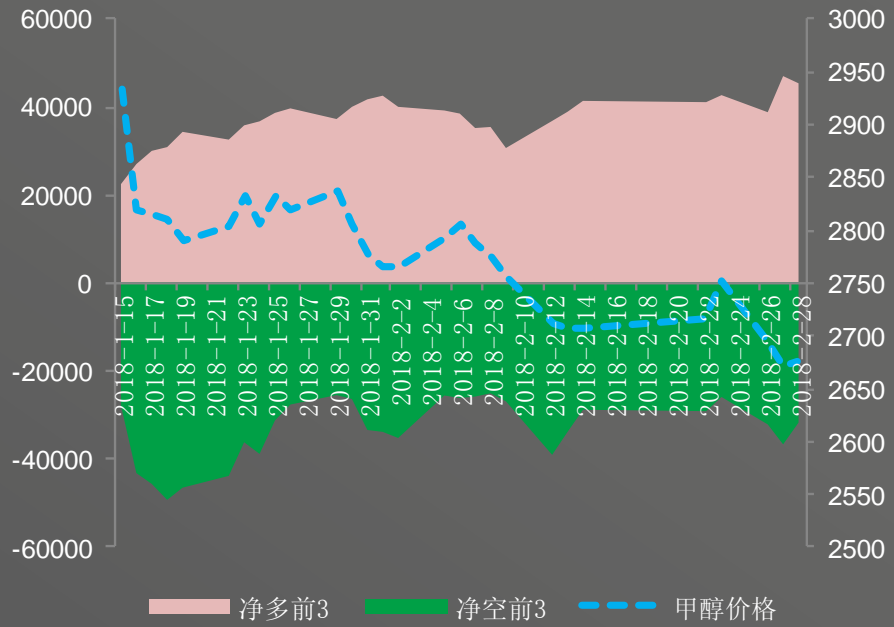
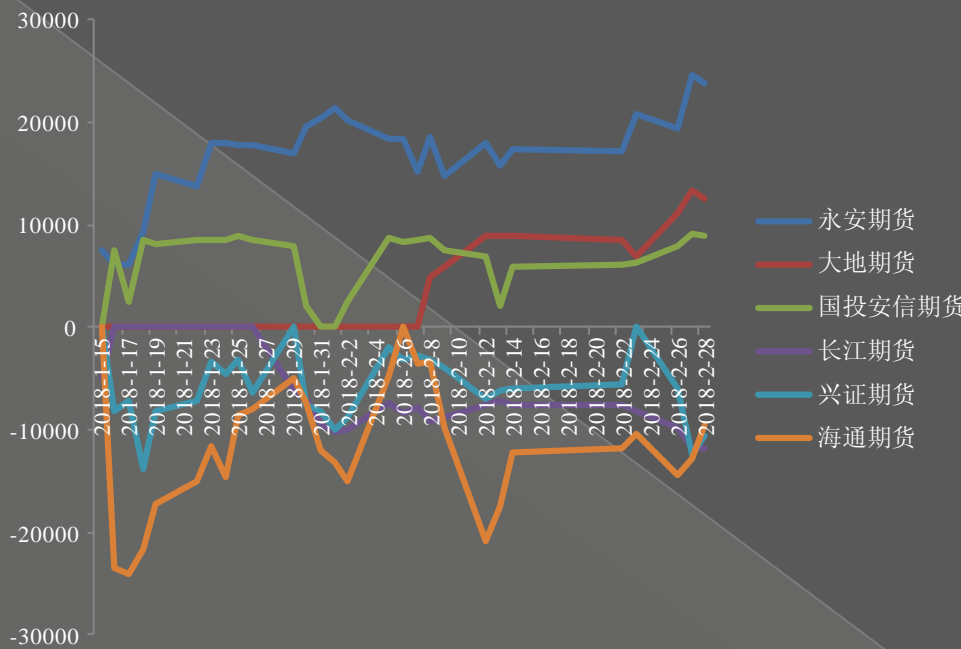


变动幅度		当日	最近5日	平均变化	波动率
I持仓	多头前3	4.96%	4.85%	0.97%	10.59%
	空头前3	4.15%	11.67%	2.33%	
I涨幅		0.00%	-0.37%	-0.07%	
震荡幅度	0.61%	1.16%(月均值)	投机度	0.38	0.51(月均值)

变动幅度		当日	最近5日	平均变化	波动率
pp持仓	多头前3	-2.47%	-2.64%	-0.53%	11.31%
	空头前3	-3.38%	0.34%	0.07%	
pp涨幅		-0.27%	-1.84%	-0.37%	
震荡幅度	0.58%	1.21%(月均值)	投机度	0.42	0.59(月均值)

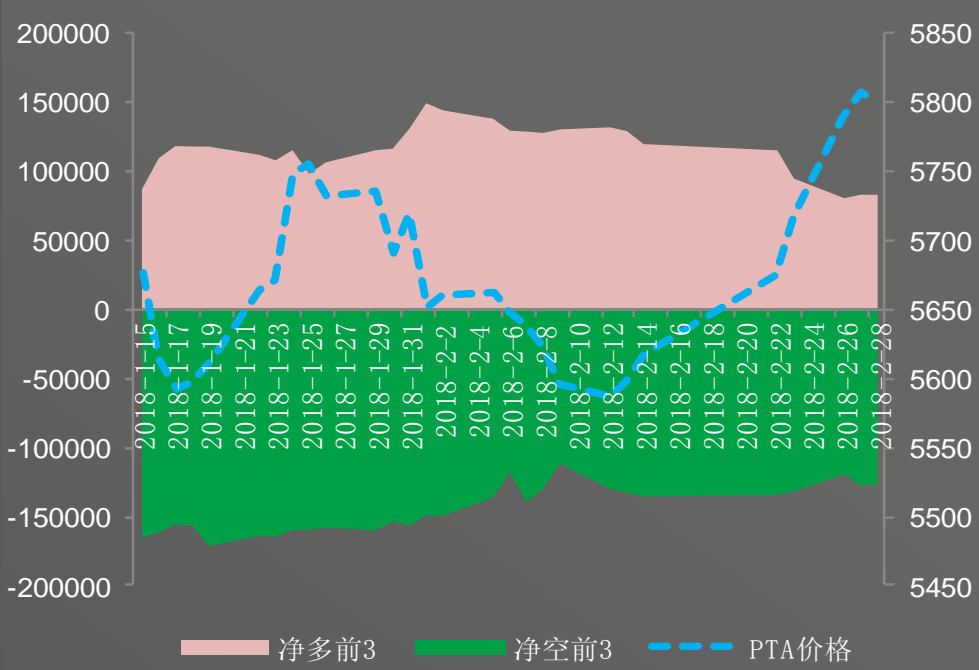
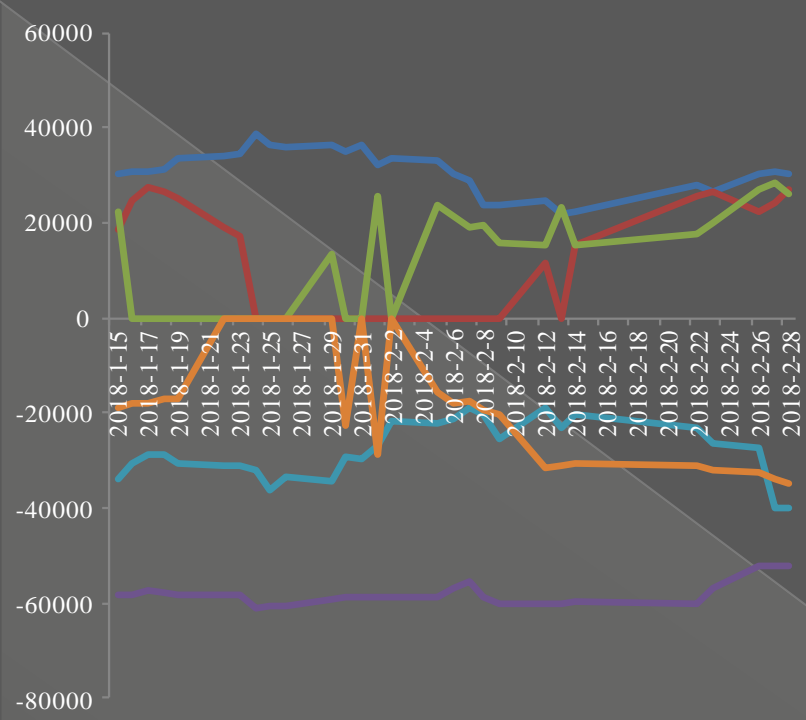


# 化工：甲醇



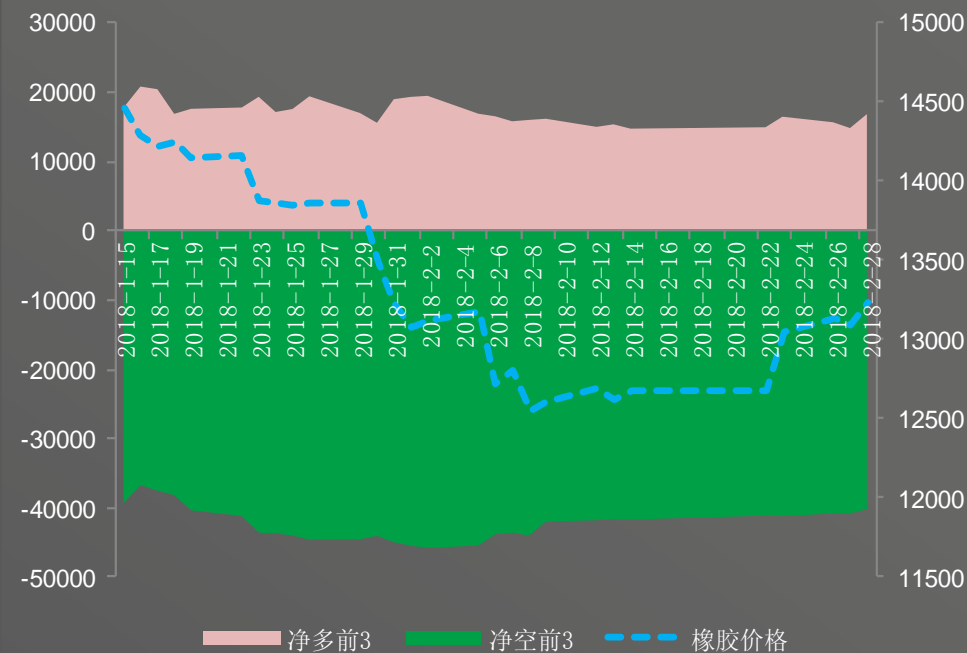
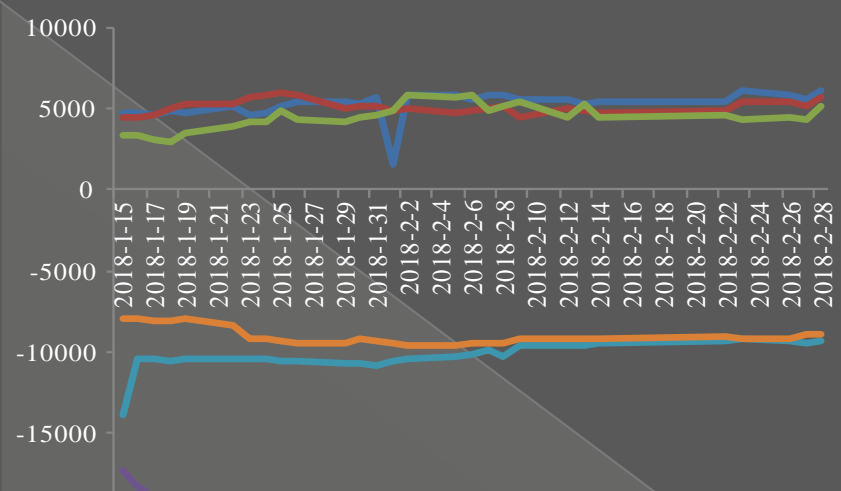
变动幅度		当日	最近5日	平均变化	波动率
ma持仓	多头前3	-3.49%	9.70%	1.94%	14.18%
	空头前3	-13.41%	10.08%	2.02%	
ma涨幅		0.12%	-1.20%	-0.24%	
震荡幅度	0.82%	1.60%(月均值)	投机度	0.85	1.09(月均值)

# 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	-0.11%	-30.83%	-6.17%	9.79%
	空头前3	-0.54%	-6.49%	-1.30%	
pta涨幅		-0.14%	3.26%	0.65%	
震荡幅度	0.98%	1.20%(月均值)	投机度	0.37	0.43(月均值)

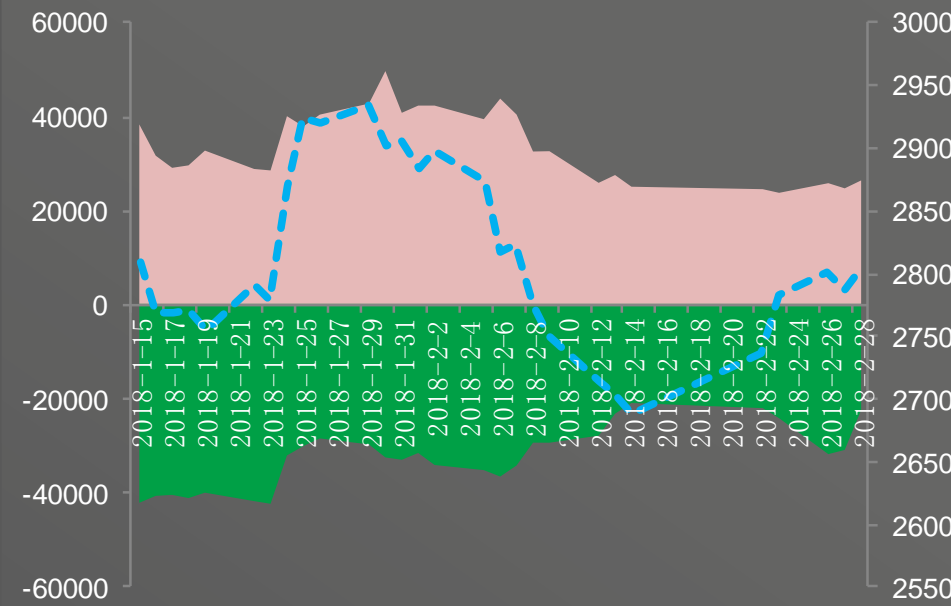
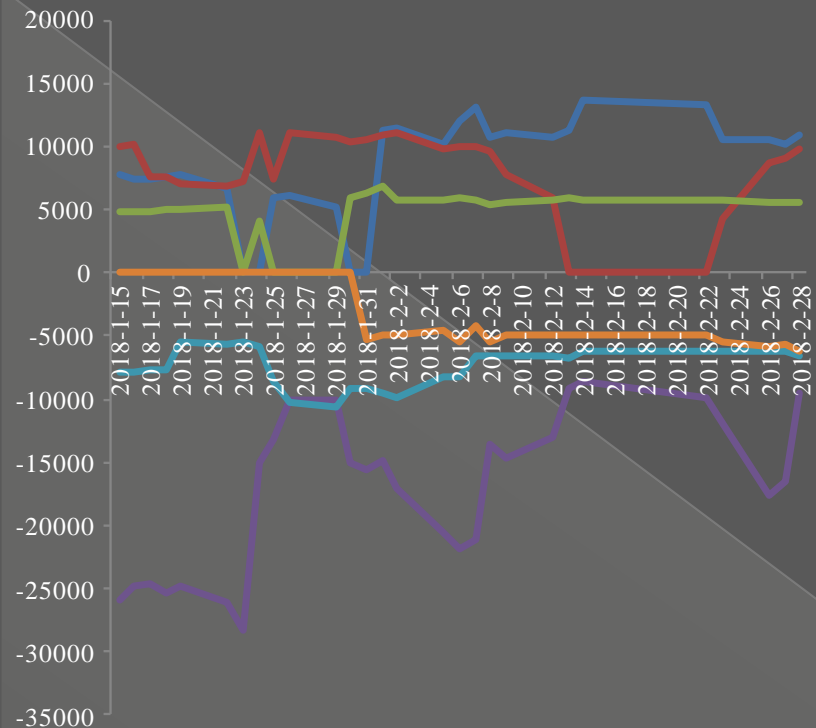
# 化工：橡胶



变动幅度		当日	最近5日	平均变化	波动率
ru持仓	多头前3	13.53%	14.15%	2.83%	22.60%
	空头前3	-1.53%	-3.61%	-0.72%	
ru涨幅		1.10%	4.40%	0.88%	
震荡幅度	2.83%	2.26%(月均值)	投机度	0.97	0.71(月均值)

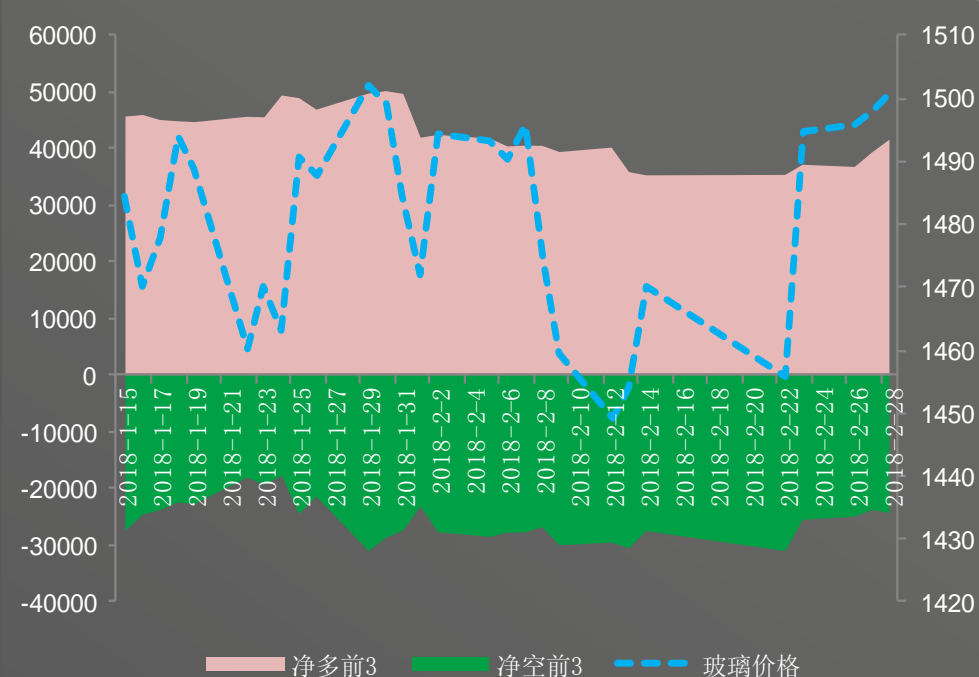
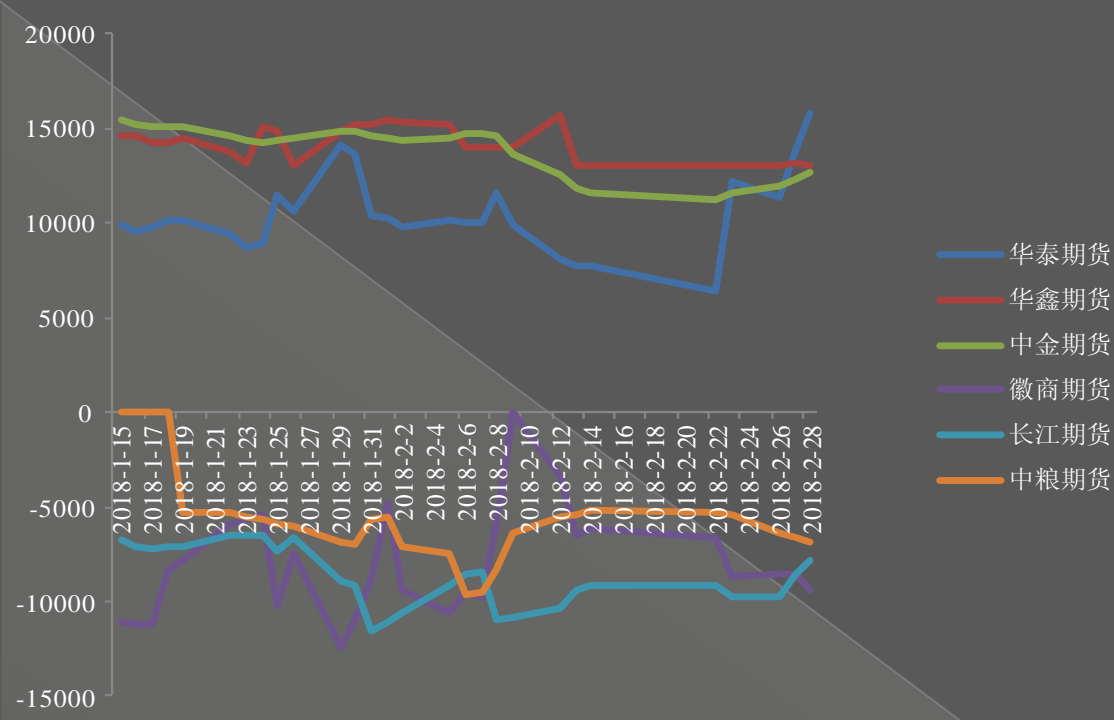


# 化工：沥青



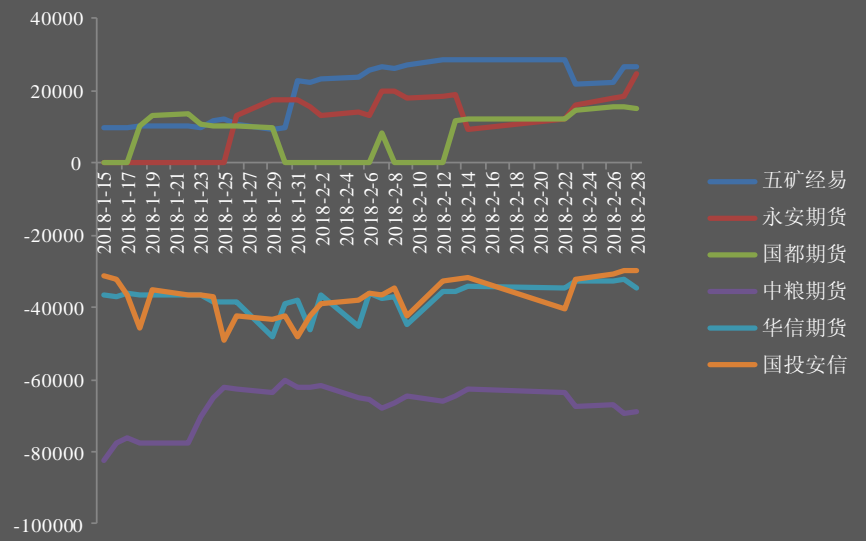
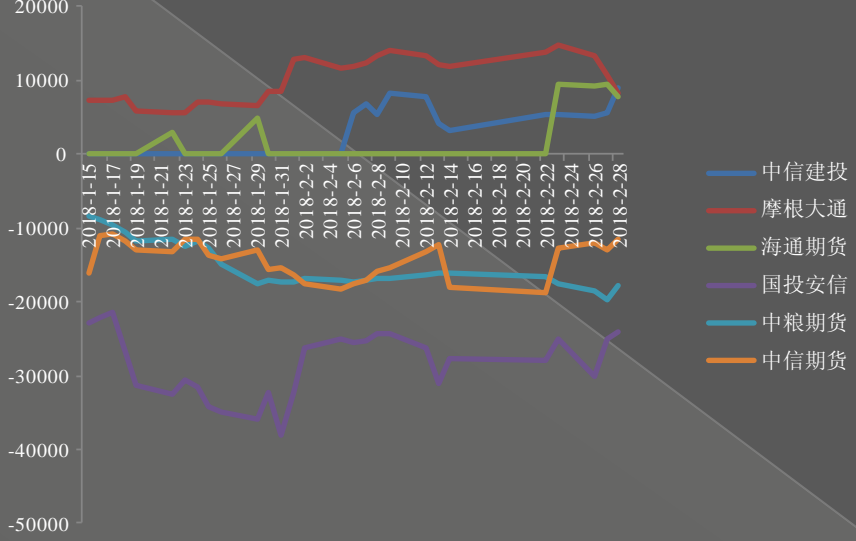
变动幅度		当日	最近5日	平均变化	波动率
bu持仓	多头前3	6.85%	5.36%	1.07%	20.13%
	空头前3	-27.35%	7.06%	1.41%	
bu涨幅		0.56%	4.28%	0.86%	
震荡幅度	1.96%	1.78%(月均值)	投机度	1.11	0.76(月均值)

# 化工：玻璃



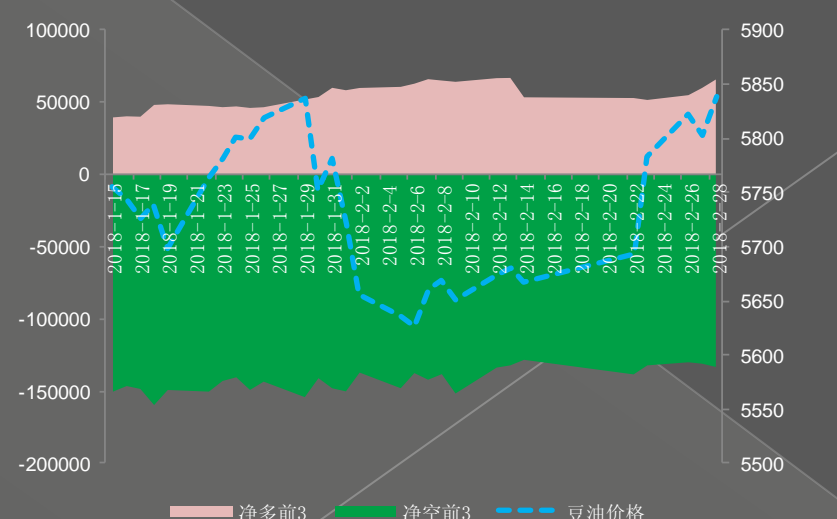
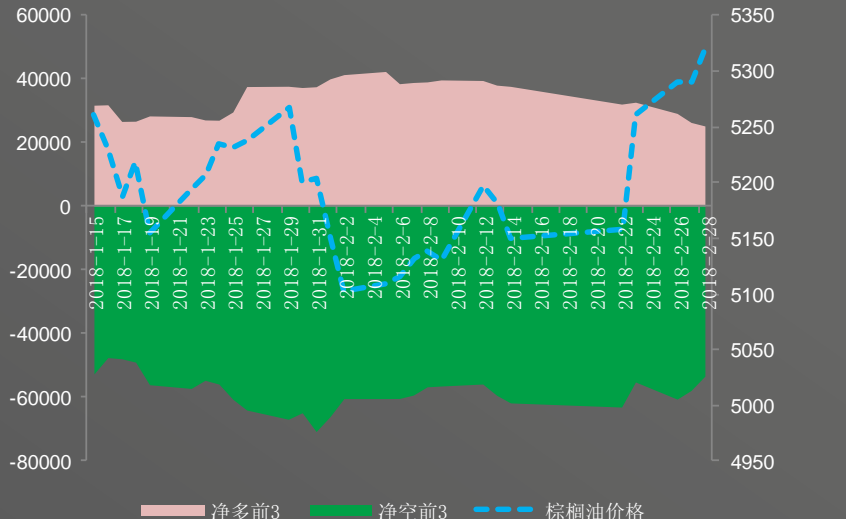
变动幅度		当日	最近5日	平均变化	波动率
fg持仓	多头前3	5.74%	17.86%	3.57%	16.17%
	空头前3	2.17%	-11.74%	-2.35%	
fg涨幅		0.21%	2.11%	0.42%	
震荡幅度	1.15%	1.65%(月均值)	投机度	0.47	0.53(月均值)

# 农产品：P & Y

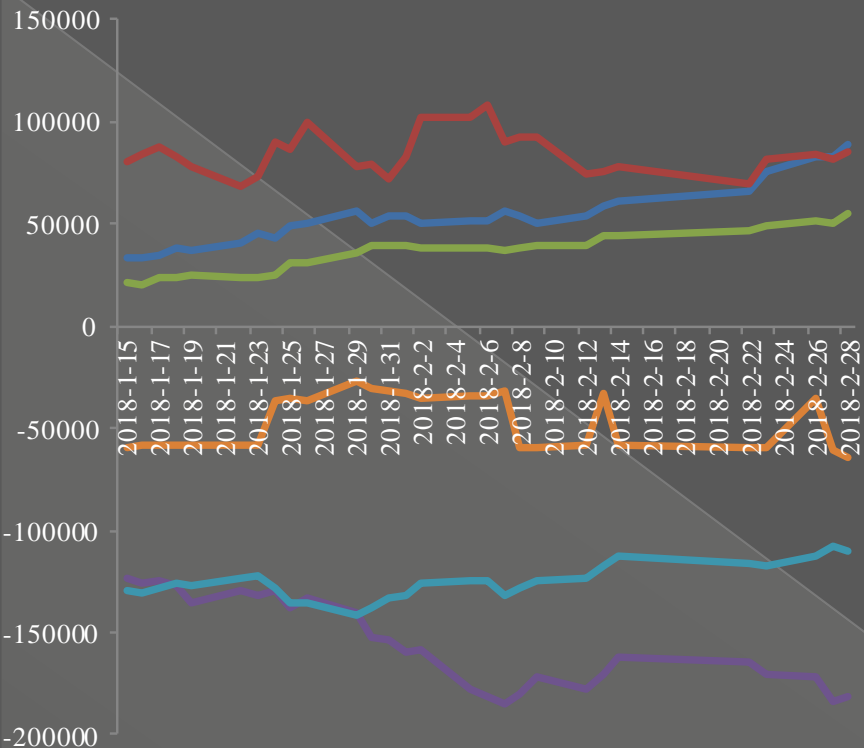


变动幅度		当日	最近5日	平均变化	波动率
p持仓	多头前3	-4.22%	-33.07%	-6.61%	11.46%
	空头前3	-7.78%	-13.61%	-2.72%	
p涨幅		0.61%	3.37%	0.67%	
震荡幅度	1.24%	1.19%(月均值)	投机度	0.53	0.48(月均值)

变动幅度		当日	最近5日	平均变化	波动率
y持仓	多头前3	9.65%	22.86%	4.57%	10.78%
	空头前3	1.72%	3.86%	0.77%	
y涨幅		0.60%	3.01%	0.60%	
震荡幅度	1.15%	1.11%(月均值)	投机度	0.37	0.30(月均值)

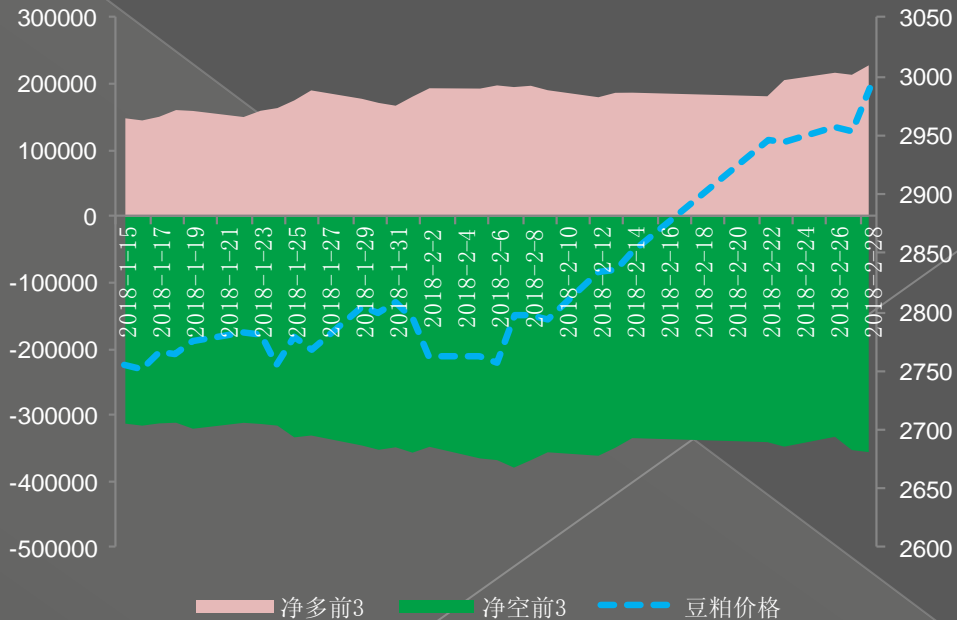


# 农产品：豆粕

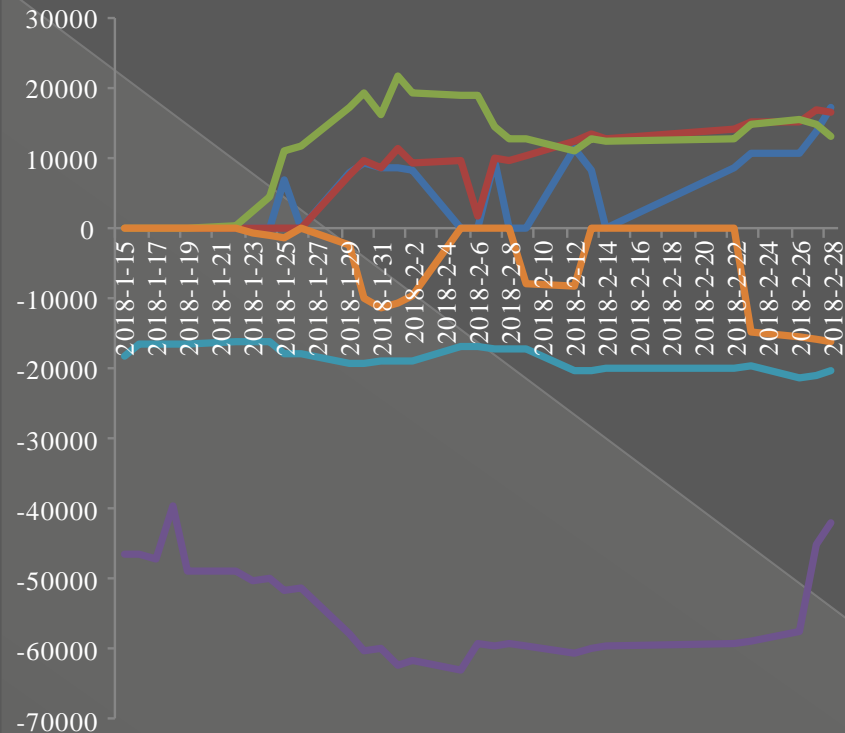


- 中信期货
- 永安期货
- 徽商期货
- 中粮期货
- 华信期货
- 新湖期货

变动幅度		当日	最近5日	平均变化	波动率
m持仓	多头前3	6.64%	22.03%	4.41%	15.23%
	空头前3	0.88%	6.33%	1.27%	
m涨幅		1.22%	4.89%	0.98%	
震荡幅度	1.51%	0.92%(月均值)	投机度	0.46	0.33(月均值)

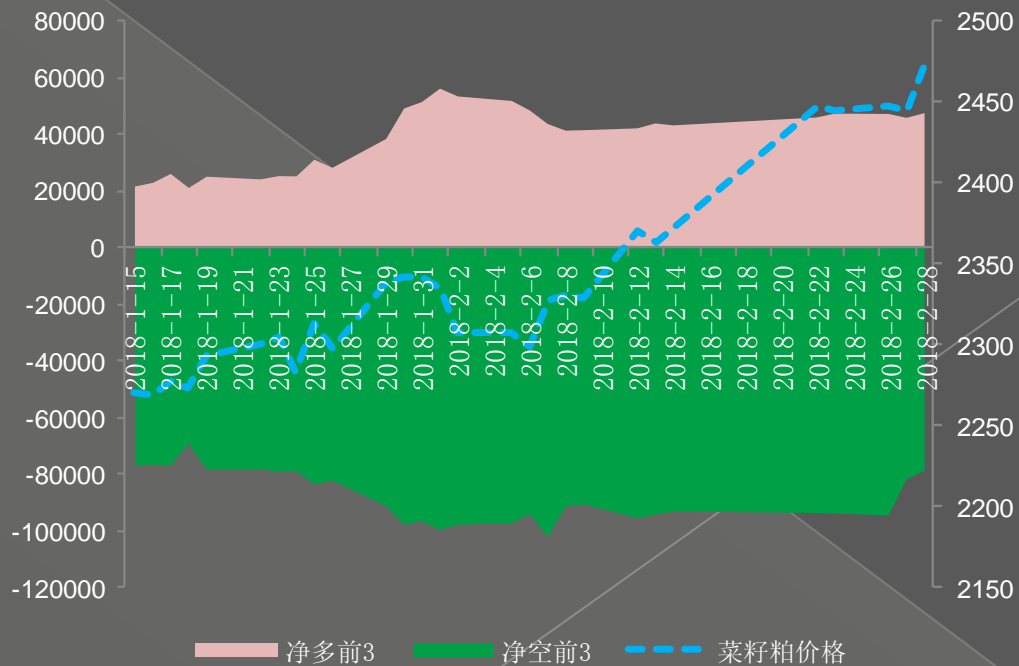


# 农产品：菜粕

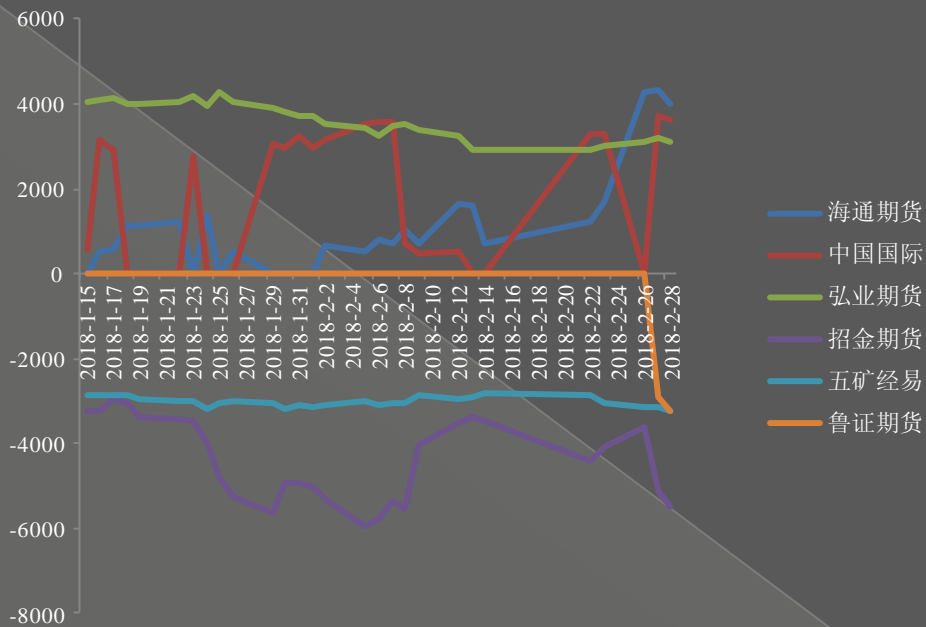


- 海通期货
- 中信期货
- 华泰期货
- 中粮期货
- 中国国际
- 国元期货

变动幅度		当日	最近5日	平均变化	波动率
rm持仓	多头前3	3.62%	10.00%	2.00%	16.06%
	空头前3	-3.90%	-15.60%	-3.12%	
rm涨幅		1.27%	4.36%	0.87%	
震荡幅度	1.47%	0.96%(月均值)	投机度	0.56	0.45(月均值)

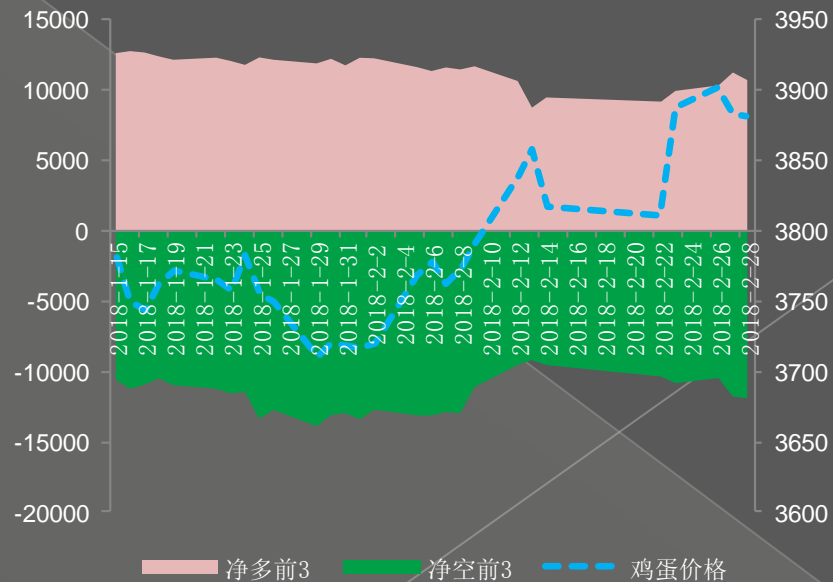


- 净多前3
- 净空前3
- 菜籽粕价格

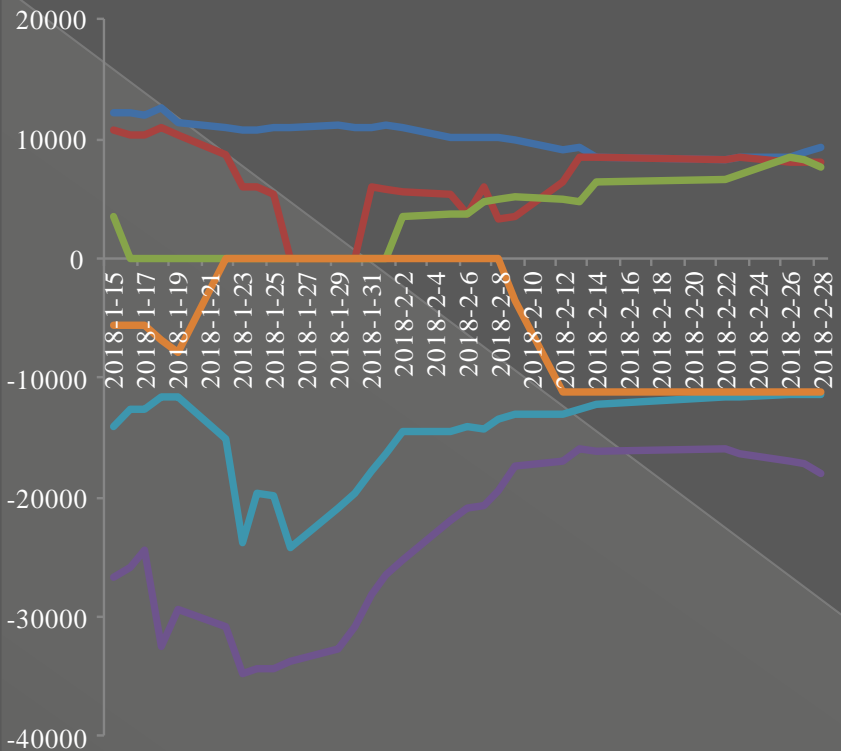


# 农产品：鸡蛋

变动幅度		当日	最近5日	平均变化	波动率
jd持仓	多头前3	-4.75%	12.92%	2.58%	11.68%
	空头前3	1.00%	25.00%	5.00%	
jd涨幅		-0.02%	1.71%	0.34%	
震荡幅度	0.74%	1.22%(月均值)	投机度	0.28	0.39(月均值)

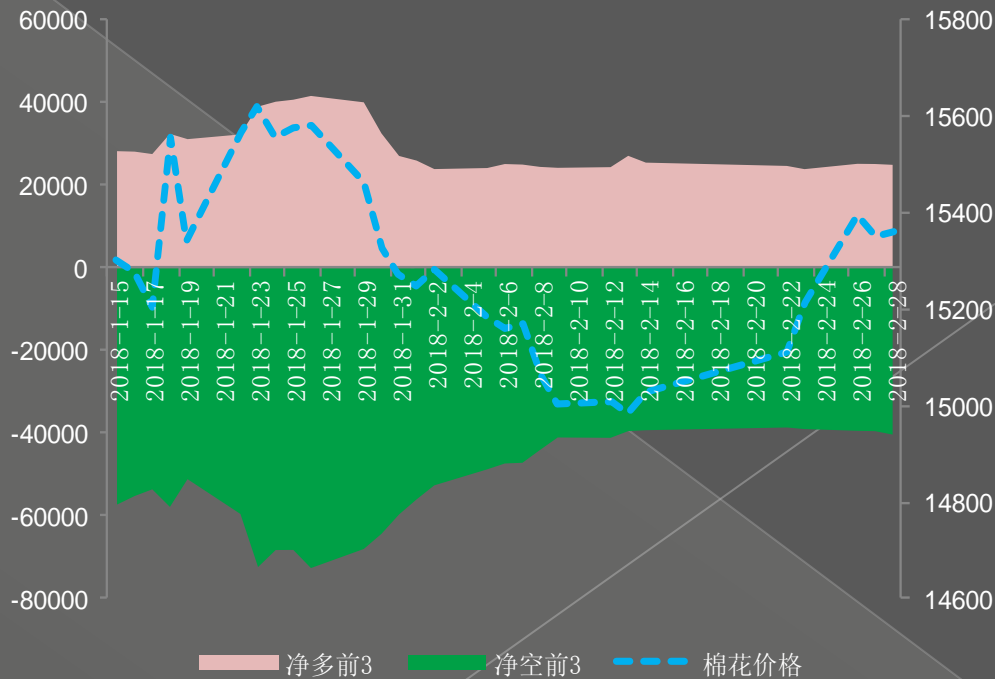


# 农产品：棉花

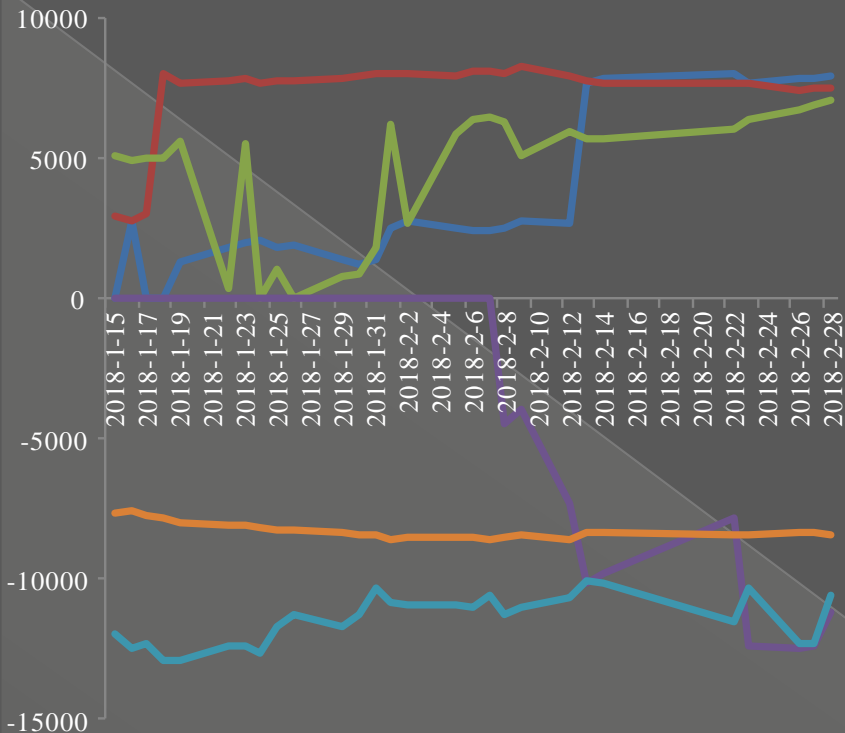


- 方正中期
- 银河期货
- 招商期货
- 华信期货
- 东证期货
- 格林大华期货

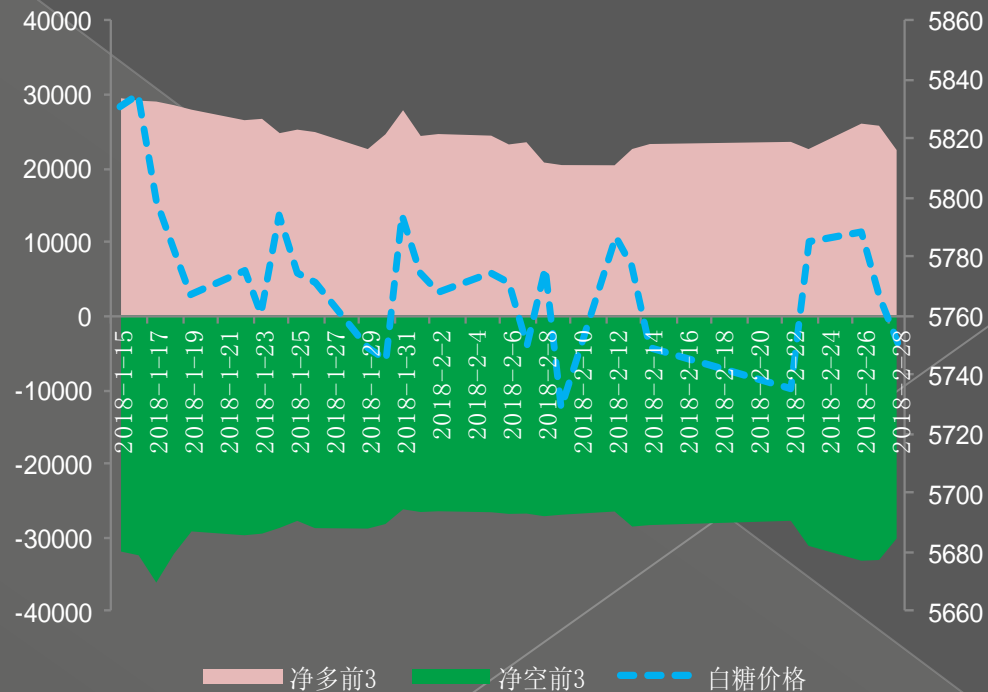
变动幅度		当日	最近5日	平均变化	波动率
cf持仓	多头前3	-0.78%	-2.08%	-0.42%	7.94%
	空头前3	2.12%	2.70%	0.54%	
cf涨幅		0.07%	2.22%	0.44%	
震荡幅度	0.54%	0.86%(月均值)	投机度	0.23	0.34(月均值)



# 农产品：白糖

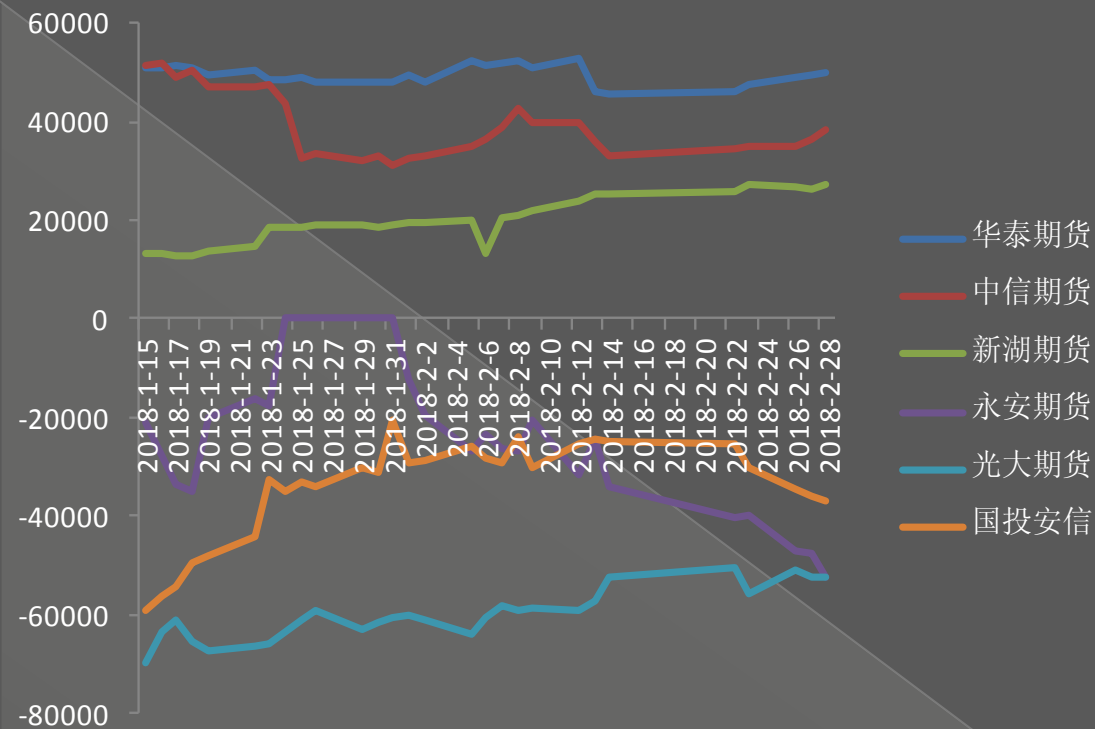


变动幅度		当日	最近5日	平均变化	波动率
sr持仓	多头前3	-12.83%	-3.50%	-0.70%	7.56%
	空头前3	-8.74%	6.44%	1.29%	
sr涨幅		-0.28%	0.03%	0.01%	
震荡幅度	0.98%	0.77% (月均值)	投机度	0.52	0.40 (月均值)

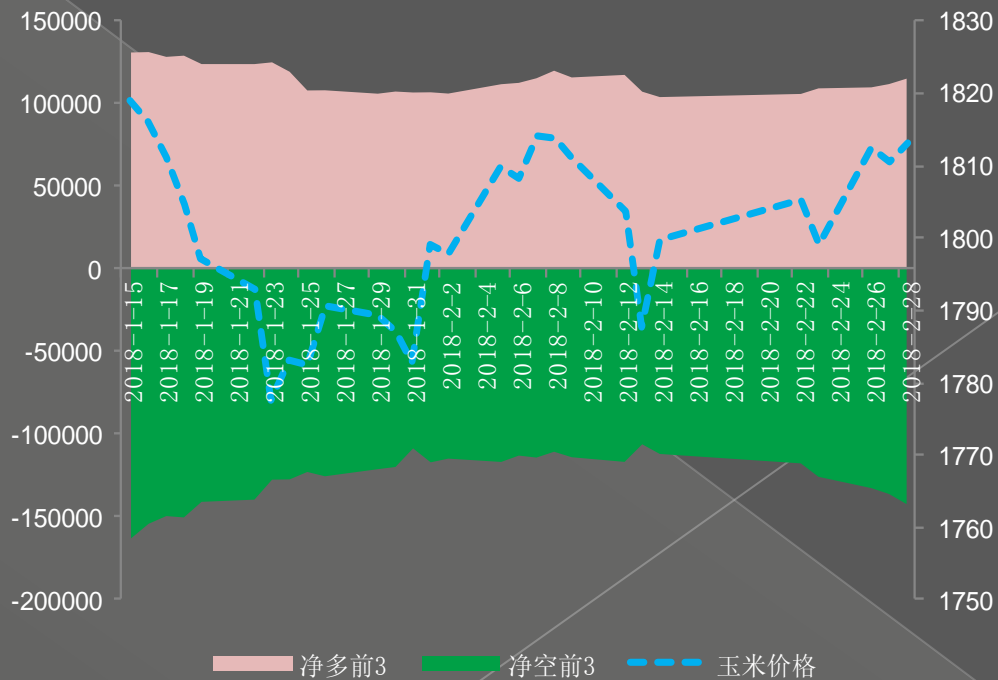




# 农产品：玉米



变动幅度		当日	最近5日	平均变化	波动率
c持仓	多头前3	2.94%	10.70%	2.14%	7.47%
	空头前3	4.51%	27.15%	5.43%	
c涨幅		0.16%	0.76%	0.15%	
震荡幅度	0.50%	0.71%(月均值)	投机度	0.24	0.35(月均值)



# 部分机构资金变动表

制表日期：2018年2月28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	-5220.79	-2.08%	-3464.73	-1.39%
南华期货	8624.49	12.05%	20233.13	33.73%
混沌天成	740.35	2.30%	2851.00	9.47%
海通期货	-18855.32	-13.22%	7439.10	6.39%
上海大陆	-9339.70	-84.36%	-7483.20	-81.21%
中信期货	12801.25	5.34%	15459.51	6.52%
新湖期货	454.28	0.62%	21962.32	42.84%

中粮期货	7345.87	3.47%	27992.81	14.67%
中信建投	8412.91	18.60%	33281.05	163.45%
申银万国	10028.30	35.02%	15824.03	69.28%
华泰期货	12496.48	14.35%	16855.02	20.37%
光大期货	3599.66	7.38%	-9511.41	-15.37%
一德期货	-2233.79	-2.13%	-15057.71	-12.80%
国投期货	-6746.32	-10.64%	-10335.24	-15.42%
金瑞期货	-2898.72	-2.83%	2577.44	2.66%
鲁证期货	5170.28	5.07%	41790.46	63.94%
中国国际	4811.20	7.72%	19196.78	40.03%

# 部分机构持仓一览

机构	永安期货					
日期	2018-2-14	2018-2-22	2018-2-23	2018-2-26	2018-2-27	2018-2-28
黄金	4886	4723	4820	4832	4857	4106
白银						
沪铜	18907	19112	19299	16435	17509	19493
沪铝	-9432	-10007	-9363	-8672	-5152	-5143
沪镍	24142	23996	24610	26506	26925	18645
沪锌		-2932	-2851	-2369	-2329	-2848
沪铅		750	482			
螺纹钢	-31280	-37092				-21340
铁矿石	32724	26596	26960		-13666	-17605
焦煤				-918	-873	-2403
焦炭	4378	3272	4220	12101	9297	2888
豆油	9377	12267	15961	17989	18419	24639
棕榈油	-8413	-8160	-6980	-7391	-6727	-6096
菜籽油	12452	13476	13271	14020	13589	12573
豆粕	78722	69573	81445	84713	81628	85563
菜籽粕	-2006			3525	2414	1977
棉花	8739	8071	7056	4340	3655	3695
白糖	-4968	-5264	-6251	-6107	-5359	-5977
玉米	-34051	-40263	-39806	-46999	-47372	-52617
鸡蛋			1258			
PTA	15137	25803	26358	22165	24388	27112
聚乙烯						
聚丙烯	25784	27914	25594	28731	29974	29122
甲醇	17435	17276	20802	19334	24686	23930
玻璃						
橡胶	-22919	-22618	-22640	-22209	-22330	-21821
沥青	-8600	-9891	-11897	-17557	-16475	-9595
动力煤	9300	8958	9433	13009	13081	13933

## 部分机构持仓一览

机构	南华期货					
日期	2018-2-14	2018-2-22	2018-2-23	2018-2-26	2018-2-27	2018-2-28
黄金	-1119	-1181	-1272	-1118	-1346	-1177
白银	7940	7933	9114	7994		
沪铜	3780	5242	4397	3822	4199	4321
沪铝		-797			-10738	-10692
沪镍	-6072	-5083	-6220	-7754		
沪锌				-2364	-2501	-3045
沪铅	424	-287	-654			-686
螺纹钢		-22636				-25836
铁矿石						
焦煤		1787	2090			
焦炭	-2013	-2000	-2425	-2823	-2907	-3108
豆油	4101	5921	7289	14262	14087	13612
棕榈油	4918	5332	5276			
菜籽油						
豆粕						
菜籽粕	-9740	-9069	-8853		-7367	-7962
棉花			2858			
白糖	4543	4721	5772	5462	5245	
玉米	-14705	-18150		-17301	-16855	-16684
鸡蛋	2290			2529	2531	2486
PTA						
聚乙烯	10537	11170	10598	12122	11486	12620
聚丙烯	-14827	-14782	-15601	-15354	-14682	-13641
甲醇	-4505	-5097	4468	-7823	-4230	-4548
玻璃			4132	5155	4580	4844
橡胶					1421	900
沥青						
动力煤						-4216

## 部分机构持仓一览

机构	国泰君安					
日期	2018-2-14	2018-2-22	2018-2-23	2018-2-26	2018-2-27	2018-2-28
黄金			689			
白银	-15382	-15889	-15972	-16065	-14964	-15001
沪铜	4919	4175	3960	4665	3942	5331
沪铝	4495	3737	2362	5024	11868	11652
沪镍						
沪锌		-2758	-2916	-2632		-2382
沪铅						
螺纹钢	37684	39223	44601	47735	37830	37950
铁矿石	10450	10797	8756	10704	7856	12087
焦煤						
焦炭						
豆油			1417	1812	1944	1887
棕榈油						
菜籽油	29688	29887	32692	36299	32718	36281
豆粕		23959	23569			
菜籽粕	9635	10037	10782	10677	10779	11373
棉花			-3491			
白糖	-6815	-6960	-7042	-6993	-6864	-7086
玉米	9732					
鸡蛋	973			1346	1422	1711
PTA	15229	17573	19792	26952	28228	25916
聚乙烯	-6314	-3439			-6917	-6936
聚丙烯	6703	11357	6259	6667	7909	7362
甲醇	-8626	-8848	-4546	-5985	-8004	-8687
玻璃						
橡胶	-4291	-4391			-3787	-3568
沥青	3646					
动力煤						

## 部分机构持仓一览

机构	混沌天成					
日期	2018-2-14	2018-2-22	2018-2-23	2018-2-26	2018-2-27	2018-2-28
黄金						
白银						
沪铜	-8203	-8200	-9022	-9004	-8994	-9534
沪铝						
沪镍	-8080	-7938	-7924	-7606	-7613	-7367
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	2018-2-14	2018-2-22	2018-2-23	2018-2-26	2018-2-27	2018-2-28
黄金	3784	3990	3336	4169	3577	3497
白银	15338	15024	13053	14754	14034	12462
沪铜	-12659	-12755	-12161	-12293	-12959	-12154
沪铝	-5907	-5761	-3924	-4818		
沪镍	7945	7495	7631	10240	8926	7361
沪锌	7158	3095	4424	6903	3792	
沪铅	463	1763	1656	1814	1758	1485
螺纹钢		-25284				
铁矿石	-2450	-1616	-3018	-7919	-6692	
焦煤		946	1454		1950	
焦炭		591	2847	3527	1872	1694
豆油						8711
棕榈油			9406	9301	9566	7866
菜籽油	-9657	-9181	-5571	-5393	-5543	-5266
豆粕	47379	39472	39515	35451	32830	35893
菜籽粕		8792	10784	10836	13926	17304
棉花				3617	3367	3441
白糖	-5503	-5611	-5343	-5447	-5525	-4807
玉米	9887	9895	9890	14356	15396	17092
鸡蛋	697	1241	1710	4303	4335	4001
PTA	22470	27810	26736	30418	30617	30117
聚乙烯				-3898	-6273	-3955
聚丙烯	-4507	-7141	-8687	-12566	-10335	-8909
甲醇	-12127	-11763	-10300	-14365	-12709	-9664
玻璃	-12036	-15038	-5558	-5479	-5933	-5641
橡胶					-3868	
沥青		3189	3518	3474		3665
动力煤	-2940		-3374	-4729	-3294	-3701



## 部分机构持仓一览

机构	上海大陆					
日期	2018-2-14	2018-2-22	2018-2-23	2018-2-26	2018-2-27	2018-2-28
黄金						
白银						
沪铜						
沪铝						
沪镍						
沪锌						
沪铅						
螺纹钢	20188				23618	
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	-4906	-4977	-5564	-5803	-5752	-6179
动力煤						

# 部分机构持仓一览

机构	中粮期货					
日期	2018-2-14	2018-2-22	2018-2-23	2018-2-26	2018-2-27	2018-2-28
黄金						
白银	7350	7308		7864	7549	7664
沪铜	-7799	-7778	-7135	-5652	-7598	-10488
沪铝	-4612	-3904	-5087	-4263		-4756
沪镍	7021	6550	6896	6735	6859	6483
沪锌	-2081	-6587	-6466	-6551	-7465	-7475
沪铅	-584	-606				
螺纹钢						
铁矿石						
焦煤	-2155	-1922				
焦炭	-2433	-2526	-2648	-2778	-2753	-2777
豆油	-62538	-63680	-67234	-66916	-69276	-68675
棕榈油	-16106	-16472	-17473	-18445	-19811	-17855
菜籽油	-9170	-9081	-9886	-9864	-10306	-9922
豆粕	-161868	-164498	-170435	-171911	-184137	-181687
菜籽粕	-59413	-59146	-58946	-57356	-44990	-42008
棉花	-10581	-10581	-10582	-10722	-10601	-10578
白糖	-9820	-7844	-12390	-12455	-12408	-11151
玉米		-13634	-14073	-14661	-18011	-19077
鸡蛋	2679	2684	2670	2923	2837	2756
PTA						
聚乙烯						
聚丙烯						
甲醇	-3984	-4474	-4683	-5336	-5664	-6029
玻璃	-5219	-5268	-5418	-6428	-6583	-6900
橡胶	-8095	-8136	-8535	-7435	-7169	-6723
沥青						
动力煤			-3371	-3449	-3682	-3652

# 部分机构持仓一览

机构	中信期货					
日期	2018-2-14	2018-2-22	2018-2-23	2018-2-26	2018-2-27	2018-2-28
黄金	9861	10008	9683	8508	7357	7475
白银	-27944	-28745	-28029	-30069	-35080	-36011
沪铜	-20961	-21053	-21619	-19019	-20703	-21681
沪铝	-33001	-33319	-28976	-30332	-30229	-28343
沪镍						
沪锌	-5136	-5418	-4914	-4434	-5151	-5509
沪铅	-1712	-2918	-3023	-3390	-3200	-2643
螺纹钢	55662	45727	39760	28591		22949
铁矿石	-12140	-15720	-16030	-13166	-13103	-12988
焦煤	6733	5889	6077	6649	7209	6971
焦炭	-3158	-2891	-4234	-5087	-5776	-6425
豆油		-6778	-9262	-8075	-6764	-8441
棕榈油	-17912	-18623	-12752	-12090	-13050	-11543
菜籽油	-11236	-11675	-11787	-11979	-12406	-12245
豆粕	61896	66116	76175	82476	82979	88652
菜籽粕	12867	14139	15412	15337	16912	16827
棉花	3132	3392	2887	3174	3156	3341
白糖	-10111	-11492	-10306	-12281	-12258	-10584
玉米	32988	34510	34881	34805	36530	38260
鸡蛋						
PTA	15169	21132	22899	23348	22515	22970
聚乙烯			-3604	-4368	-5375	-4876
聚丙烯	9717	9997	9448	8464	7908	8790
甲醇	-4240	-3466	-3875	-4903	-7097	-5559
玻璃	10072	9307	9586	10777	10984	12553
橡胶						
沥青						
动力煤		4291				

## 部分机构持仓一览

机构	中信建投					
日期	2018-2-14	2018-2-22	2018-2-23	2018-2-26	2018-2-27	2018-2-28
黄金						
白银						7439
沪铜						
沪铝						
沪镍	4309	7573	7738	8728	9343	9407
沪锌						2602
沪铅	-170					
螺纹钢						
铁矿石		-13342	-14285		-14015	15565
焦煤	-1816		-2050	-2570	-2807	
焦炭			3090	3978	4729	4871
豆油						
棕榈油	3244	5421	5330	5197	5645	9074
菜籽油						
豆粕	29054	43452	44980	44763	33959	34132
菜籽粕	13883	14188	9890			
棉花						
白糖						
玉米						
鸡蛋	-368	2800	-460	-498	-651	-640
PTA						
聚乙烯						
聚丙烯						
甲醇						
玻璃	-2907	-3158		-3999	-4138	-5146
橡胶						
沥青						
动力煤						

## 部分机构持仓一览

机构	新湖期货					
日期	2018-2-14	2018-2-22	2018-2-23	2018-2-26	2018-2-27	2018-2-28
黄金	-887	-705		-912	-958	
白银						
沪铜				-4948	-4407	-4632
沪铝						
沪镍	-7038	-7002		-7240	-7196	
沪锌						
沪铅		-278				
螺纹钢	29787	29998	30382	33870	34873	35201
铁矿石						
焦煤						
焦炭		1898				
豆油						-7737
棕榈油				1103	6015	5687
菜籽油	-6196	-6254	-5796	-5642	-5191	-5383
豆粕	-58068	-59357	-58980	-35084	-60324	-63770
菜籽粕						
棉花						3442
白糖						
玉米	25497	25694	27181	26594	26248	27190
鸡蛋	-452	-412				
PTA	-16446	-19425	-20086	-22136	-26058	-22664
聚乙烯						
聚丙烯						
甲醇						
玻璃						
橡胶						
沥青						
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

