



# 市场持仓分析

2018/3/15

## 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
沪镍	1.66%	0.91%	-0.37%	-8.60%	-5.17%	-3.18%	10.26%	☆☆☆
豆粕	7.65%	4.36%	2.00%	-0.57%	-1.64%	-2.87%	8.22%	☆☆
沪金	0.05%	0.39%	0.40%	-8.06%	-4.13%	-5.59%	8.11%	☆☆
豆油	1.66%	1.37%	3.10%	-4.19%	-6.49%	-3.24%	5.85%	☆☆
沪锌	-0.54%	-1.11%	1.57%	-5.76%	-4.32%	-0.99%	5.22%	☆☆
焦煤	-1.94%	-2.48%	-7.89%	-4.21%	-6.48%	7.17%	2.27%	☆
棕榈油	1.27%	2.25%	2.01%	-0.69%	-1.99%	-5.25%	1.96%	☆
甲醇	-3.53%	-3.98%	-4.20%	-5.07%	-1.53%	-0.53%	1.54%	☆
玻璃	-6.29%	-3.44%	-2.76%	-7.56%	-6.11%	1.24%	1.27%	☆
橡胶	1.45%	0.34%	1.66%	0.67%	-0.06%	-0.71%	0.78%	☆
鸡蛋	-1.34%	-1.15%	-0.76%	-1.50%	-1.24%	-1.34%	0.16%	☆
玉米	-1.81%	-0.72%	0.80%	-1.41%	-1.29%	-2.01%	-0.41%	☆
沪银	-1.08%	-1.06%	-0.66%	-0.47%	-0.44%	-3.01%	-0.61%	☆
PTA	-1.86%	-1.37%	-3.09%	-0.92%	-0.47%	1.18%	-0.94%	☆
棉花	1.72%	1.76%	-0.13%	2.84%	2.27%	0.12%	-1.12%	☆
聚丙烯	-2.19%	-1.79%	1.90%	-0.48%	0.39%	-1.62%	-1.71%	☆
沪铝	-0.29%	-0.06%	-0.82%	1.53%	1.04%	-0.11%	-1.83%	☆
沥青	-0.51%	0.00%	-3.13%	1.65%	2.37%	3.28%	-2.15%	☆
聚乙烯	-1.19%	0.84%	3.03%	1.47%	-1.42%	-3.43%	-2.66%	☆
白糖	-3.03%	-1.19%	-0.74%	-0.36%	-0.65%	0.37%	-2.67%	☆
动力煤	-0.31%	-0.52%	-0.52%	2.77%	2.98%	2.83%	-3.08%	☆
沪铜	-2.24%	-1.67%	-1.11%	1.10%	1.18%	0.84%	-3.33%	☆
菜籽粕	-6.33%	-2.29%	-4.46%	-1.98%	-0.85%	2.08%	-4.35%	☆
螺纹钢	-3.41%	-3.69%	-1.82%	6.10%	3.79%	5.54%	-9.51%	☆☆
铁矿石	-8.64%	-5.96%	-8.41%	7.52%	7.25%	8.13%	-16.17%	☆☆☆
焦炭	-18.59%	-16.58%	-14.29%	15.79%	14.78%	13.24%	-34.39%	☆☆☆☆

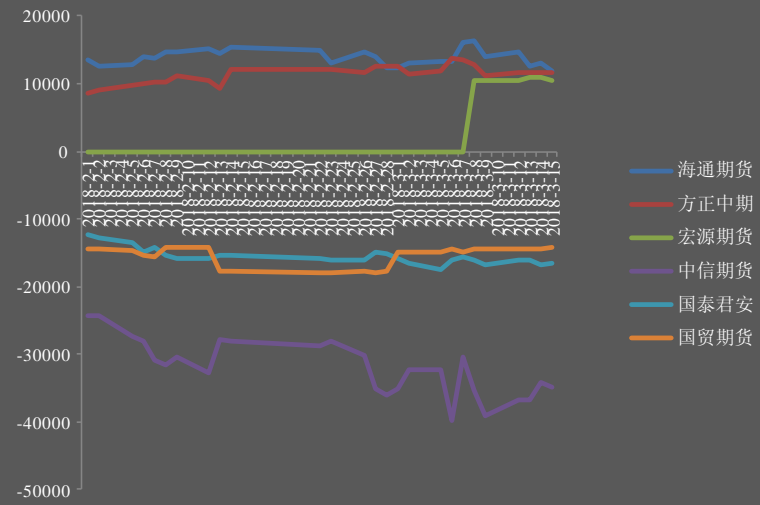
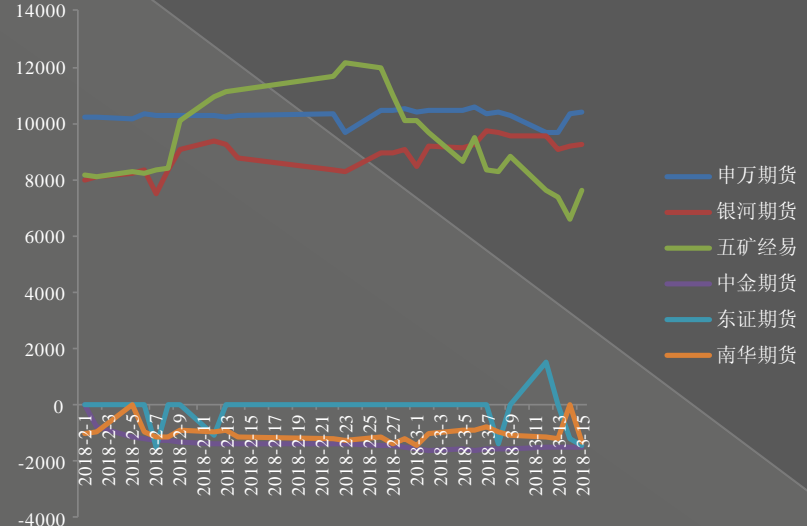
## 近5日持仓变化

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
焦煤	27.83%	15.58%	8.91%	-23.72%	-23.52%	-11.52%	51.55%	☆☆☆☆
焦炭	-4.18%	-3.12%	-5.79%	-38.86%	-25.16%	-4.58%	34.68%	☆☆☆
鸡蛋	7.14%	3.68%	1.73%	-6.24%	-5.00%	-2.15%	13.38%	☆☆
沪镍	7.05%	10.68%	7.79%	-3.65%	1.01%	2.68%	10.70%	☆☆
动力煤	10.59%	7.83%	1.37%	-0.11%	2.61%	-0.60%	10.69%	☆☆
PTA	1.01%	5.21%	4.62%	-9.43%	-5.69%	2.11%	10.43%	☆☆
棕榈油	9.24%	10.74%	7.73%	0.46%	-1.17%	-1.94%	8.78%	☆
沪锌	6.71%	4.25%	8.11%	-1.57%	-4.66%	-6.33%	8.27%	☆
橡胶	6.47%	5.19%	5.05%	1.32%	-0.03%	0.44%	5.15%	☆
菜籽粕	3.13%	-0.90%	-6.82%	-1.86%	-0.92%	4.91%	4.99%	☆
沪铝	5.77%	3.58%	0.63%	2.74%	3.50%	5.51%	3.04%	☆
豆油	2.56%	0.48%	2.27%	3.63%	-1.30%	0.76%	-1.07%	☆
螺纹钢	0.07%	0.22%	0.41%	2.21%	-1.27%	-0.35%	-2.15%	☆
沪金	-1.13%	0.35%	-0.84%	3.28%	1.57%	5.73%	-4.42%	☆
白糖	-3.93%	-1.61%	-2.15%	0.59%	-0.01%	0.63%	-4.52%	☆
玉米	-3.95%	-1.60%	-1.97%	4.76%	5.08%	3.77%	-8.71%	☆
沪银	-11.21%	-8.73%	-5.69%	-2.16%	0.50%	-1.64%	-9.05%	☆
棉花	-1.63%	-8.38%	-5.03%	12.39%	9.64%	6.60%	-14.02%	☆☆
铁矿石	-4.06%	1.21%	-1.59%	9.99%	5.24%	1.71%	-14.05%	☆☆
玻璃	-11.20%	-9.64%	-12.74%	7.90%	6.76%	9.31%	-19.10%	☆☆
豆粕	-21.97%	-18.30%	-7.13%	-2.46%	-1.74%	0.70%	-19.51%	☆☆
沪铜	-16.94%	-13.34%	-5.96%	3.19%	4.39%	3.16%	-20.12%	☆☆
聚乙烯	-10.59%	-12.77%	-2.53%	17.76%	13.12%	9.05%	-28.36%	☆☆
聚丙烯	-28.70%	-21.52%	-8.57%	7.40%	7.46%	7.04%	-36.10%	☆☆☆
沥青	-15.64%	-12.26%	-8.11%	21.02%	14.95%	7.20%	-36.66%	☆☆☆
甲醇	-26.17%	-20.74%	-11.97%	12.26%	11.06%	12.98%	-38.43%	☆☆☆



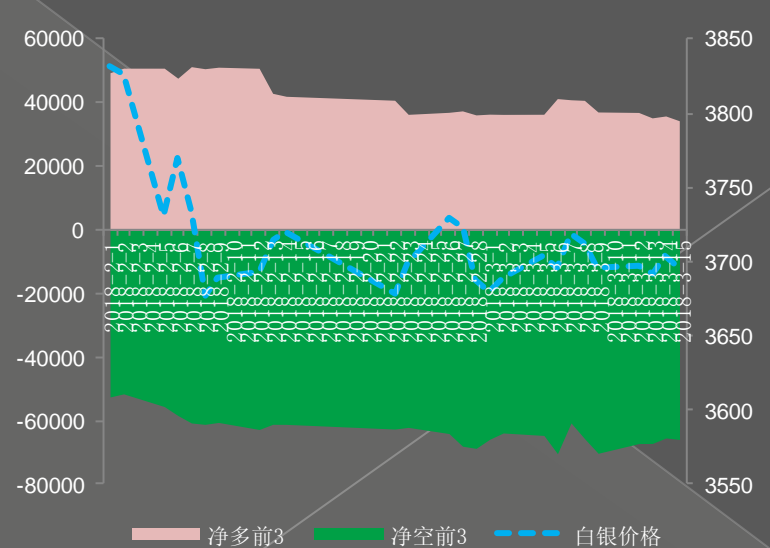
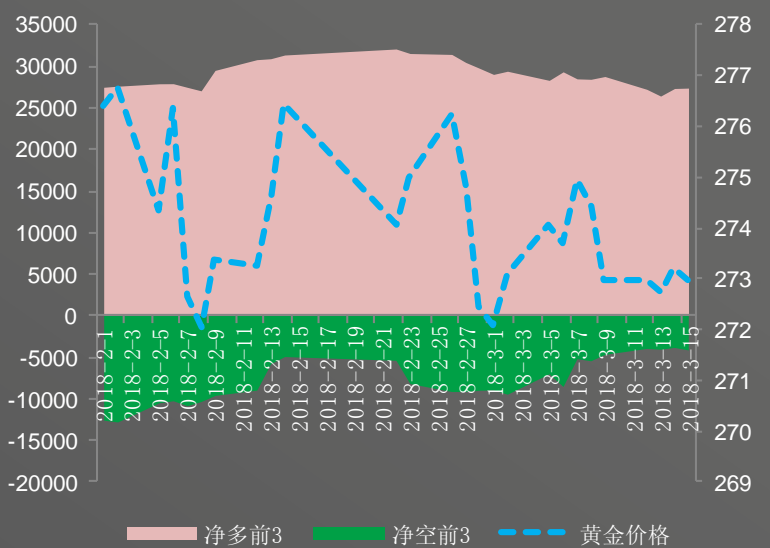


# 金属板块：AU & AG

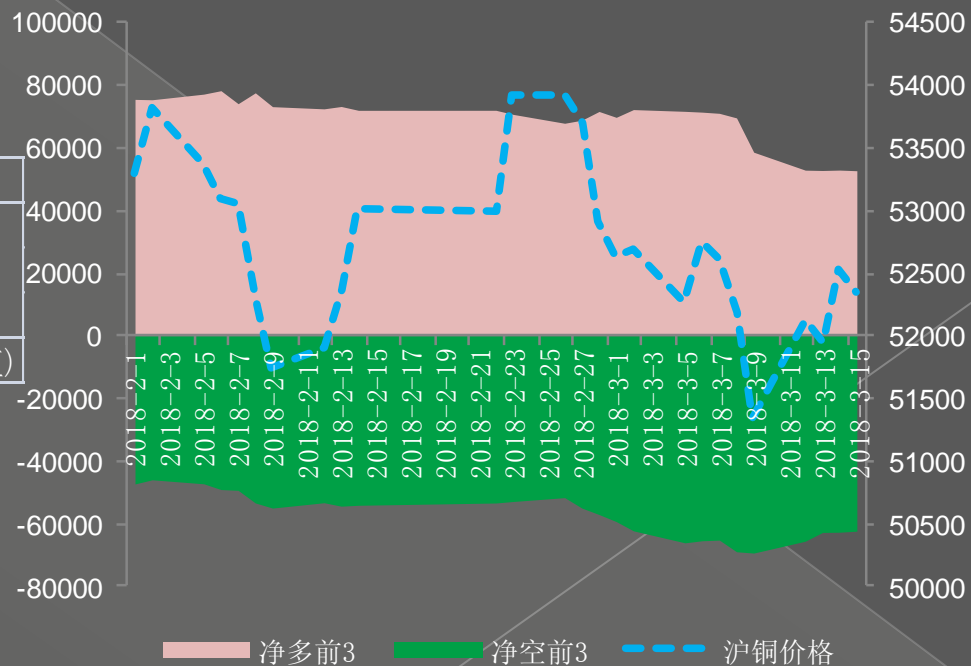
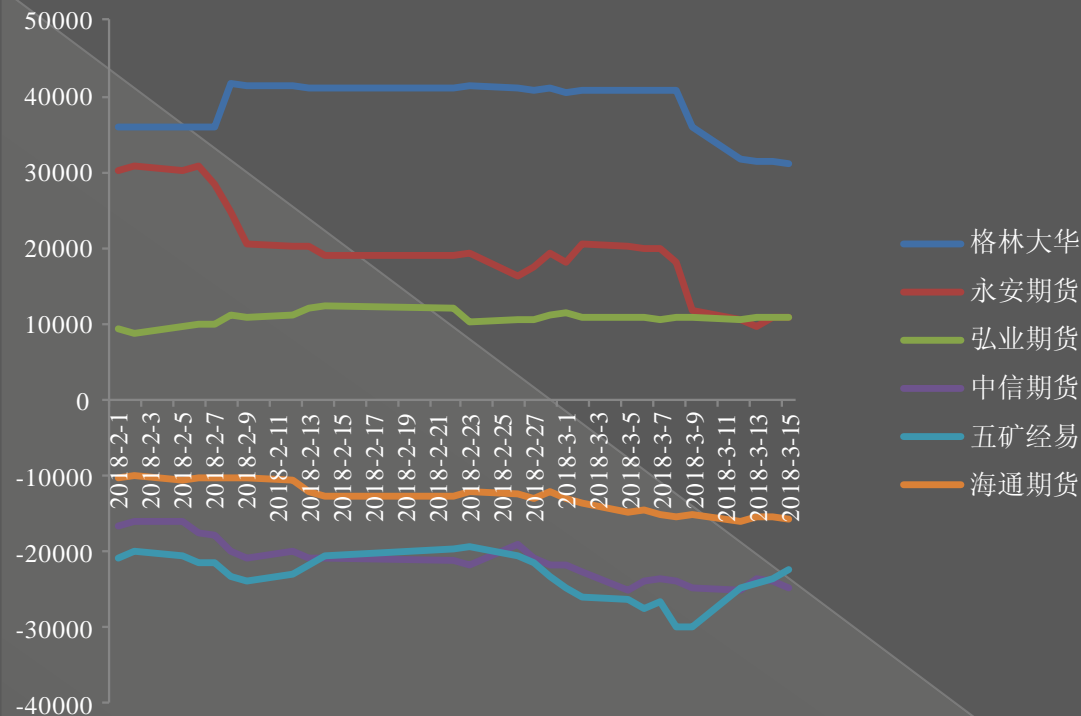


变动幅度		当日	最近5日	平均变化	波动率
au持仓	多头前3	0.17%	-3.73%	-0.75%	8.22%
	空头前3	7.88%	-23.87%	-4.77%	
au涨幅		-0.09%	-0.53%	-0.11%	
震荡幅度	0.31%	0.68%(月均值)	投机度	0.24	0.37(月均值)

变动幅度		当日	最近5日	平均变化	波动率
ag持仓	多头前3	-4.19%	-15.70%	-3.14%	9.77%
	空头前3	0.75%	0.41%	0.08%	
ag涨幅		-0.21%	-0.45%	-0.09%	
震荡幅度	0.30%	0.98%(月均值)	投机度	0.28	0.48(月均值)



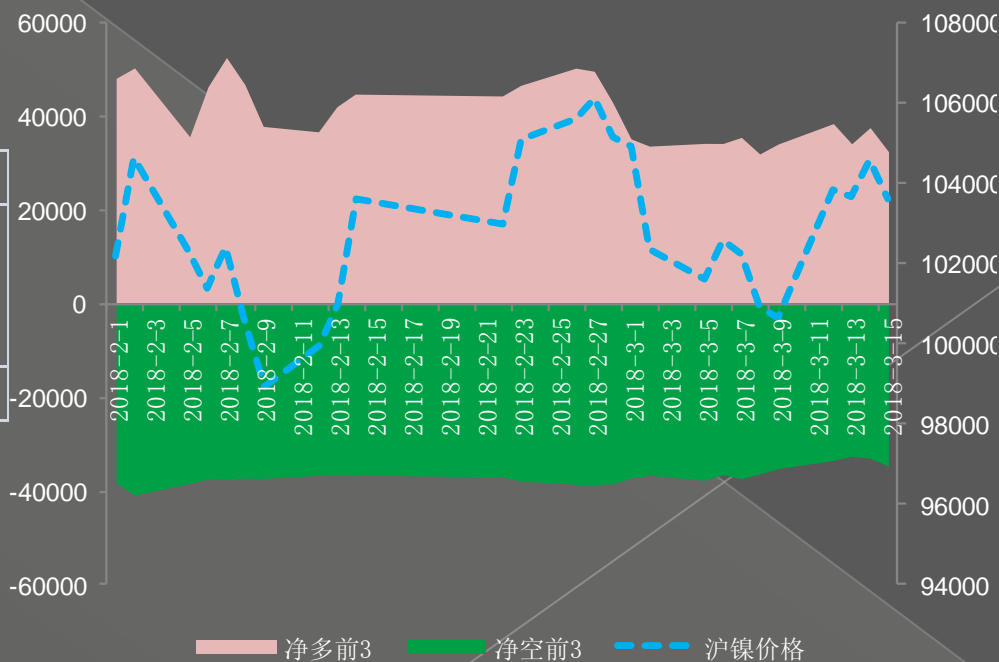
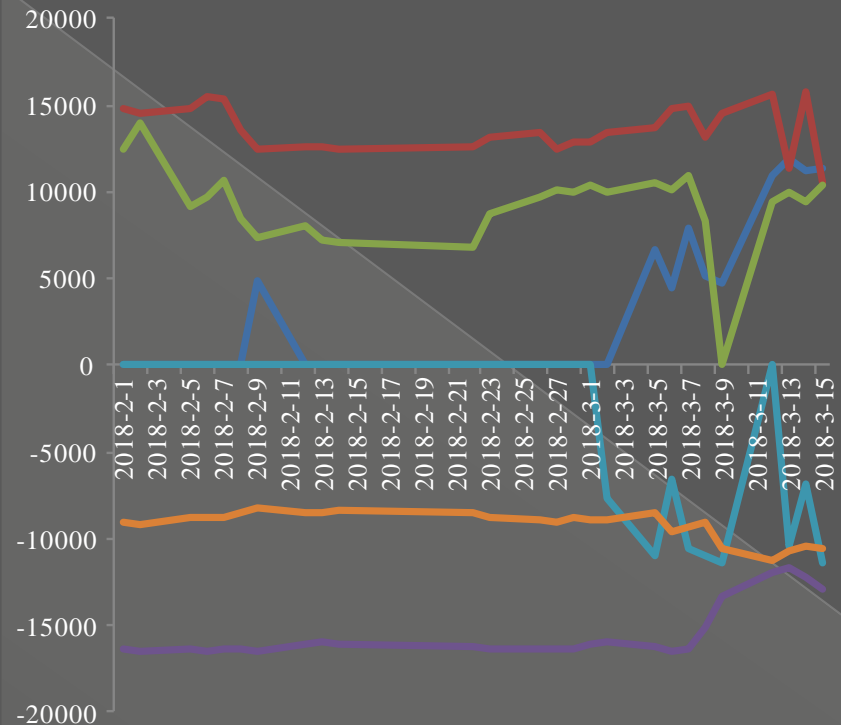
# 金属板块：Cu



变动幅度		当日	最近5日	平均变化	波动率
cu持仓	多头前3	-0.38%	-24.24%	-4.85%	15.38%
	空头前3	-0.54%	-9.54%	-1.91%	
cu涨幅		-0.34%	0.29%	0.06%	
震荡幅度	1.45%	1.37%(月均值)	投机度	0.46	0.52(月均值)

# 金属板块：Ni

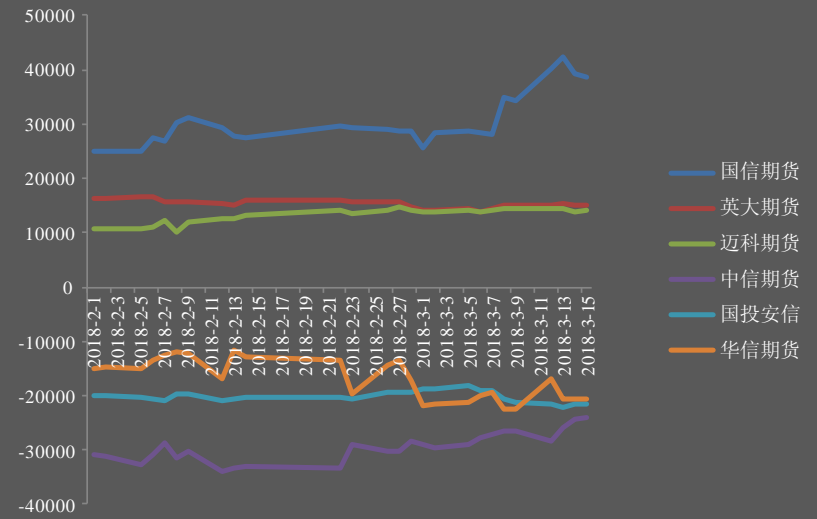
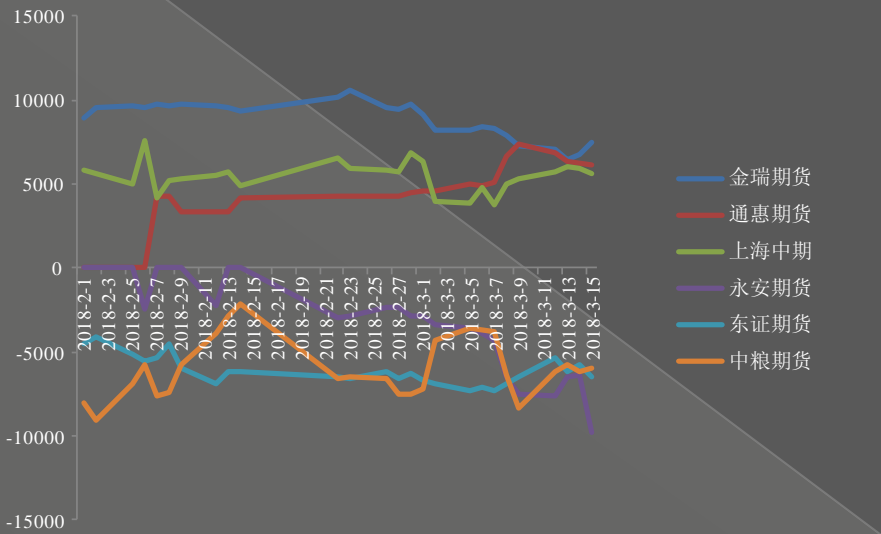
- 广发期货
- 国贸期货
- 华泰期货
- 兴业期货
- 鲁证期货
- 国富期货



变动幅度		当日	最近5日	平均变化	波动率
ni持仓	多头前3	-13.75%	1.56%	0.31%	22.54%
	空头前3	5.20%	-4.49%	-0.90%	
ni涨幅		-0.97%	2.62%	0.52%	
震荡幅度	2.04%	2.19%(月均值)	投机度	1.49	1.50(月均值)

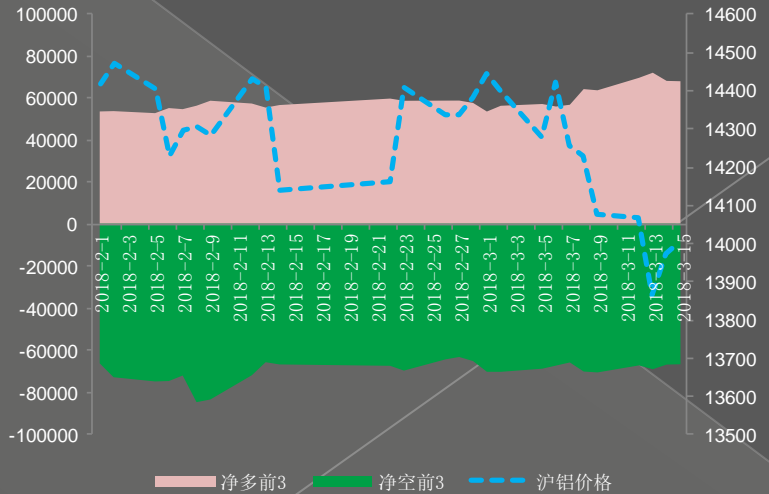
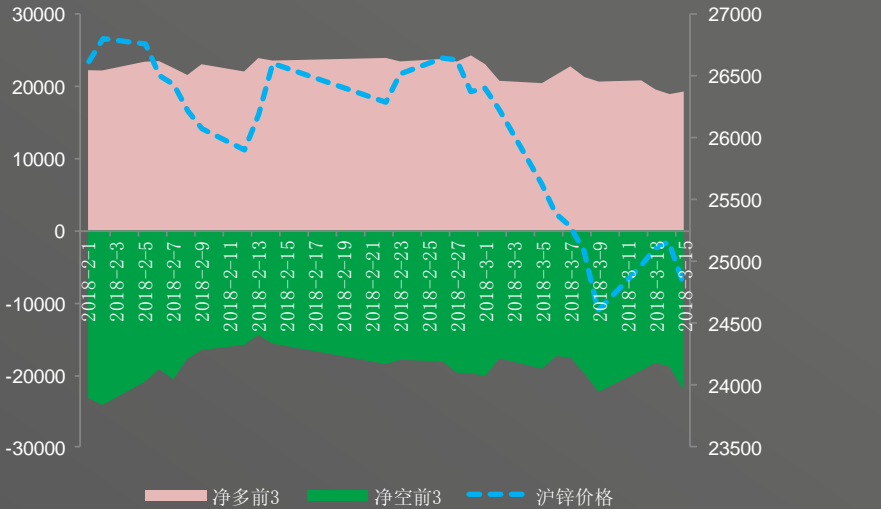


# 金属板块：Zn & Al

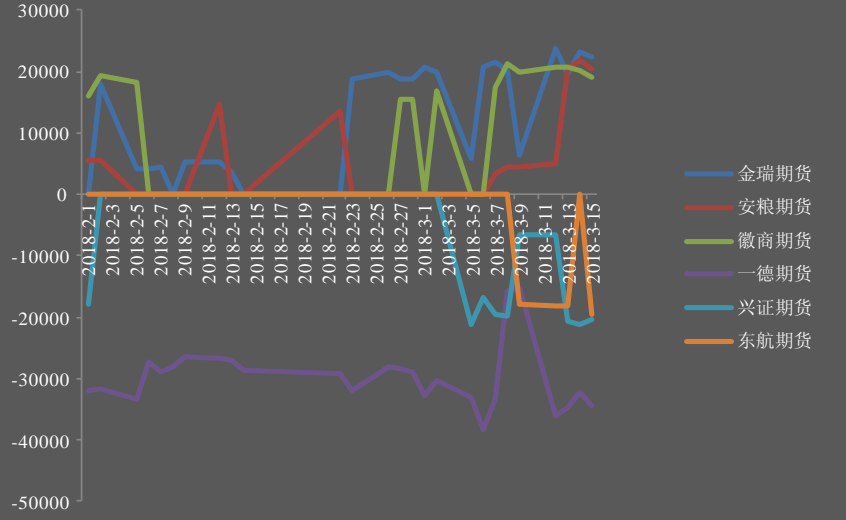
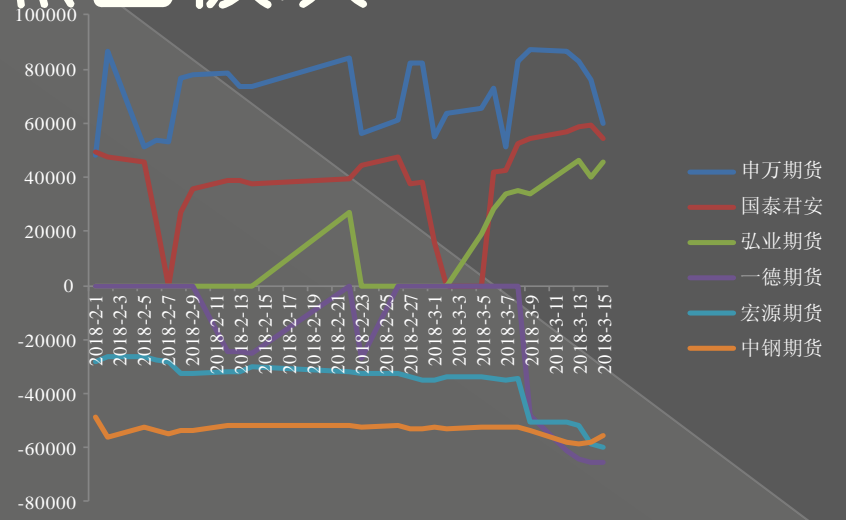


变动幅度		当日	最近5日	平均变化	波动率
zn持仓	多头前3	1.86%	-9.49%	-1.90%	16.24%
	空头前3	17.36%	11.76%	2.35%	
zn涨幅		-1.32%	-1.05%	-0.21%	
震荡幅度	2.01%	1.60% (月均值)	投机度	1.42	1.25 (月均值)

变动幅度		当日	最近5日	平均变化	波动率
al持仓	多头前3	-0.25%	5.85%	1.17%	13.53%
	空头前3	-0.23%	-4.91%	-0.98%	
al涨幅		0.25%	-1.56%	-0.31%	
震荡幅度	1.18%	1.55% (月均值)	投机度	0.46	0.60 (月均值)

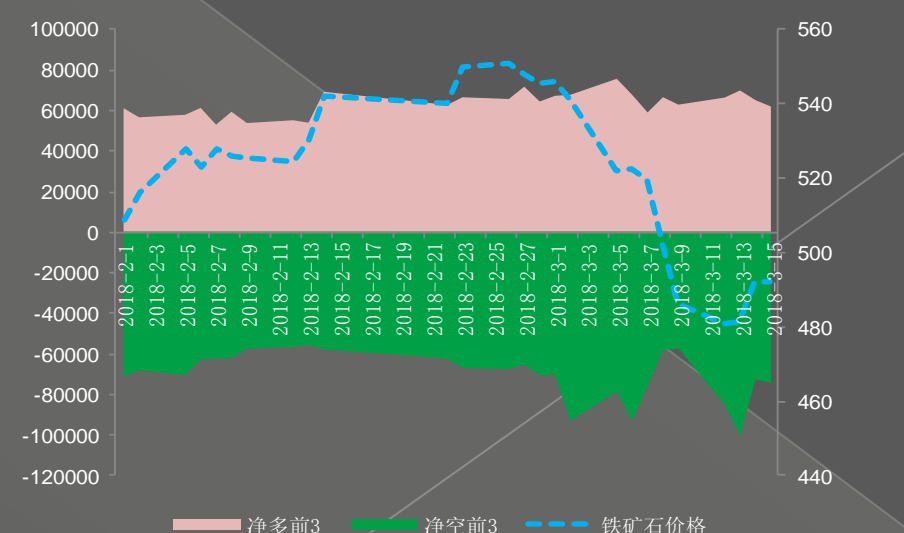
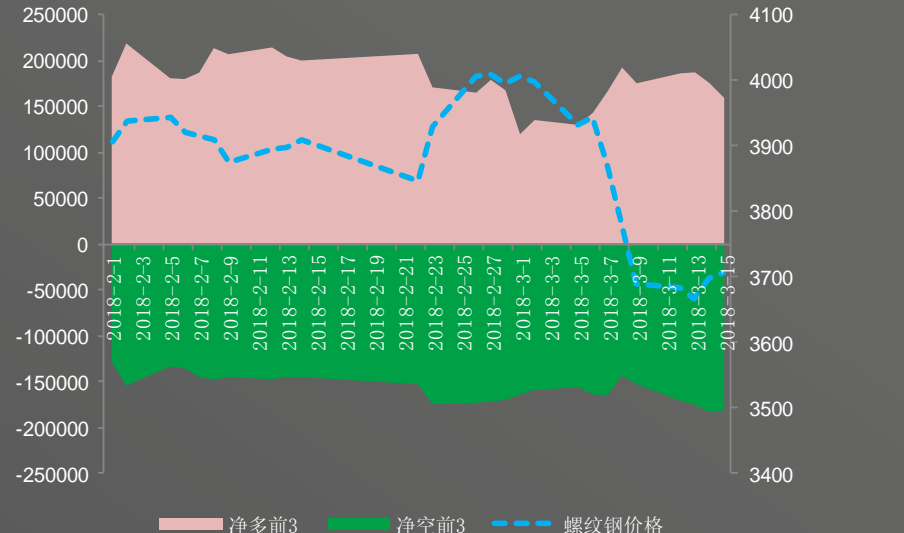


# 黑色板块：Rb & I

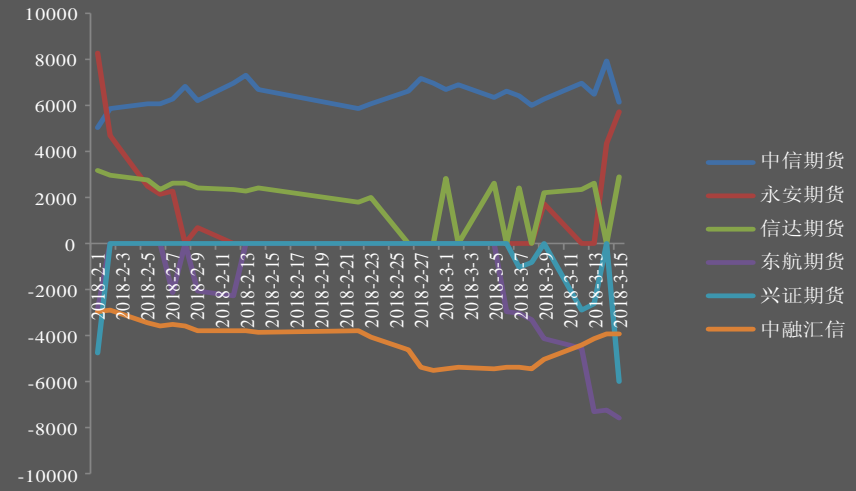
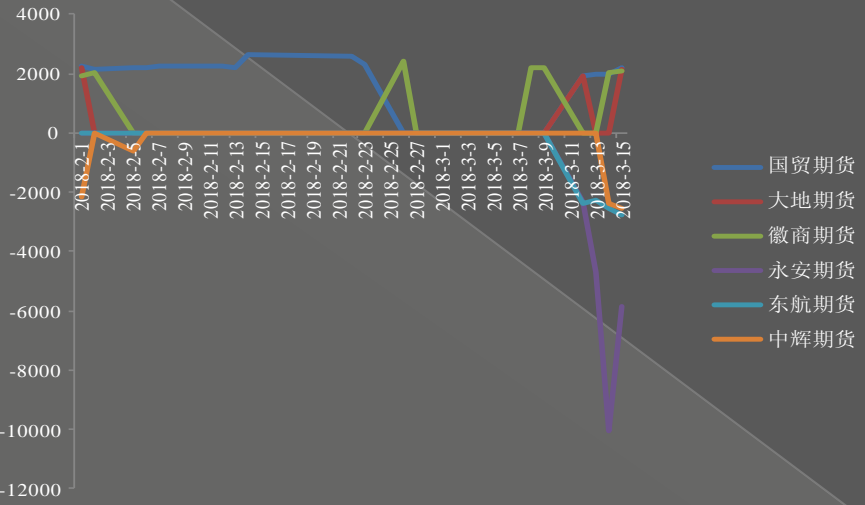


变动幅度		当日	最近5日	平均变化	波动率
rb持仓	多头前3	-9.19%	-17.25%	-3.45%	18.83%
	空头前3	-0.92%	26.29%	5.26%	
rb涨幅		0.22%	-1.99%	-0.40%	
震荡幅度	1.17%	1.73%(月均值)	投机度	1.08	0.96(月均值)

变动幅度		当日	最近5日	平均变化	波动率
I持仓	多头前3	-4.86%	-6.93%	-1.39%	24.85%
	空头前3	2.48%	27.69%	5.54%	
I涨幅		0.02%	-2.00%	-0.40%	
震荡幅度	1.81%	2.29%(月均值)	投机度	1.06	1.00(月均值)

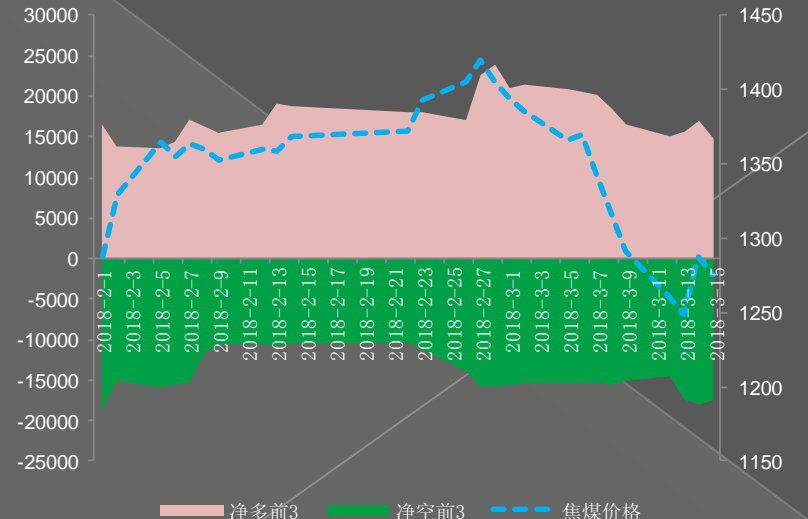
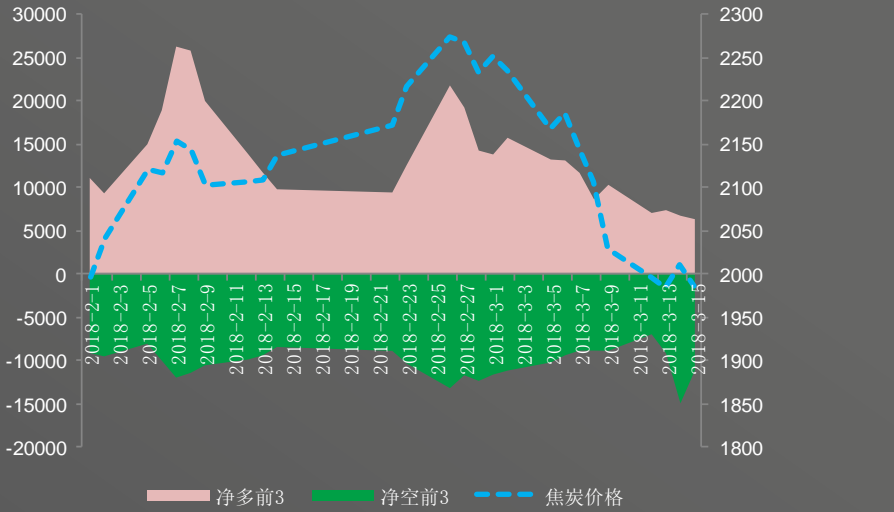


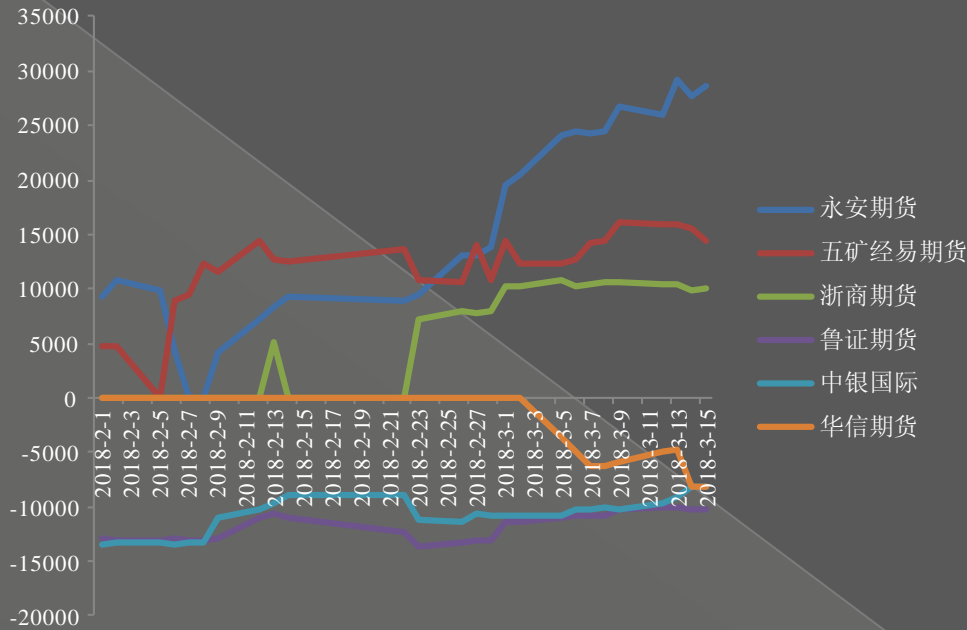
# 黑色板块：J & JM



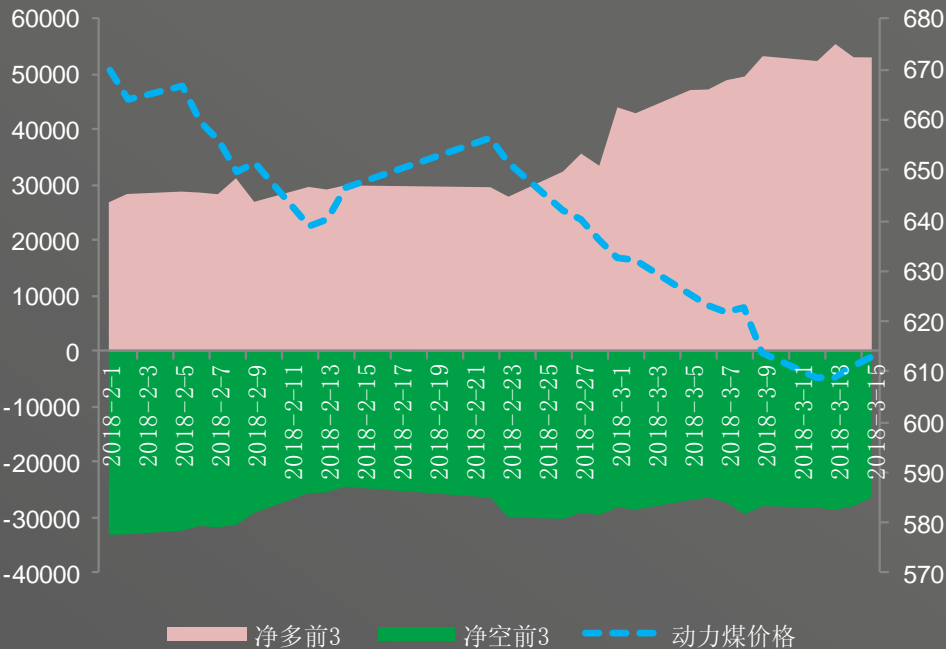
变动幅度		当日	最近5日	平均变化	波动率
j持仓	多头前3	-5.86%	-26.48%	-5.30%	26.73%
	空头前3	-25.47%	26.20%	5.24%	
j涨幅		-1.18%	-5.68%	-1.14%	
震荡幅度	2.70%	2.67%(月均值)	投机度	1.56	1.11(月均值)

变动幅度		当日	最近5日	平均变化	波动率
jm持仓	多头前3	-12.89%	-20.05%	-4.01%	21.09%
	空头前3	-3.20%	12.05%	2.41%	
jm涨幅		-0.92%	-3.17%	-0.63%	
震荡幅度	2.32%	2.38%(月均值)	投机度	1.29	0.99(月均值)



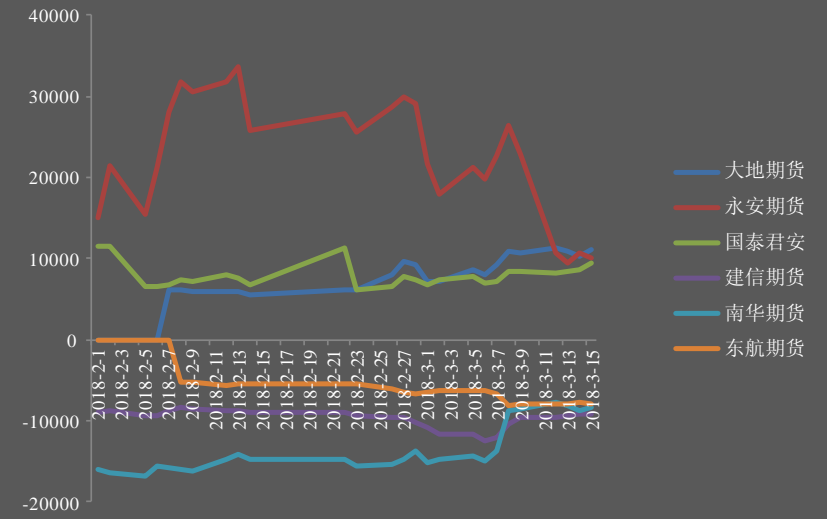
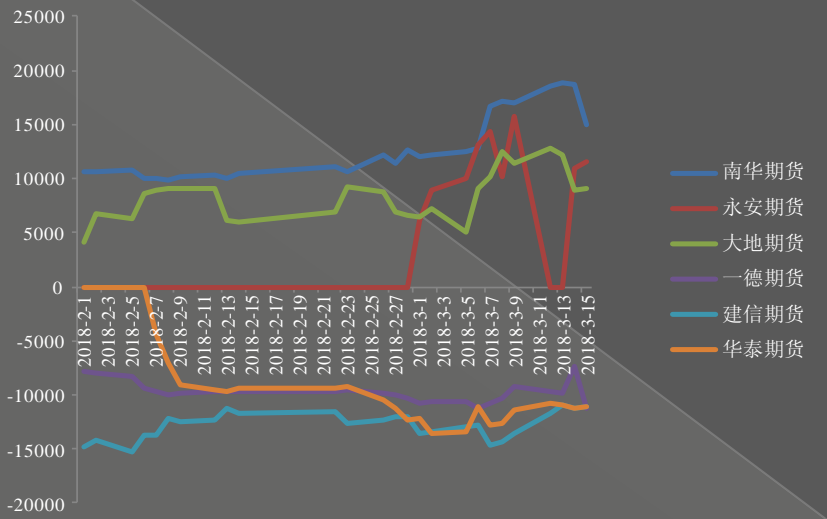


# 黑色：动力煤



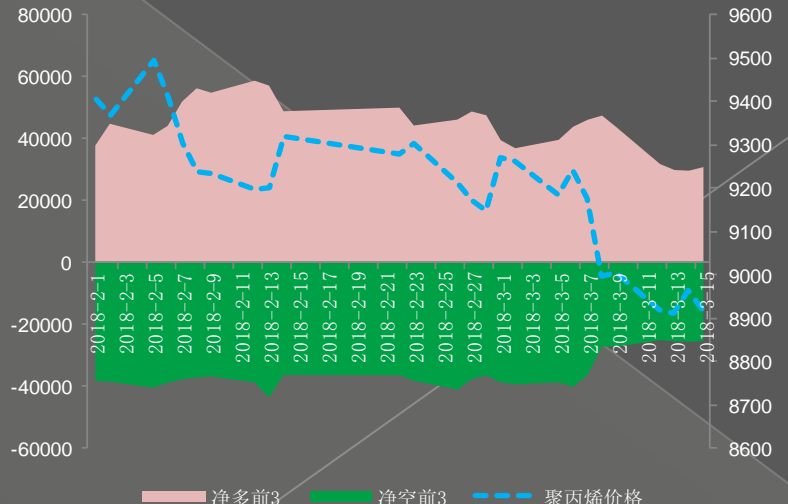
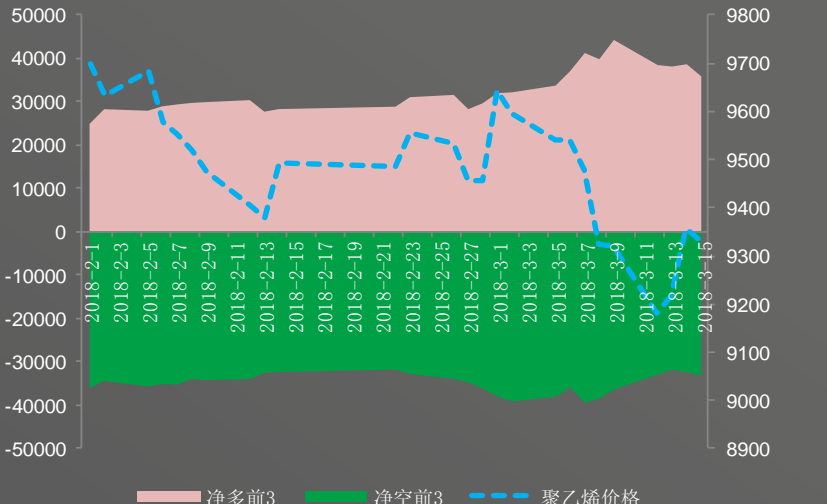
变动幅度		当日	最近5日	平均变化	波动率
zc持仓	多头前3	-0.05%	6.95%	1.39%	13.00%
	空头前3	-5.37%	-10.24%	-2.05%	
zc涨幅		0.33%	-1.60%	-0.32%	
震荡幅度	0.90%	1.40%(月均值)	投机度	0.52	0.66(月均值)

# 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	-7.27%	-10.01%	-2.00%	13.69%
	空头前3	2.65%	-13.54%	-2.71%	
I涨幅		-0.27%	0.11%	0.02%	
震荡幅度	0.98%	1.27%(月均值)	投机度	0.53	0.58(月均值)

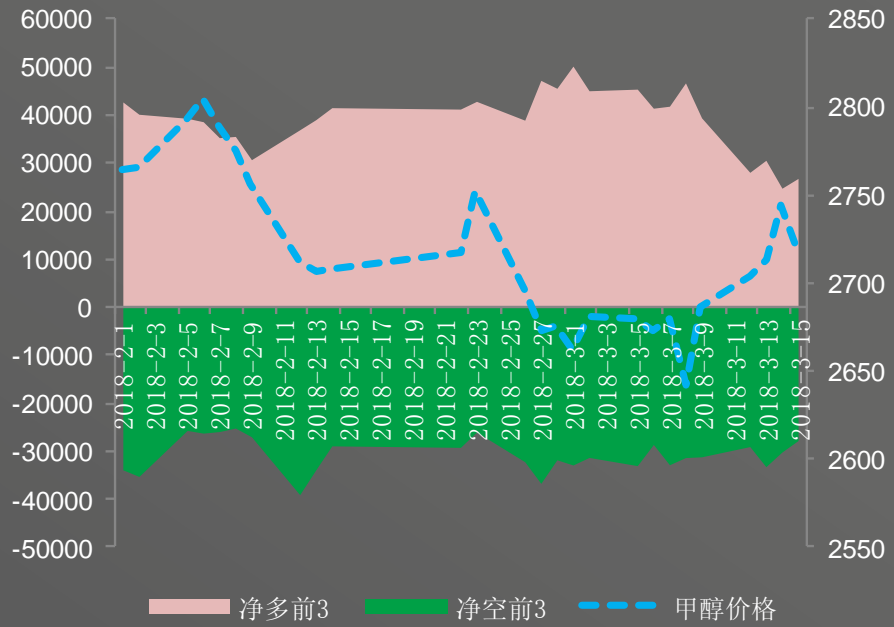
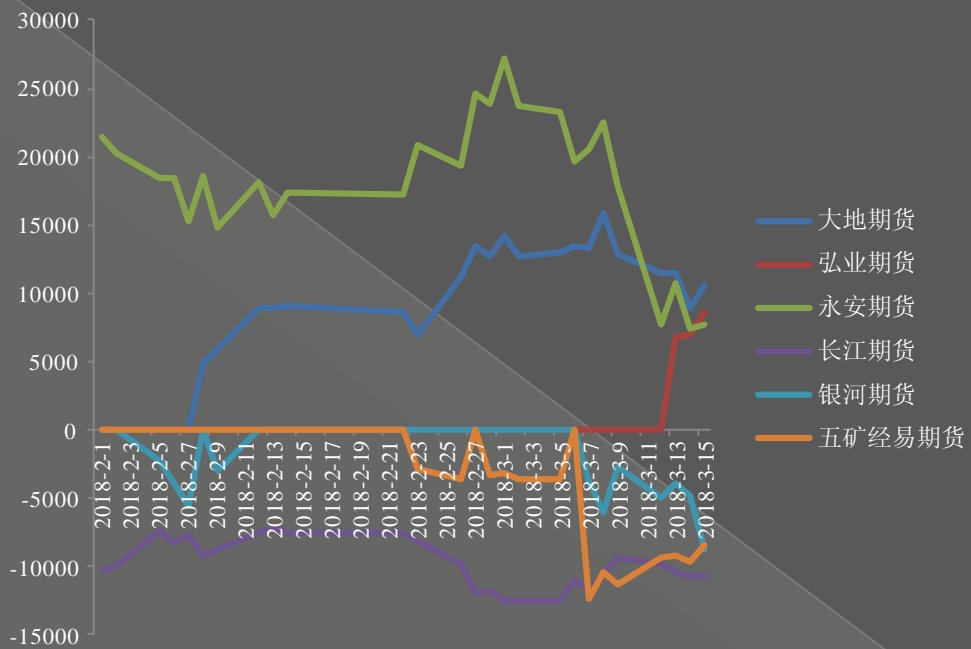
变动幅度		当日	最近5日	平均变化	波动率
pp持仓	多头前3	3.90%	-34.95%	-6.99%	12.18%
	空头前3	-0.93%	-6.46%	-1.29%	
pp涨幅		-0.47%	-0.87%	-0.17%	
震荡幅度	1.14%	1.27%(月均值)	投机度	0.57	0.61(月均值)



净多前3 净空前3 聚乙烯价格

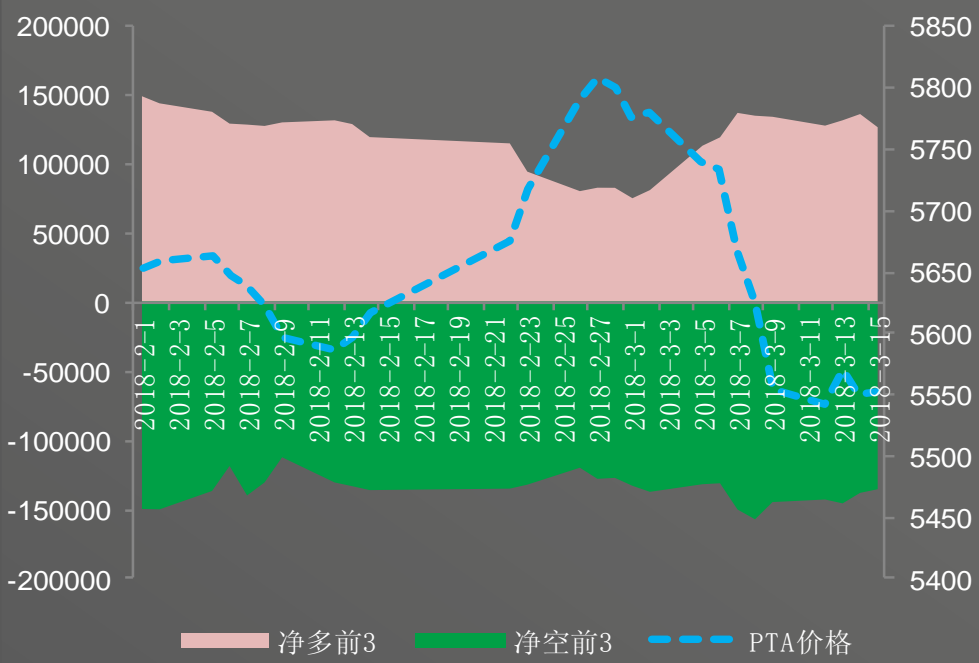
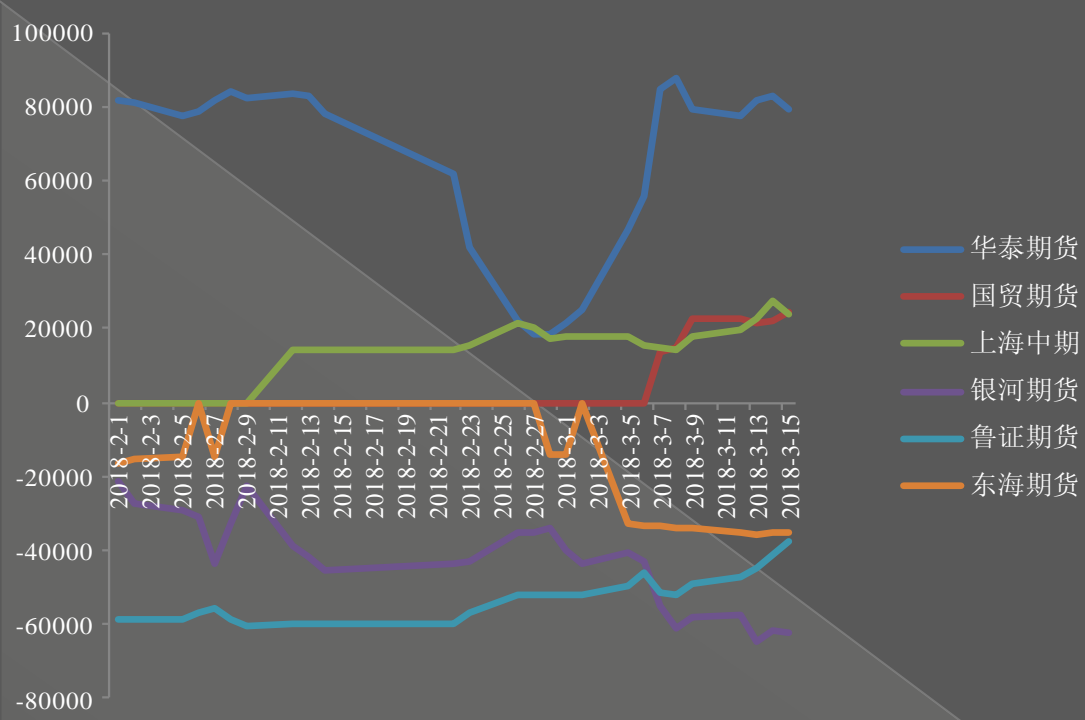
净多前3 净空前3 聚丙烯价格

# 化工：甲醇

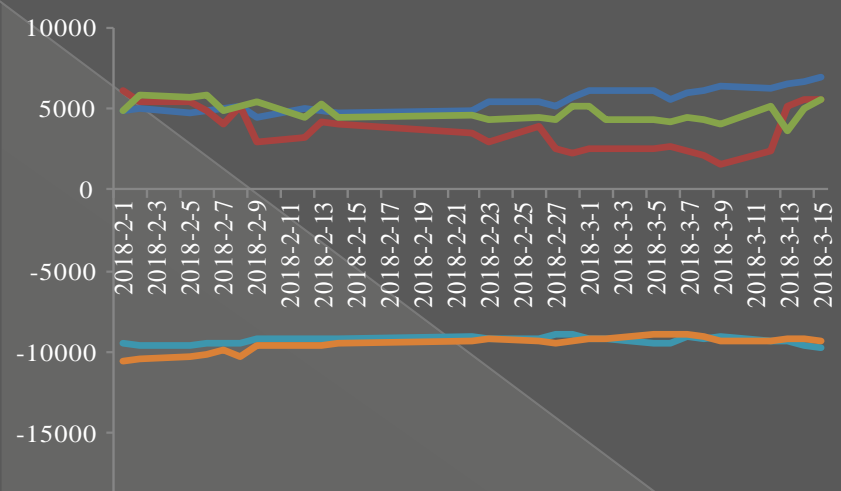


变动幅度		当日	最近5日	平均变化	波动率
ma持仓	多头前3	8.20%	-42.49%	-8.50%	14.91%
	空头前3	-7.92%	-11.35%	-2.27%	
ma涨幅		-0.91%	2.92%	0.58%	
震荡幅度	1.58%	1.60%(月均值)	投机度	0.96	1.12(月均值)

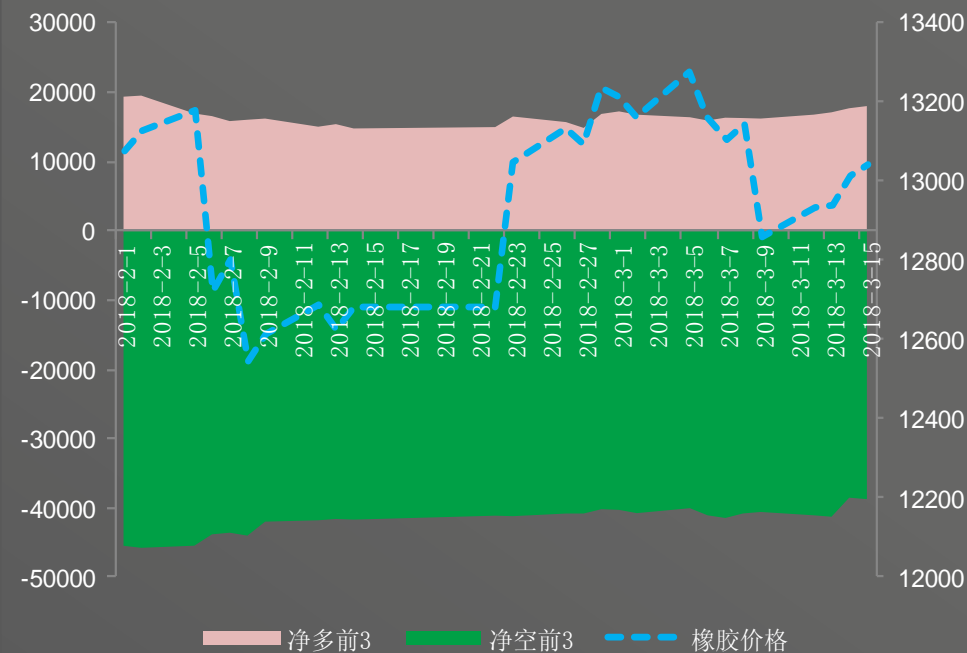
# 化工：PTA



变动幅度		当日	最近5日	平均变化	波动率
pta持仓	多头前3	-7.04%	-6.21%	-1.24%	9.96%
	空头前3	-1.89%	-13.81%	-2.76%	
pta涨幅		0.03%	-1.27%	-0.25%	
震荡幅度	0.99%	1.27%(月均值)	投机度	0.42	0.46(月均值)



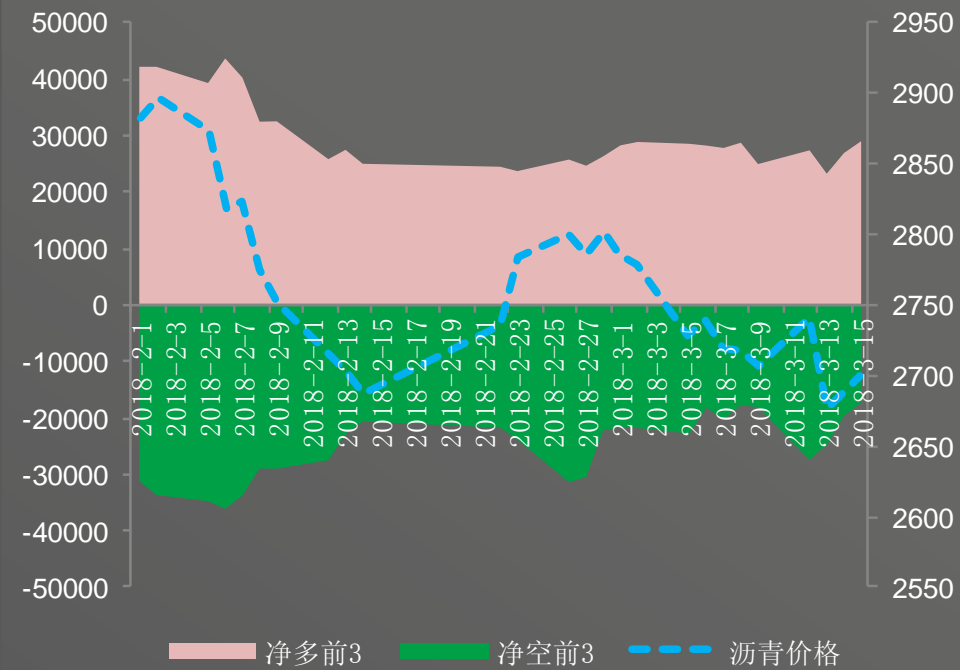
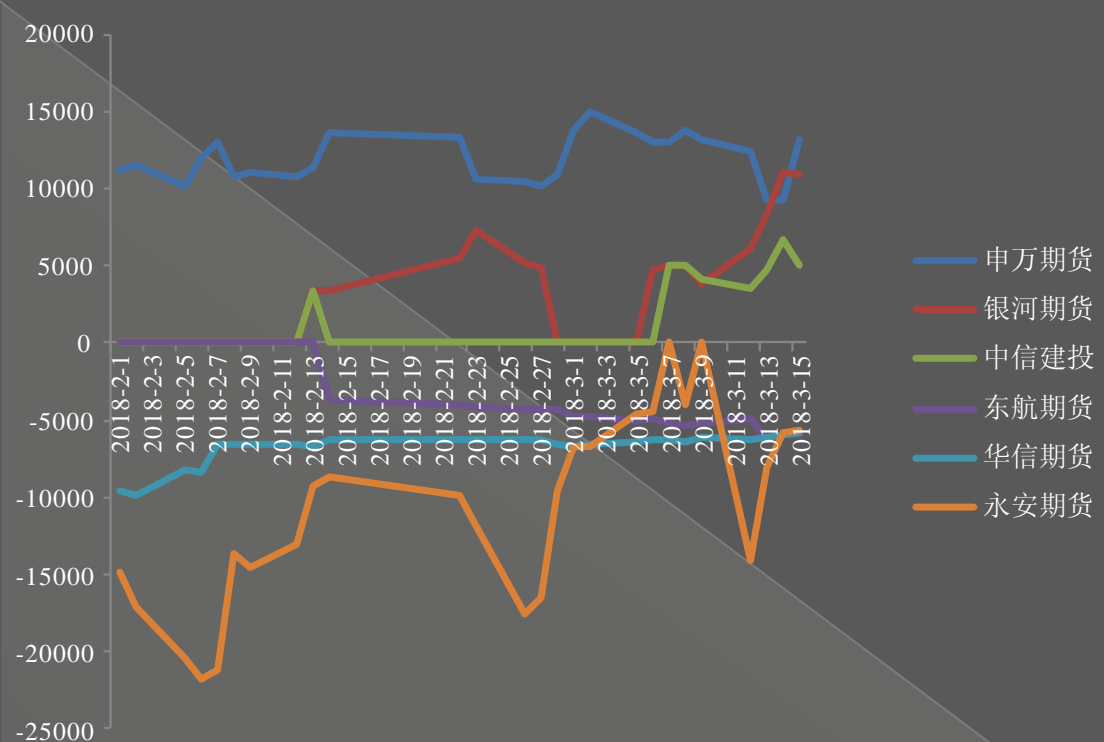
# 化工：橡胶



变动幅度		当日	最近5日	平均变化	波动率
ru持仓	多头前3	1.77%	10.57%	2.11%	16.49%
	空头前3	0.54%	-5.08%	-1.02%	
ru涨幅		0.21%	-0.78%	-0.16%	
震荡幅度	1.23%	2.04%(月均值)	投机度	0.63	0.72(月均值)

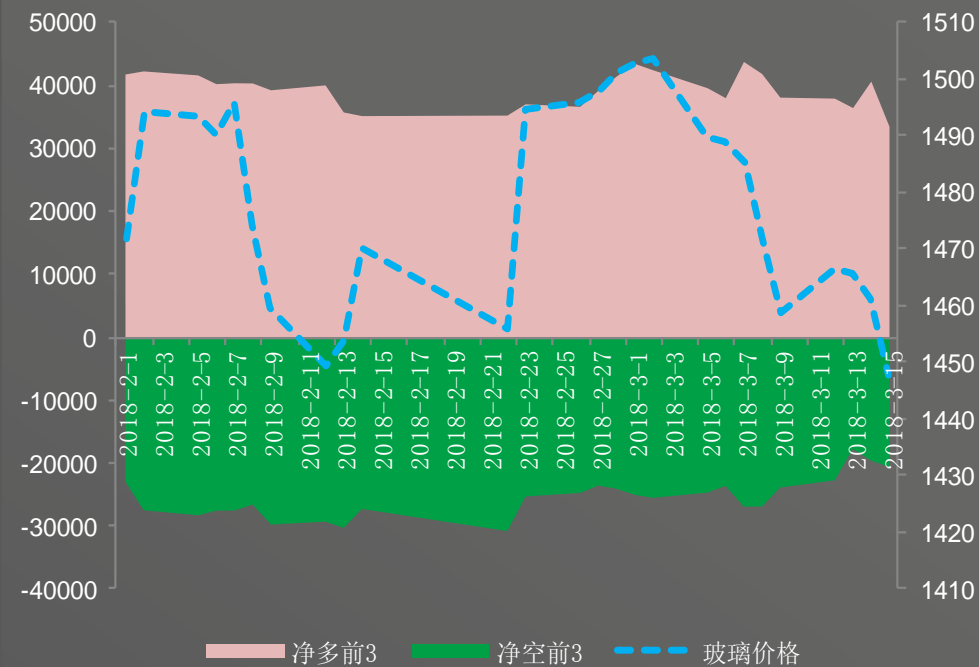
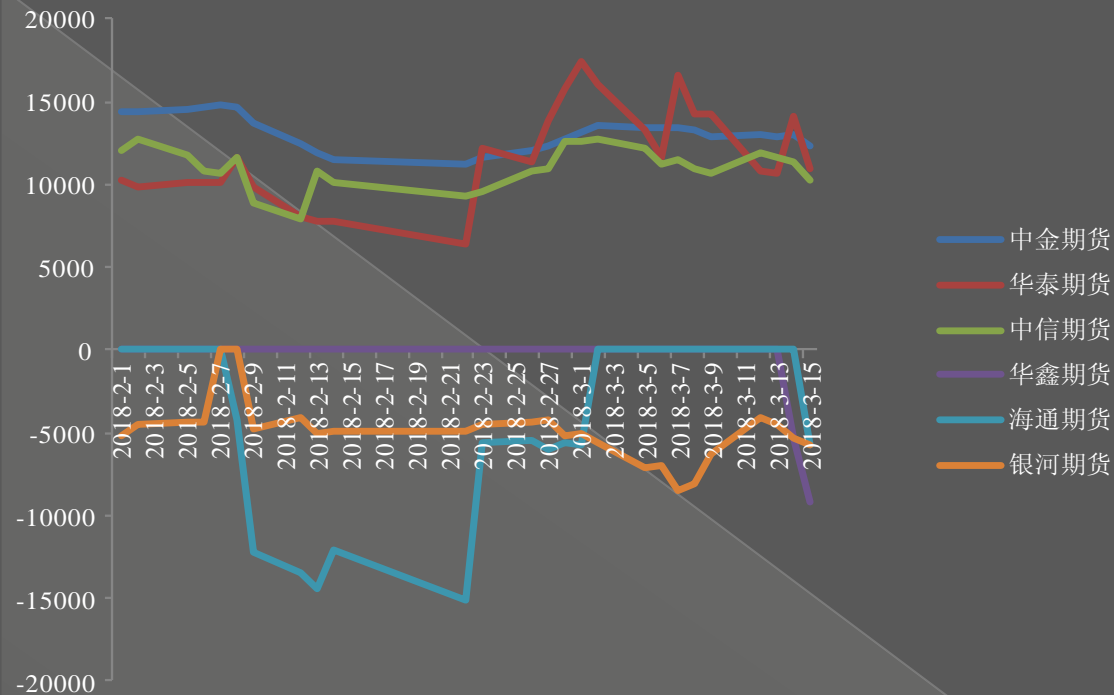


# 化工：沥青



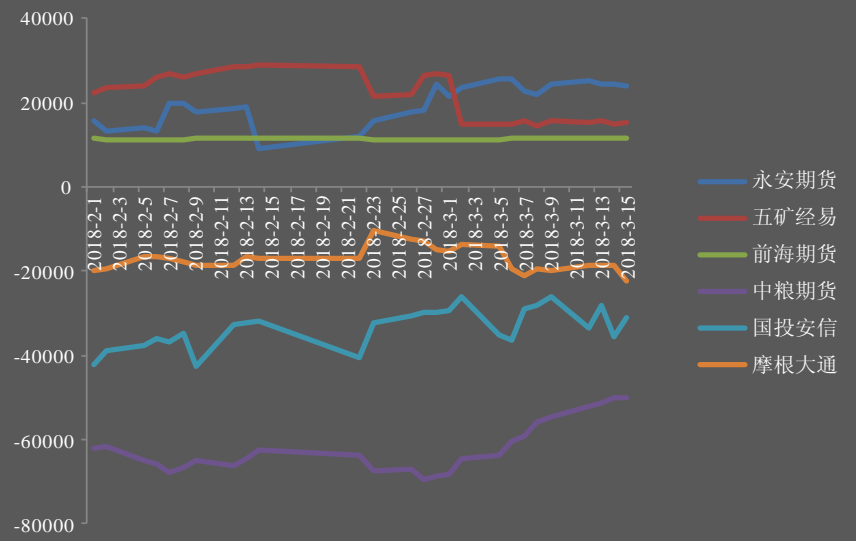
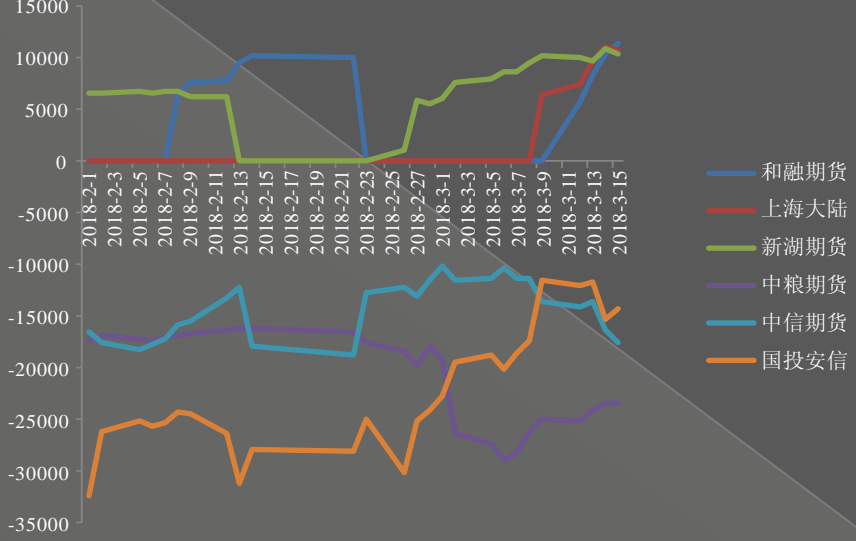
变动幅度		当日	最近5日	平均变化	波动率
bu持仓	多头前3	7.87%	0.95%	0.19%	17.04%
	空头前3	-11.89%	-2.11%	-0.42%	
bu涨幅		0.47%	-0.72%	-0.14%	
震荡幅度	0.92%	1.78%(月均值)	投机度	0.62	0.78(月均值)

# 化工：玻璃



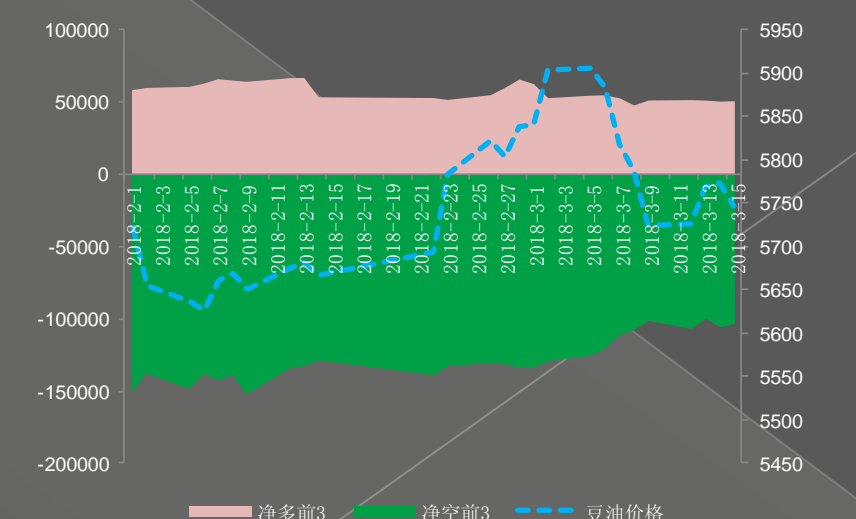
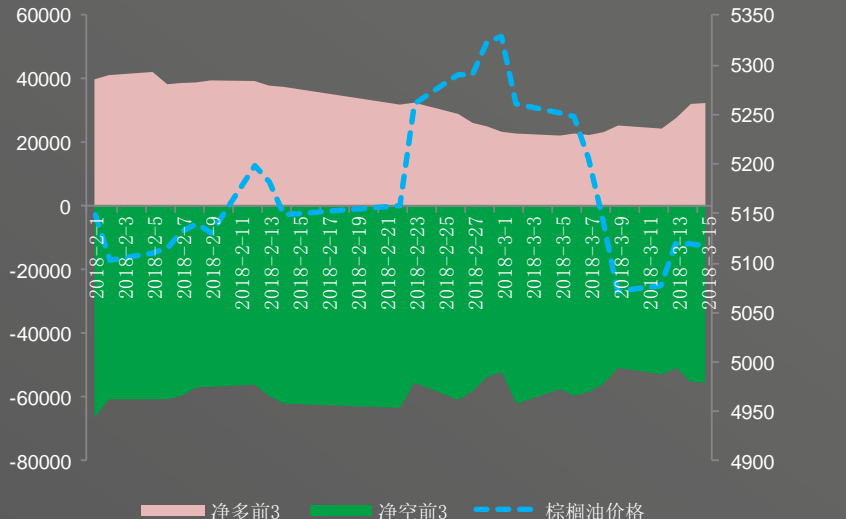
变动幅度		当日	最近5日	平均变化	波动率
fg持仓	多头前3	-17.69%	-20.06%	-4.01%	14.01%
	空头前3	5.04%	-23.44%	-4.69%	
fg涨幅		-0.92%	-1.61%	-0.32%	
震荡幅度	1.53%	1.55%(月均值)	投机度	0.74	0.57(月均值)

# 农产品：P & Y

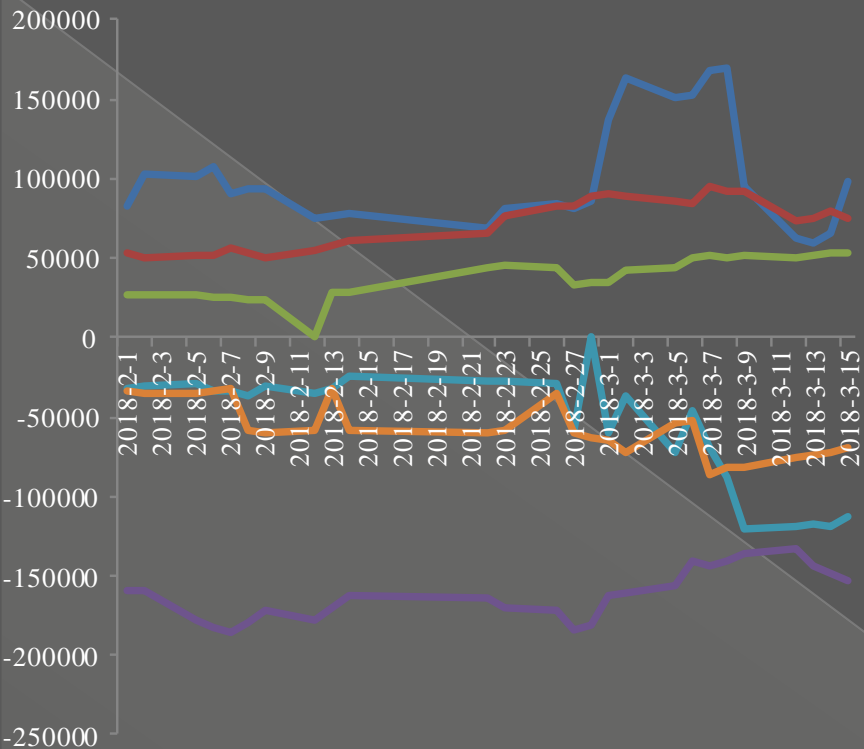


变动幅度		当日	最近5日	平均变化	波动率
p持仓	多头前3	0.92%	39.19%	7.84%	12.64%
	空头前3	0.39%	-0.82%	-0.16%	
p涨幅		-0.04%	-0.51%	-0.10%	
震荡幅度	0.93%	1.26%(月均值)	投机度	0.44	0.60(月均值)

变动幅度		当日	最近5日	平均变化	波动率
y持仓	多头前3	0.49%	6.04%	1.21%	10.28%
	空头前3	-2.11%	-3.88%	-0.78%	
y涨幅		-0.46%	-0.70%	-0.14%	
震荡幅度	1.14%	1.21%(月均值)	投机度	0.34	0.39(月均值)

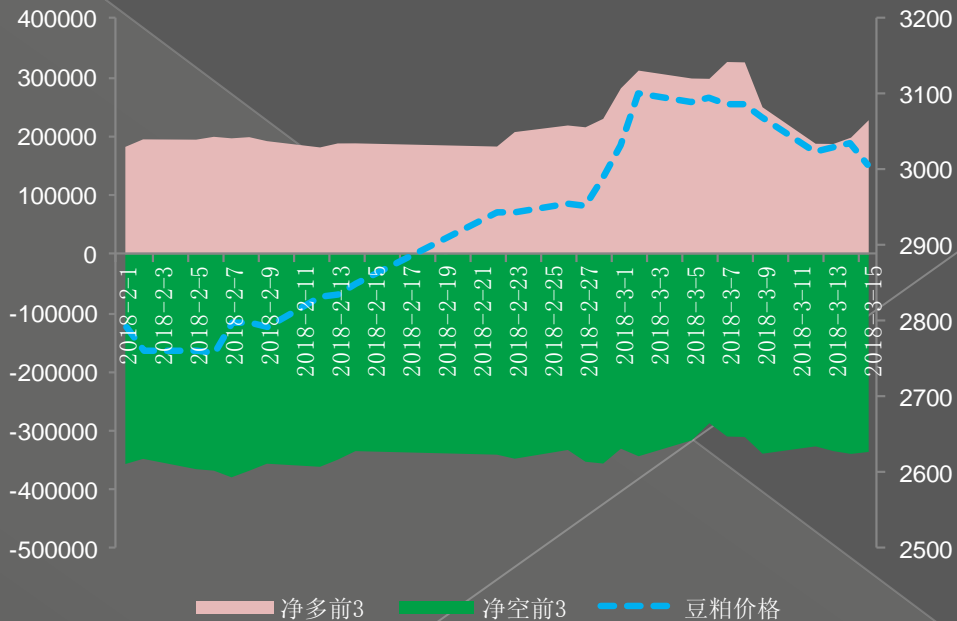


# 农产品：豆粕

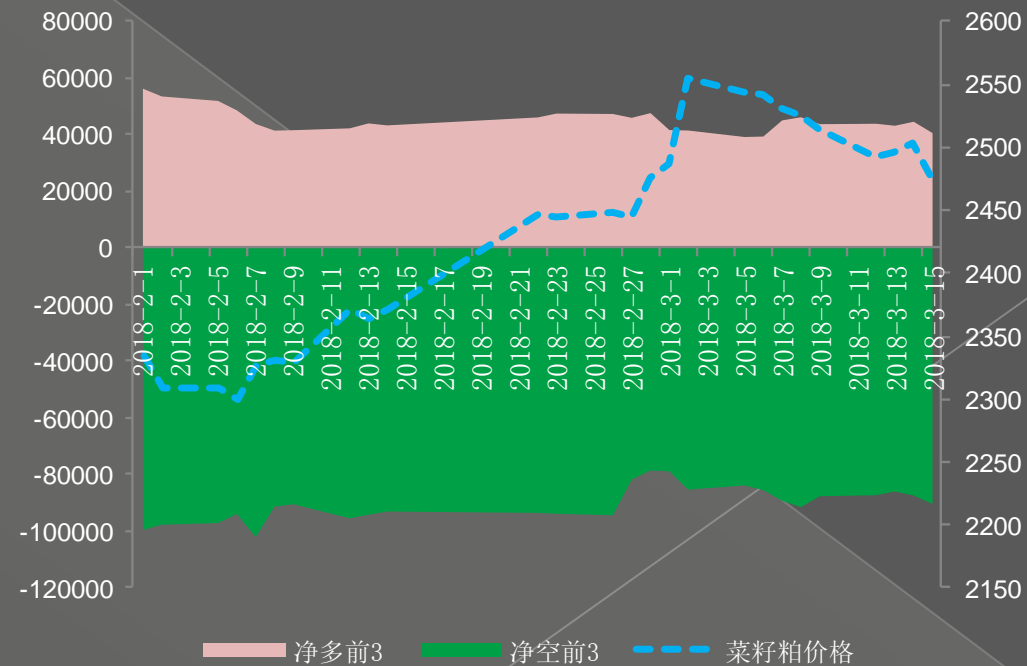
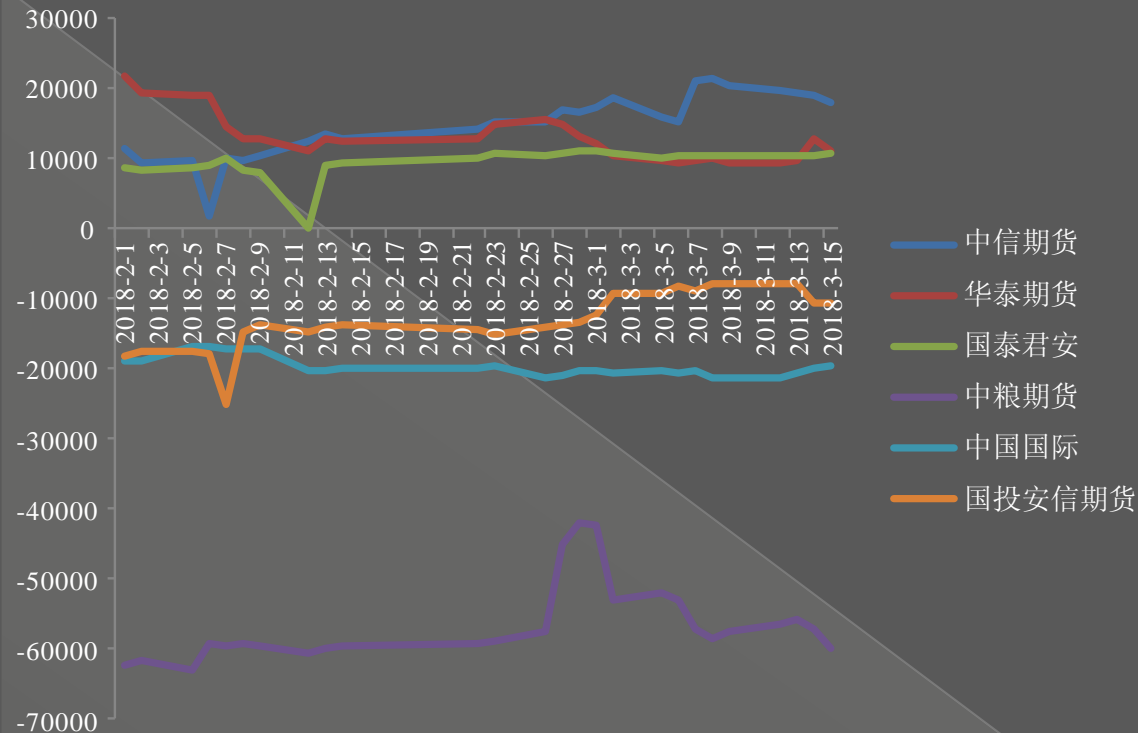


- 永安期货
- 中信期货
- 中信建投
- 中粮期货
- 银河期货
- 新湖期货

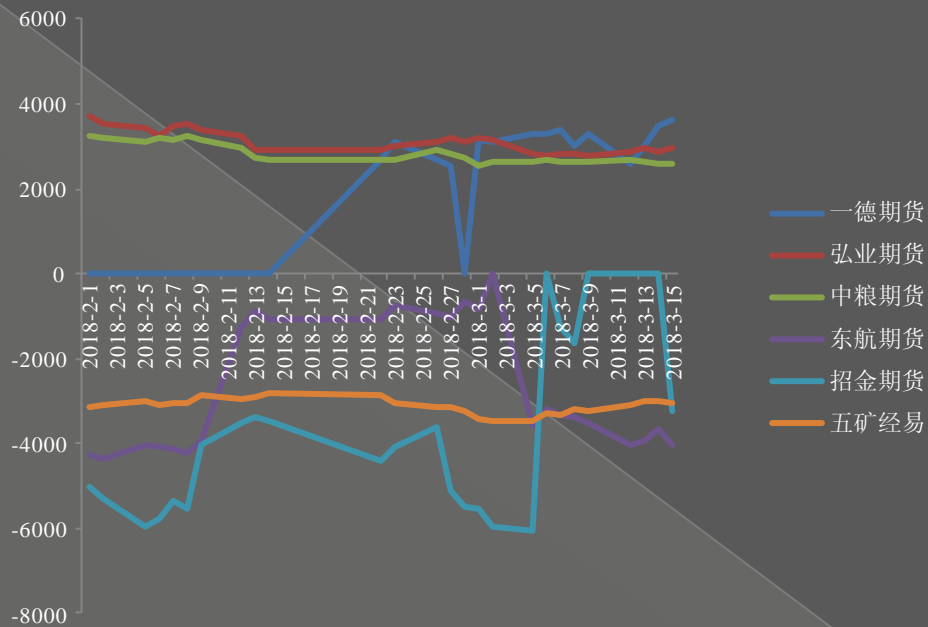
变动幅度		当日	最近5日	平均变化	波动率
m持仓	多头前3	14.91%	-30.11%	-6.02%	17.04%
	空头前3	-1.01%	8.18%	1.64%	
m涨幅		-0.88%	-2.59%	-0.52%	
震荡幅度	1.64%	1.37%(月均值)	投机度	0.58	0.53(月均值)



# 农产品：菜粕

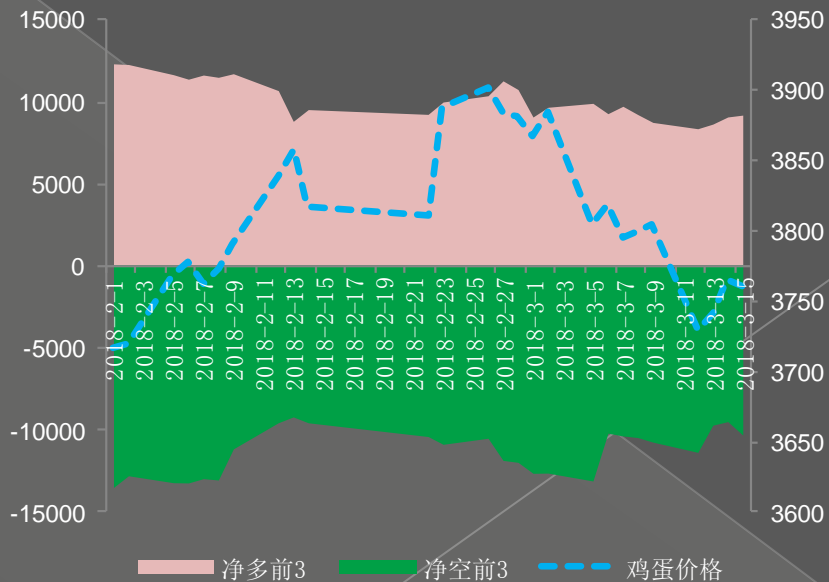


变动幅度		当日	最近5日	平均变化	波动率
rm持仓	多头前3	-8.98%	-12.10%	-2.42%	16.93%
	空头前3	3.42%	-1.22%	-0.24%	
rm涨幅		-1.10%	-2.01%	-0.40%	
震荡幅度	1.64%	1.28%(月均值)	投机度	0.69	0.62(月均值)

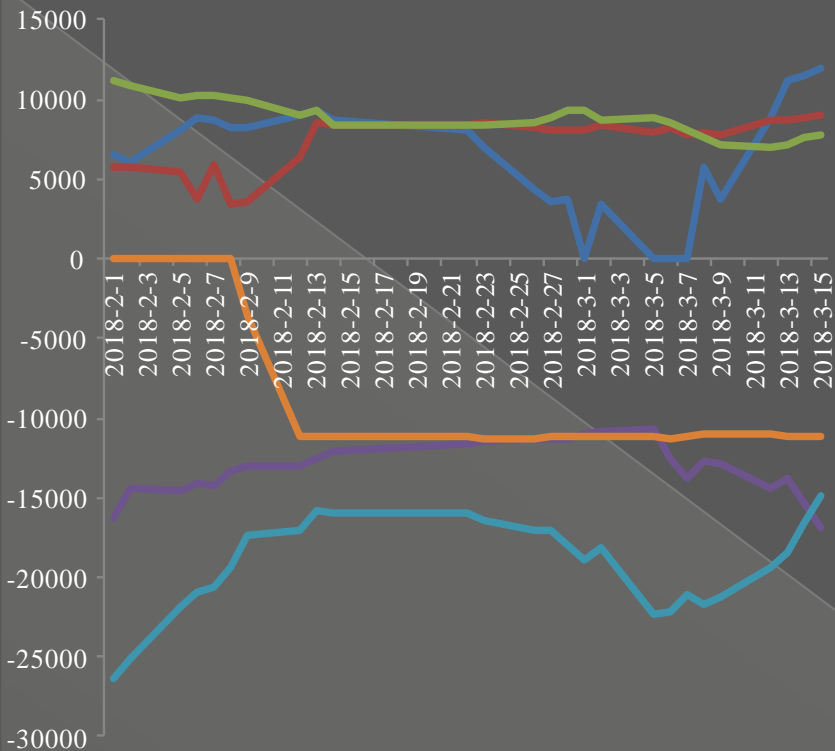


# 农产品：鸡蛋

变动幅度		当日	最近5日	平均变化	波动率
jd持仓	多头前3	1.24%	-0.34%	-0.07%	14.44%
	空头前3	8.50%	-1.51%	-0.30%	
jd涨幅		-0.10%	-1.03%	-0.21%	
震荡幅度	1.02%	1.27%(月均值)	投机度	0.36	0.42(月均值)

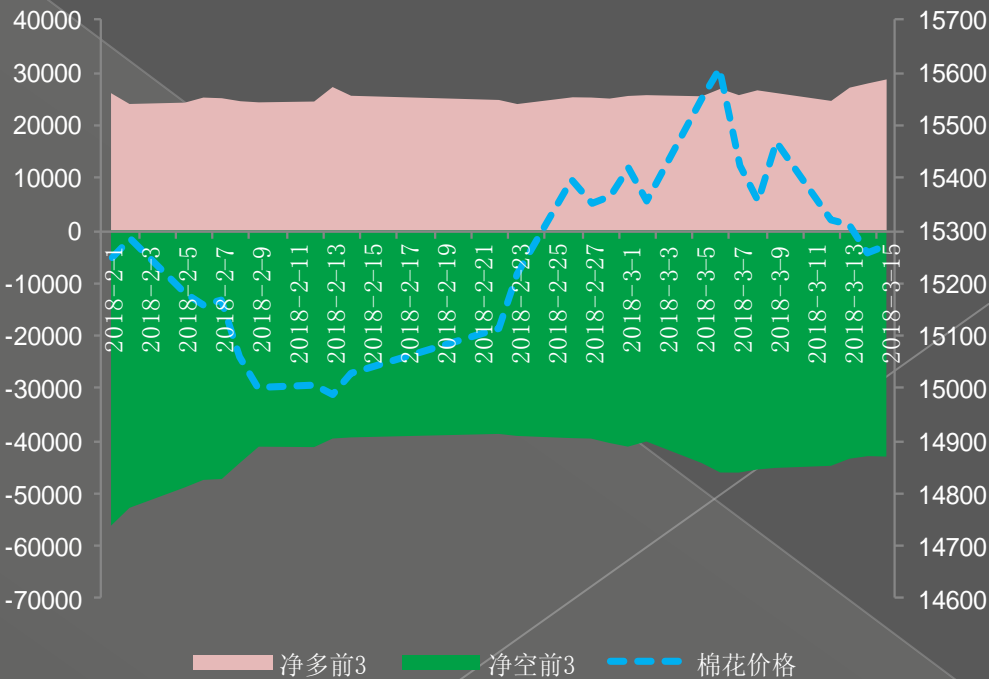


# 农产品：棉花

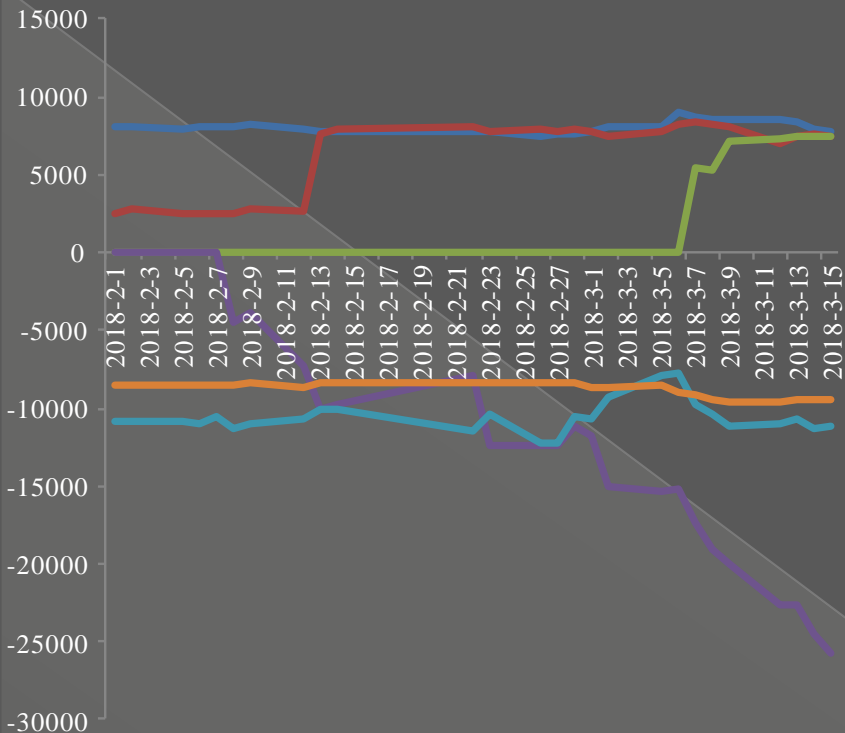


- 永安期货
- 银河期货
- 方正中期
- 东证期货
- 华信期货
- 格林大华期货

变动幅度		当日	最近5日	平均变化	波动率
cf持仓	多头前3	2.68%	7.78%	1.56%	9.88%
	空头前3	0.21%	-5.41%	-1.08%	
cf涨幅		0.10%	-0.54%	-0.11%	
震荡幅度	0.89%	0.91%(月均值)	投机度	0.55	0.36(月均值)

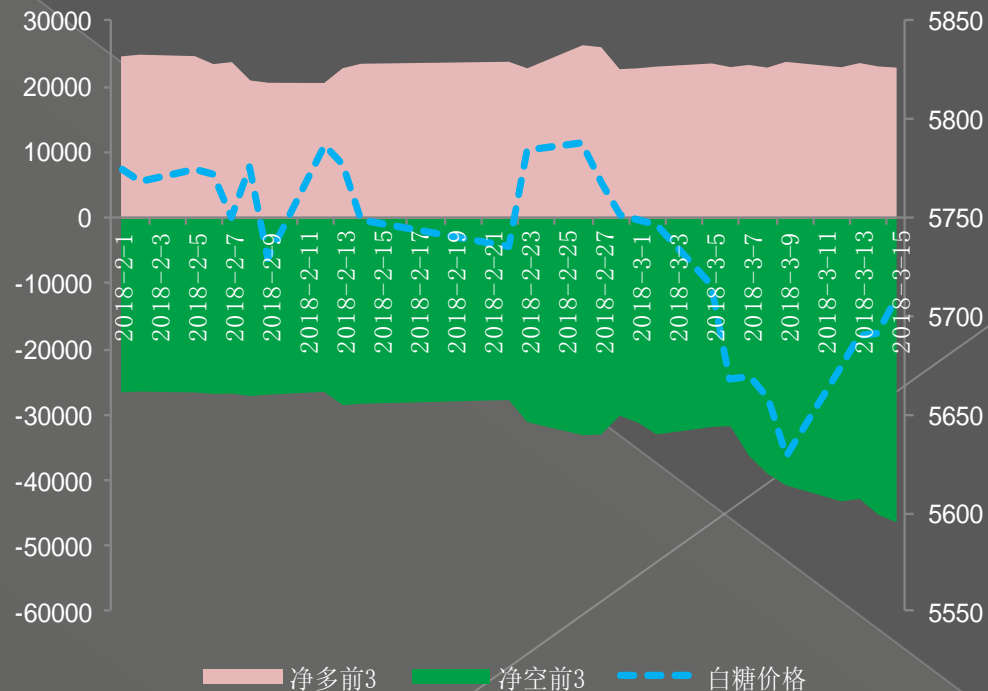


# 农产品：白糖



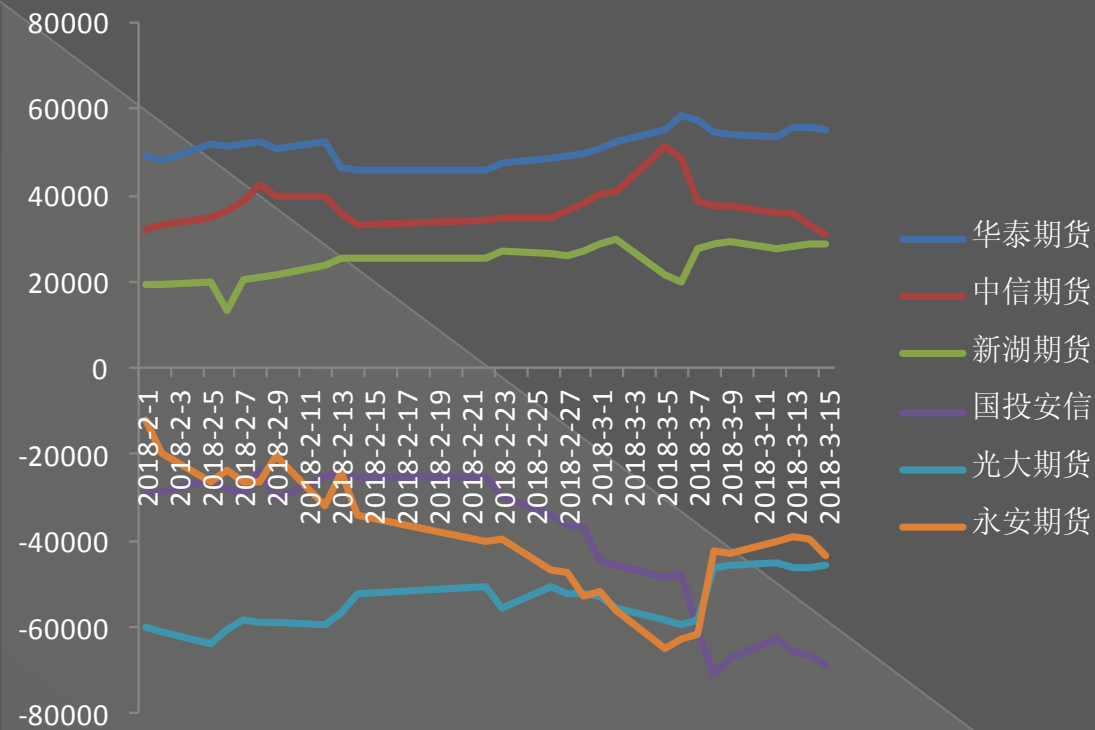
- 一德期货
- 混沌天成期货
- 五矿经易期货
- 中粮期货
- 中信期货
- 中金期货

变动幅度		当日	最近5日	平均变化	波动率
sr持仓	多头前3	-0.78%	0.00%	0.00%	7.93%
	空头前3	2.60%	19.13%	3.83%	
sr涨幅		0.29%	0.88%	0.18%	
震荡幅度	0.56%	0.80% (月均值)	投机度	0.43	0.44 (月均值)

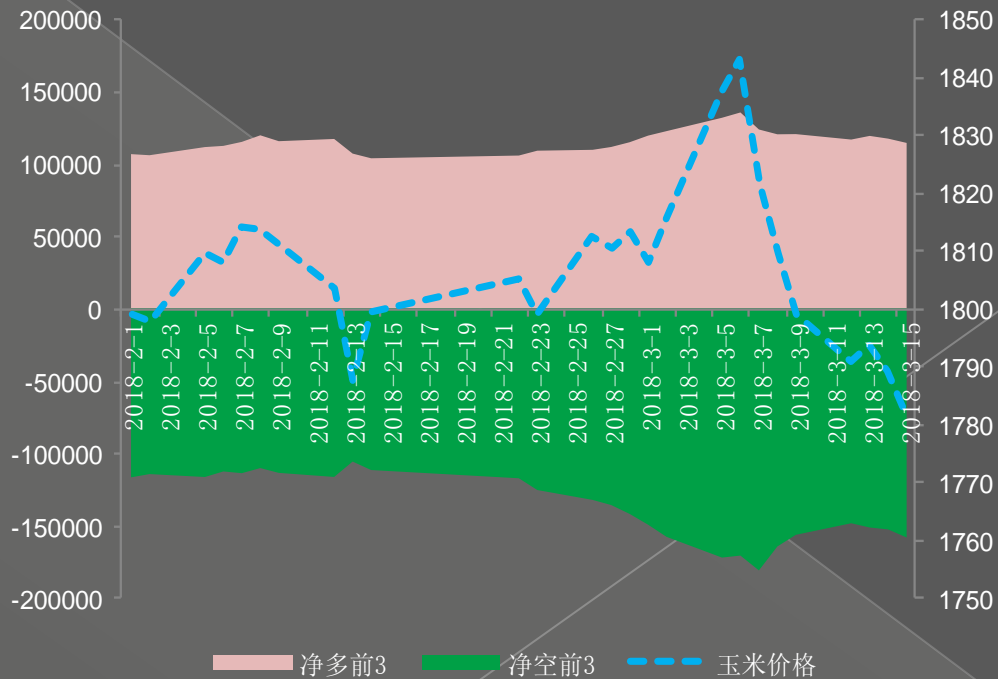




# 农产品：玉米



变动幅度		当日	最近5日	平均变化	波动率
c持仓	多头前3	-2.51%	-4.94%	-0.99%	8.87%
	空头前3	3.66%	-3.77%	-0.75%	
c涨幅		-0.40%	-1.52%	-0.30%	
震荡幅度	0.60%	0.78%(月均值)	投机度	0.44	0.42(月均值)



# 部分机构资金变动表

制表日期：2018年3月15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	12272.95	6.04%	-15893.57	-6.87%
南华期货	4103.41	6.28%	1589.06	2.34%
混沌天成	-321.29	-0.92%	3681.73	11.85%
海通期货	-8198.56	-6.82%	-7034.15	-5.91%
上海大陆	-142.91	-2.52%	4364.31	378.44%
中信期货	-2093.88	-0.96%	-19718.75	-8.33%
新湖期货	617.77	0.92%	-10582.50	-13.54%

中粮期货	-245.37	-0.12%	-24998.10	-11.23%
中信建投	6550.57	18.14%	7070.97	19.86%
申银万国	-598.40	-1.71%	489.14	1.44%
华泰期货	1916.74	2.33%	-42020.44	-33.28%
光大期货	-2305.14	-2.97%	-10342.59	-12.06%
一德期货	-3674.67	-3.14%	11647.74	11.45%
国投期货	-10382.79	-12.55%	-433.01	-0.59%
金瑞期货	8163.88	7.99%	289.40	0.26%
鲁证期货	11726.06	13.12%	-7151.74	-6.61%
中国国际	-5438.18	-8.14%	-8225.36	-11.81%

# 部分机构持仓一览

机构	永安期货					
日期	2018-3-8	2018-3-9	2018-3-12	2018-3-13	2018-3-14	2018-3-15
黄金	4465	4060	3756	3795	3817	4044
白银						
沪铜	18194	11914	10586	9625	10931	10908
沪铝	-145	812			-6436	-11263
沪镍			6041		9903	6894
沪锌	-6513	-7505	-7574	-6418	-6397	-9806
沪铅		798				
螺纹钢						
铁矿石	3784	-6744	-29182	-37341	-12049	12086
焦煤		1787			4404	5767
焦炭	2609	5455	-2307	-4702	-10015	-5824
豆油	22143	24603	25282	24627	24584	24255
棕榈油	-5884	-7656	-8628	-7583		-4582
菜籽油	13758	8015	8557	7281	6683	7268
豆粕	170172	95349	62158	60343	65318	98049
菜籽粕	8250	7501	5091	5451		176
棉花	5693	3720	8883	11230	11468	11908
白糖	-4124					
玉米	-42464	-42719	-40293	-39308	-39609	-43376
鸡蛋		-125	-24	358	973	1091
PTA					-15209	-18785
聚乙烯	10132	15740			11025	11640
聚丙烯	26347	22842	10769	9492	10705	10199
甲醇	22491	17823	7706	10815	7442	7651
玻璃						
橡胶	-22450	-21976	-22272	-22579	-19563	-19662
沥青	-4021		-14023	-8007	-5756	-5718
动力煤	24559	26661	26072	29187	27710	28564

## 部分机构持仓一览

机构	南华期货					
日期	2018-3-8	2018-3-9	2018-3-12	2018-3-13	2018-3-14	2018-3-15
黄金	-951	-1043	-1123	-1165		-1283
白银		8273	8796	8468	8592	8431
沪铜	4716	5355				
沪铝	-14572	-10507	-11710	-10746	5617	4691
沪镍						
沪锌						
沪铅	-558		-779	-967	-860	-566
螺纹钢		26754	33146	36781	37280	36750
铁矿石						
焦煤						
焦炭	-3325	-3301	-2234			-1968
豆油	11212	11628	9822	9758	9669	10079
棕榈油						
菜籽油						-5551
豆粕		-30664				
菜籽粕					-9863	-9312
棉花						
白糖	5218	5084	5236	4944	5185	4896
玉米						
鸡蛋						2338
PTA	14349	14011	15800	14894	16452	15351
聚乙烯	17114	16994	18509	18911	18661	15011
聚丙烯	-8680	-8605	-7615	-8204	-8705	-8234
甲醇		1737	623	838		1945
玻璃			4916	4805	4426	
橡胶	1336	1011	2020	1960	1975	1648
沥青				-4527	-4868	
动力煤						

## 部分机构持仓一览

机构	国泰君安					
日期	2018-3-8	2018-3-9	2018-3-12	2018-3-13	2018-3-14	2018-3-15
黄金	3337	3939	4528	4037	5699	5735
白银	-16006	-16727	-16059	-16031	-16852	-16560
沪铜	5144	5004	7125	5702	7529	6485
沪铝	12495	12653	12479	12823	11739	6869
沪镍						
沪锌						-2507
沪铅			702	767		697
螺纹钢	52653	54324	56707	58874	59606	54368
铁矿石	11745	11821	12639	28152	10143	8295
焦煤		-892			-530	-823
焦炭		-504		-382	-475	-819
豆油		1731	1705			
棕榈油						
菜籽油	36043	35838	35849	35891	36057	36280
豆粕			30016			
菜籽粕	10529	10388	10565	10562	10668	10864
棉花						
白糖	-8181	-7971	-7563	-7502	-7294	-7119
玉米						
鸡蛋	1244	1172	818	703	609	603
PTA						
聚乙烯	-7695			-5140		
聚丙烯	8382	8489	8272	8448	8757	9485
甲醇	-6797	-5706	-3392	-1985	-1445	
玻璃	4462					
橡胶	-4354	-4342	-4146	-4800	-4670	-5011
沥青						
动力煤						

## 部分机构持仓一览

机构	混沌天成					
日期	2018-3-8	2018-3-9	2018-3-12	2018-3-13	2018-3-14	2018-3-15
黄金						
白银						
沪铜	-8448	-8447	-8432	-8442	-9634	-9629
沪铝						
沪镍	-8939	-9192	-9427	-8987	-9343	-9220
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	2018-3-8	2018-3-9	2018-3-12	2018-3-13	2018-3-14	2018-3-15
黄金	4750	4138	5093	4988	4983	5295
白银	16369	13959	14734	12689	13016	11878
沪铜	-15303	-15112	-16066	-15314	-15479	-15616
沪铝	-6248	-8932	-11247	-11511	-10020	-4806
沪镍	9142	9519	11667	10810	10498	8260
沪锌						
沪铅	1709	3343	3454	3448	3470	4025
螺纹钢						
铁矿石	-10900	-12231	-11534	-8485	692	
焦煤			-1570			-1709
焦炭				1031	2356	-105
豆油						
棕榈油	7541	7786	7137			
菜籽油	-4932	-5578	-5113	-4906	-6810	-6391
豆粕	36735	37229		32961	36051	35461
菜籽粕	9032	7895	9368	6810	7963	6654
棉花						
白糖		-6902	-6834	-7433	-7464	-6883
玉米	26749	25153	26330	20688	20593	17679
鸡蛋	1252	1017	453	727	1312	1265
PTA	16011	13417				
聚乙烯	-6213		-6924	-5735	-5993	-5892
聚丙烯		5010				3467
甲醇				-3054	4185	-1089
玻璃						-5775
橡胶						
沥青						
动力煤		-4196				



## 部分机构持仓一览

机构	上海大陆					
日期	2018-3-8	2018-3-9	2018-3-12	2018-3-13	2018-3-14	2018-3-15
黄金						
白银						
沪铜						
沪铝						
沪镍						
沪锌						
沪铅						
螺纹钢						
铁矿石						
焦煤						
焦炭						
豆油						
棕榈油		6458	7424	9734	11057	10782
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	-4242	-6320				
动力煤						

# 部分机构持仓一览

机构	中粮期货					
日期	2018-3-8	2018-3-9	2018-3-12	2018-3-13	2018-3-14	2018-3-15
黄金						
白银						
沪铜	-13223	-12731	-11517	-7312	-8170	-6815
沪铝	-6346	-5823	-7530	-5620	-6413	-6645
沪镍	7018	6907	6858	7023		
沪锌	-6404	-8379	-6136	-5787	-6180	-5917
沪铅						641
螺纹钢						
铁矿石						
焦煤						
焦炭	2381					
豆油	-55649	-54721	-52221	-51064	-49978	-49939
棕榈油	-26194	-24929	-25089	-24064	-23341	-23323
菜籽油	-21715	-21096	-20689	-18344	-20308	-22738
豆粕	-141085	-135236	-132169	-143220	-147730	-152821
菜籽粕	-58282	-57286	-56395	-55721	-56926	-59957
棉花	-8746	-8776	-8846	-8368	-7804	-7831
白糖	-19124	-19961	-22668	-22565	-24456	-25794
玉米	-47288	-43079	-39217	-38198	-34931	-31214
鸡蛋	2633	2627	2678	2624	2598	2584
PTA				-17225		
聚乙烯					8499	8262
聚丙烯						
甲醇						
玻璃	-5224	-6315	-5145	-4850		
橡胶	-7675	-7667	-7593	-7713	-7723	-7737
沥青						
动力煤	-5788	-5922	-6203	-6419	-6699	-6830

# 部分机构持仓一览

机构	中信期货					
日期	2018-3-8	2018-3-9	2018-3-12	2018-3-13	2018-3-14	2018-3-15
黄金	7200	8299	7967	7659	7762	6693
白银	-35228	-39080	-36691	-36724	-34169	-34961
沪铜	-23963	-24605	-24935	-23466	-23833	-24619
沪铝	-26655	-26488	-28316	-25894	-24363	-24042
沪镍				5433	5025	6201
沪锌						
沪铅	-3192	-3889	-3622	-3284	-2747	-2675
螺纹钢						
铁矿石	-13597	-5728			-7480	-7511
焦煤	6022	6293	7031	6543	7984	6200
焦炭	1626	850	2355	2775	2415	1872
豆油	-10996	-14739	-18210	-16481	-15871	-18402
棕榈油	-11360	-13512	-14050	-13571	-16357	-17582
菜籽油	-12612	-12953	-12743	-12540	-11161	-11479
豆粕	91759	91918	74302	74631	79297	75344
菜籽粕	21566	20580	19917	19615	19168	18241
棉花	5363	4750	4297			
白糖	-10422	-11188	-10931	-10756	-11280	-11098
玉米	37684	37711	35705	35878	32995	30983
鸡蛋			-338	-390	-646	-1004
PTA	31242	29200	15257			
聚乙烯	-6766	-9337	-5726	-6109	-6159	-6624
聚丙烯	6139	6061				
甲醇	-6068	-3745	-1716	-1578		
玻璃	10976	10673	11972	11667	11329	10324
橡胶						
沥青			-4129	-4941	-5298	-4974
动力煤						

## 部分机构持仓一览

机构	中信建投					
日期	2018-3-8	2018-3-9	2018-3-12	2018-3-13	2018-3-14	2018-3-15
黄金						
白银	10254	10558	9685	9496	8082	9141
沪铜						
沪铝						
沪镍	8134	7954	6617			
沪锌						
沪铅						
螺纹钢				33186	29786	28545
铁矿石		1648				
焦煤						
焦炭						2051
豆油						
棕榈油	-8884	-11020	-10296	-12240	-5345	-10613
菜籽油						
豆粕	51000	51896	50848	51924	53037	53720
菜籽粕						
棉花						
白糖						
玉米						
鸡蛋			582	461		
PTA						
聚乙烯						
聚丙烯						
甲醇						
玻璃			-4824	-4886		
橡胶						
沥青	4985	4187	3526	4709	6616	5017
动力煤						

## 部分机构持仓一览

机构	新湖期货					
日期	2018-3-8	2018-3-9	2018-3-12	2018-3-13	2018-3-14	2018-3-15
黄金	-1177	-614	-619	-712	-635	-1279
白银						
沪铜	6207	6324	6750	6746	6721	6622
沪铝						
沪镍	-7121		-7023			
沪锌						
沪铅						
螺纹钢						
铁矿石						
焦煤						
焦炭						
豆油						
棕榈油	9556	10206	10033	9782	10920	10457
菜籽油	-5184	-4583	-4536	-7298	-7096	
豆粕	-81513	-82181	-74847	-73484	-72549	-69873
菜籽粕						
棉花	3650	3622				3006
白糖						
玉米	28705	29294	27882	28406	28948	28961
鸡蛋	-306	-365	-223	-176		
PTA	-25642	-28739	-28724	-28776	-29314	-30472
聚乙烯						
聚丙烯					-4620	-4892
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

