



市场持仓分析

2018/3/27

今天持仓变化

品种	今天变化						今天头寸变化参考	
	净多前3	净多前5	净多前10	净空前3	净空前5	净空前10	净多前3-净空前3	指标参考
沥青	7.52%	1.39%	1.89%	-9.61%	-6.99%	-5.01%	17.14%	☆☆☆
豆粕	5.62%	9.80%	9.56%	-7.23%	-2.70%	3.40%	12.85%	☆☆☆
PTA	4.67%	4.89%	6.59%	-6.30%	-5.16%	0.74%	10.97%	☆☆☆
鸡蛋	6.29%	3.75%	3.81%	-2.20%	-1.51%	-2.13%	8.49%	☆☆
玻璃	-5.18%	-10.15%	-12.85%	-12.40%	-14.87%	-16.39%	7.21%	☆☆
聚丙烯	1.19%	2.25%	1.26%	-5.31%	-6.68%	-7.87%	6.50%	☆☆
橡胶	0.89%	1.34%	-0.83%	-4.29%	-3.68%	-1.82%	5.17%	☆☆
沪铜	1.75%	0.83%	-0.15%	-1.71%	-1.23%	0.97%	3.46%	☆
白糖	3.93%	2.97%	3.18%	1.54%	1.04%	1.83%	2.39%	☆
动力煤	1.14%	0.91%	2.89%	-0.79%	-2.73%	-2.10%	1.93%	☆
豆油	5.60%	3.76%	8.08%	4.09%	5.35%	3.13%	1.50%	☆
铁矿石	-3.61%	-5.08%	-4.73%	-3.11%	-0.66%	1.75%	-0.50%	☆
菜籽粕	-0.99%	-0.31%	-7.83%	-0.47%	-0.01%	-5.10%	-0.52%	☆
棕榈油	4.12%	2.99%	2.98%	6.07%	5.19%	5.14%	-1.94%	☆
沪镍	-3.37%	-3.72%	-0.50%	0.97%	3.36%	4.62%	-4.34%	☆
棉花	-0.30%	-1.38%	-0.67%	4.78%	6.09%	6.38%	-5.08%	☆☆
沪铝	-6.25%	-4.62%	-5.08%	-1.05%	-1.22%	-4.72%	-5.20%	☆☆
沪银	-6.54%	-2.42%	-0.92%	1.39%	2.27%	4.60%	-7.93%	☆☆
沪金	-5.96%	-5.15%	-4.28%	2.56%	1.29%	28.92%	-8.52%	☆☆
玉米	-8.78%	-8.76%	-5.79%	0.41%	-2.14%	-4.89%	-9.19%	☆☆
聚乙烯	-12.17%	-11.40%	-8.24%	-1.86%	2.70%	1.17%	-10.31%	☆☆☆
沪锌	-11.17%	-8.62%	-9.16%	-0.64%	-1.89%	-2.02%	-10.53%	☆☆☆
甲醇	8.81%	3.66%	-4.36%	19.60%	5.17%	-5.78%	-10.79%	☆☆☆
螺纹钢	-15.66%	-13.29%	-10.03%	-4.30%	-4.29%	-4.93%	-11.36%	☆☆☆
焦炭	-12.10%	-10.57%	-12.80%	0.59%	1.40%	0.71%	-12.69%	☆☆☆
焦煤	4.08%	4.50%	11.19%	17.45%	6.60%	14.37%	-13.38%	☆☆☆

近5日持仓变化

品种	五日变化						近五日头寸变化参考	
	净多前3	净多前5	净多前10	净空前3	净空前5	净空前10	净多前3-净空前3	指标参考
铁矿石	5.17%	1.87%	-4.97%	-31.62%	-22.15%	-22.49%	36.79%	☆☆☆
菜籽粕	13.54%	8.85%	-4.44%	-5.44%	-0.36%	15.02%	18.98%	☆☆
沪铜	5.70%	4.48%	-2.98%	-13.24%	-11.05%	-2.18%	18.94%	☆☆
动力煤	-2.93%	-5.97%	-4.25%	-18.86%	-16.55%	-14.78%	15.93%	☆☆
甲醇	31.68%	36.68%	41.00%	17.84%	35.41%	24.01%	13.84%	☆☆
棉花	4.06%	-1.31%	-0.69%	-9.62%	-5.24%	-1.32%	13.69%	☆☆
豆粕	-5.66%	3.69%	5.55%	-19.05%	-8.64%	-3.02%	13.39%	☆☆
焦炭	28.94%	21.02%	18.07%	18.07%	22.88%	40.24%	10.87%	☆☆
棕榈油	12.86%	14.61%	20.23%	2.99%	-3.60%	-4.60%	9.87%	☆
鸡蛋	-7.13%	-8.85%	-12.79%	-11.37%	-8.01%	-16.55%	4.24%	☆
豆油	-4.14%	-5.10%	1.74%	-7.93%	-7.17%	-9.10%	3.79%	☆
橡胶	-5.92%	1.56%	9.59%	-8.99%	-7.26%	-4.93%	3.06%	☆
沪镍	16.26%	8.32%	6.89%	16.37%	13.66%	9.65%	-0.11%	☆
聚丙烯	8.19%	7.85%	4.22%	8.98%	0.22%	-6.28%	-0.79%	☆
白糖	-6.22%	-1.45%	6.19%	1.52%	5.50%	4.72%	-7.75%	☆
玻璃	-8.22%	-8.88%	-17.57%	-0.43%	-0.89%	-12.86%	-7.78%	☆
沪锌	-4.45%	-3.10%	-1.52%	4.97%	6.01%	-1.60%	-9.42%	☆
沪铝	-10.67%	-10.65%	-3.52%	0.43%	0.53%	-5.87%	-11.09%	☆☆
PTA	-39.80%	-32.74%	-27.59%	-28.04%	-25.94%	-23.06%	-11.76%	☆☆
聚乙烯	-19.82%	-13.46%	-9.90%	-6.64%	-6.55%	-8.26%	-13.18%	☆☆
沪银	-8.91%	2.45%	4.13%	7.11%	6.17%	3.82%	-16.02%	☆☆
沥青	-17.06%	-14.97%	-10.39%	6.44%	1.08%	-7.48%	-23.51%	☆☆
沪金	1.31%	-0.79%	1.69%	28.76%	13.83%	77.96%	-27.45%	☆☆
玉米	-17.86%	-17.26%	-1.88%	11.66%	5.41%	-3.71%	-29.51%	☆☆
螺纹钢	-8.62%	-10.17%	-8.88%	23.25%	15.80%	12.96%	-31.88%	☆☆☆
焦煤	-0.89%	7.62%	13.07%	34.13%	29.77%	28.54%	-35.02%	☆☆☆

持仓变化说明

- 1.本表所列数据均为净头寸的变化幅度，以净多前三变化幅度为例，对于今日持仓汇总，净多前3变化幅度= $[(\text{今日净多前3持仓量}/\text{昨日净多前3持仓量})-1]*100\%$ ，对于近五日持仓汇总，净多前3变化幅度= $[(\text{今日净多前3持仓量}/\text{前五日净多前3持仓量})-1]*100\%$ ，其他以此类推；
- 2.对于净多头或净空头前几变化幅度的数值，正值表示该净头寸的增加，负值表示该净头寸的减少；
- 3.对于市场主力买卖双方力量对比的情况，我们用“净多前3-净空前3”来衡量，正值表示净多头寸力量大于净空头寸力量，负值则表示净空头寸力量大于净多头寸力量；
- 4.“指标参考”一列星级评分是由“净多前3-净空前3”数据的绝对值给出，星级越高就越值得投资者关注。

绝对值 $\geq 50\%$	$20\% \leq \text{绝对值} < 50\%$	$10\% \leq \text{绝对值} < 20\%$	$5\% \leq \text{绝对值} < 10\%$	绝对值 $< 5\%$
☆☆☆☆☆	☆☆☆☆	☆☆☆	☆☆	☆

2018年3月27日机构持仓异动表

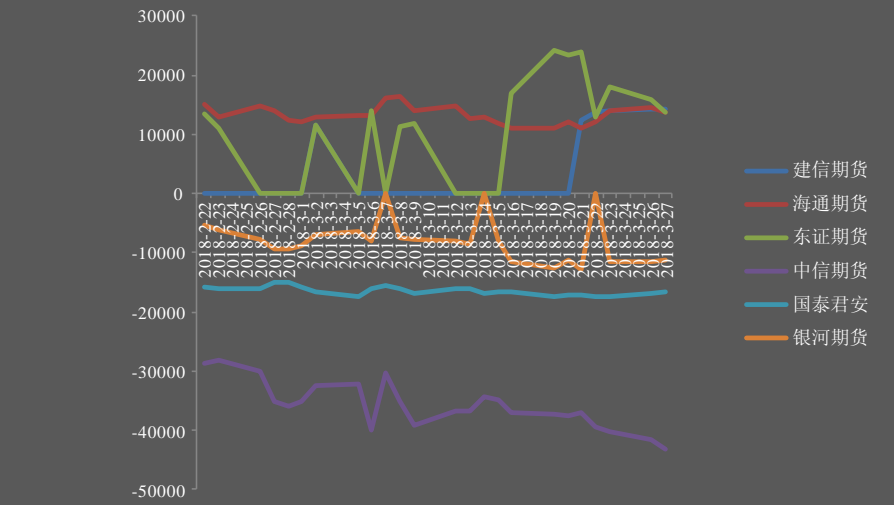
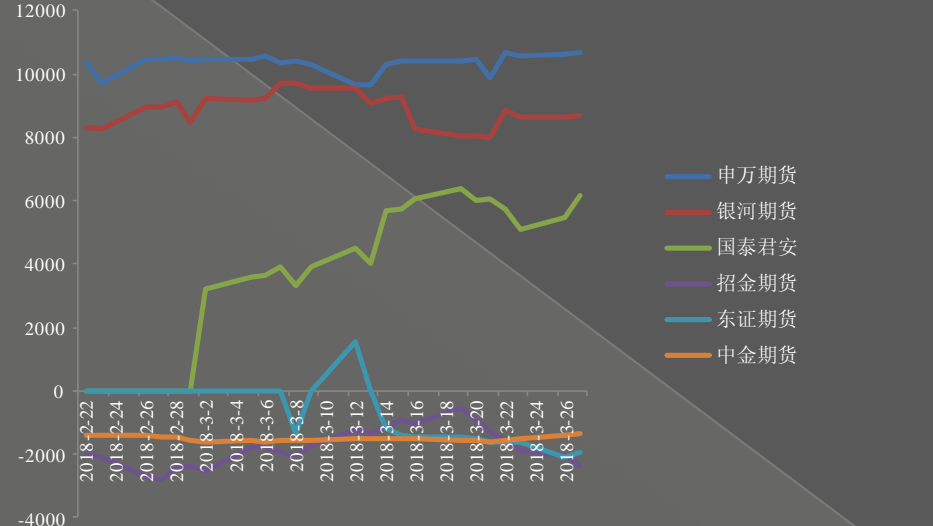
金属

广发期货	沪镍净多单变动幅度为：-2860手
广发期货	沪锌净多单变动幅度为：-2684手
金瑞期货	沪铅净多单变动幅度为：432手

黑色

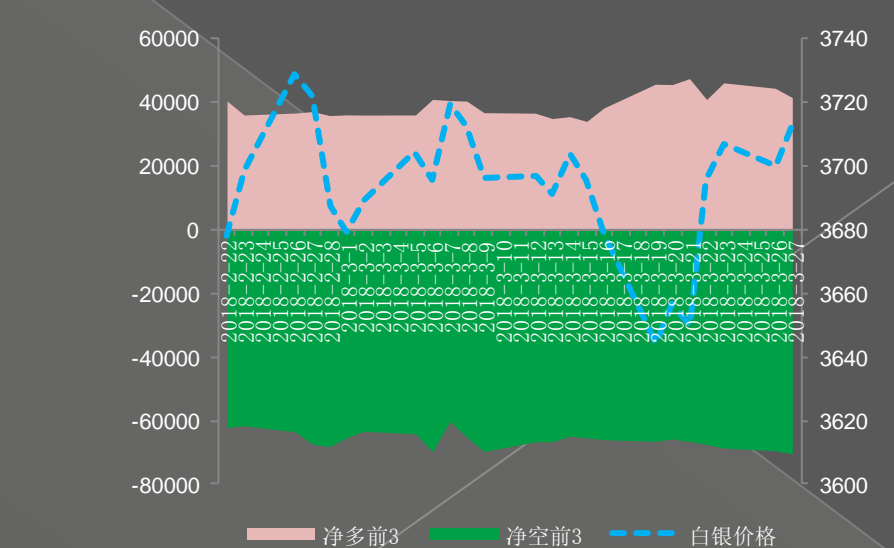
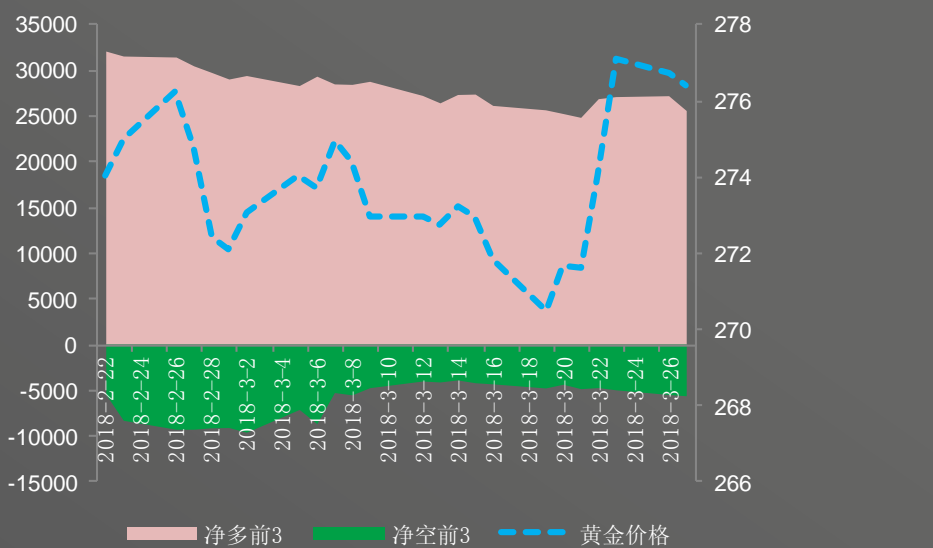
国泰君安	螺纹钢净多单变动幅度为：-23917手
国泰君安	螺纹钢净多单变动幅度为：-23917手
一德期货	螺纹钢净空单变动幅度为：23279手
徽商期货	铁矿石净多单变动幅度为：-23595手
东海期货	铁矿石净多单变动幅度为：-23340手
集成期货	焦煤净多单变动幅度为：-2729手
银河期货	焦煤净多单变动幅度为：3464手
华泰期货	焦煤净空单变动幅度为：5276手

金属板块：AU & AG

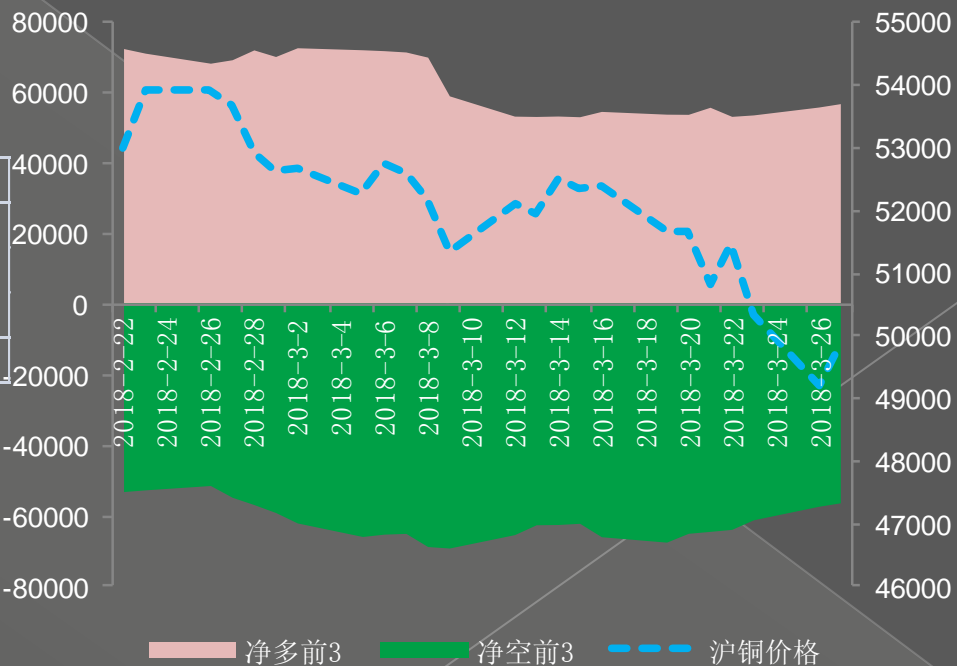
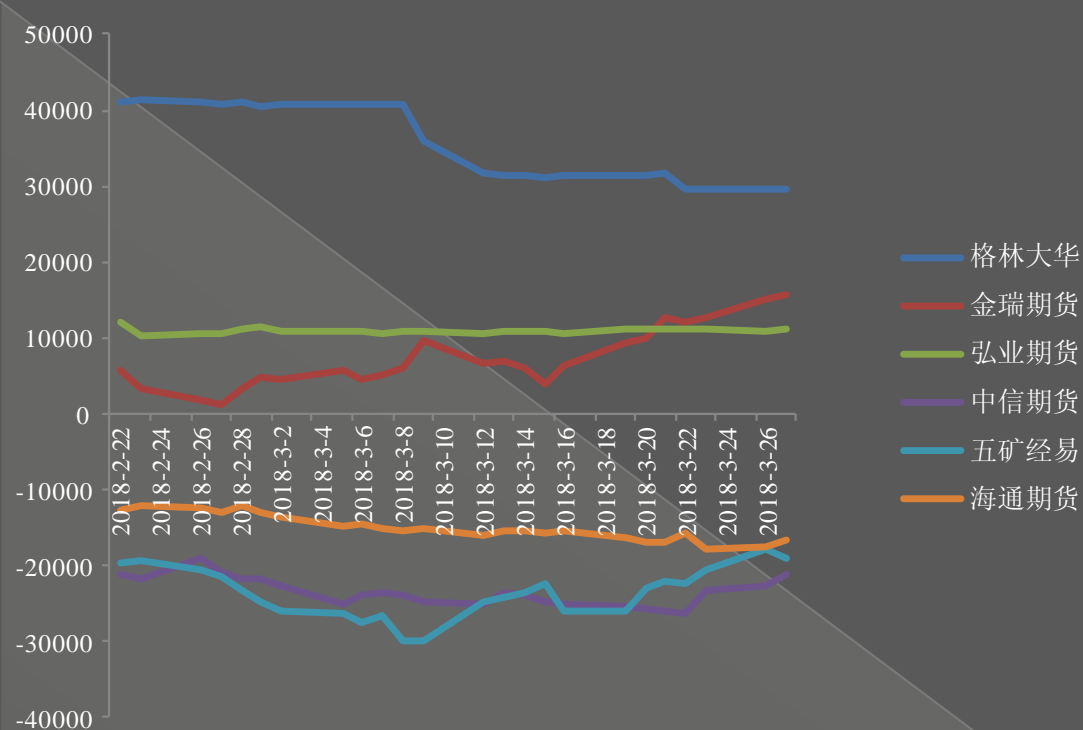


变动幅度		当日	最近5日	平均变化	波动率
au持仓	多头前3	-5.96%	1.31%	0.26%	6.43%
	空头前3	2.56%	28.76%	5.75%	
au涨幅		-0.13%	1.73%	0.35%	
震荡幅度	0.47%	0.60%(月均值)	投机度	0.37	0.37(月均值)

变动幅度		当日	最近5日	平均变化	波动率
ag持仓	多头前3	-6.54%	-8.91%	-1.78%	8.26%
	空头前3	1.39%	7.11%	1.42%	
ag涨幅		0.34%	1.52%	0.30%	
震荡幅度	0.56%	0.95%(月均值)	投机度	0.40	0.49(月均值)



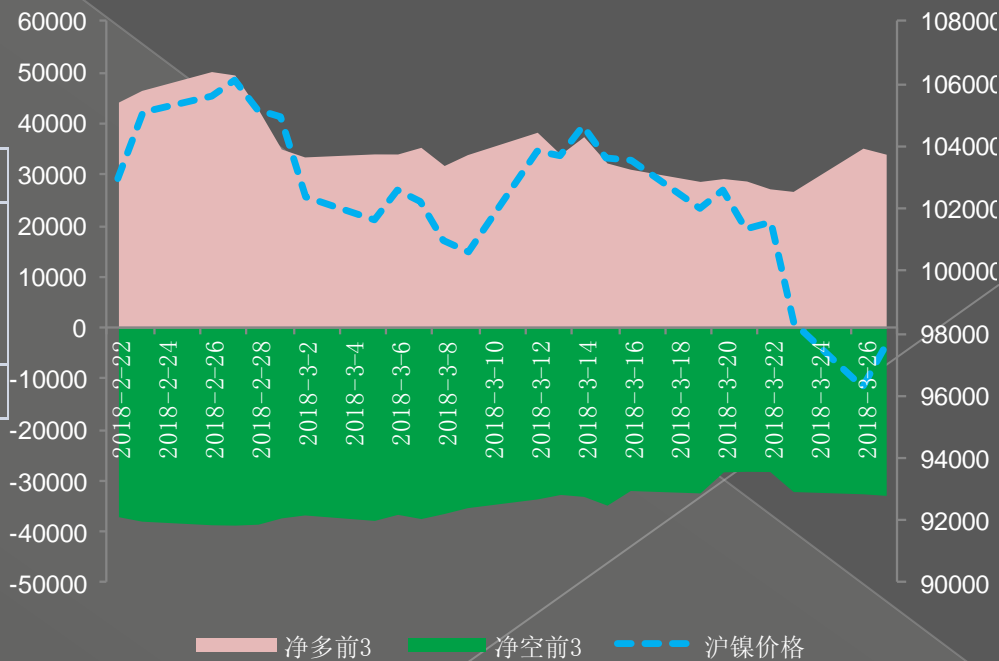
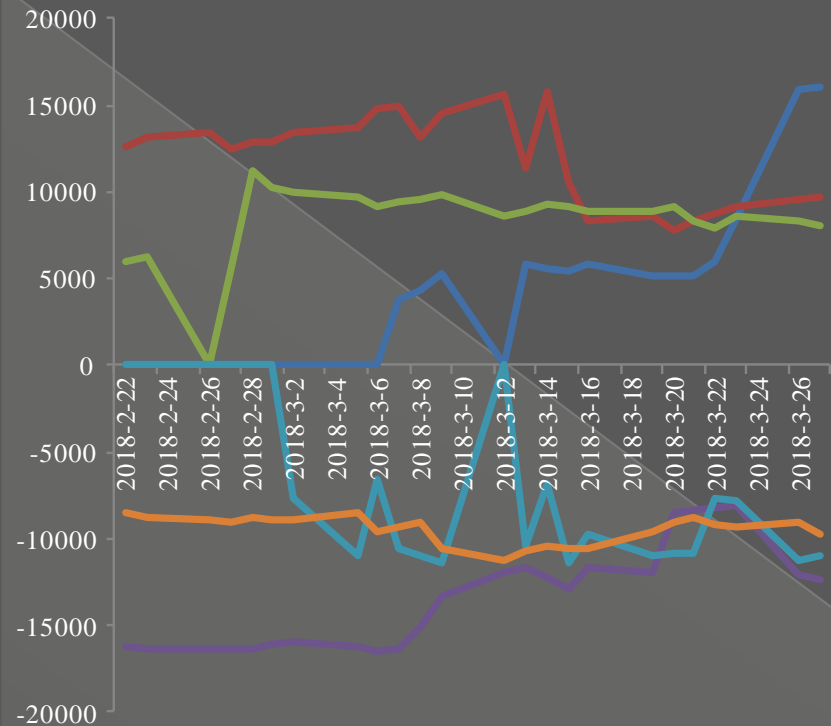
金属板块：Cu



变动幅度		当日	最近5日	平均变化	波动率
cu持仓	多头前3	1.75%	5.70%	1.14%	16.60%
	空头前3	-1.71%	-13.24%	-2.65%	
cu涨幅		1.36%	-3.52%	-0.70%	
震荡幅度	2.21%	1.53%(月均值)	投机度	0.69	0.53(月均值)

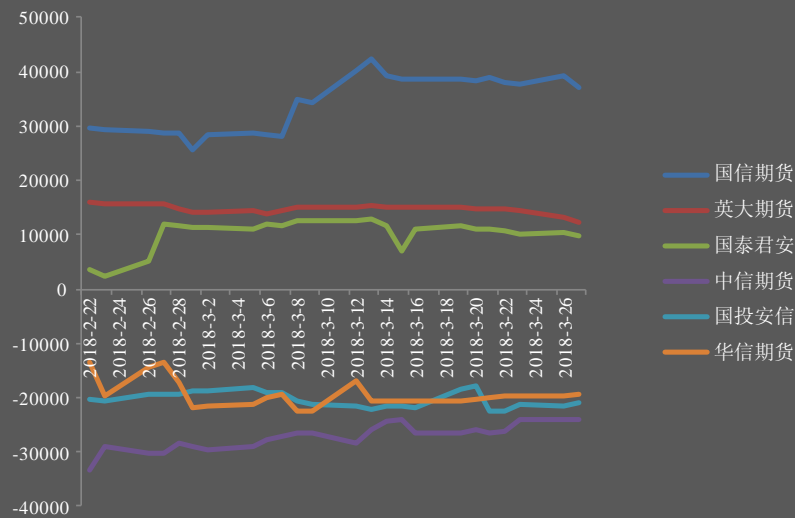
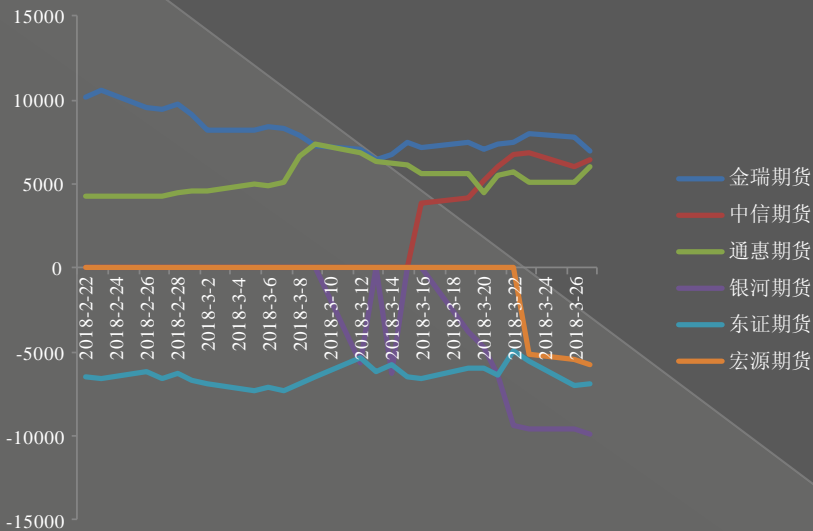
金属板块：Ni

- 五矿经易
- 国贸期货
- 方正中期
- 兴业期货
- 鲁证期货
- 国富期货



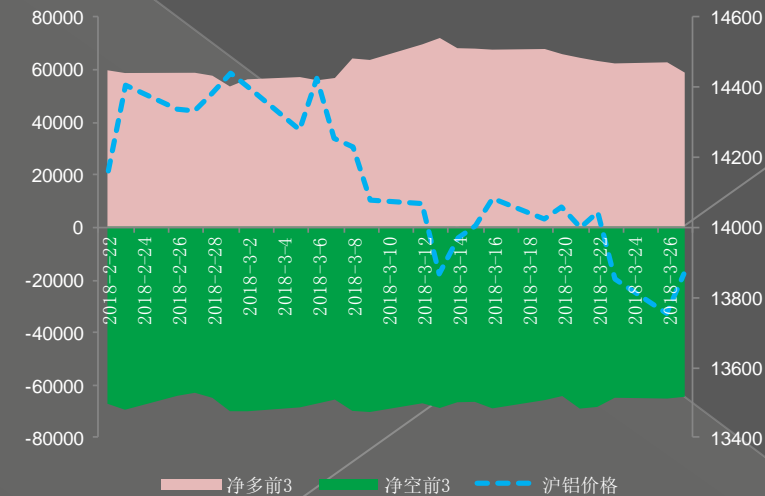
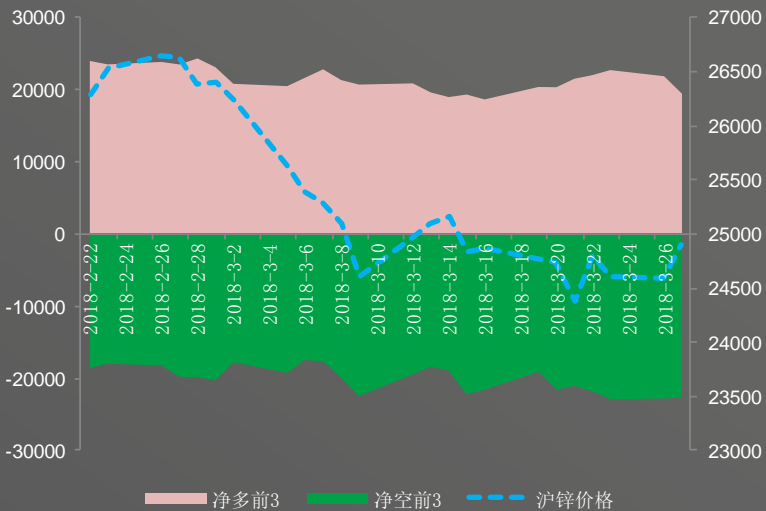
变动幅度		当日	最近5日	平均变化	波动率
ni持仓	多头前3	-3.37%	16.26%	3.25%	19.59%
	空头前3	0.97%	16.37%	3.27%	
ni涨幅		1.36%	-4.90%	-0.98%	
震荡幅度	2.44%	2.15%(月均值)	投机度	1.75	1.59(月均值)

金属板块：Zn & Al

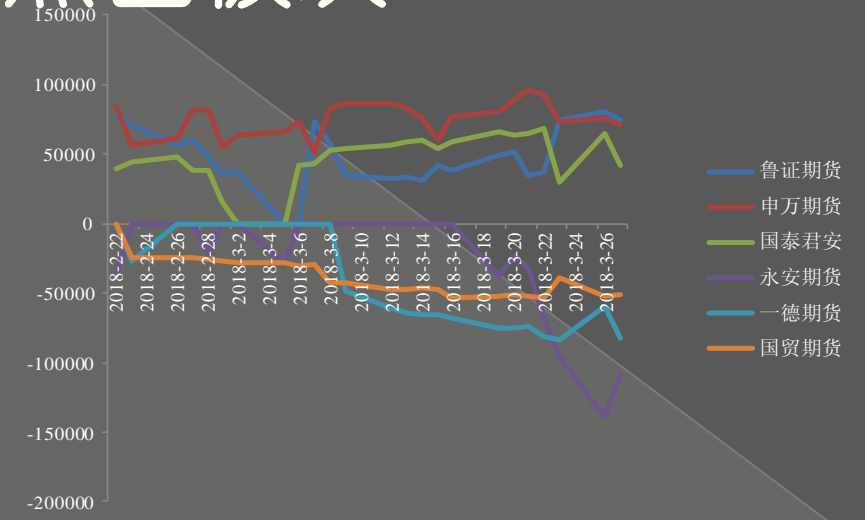


变动幅度		当日	最近5日	平均变化	波动率
zn持仓	多头前3	-11.17%	-4.45%	-0.89%	16.32%
	空头前3	-0.64%	4.97%	0.99%	
zn涨幅		1.27%	0.64%	0.13%	
震荡幅度	1.73%	1.57%(月均值)	投机度	1.62	1.39(月均值)

变动幅度		当日	最近5日	平均变化	波动率
al持仓	多头前3	-6.25%	-10.67%	-2.13%	10.57%
	空头前3	-1.05%	0.43%	0.09%	
al涨幅		0.83%	-1.35%	-0.27%	
震荡幅度	1.58%	1.35%(月均值)	投机度	0.54	0.55(月均值)

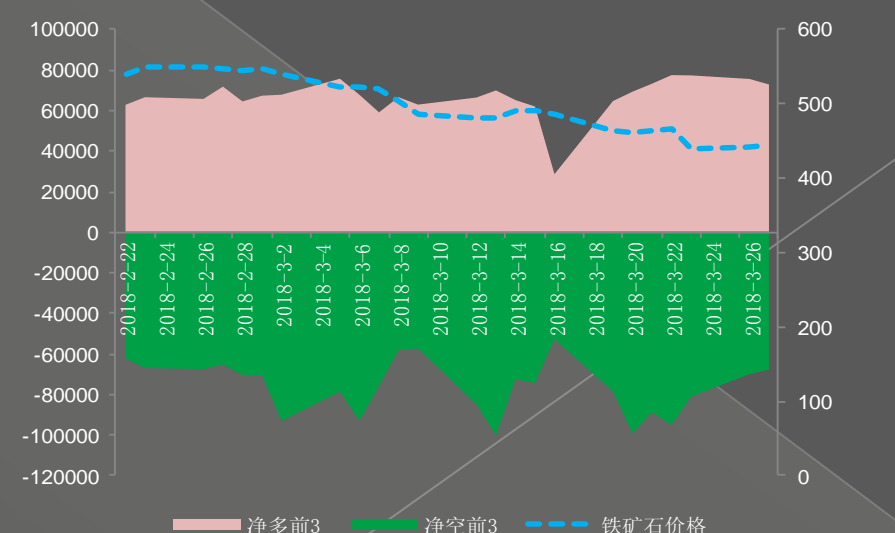
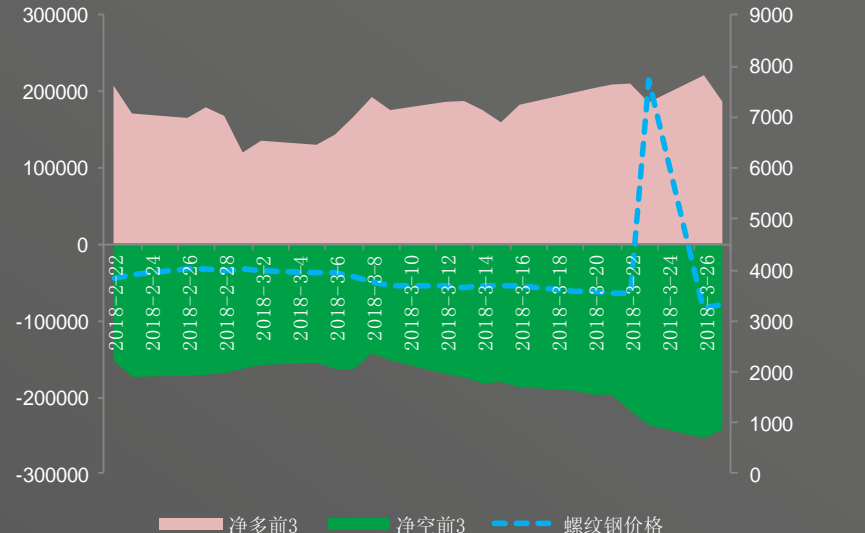


黑色板块：Rb & I

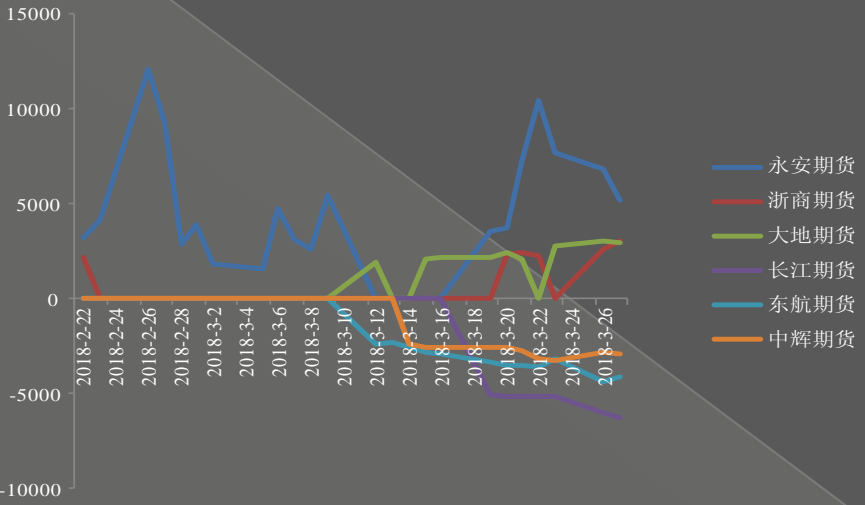


变动幅度		当日	最近5日	平均变化	波动率
rb持仓	多头前3	-15.66%	-8.62%	-1.72%	289.72%
	空头前3	-4.30%	23.25%	4.65%	
rb涨幅		1.49%	-7.15%	-1.43%	
震荡幅度	2.99%	1.99%(月均值)	投机度	1.39	1.13(月均值)

变动幅度		当日	最近5日	平均变化	波动率
I持仓	多头前3	-3.61%	5.17%	1.03%	25.82%
	空头前3	-3.11%	-31.62%	-6.32%	
I涨幅		0.93%	-3.56%	-0.71%	
震荡幅度	2.21%	2.56%(月均值)	投机度	1.18	1.13(月均值)

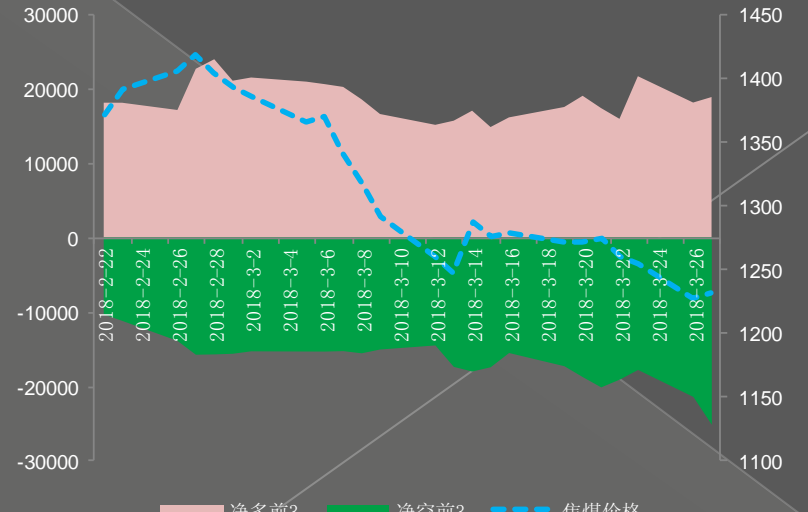
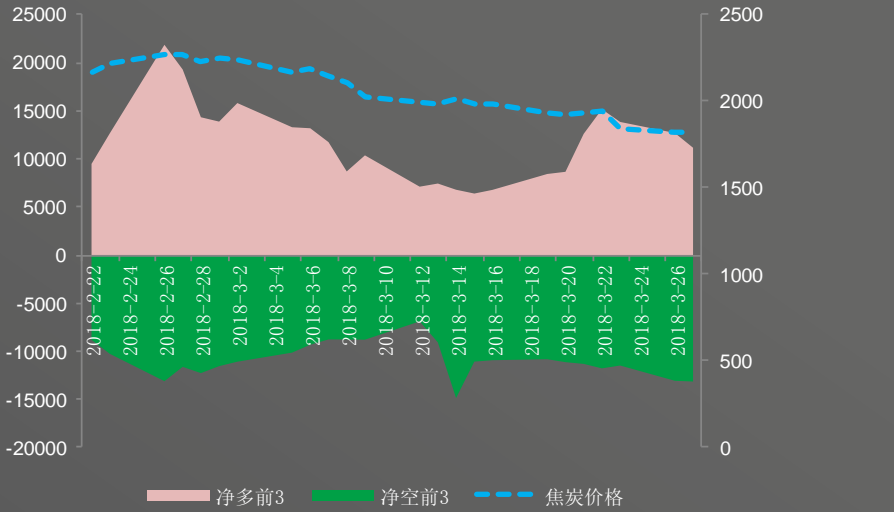


黑色板块：J & JM

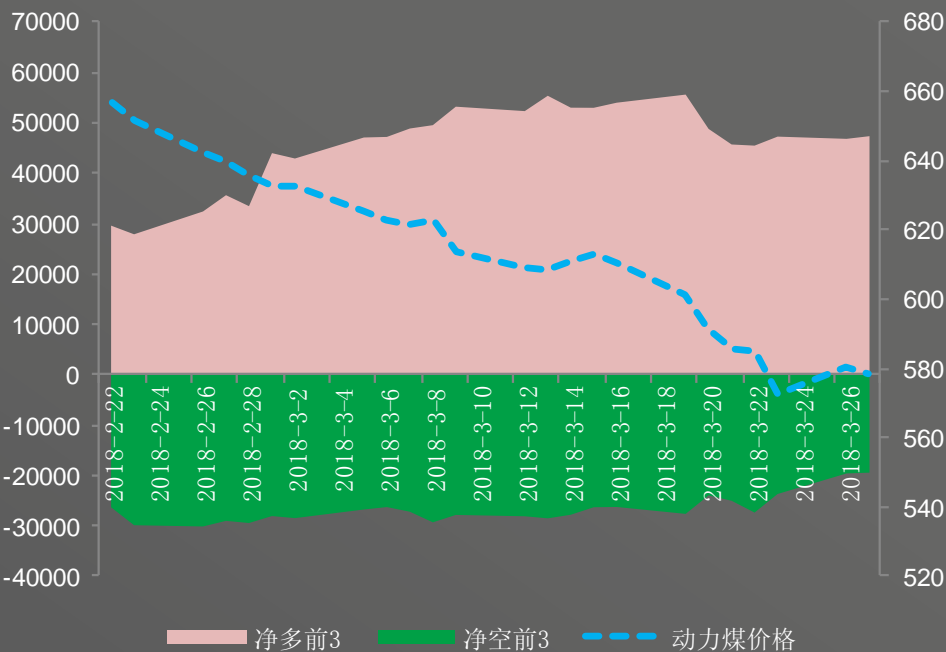
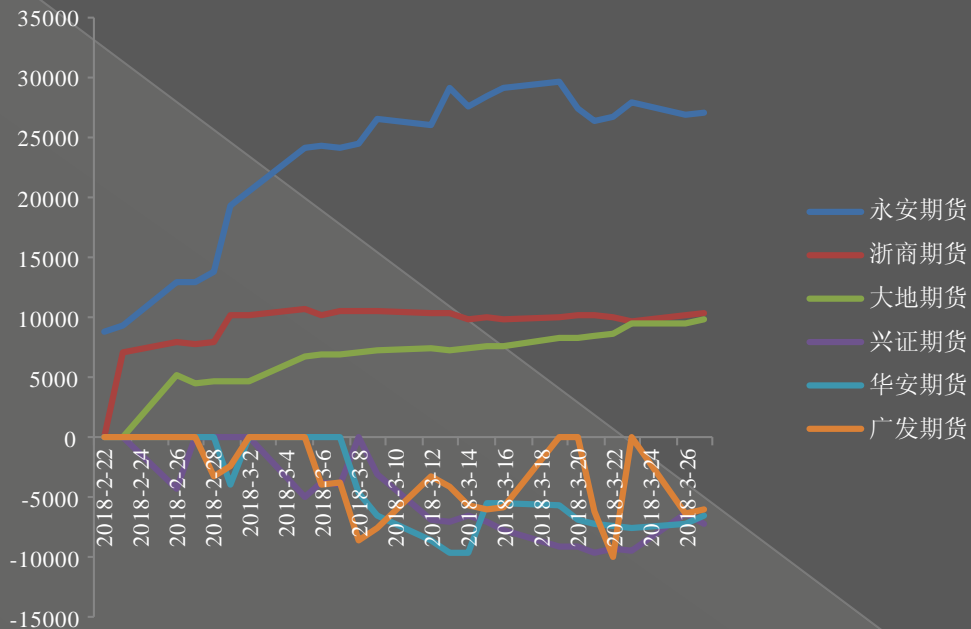


变动幅度		当日	最近5日	平均变化	波动率
j持仓	多头前3	-12.10%	28.94%	5.79%	23.68%
	空头前3	0.59%	18.07%	3.61%	
j涨幅		0.22%	-5.35%	-1.07%	
震荡幅度	2.35%	2.77%(月均值)	投机度	1.22	1.25(月均值)

变动幅度		当日	最近5日	平均变化	波动率
jm持仓	多头前3	4.08%	-0.89%	-0.18%	20.68%
	空头前3	17.45%	34.13%	6.83%	
jm涨幅		0.40%	-3.19%	-0.64%	
震荡幅度	2.48%	2.68%(月均值)	投机度	1.06	1.11(月均值)

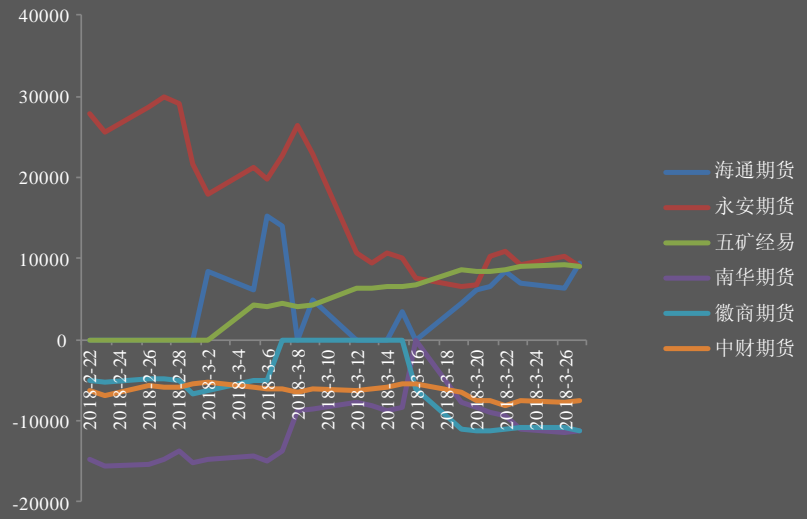
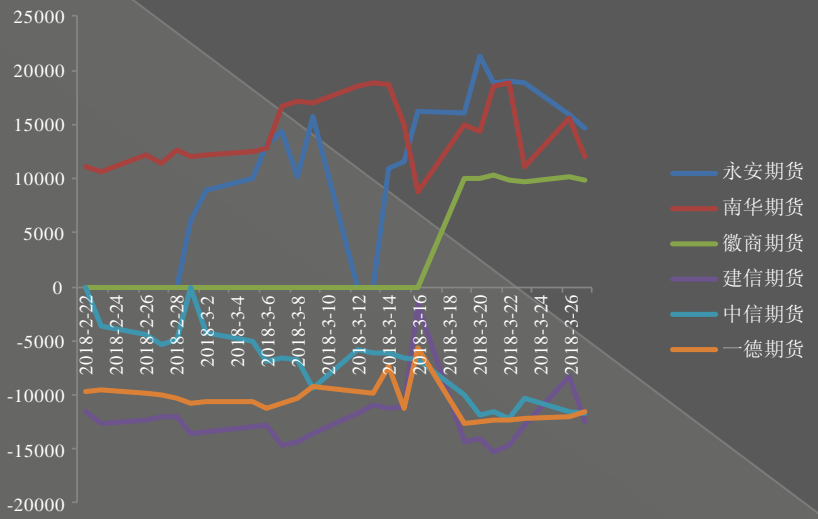


黑色：动力煤



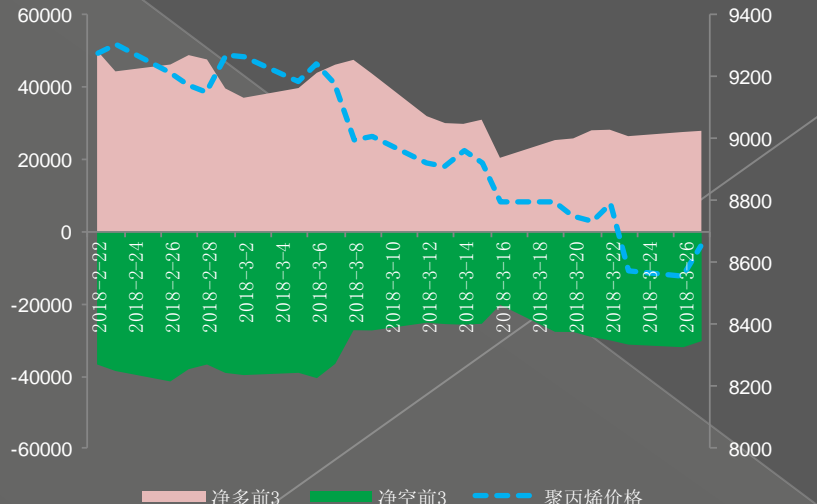
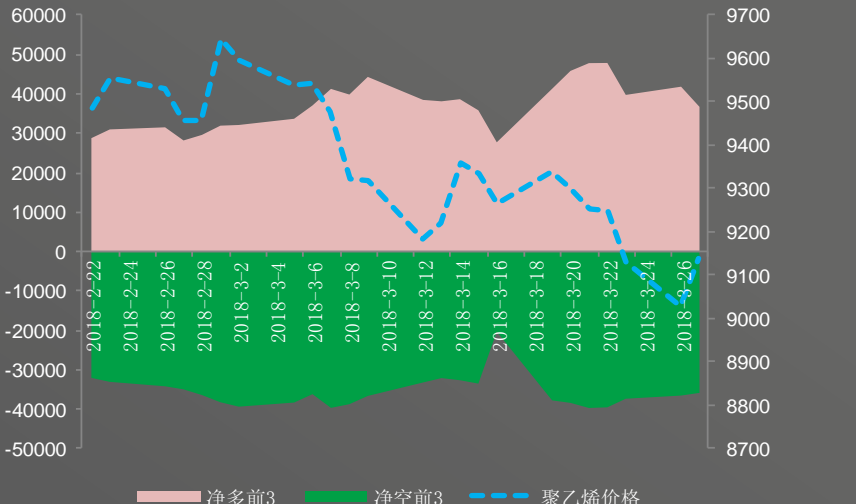
变动幅度		当日	最近5日	平均变化	波动率
zc持仓	多头前3	1.14%	-2.93%	-0.59%	11.63%
	空头前3	-0.79%	-18.86%	-3.77%	
zc涨幅		-0.34%	-2.23%	-0.45%	
震荡幅度	2.73%	1.55% (月均值)	投机度	0.81	0.67 (月均值)

化工：塑料 & PP

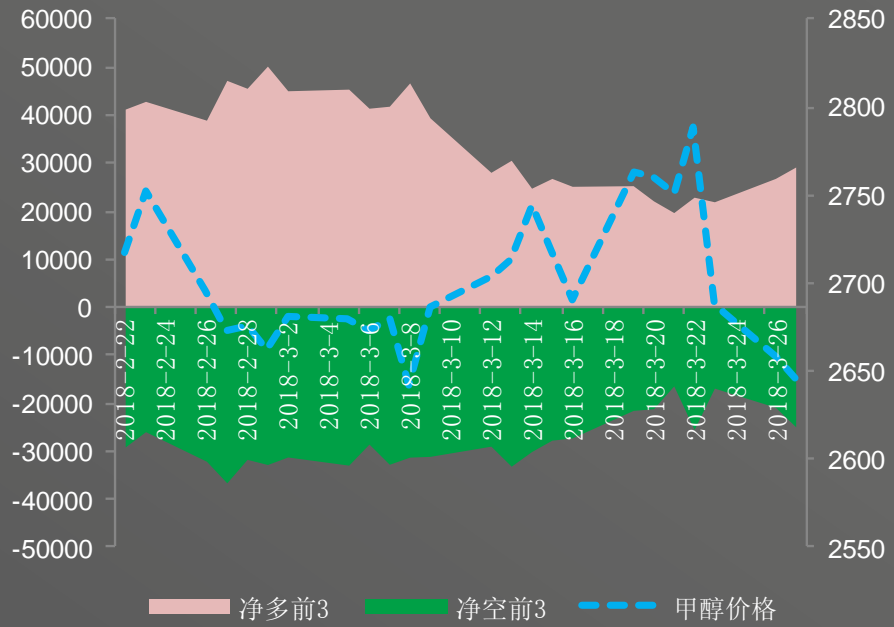
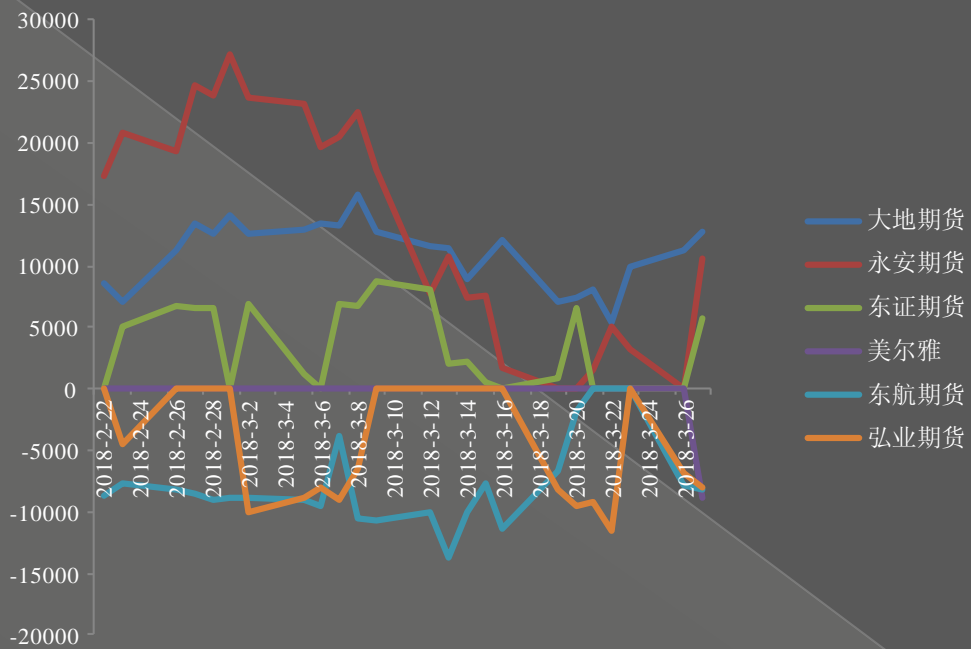


变动幅度		当日	最近5日	平均变化	波动率
I持仓	多头前3	-12.17%	-19.82%	-3.96%	14.24%
	空头前3	-1.86%	-6.64%	-1.33%	
I涨幅		1.25%	-1.75%	-0.35%	
震荡幅度	1.26%	1.39%(月均值)	投机度	0.61	0.64(月均值)

变动幅度		当日	最近5日	平均变化	波动率
pp持仓	多头前3	1.19%	8.19%	1.64%	12.40%
	空头前3	-5.31%	8.98%	1.80%	
pp涨幅		1.13%	-1.10%	-0.22%	
震荡幅度	1.32%	1.23%(月均值)	投机度	0.56	0.62(月均值)

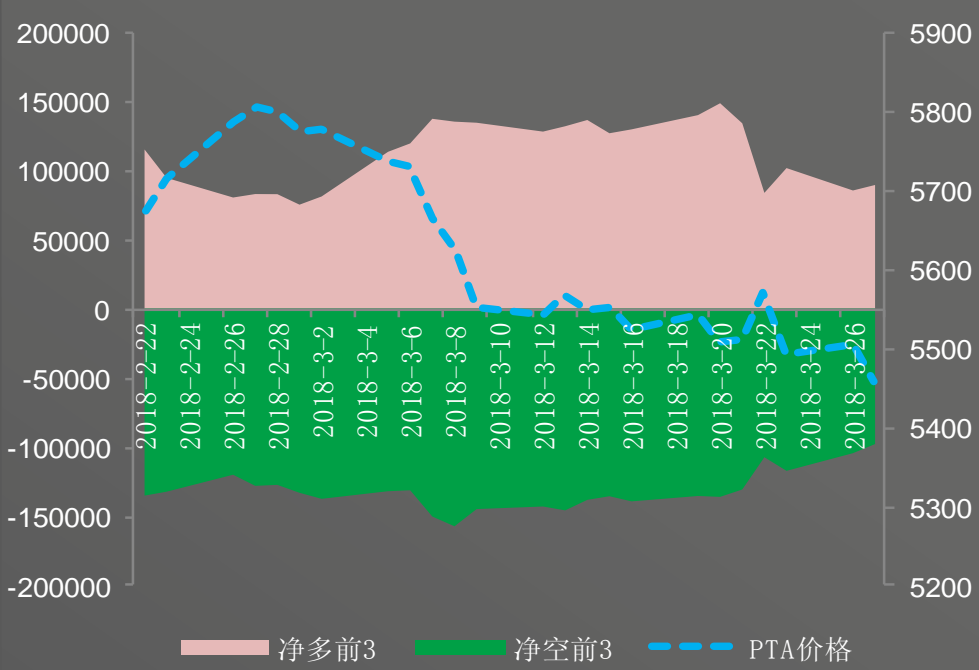
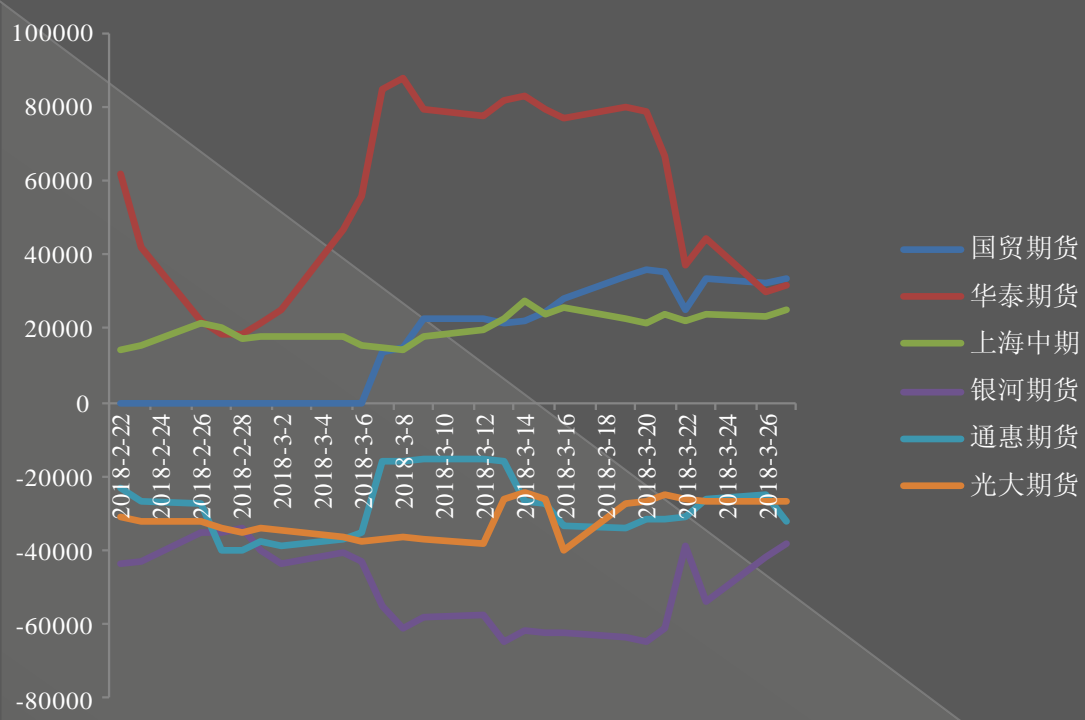


化工：甲醇



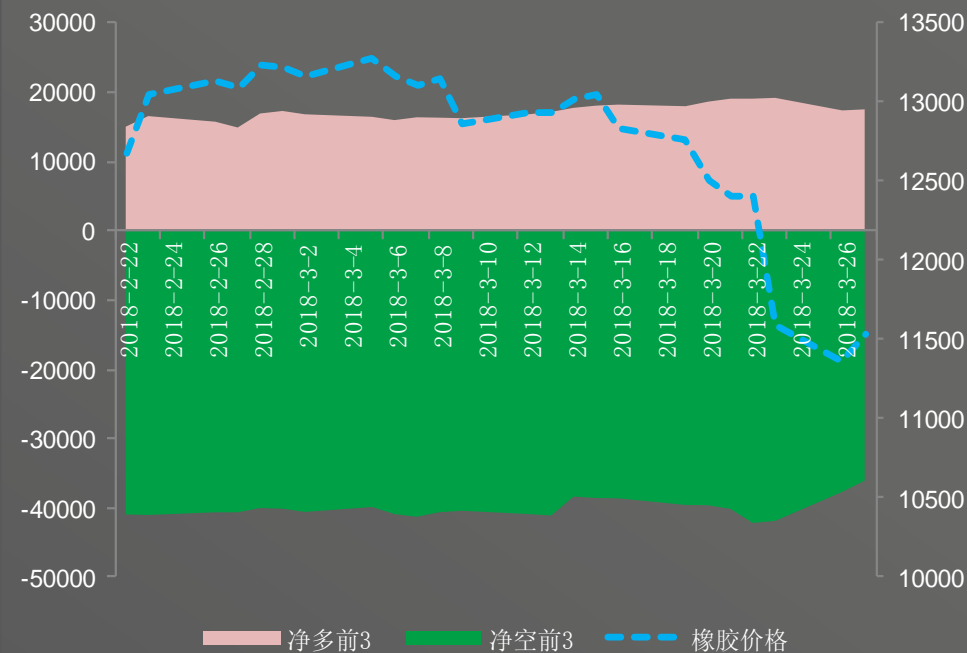
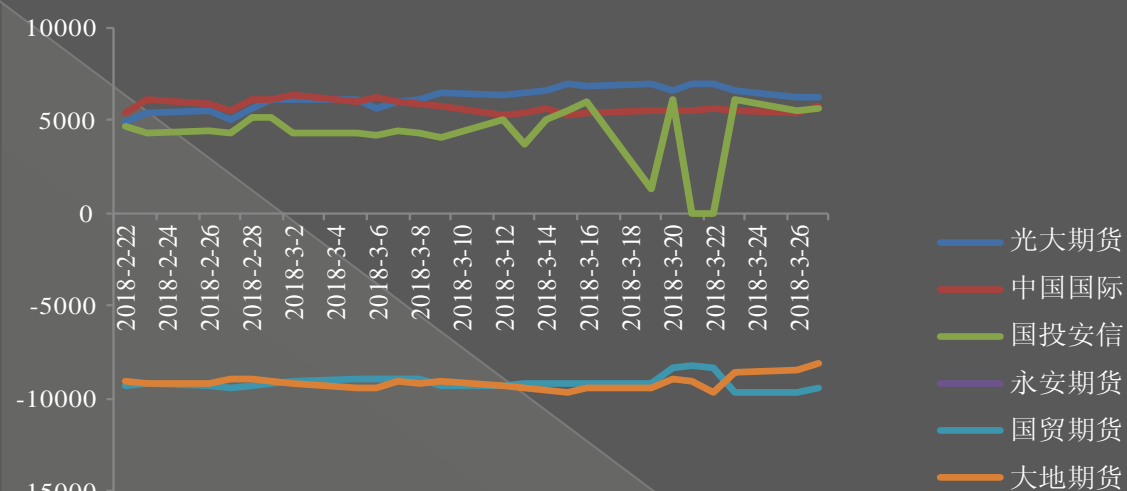
变动幅度		当日	最近5日	平均变化	波动率
ma持仓	多头前3	8.81%	31.68%	6.34%	17.41%
	空头前3	19.60%	17.84%	3.57%	
ma涨幅		-0.45%	-4.15%	-0.83%	
震荡幅度	1.92%	1.87%(月均值)	投机度	1.65	1.23(月均值)

化工：PTA



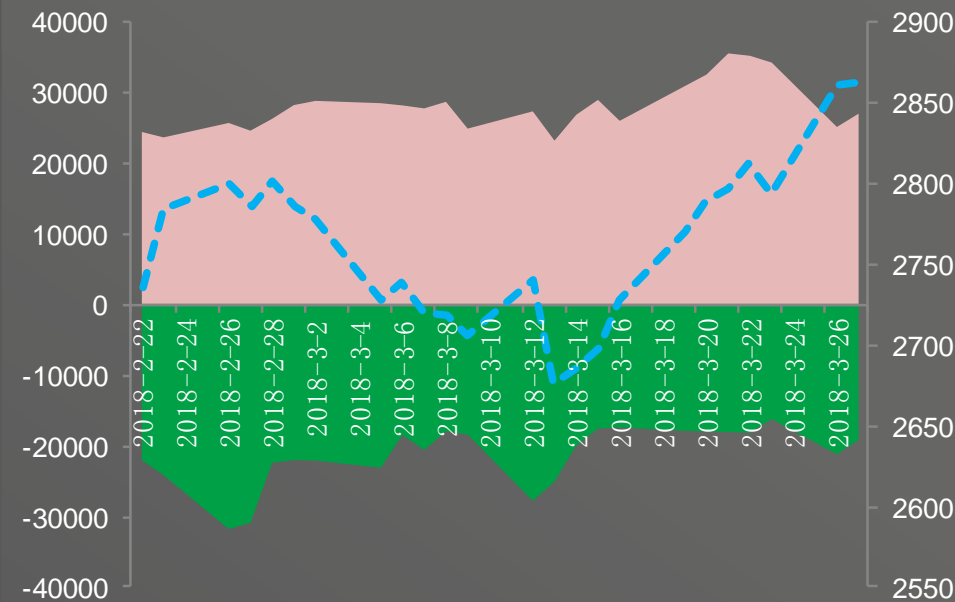
变动幅度		当日	最近5日	平均变化	波动率
pta持仓	多头前3	4.67%	-39.80%	-7.96%	10.09%
	空头前3	-6.30%	-28.04%	-5.61%	
pta涨幅		-0.85%	-0.86%	-0.17%	
震荡幅度	1.62%	1.27%(月均值)	投机度	0.55	0.46(月均值)

化工：橡胶



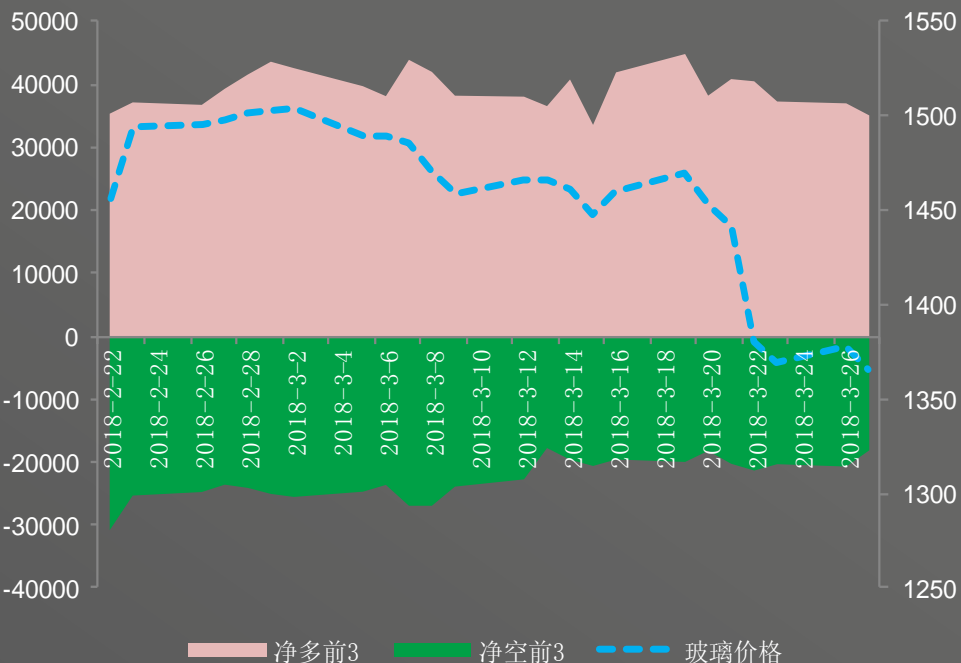
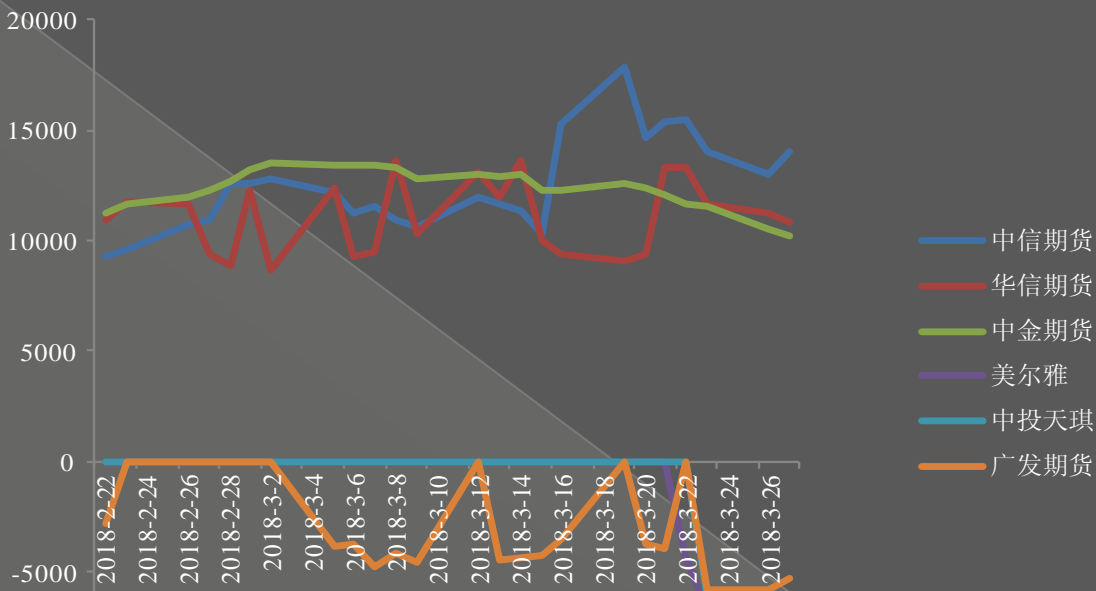
变动幅度		当日	最近5日	平均变化	波动率
ru持仓	多头前3	0.89%	-5.92%	-1.18%	16.19%
	空头前3	-4.29%	-8.99%	-1.80%	
ru涨幅		1.56%	-7.74%	-1.55%	
震荡幅度	2.31%	1.94%(月均值)	投机度	0.87	0.79(月均值)

化工：沥青



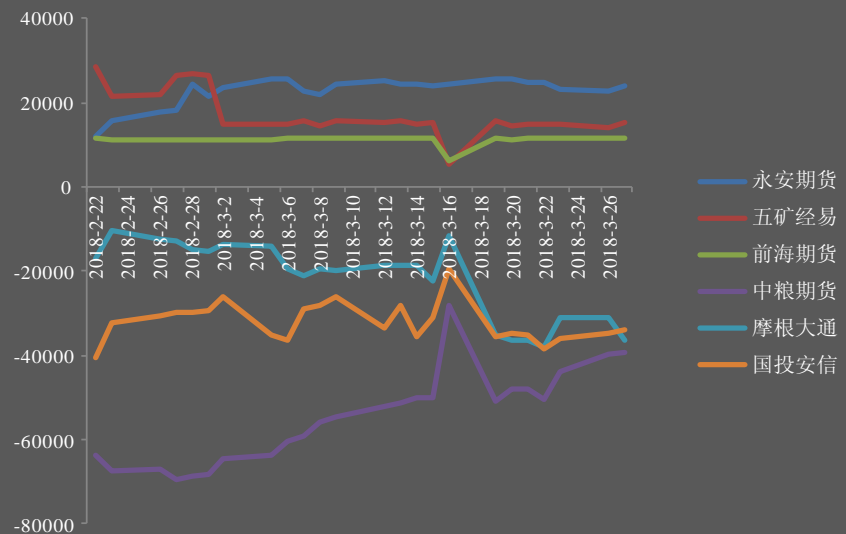
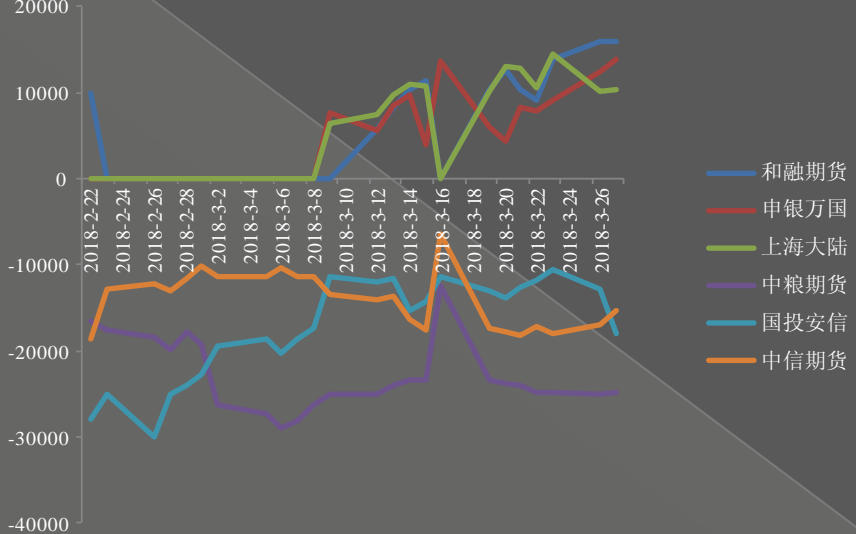
变动幅度		当日	最近5日	平均变化	波动率
bu持仓	多头前3	7.52%	-17.06%	-3.41%	16.32%
	空头前3	-9.61%	6.44%	1.29%	
bu涨幅		0.07%	2.65%	0.53%	
震荡幅度	1.40%	1.80%(月均值)	投机度	1.04	0.93(月均值)

化工：玻璃



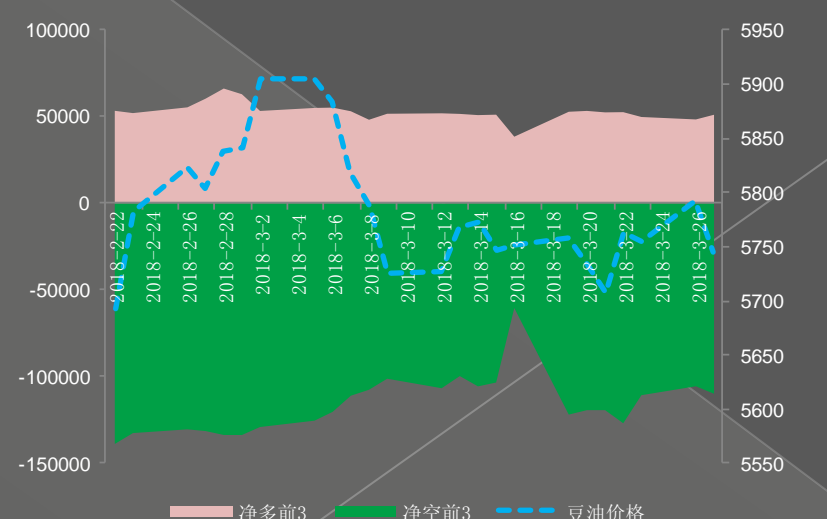
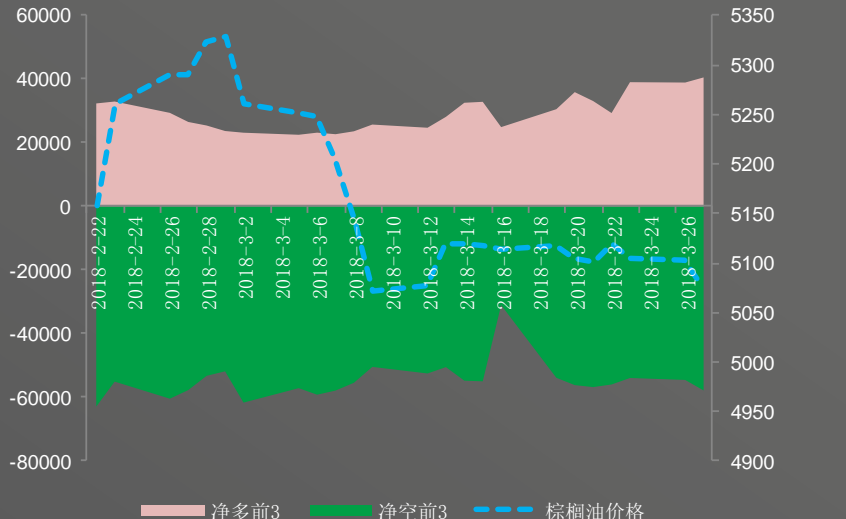
变动幅度		当日	最近5日	平均变化	波动率
fg持仓	多头前3	-5.18%	-8.22%	-1.64%	16.91%
	空头前3	-12.40%	-0.43%	-0.09%	
fg涨幅		-0.90%	-6.00%	-1.20%	
震荡幅度	2.11%	1.95%(月均值)	投机度	0.77	0.68(月均值)

农产品：P & Y

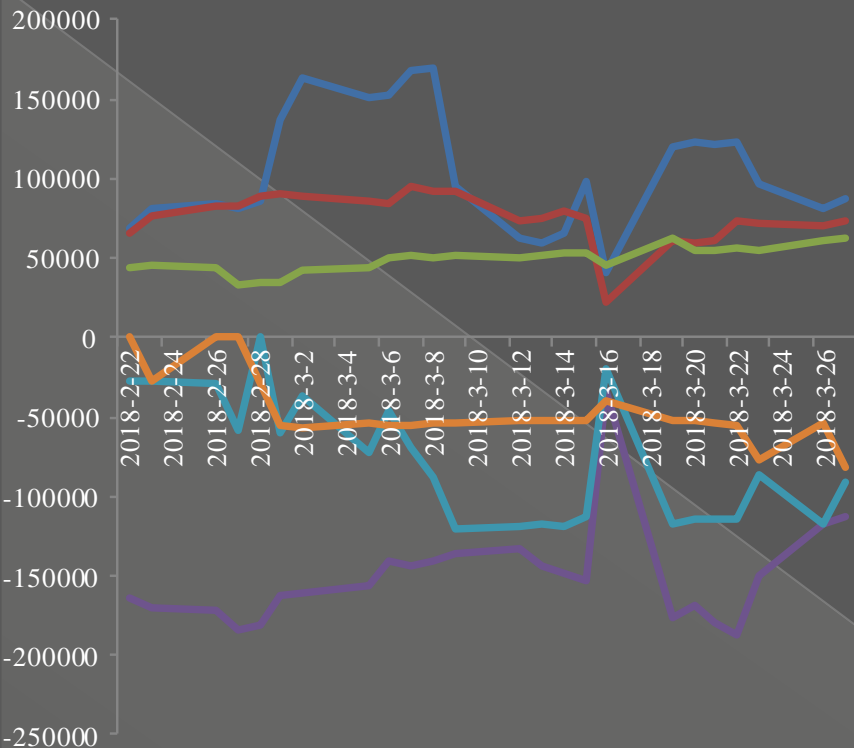


变动幅度		当日	最近5日	平均变化	波动率
p持仓	多头前3	4.12%	12.86%	2.57%	9.21%
	空头前3	6.07%	2.99%	0.60%	
p涨幅		-0.54%	-0.58%	-0.12%	
震荡幅度	1.57%	1.26%(月均值)	投机度	0.62	0.68(月均值)

变动幅度		当日	最近5日	平均变化	波动率
y持仓	多头前3	5.60%	-4.14%	-0.83%	9.85%
	空头前3	4.09%	-7.93%	-1.59%	
y涨幅		-0.84%	0.16%	0.03%	
震荡幅度	2.07%	1.31%(月均值)	投机度	0.73	0.49(月均值)

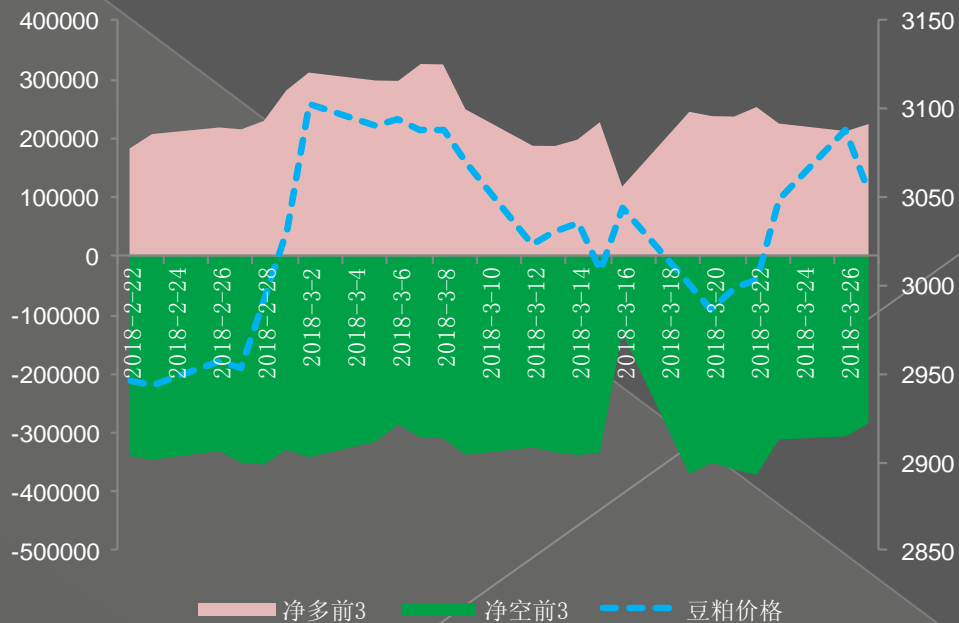


农产品：豆粕



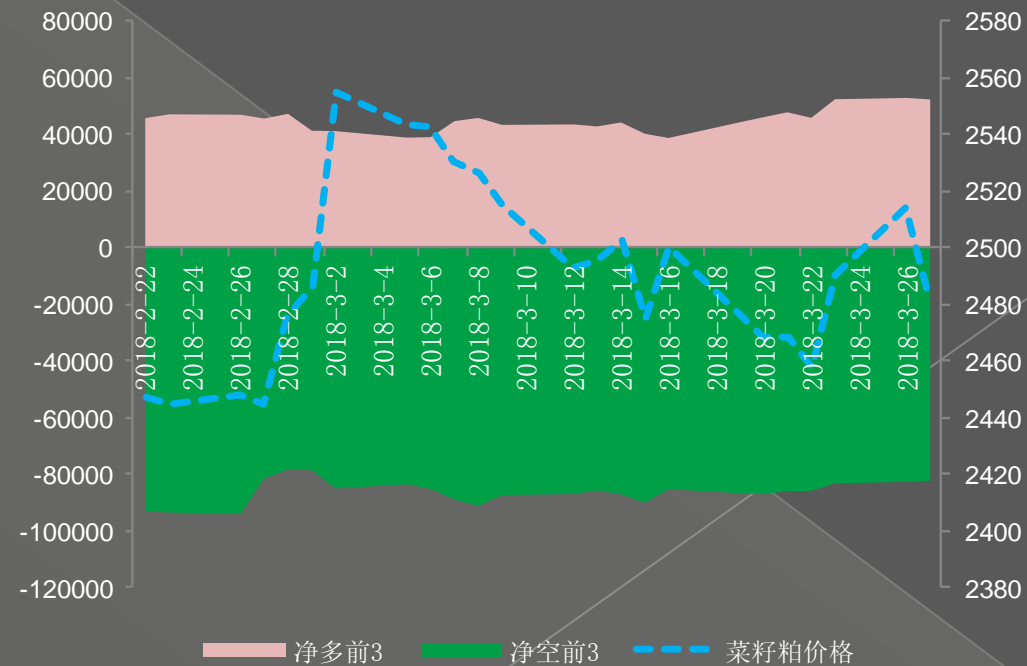
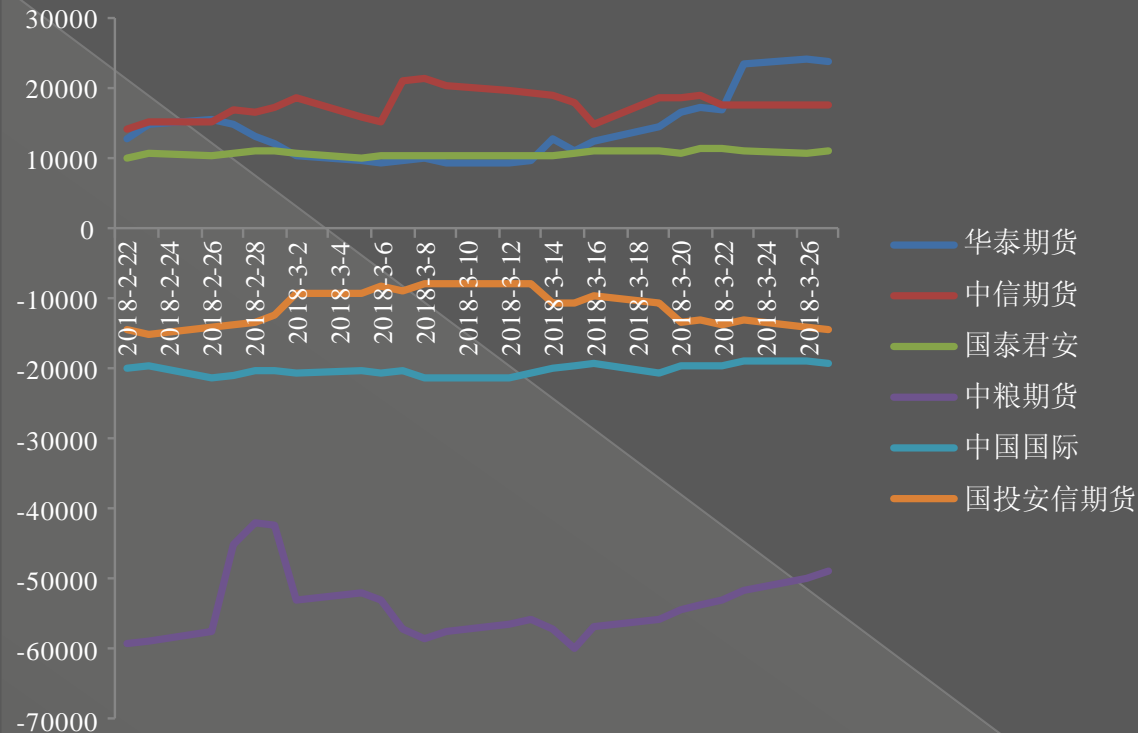
- 永安期货
- 中信期货
- 中信建投
- 中粮期货
- 银河期货
- 鲁证期货

变动幅度		当日	最近5日	平均变化	波动率
m持仓	多头前3	5.62%	-5.66%	-1.13%	15.05%
	空头前3	-7.23%	-19.05%	-3.81%	
m涨幅		-1.06%	2.30%	0.46%	
震荡幅度	1.77%	1.58%(月均值)	投机度	0.55	0.62(月均值)

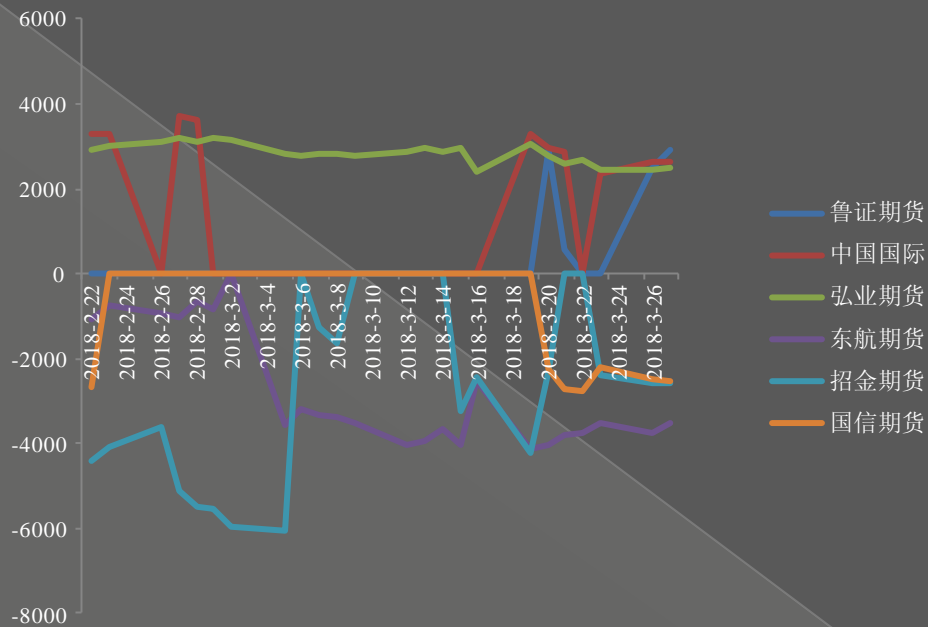


- 净多前3
- 净空前3
- 豆粕价格

农产品：菜粕

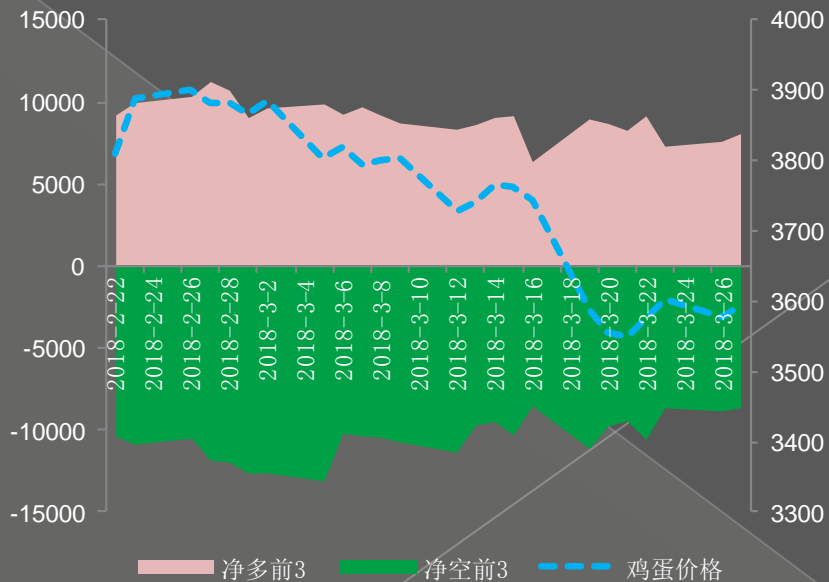


变动幅度		当日	最近5日	平均变化	波动率
rm持仓	多头前3	-0.99%	13.54%	2.71%	14.06%
	空头前3	-0.47%	-5.44%	-1.09%	
rm涨幅		-1.29%	0.56%	0.11%	
震荡幅度	2.31%	1.50%(月均值)	投机度	0.88	0.74(月均值)

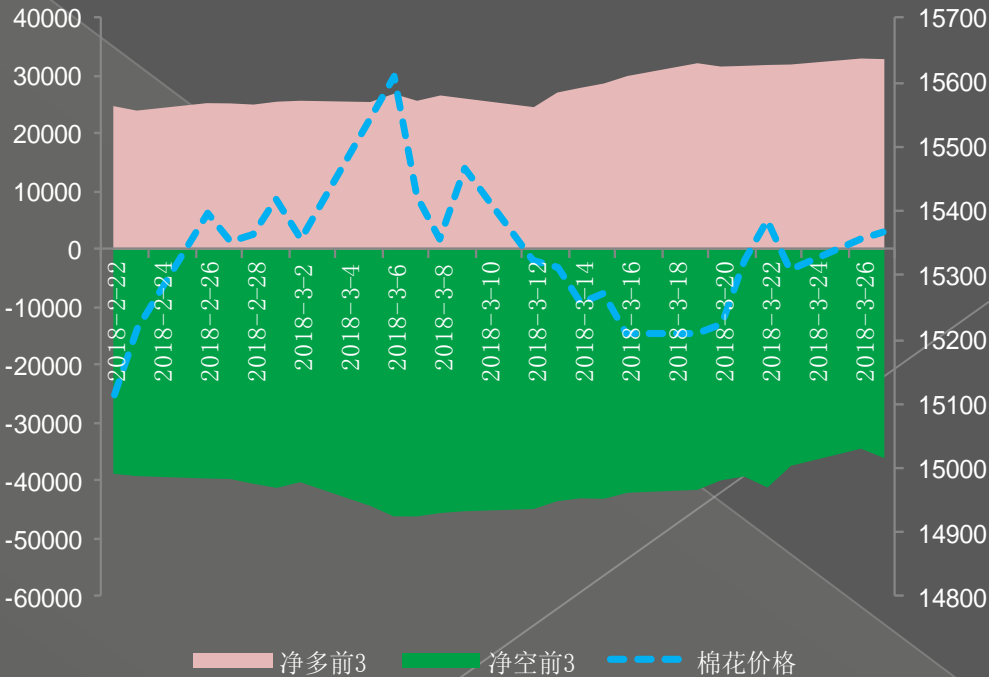
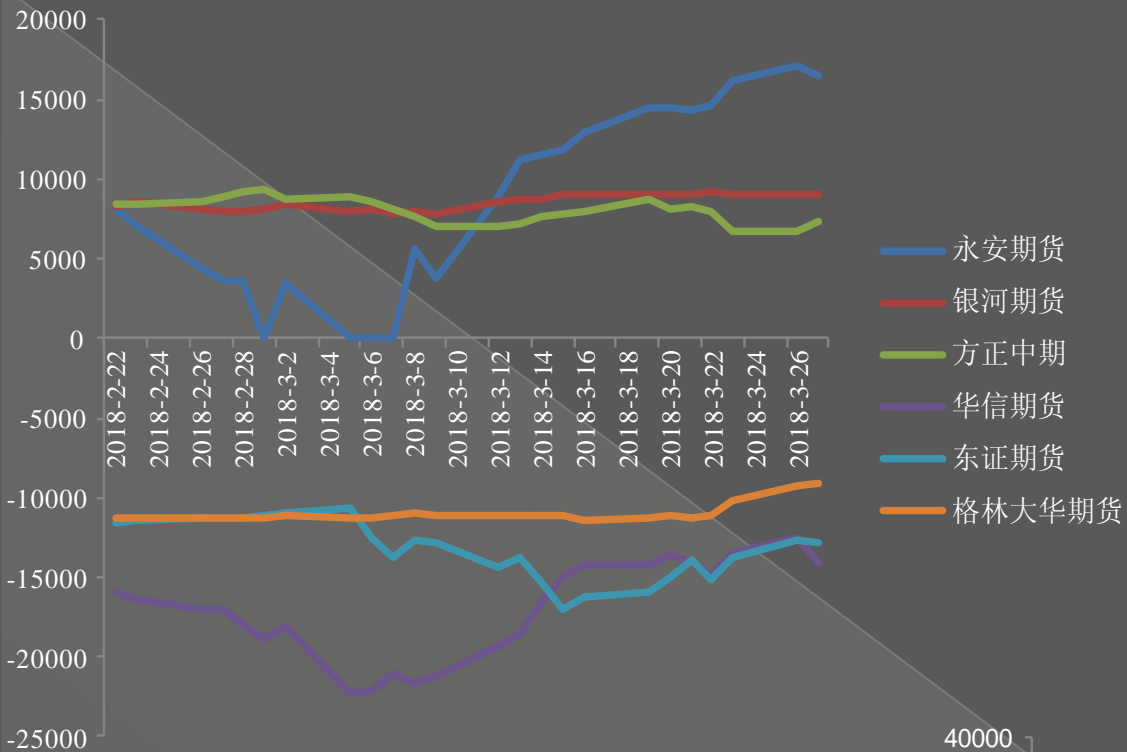


农产品：鸡蛋

变动幅度		当日	最近5日	平均变化	波动率
jd持仓	多头前3	6.29%	-7.13%	-1.43%	17.92%
	空头前3	-2.20%	-11.37%	-2.27%	
jd涨幅		0.41%	1.07%	0.21%	
震荡幅度	1.49%	1.57%(月均值)	投机度	0.45	0.52(月均值)

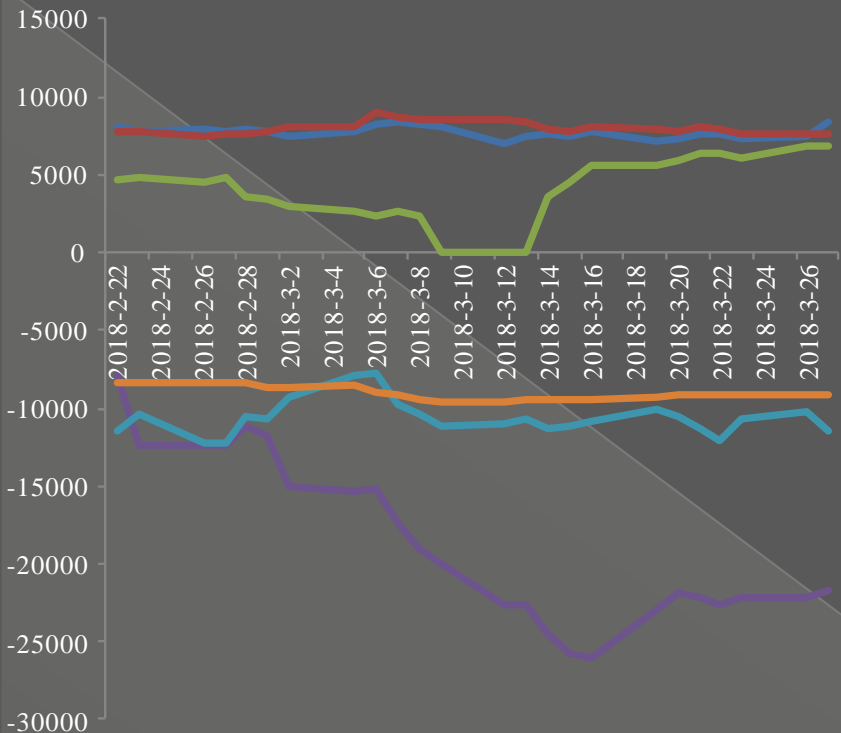


农产品：棉花



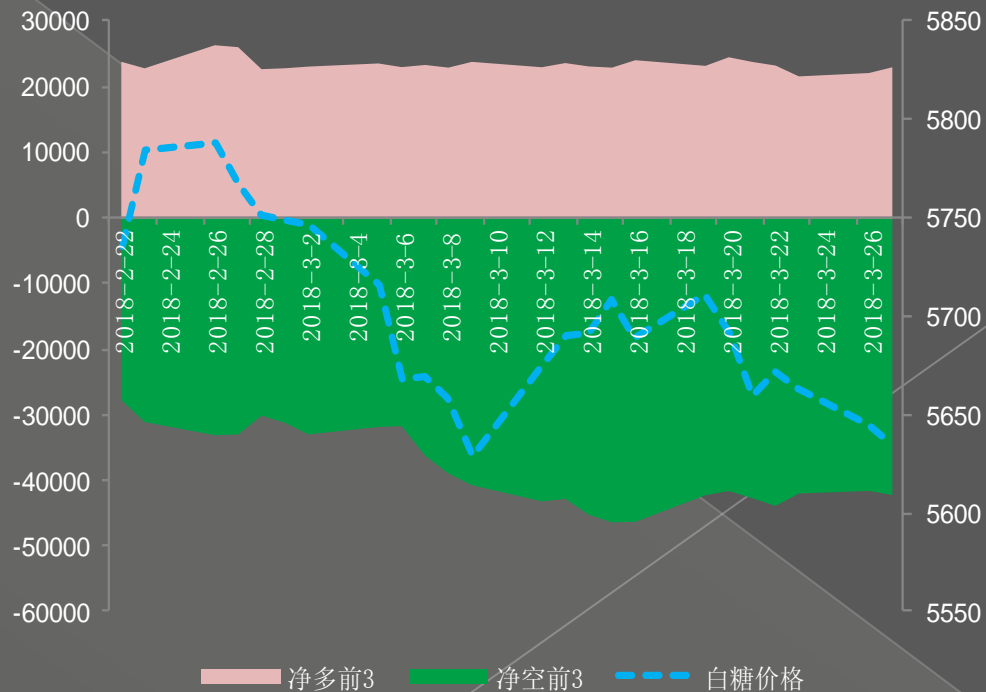
变动幅度		当日	最近5日	平均变化	波动率
cf持仓	多头前3	-0.30%	4.06%	0.81%	9.42%
	空头前3	4.78%	-9.62%	-1.92%	
cf涨幅		0.06%	0.94%	0.19%	
震荡幅度	0.75%	0.91%(月均值)	投机度	0.47	0.42(月均值)

农产品：白糖

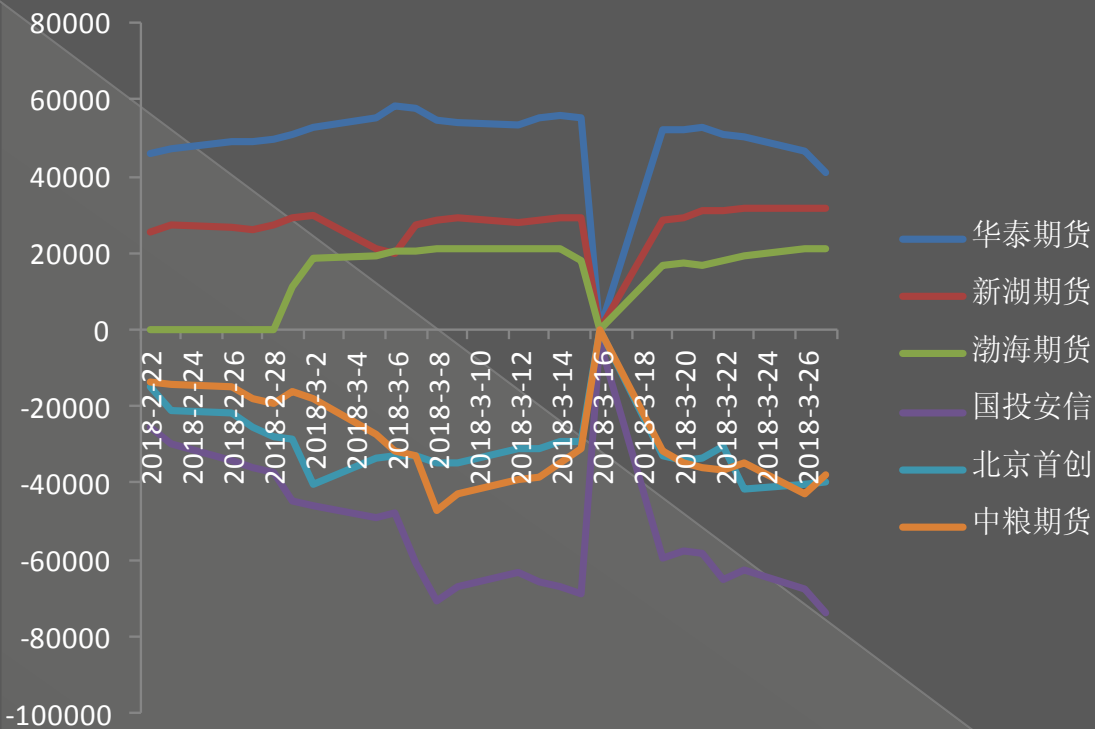


- 混沌天成期货
- 一德期货
- 光大期货
- 中粮期货
- 中信期货
- 中金期货

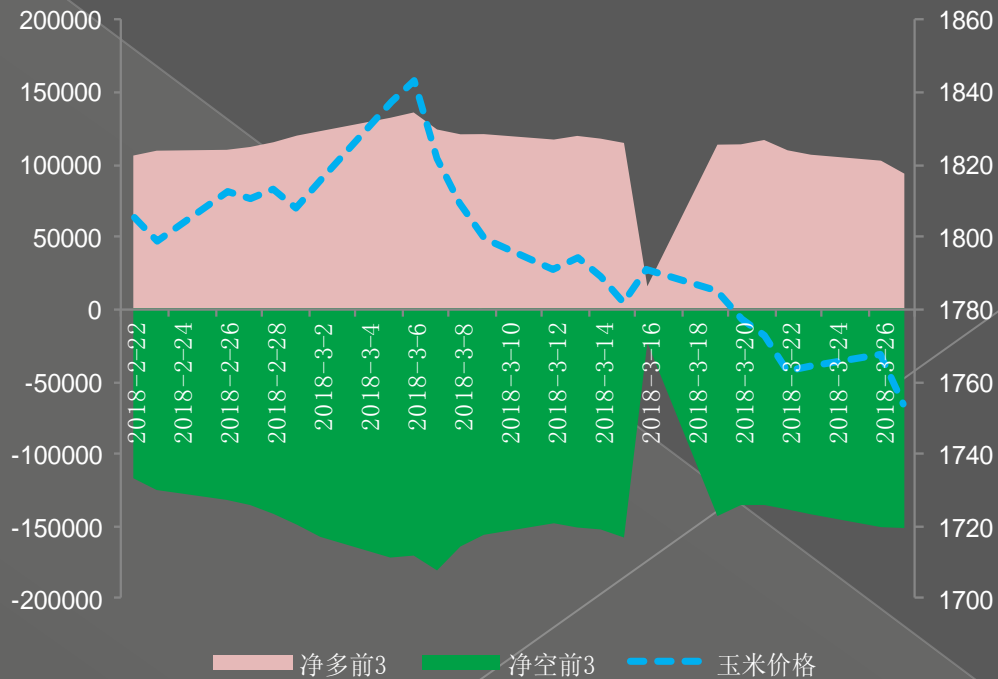
变动幅度		当日	最近5日	平均变化	波动率
sr持仓	多头前3	3.93%	-6.22%	-1.24%	5.87%
	空头前3	1.54%	1.52%	0.30%	
sr涨幅		-0.18%	-1.00%	-0.20%	
震荡幅度	0.72%	0.77% (月均值)	投机度	0.51	0.48 (月均值)



农产品：玉米



变动幅度		当日	最近5日	平均变化	波动率
c持仓	多头前3	-8.78%	-17.86%	-3.57%	8.63%
	空头前3	0.41%	11.66%	2.33%	
c涨幅		-0.78%	-1.33%	-0.27%	
震荡幅度	0.94%	0.80%(月均值)	投机度	0.42	0.45(月均值)



净多前3 净空前3 玉米价格

部分机构资金变动表

制表日期：2018年3月27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	-10148.37	-4.70%	-34624.65	-14.41%
南华期货	462.04	0.67%	19225.08	38.49%
混沌天成	358.62	1.08%	-600.99	-1.75%
海通期货	-25031.21	-19.92%	-17617.64	-14.90%
上海大陆	80.80	1.56%	-3160.44	-37.46%
中信期货	-4322.17	-2.02%	-17354.60	-7.66%
新湖期货	967.22	1.65%	-19039.99	-24.27%

中粮期货	-12914.88	-7.40%	-33059.08	-16.98%
中信建投	-3949.61	-9.03%	6630.76	19.99%
申银万国	-714.16	-2.61%	-680.64	-2.49%
华泰期货	18215.86	20.81%	-10436.20	-8.98%
光大期货	3457.82	6.04%	-147.53	-0.24%
一德期货	-3084.84	-2.49%	16476.96	15.77%
国投期货	-2893.68	-4.21%	-22809.49	-25.73%
金瑞期货	13369.71	13.57%	309.43	0.28%
鲁证期货	-770.29	-0.81%	621.12	0.67%
中国国际	9653.39	17.84%	13001.25	25.61%

部分机构持仓一览

机构	永安期货					
日期	2018-3-20	2018-3-21	2018-3-22	2018-3-23	2018-3-26	2018-3-27
黄金	3197	3166	4108	5054	5479	5330
白银						
沪铜	10375	9740	11321	4472		
沪铝	-11865	-12045	-12896	-12558	-12919	-11932
沪镍					-9386	-8846
沪锌	-9715	-8292	-7400	-7634		
沪铅		583				
螺纹钢	-23319	-31981	-68409	-95896	-139316	-109067
铁矿石	-39147	-12463	-24828	-10962	-4959	-6500
焦煤	9022	6518	5801			2446
焦炭	3707	7288	10448	7686	6884	5185
豆油	25801	24877	24861	23282	22912	24206
棕榈油				-4538	-5478	-6301
菜籽油	5722	4662	5444	4500	1485	
豆粕	122604	121903	123616	96895	81124	87286
菜籽粕	-2490	-2350	-2489	-3160	-2414	-3048
棉花	14475	14331	14615	16203	17173	16528
白糖		-5273	-5382	-8867	-9190	-9119
玉米	-36176	-36419	-37145	-35754	-26126	-24635
鸡蛋		577	860	-316	-575	-437
PTA	-18563	-20118	-6692			
聚乙烯	21326	18796	18969	18829	15970	14696
聚丙烯	6781	10344	10933	9243	10321	9164
甲醇	-2219	1605	5160	3309		10563
玻璃						2755
橡胶	-22312	-22820	-23099	-22410	-19562	-18517
沥青	12216	11702	11928	11884	-8543	-6708
动力煤	27536	26543	26757	28089	27039	27111

部分机构持仓一览

机构	南华期货					
日期	2018-3-20	2018-3-21	2018-3-22	2018-3-23	2018-3-26	2018-3-27
黄金	1067	-1652	966	857	1365	1349
白银						
沪铜				4370	4525	3954
沪铝	5002	5245	5262	5256	4919	4527
沪镍	-5974	-5728	-6124	-4178		
沪锌						
沪铅	-674			-1327	-1739	-1477
螺纹钢		45120	45626	25313	27024	29635
铁矿石						
焦煤				-2837		
焦炭						
豆油	10576	10925	4279	3694	3733	
棕榈油					4497	4688
菜籽油			-5009	-4691	-4368	-4398
豆粕						
菜籽粕	-9064	-8833	-9169	-9164	-9404	-9543
棉花						
白糖	4677				5227	5431
玉米	-15581		-16125	-16797	-16031	-16189
鸡蛋	2427		2396	2433	2311	2382
PTA	18049	18547				20318
聚乙烯	14410	18633	18843	11113	15640	12056
聚丙烯	-8228	-8888	-9317	-10981	-11351	-11286
甲醇	783	1106	2500			998
玻璃						
橡胶		730		2320	4193	4515
沥青						
动力煤						

部分机构持仓一览

机构	国泰君安					
日期	2018-3-20	2018-3-21	2018-3-22	2018-3-23	2018-3-26	2018-3-27
黄金	6001	6064	5722	5079	5466	6200
白银	-17077	-17092	-17369	-17315	-16716	-16523
沪铜	6017	5246	7967	8120	10168	9505
沪铝	11051	10990	10856	10153	10379	9766
沪镍				4440		5536
沪锌						
沪铅						
螺纹钢	64095	65392	67938	30291	65379	41462
铁矿石	11240	11239	6365	5033	10122	9647
焦煤	-2645	-3056	-2986	-3773	-6839	-4052
焦炭	-653		-953	-1635	-1664	-1659
豆油						
棕榈油						
菜籽油	36823	36825	36198	36474	36406	36399
豆粕						
菜籽粕	11016	11466	11382	11351	11029	11102
棉花						
白糖	-6771	-7221	-7120	-7190	-7713	-7166
玉米	5487					
鸡蛋	1121	1102	1070	651	732	760
PTA						
聚乙烯						
聚丙烯	7947	7728	6478			
甲醇	-1531	-845		1190		897
玻璃			4561			
橡胶	-5919	-5913	-6158	-5521	-5859	-5720
沥青						
动力煤						

部分机构持仓一览

机构	混沌天成					
日期	2018-3-20	2018-3-21	2018-3-22	2018-3-23	2018-3-26	2018-3-27
黄金						
白银						
沪铜	-10155	-11013	-11170	-10905	-10976	-10797
沪铝						
沪镍	-7832	-7865	-7873	-5514	-6565	-6926
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	2018-3-20	2018-3-21	2018-3-22	2018-3-23	2018-3-26	2018-3-27
黄金	4949	4797	4280	3561	3945	4356
白银	12246	11056	12218	14146	14509	13672
沪铜	-16864	-16977	-15603	-17685	-17362	-16672
沪铝	-5523	-6414	-5789	-6580	-10371	-5799
沪镍	7856	6086	4679	8082	4903	
沪锌						
沪铅	3327	3826	4206	4186	3906	3997
螺纹钢					19817	
铁矿石			5796	-3903	-6144	-7190
焦煤	-838		-1601	-2223		
焦炭	1690	794	1052	1829	2498	
豆油						
棕榈油	2258	1819	1906	1121	1962	
菜籽油	-6407				-6522	-7134
豆粕	34008	33799	31850	37559	31911	
菜籽粕	6277			4414	4554	5304
棉花	3501	3629	3808			
白糖	-6721	-5905	-5990	-5865		-6034
玉米		12195			13706	
鸡蛋				520		358
PTA			12038		11466	-22220
聚乙烯	-6299	-5861	-6504	-6066	-7738	-6583
聚丙烯	6237	6647	8350	6967	6414	9564
甲醇			6407	40	-3761	-3247
玻璃	-2999	-3823	-6505		3645	2838
橡胶						
沥青				2791	4526	4200
动力煤	-6153	-5642	-5557	-5338	-4832	-4635

部分机构持仓一览

机构	上海大陆					
日期	2018-3-20	2018-3-21	2018-3-22	2018-3-23	2018-3-26	2018-3-27
黄金						
白银						
沪铜						
沪铝						
沪镍		4176	4531			
沪锌						
沪铅						
螺纹钢						
铁矿石						
焦煤						
焦炭						
豆油						
棕榈油	13164	12842	10501	14548	10182	10397
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	-6157	-6230	-6242	-3849		
动力煤						

部分机构持仓一览

机构	中粮期货					
日期	2018-3-20	2018-3-21	2018-3-22	2018-3-23	2018-3-26	2018-3-27
黄金						
白银	7625		7990	8364	8436	8578
沪铜	-8059	-7990	-8098	-7714	-7589	
沪铝	-6938	-6623	-6783			-4423
沪镍			4693	5731	5720	5934
沪锌	-4349	-3567	-4030	-4674	-4513	-4563
沪铅	515	492	718	597	575	577
螺纹钢						
铁矿石						
焦煤						
焦炭						
豆油	-47987	-47909	-50352	-43742	-39736	-39423
棕榈油	-23698	-24009	-24759	-24871	-25016	-24831
菜籽油	-20387	-19685	-20110	-19730	-19646	-21485
豆粕	-168595	-180046	-187419	-149210	-117667	-112957
菜籽粕	-54356	-53661	-52813	-51428	-49801	-48949
棉花	-4677	-7999	-7946	-7638	-4284	-7623
白糖	-21925	-22220	-22656	-22089	-22182	-21639
玉米	-34912	-35962	-36465	-34871	-42997	-37548
鸡蛋						
PTA						
聚乙烯	8594	8792	9601	9692	9837	9505
聚丙烯						
甲醇						
玻璃		-3663				
橡胶	-6824	-6585	-6581	-6153	-5891	-5964
沥青						
动力煤	-6471	-6228	-5209			

部分机构持仓一览

机构	中信期货					
日期	2018-3-20	2018-3-21	2018-3-22	2018-3-23	2018-3-26	2018-3-27
黄金	6687	6948	7300	7863	7912	6021
白银	-37549	-36969	-39503	-40229	-41664	-43130
沪铜	-25576	-25835	-26291	-23314	-22504	-21119
沪铝	-26033	-26526	-26125	-23889	-23881	-23969
沪镍	8890	8365	8127	6455	7009	7826
沪锌	5255	6103	6731	6867	6089	6432
沪铅	-1421	-1632	-1195	-649		
螺纹钢						
铁矿石	3034	1041	-1169	-1399	-4663	-3934
焦煤	6009	5277	4834	3633	4115	4601
焦炭	912	707	615	1310	1085	1084
豆油	-20420	-21223	-19379	-16660	-14174	-16352
棕榈油	-17692	-18218	-17229	-17867	-16926	-15244
菜籽油	-6054	-7810	-5067	-4916	-6692	-6986
豆粕	59274	60404	73433	72731	69947	73876
菜籽粕	18743	18994	17776	17827	17867	17647
棉花						
白糖	-10524	-11319	-12071	-10725	-10220	-11427
玉米	32122	33183	27750	24585	24819	19771
鸡蛋	-658	-853	-1221	-1528	-1192	-1267
PTA			21707			
聚乙烯	-11812	-11499	-12180	-10336	-11585	-11713
聚丙烯	6519	5813	6287	7590	7329	6948
甲醇	2694	3570	5835	5208	1459	
玻璃	14671	15432	15484	14086	13002	14027
橡胶						
沥青	-3336		-3056			
动力煤						

部分机构持仓一览

机构	中信建投					
日期	2018-3-20	2018-3-21	2018-3-22	2018-3-23	2018-3-26	2018-3-27
黄金				1441	1225	
白银						
沪铜						
沪铝						
沪镍						
沪锌						
沪铅						
螺纹钢	28872	30233	29241	28918	22526	19547
铁矿石				20807	22623	22774
焦煤			-3134	-2713		
焦炭						
豆油						
棕榈油	-8578	-8522	-8549	-6561	-6236	-5946
菜籽油						
豆粕	55529	54360	55700	55214	60975	62809
菜籽粕						
棉花						
白糖						
玉米						
鸡蛋	1425	1343	3987	635		
PTA						
聚乙烯						
聚丙烯						
甲醇						
玻璃	-4765		-4649			
橡胶						
沥青				-2979	-3480	-3345
动力煤						

部分机构持仓一览

机构	新湖期货					
日期	2018-3-20	2018-3-21	2018-3-22	2018-3-23	2018-3-26	2018-3-27
黄金	-1221	-1352	-1140	-1046	-1031	-998
白银		7821			7072	7620
沪铜	7486	6895	5799	4827		
沪铝						
沪镍						
沪锌						
沪铅						
螺纹钢						
铁矿石						
焦煤						
焦炭						
豆油	12957	12769	12844	3217	9601	9911
棕榈油	9846	9704	9625	10416	10206	10195
菜籽油	-6232	-6206				
豆粕	-69371	-69645	-70655	-75178	-71986	-72176
菜籽粕						
棉花	3250	3653	4166	3937	4005	4331
白糖						
玉米	29377	30925	30982	31489	31392	31570
鸡蛋		-311	-88			
PTA	-30509	-30408	-27304	-23860	-25318	-26749
聚乙烯						
聚丙烯						
甲醇			-5637			
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

