



市场持仓分析

2018/5/10

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
玻璃	6.32%	3.41%	-0.89%	-17.94%	-16.80%	-10.54%	24.26%	☆☆☆☆
铁矿石	14.13%	10.07%	-12.02%	-5.50%	-4.75%	-4.26%	19.62%	☆☆☆
沪铝	4.19%	3.02%	-9.91%	-14.09%	-10.19%	-11.17%	18.27%	☆☆☆
焦煤	7.56%	6.48%	18.33%	-8.49%	-12.17%	1.02%	16.05%	☆☆☆
橡胶	10.99%	9.73%	0.43%	0.21%	0.35%	1.65%	10.79%	☆☆☆
沪金	3.94%	1.88%	0.16%	-5.92%	-8.88%	-7.27%	9.85%	☆☆
PTA	16.93%	12.87%	11.56%	10.19%	6.86%	5.50%	6.74%	☆☆
玉米	2.23%	1.33%	2.77%	-2.97%	2.94%	3.97%	5.20%	☆☆
棉花	5.17%	4.50%	3.97%	0.05%	-0.04%	3.42%	5.13%	☆☆
沪锌	3.39%	0.75%	1.59%	-1.34%	-0.15%	-0.12%	4.73%	☆
豆粕	2.74%	1.23%	-0.06%	-1.99%	-1.46%	-1.12%	4.72%	☆
甲醇	4.22%	4.07%	0.76%	1.48%	1.94%	-1.25%	2.74%	☆
螺纹钢	-0.38%	4.88%	18.42%	-2.56%	-1.84%	9.72%	2.18%	☆
沪铜	-1.52%	-1.49%	-2.76%	-3.49%	-1.71%	-2.52%	1.97%	☆
沥青	2.91%	1.18%	0.54%	2.10%	0.27%	2.88%	0.81%	☆
鸡蛋	-1.18%	0.51%	1.92%	-1.53%	0.49%	3.09%	0.35%	☆
白糖	1.34%	1.31%	1.78%	1.21%	0.86%	3.42%	0.14%	☆
聚乙烯	-5.08%	-3.54%	-1.53%	-4.20%	-4.95%	-5.05%	-0.88%	☆
动力煤	-0.46%	-0.99%	-7.67%	1.73%	1.42%	0.88%	-2.19%	☆
豆油	-5.49%	-3.99%	-7.06%	1.41%	0.81%	-0.02%	-6.90%	☆☆
棕榈油	-11.11%	-16.01%	-13.12%	4.65%	-1.89%	-4.45%	-15.76%	☆☆☆
沪银	-6.08%	-6.64%	-7.58%	9.73%	3.15%	3.44%	-15.81%	☆☆☆
聚丙烯	-19.78%	-12.40%	-6.26%	-3.73%	-4.76%	-2.57%	-16.05%	☆☆☆
菜籽粕	-18.58%	-14.88%	-4.31%	1.10%	0.54%	-4.49%	-19.68%	☆☆☆
焦炭	12.60%	12.28%	30.83%	32.41%	28.90%	25.79%	-19.81%	☆☆☆
沪镍	-19.98%	-15.47%	-9.74%	2.36%	2.85%	1.33%	-22.34%	☆☆☆☆

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
焦炭	105.09%	110.83%	119.14%	31.75%	33.50%	63.60%	73.34%	☆☆☆☆
焦煤	49.61%	38.02%	26.63%	4.88%	0.76%	5.72%	44.73%	☆☆☆
铁矿石	40.58%	26.91%	0.71%	0.94%	-0.80%	-0.64%	39.65%	☆☆☆
沪锌	10.33%	12.40%	7.04%	-19.06%	-15.42%	-8.36%	29.39%	☆☆
PTA	55.92%	48.09%	39.70%	32.42%	28.96%	19.34%	23.50%	☆☆
沪铝	6.22%	1.13%	-14.13%	-17.00%	-12.26%	-13.18%	23.23%	☆☆
沥青	-2.68%	-2.56%	-3.14%	-25.85%	-17.44%	-9.01%	23.17%	☆☆
豆粕	17.91%	10.13%	-0.14%	-1.18%	-5.81%	-5.49%	19.09%	☆☆
橡胶	7.58%	2.11%	-10.78%	-3.90%	-5.20%	-4.95%	11.48%	☆☆
棉花	15.12%	5.75%	6.04%	4.58%	8.84%	17.96%	10.54%	☆☆
豆油	6.18%	4.67%	-0.23%	-0.88%	-0.10%	-0.26%	7.06%	☆
玉米	13.17%	2.15%	-2.52%	6.11%	6.93%	3.75%	7.06%	☆
沪铜	1.58%	1.57%	2.95%	1.07%	3.17%	1.76%	0.51%	☆
鸡蛋	-4.32%	-8.96%	-5.18%	-0.80%	-1.63%	1.14%	-3.53%	☆
螺纹钢	10.07%	6.44%	5.51%	15.34%	8.82%	-1.10%	-5.28%	☆
动力煤	-22.39%	-22.40%	-24.76%	-12.36%	-13.31%	-12.84%	-10.03%	☆☆
白糖	-1.25%	-2.09%	-1.34%	11.24%	8.93%	8.39%	-12.48%	☆☆
玻璃	11.21%	26.78%	30.21%	24.55%	17.59%	7.71%	-13.34%	☆☆
甲醇	17.49%	20.77%	24.86%	31.67%	32.51%	33.32%	-14.18%	☆☆
菜籽粕	-11.30%	-3.66%	0.58%	6.04%	5.28%	-2.02%	-17.34%	☆☆
沪银	-1.91%	-4.91%	-6.55%	16.01%	7.78%	1.35%	-17.93%	☆☆
棕榈油	-13.55%	-17.67%	-13.78%	6.65%	5.67%	1.02%	-20.20%	☆☆
沪金	1.90%	-0.42%	-2.69%	22.69%	10.40%	4.61%	-20.79%	☆☆
聚乙烯	-6.55%	-4.87%	-6.00%	14.35%	7.51%	0.44%	-20.91%	☆☆
沪镍	-21.71%	-21.19%	-18.47%	16.61%	16.00%	10.09%	-38.32%	☆☆☆
聚丙烯	-26.12%	-14.72%	-4.29%	29.81%	23.46%	18.60%	-55.93%	☆☆☆☆

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5月10日机构持仓异动表

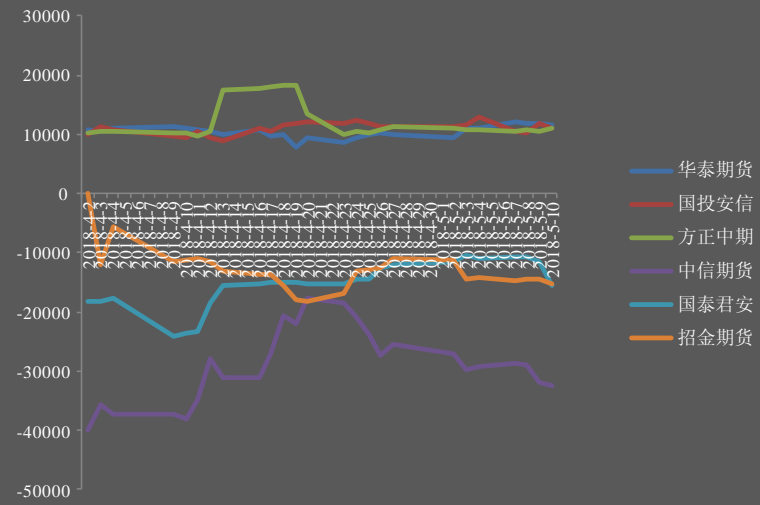
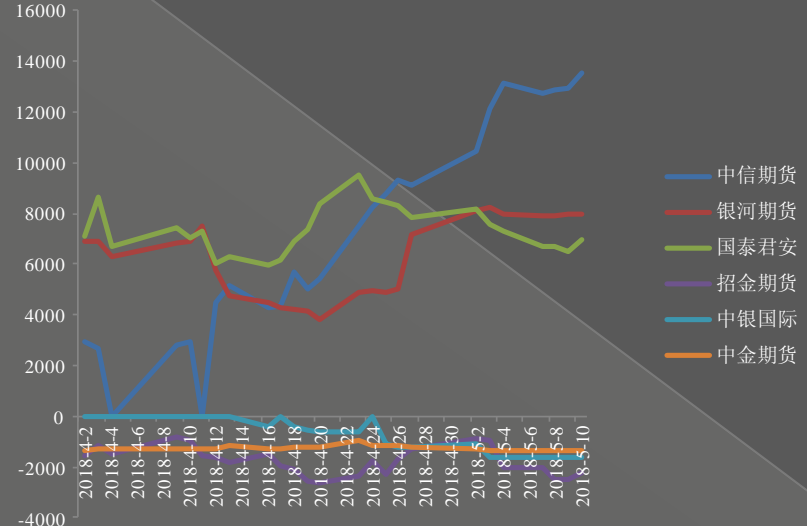
金属

国泰君安	白银净空单变动幅度为：4139手
建信期货	沪铝净多单变动幅度为：2386手
海通期货	沪镍净多单变动幅度为：-3100手
永安期货	沪铅净多单变动幅度为：644手

黑色

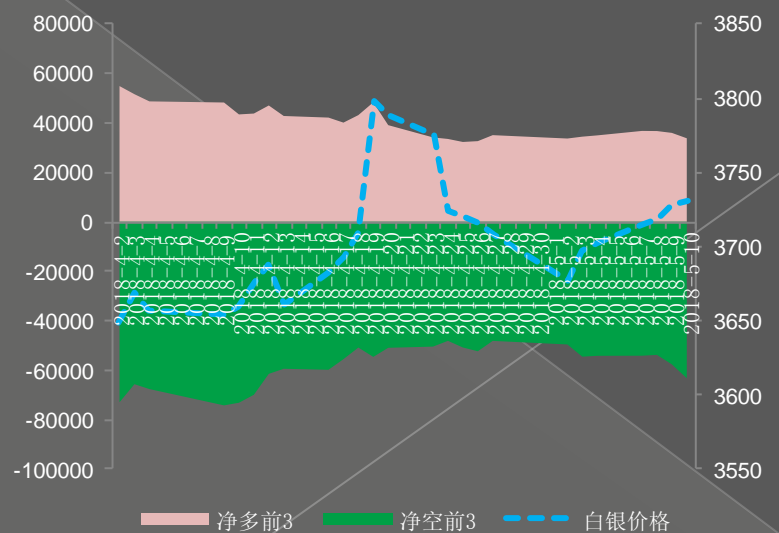
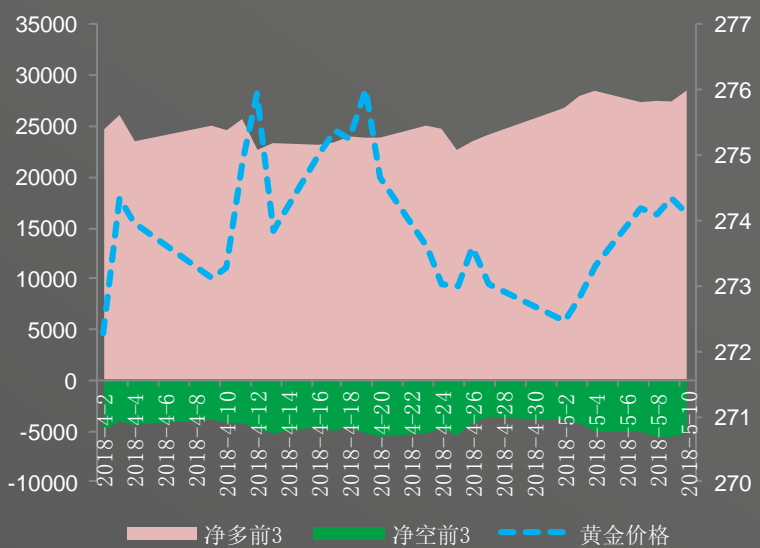
申万期货	螺纹钢净多单变动幅度为：-8861手
永安期货	螺纹钢净多单变动幅度为：19188手
一德期货	螺纹钢净空单变动幅度为：26029手
光大期货	铁矿石净多单变动幅度为：-21805手
广发期货	铁矿石净多单变动幅度为：17088手
大地期货	焦炭净空单变动幅度为：-2208手
鲁证期货	焦炭净空单变动幅度为：1877手
徽商期货	焦炭净空单变动幅度为：2782手

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	3.94%	1.90%	0.38%	6.33%
	空头前3	-5.92%	22.69%	4.54%	
au涨幅		-0.09%	0.48%	0.10%	
震荡幅度	0.32%	0.48%(月均值)	投机度	0.36	0.44(月均值)

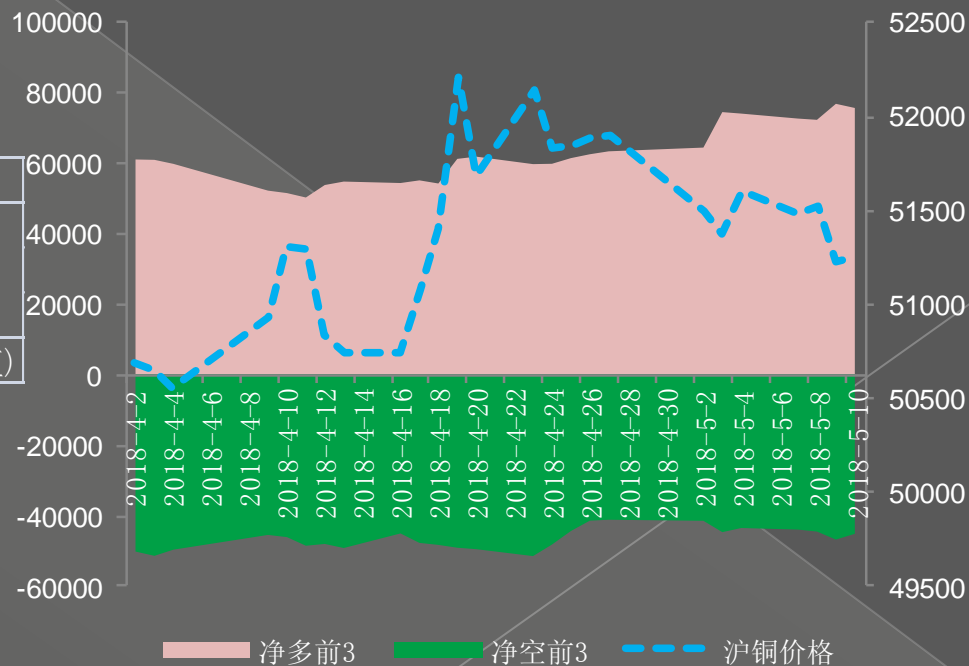
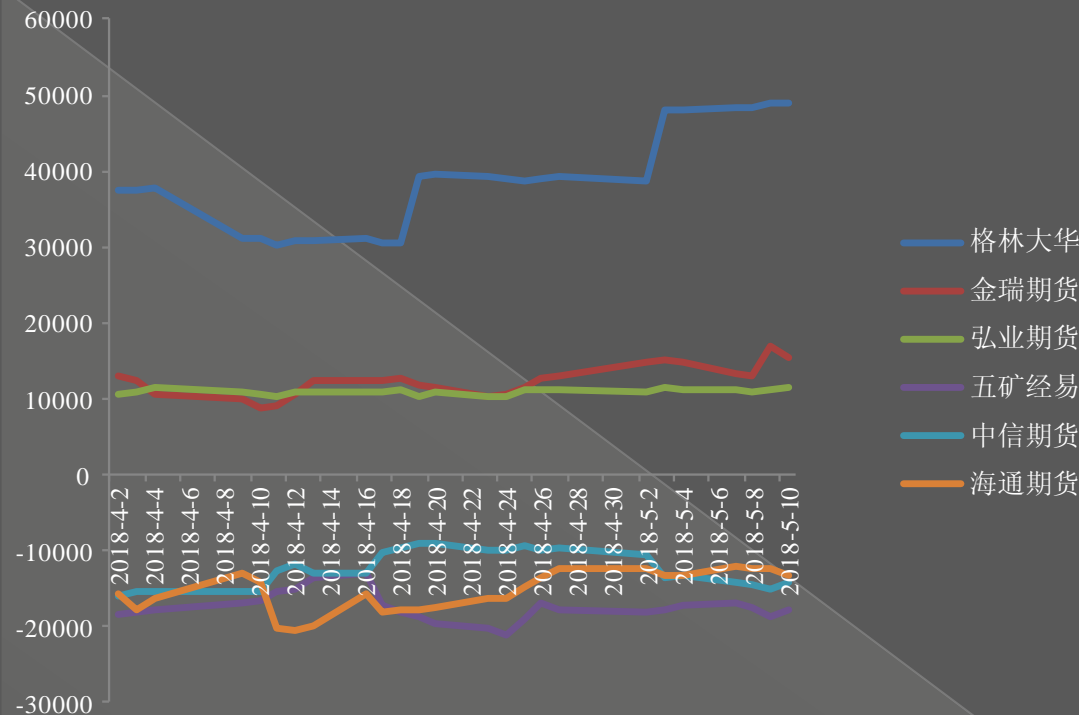
变动幅度		当日	最近5日	平均变化	波动率
ag持仓	多头前3	-6.08%	-1.91%	-0.38%	12.31%
	空头前3	9.73%	16.01%	3.20%	
ag涨幅		0.06%	0.92%	0.18%	
震荡幅度	0.47%	0.68%(月均值)	投机度	0.47	0.44(月均值)



净多前3 净空前3 黄金价格

净多前3 净空前3 白银价格

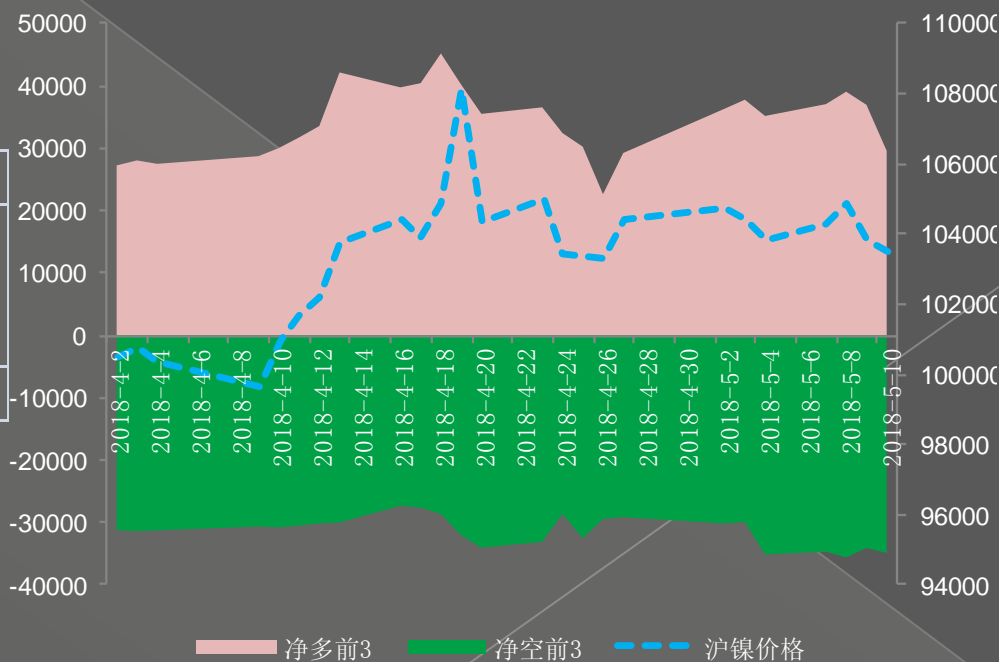
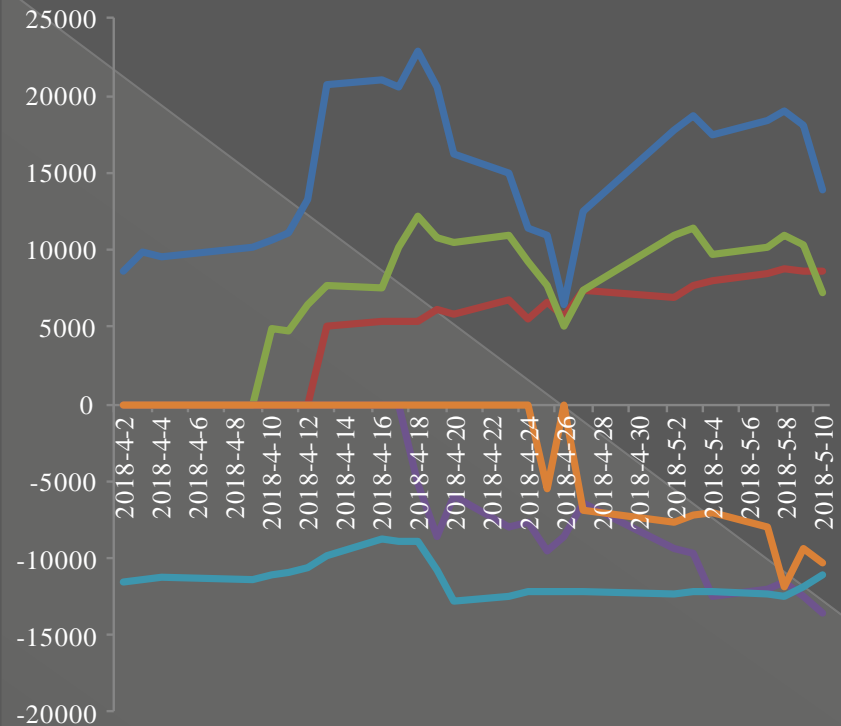
金属板块：Cu



变动幅度		当日	最近5日	平均变化	波动率
cu持仓	多头前3	-1.52%	1.58%	0.32%	12.62%
	空头前3	-3.49%	1.07%	0.21%	
cu涨幅		0.07%	-0.22%	-0.04%	
震荡幅度	0.75%	1.06%(月均值)	投机度	0.49	0.49(月均值)

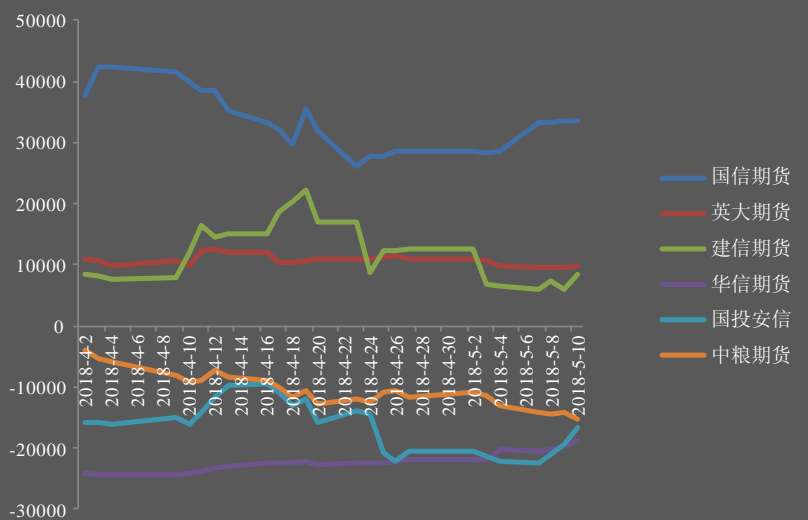
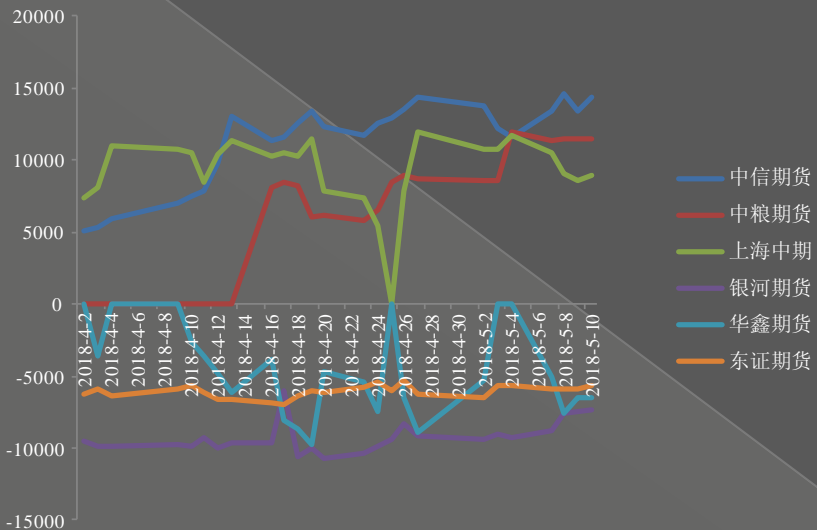
金属板块：Ni

- 永安期货
- 首创期货
- 海通期货
- 中信期货
- 兴业期货
- 中粮期货



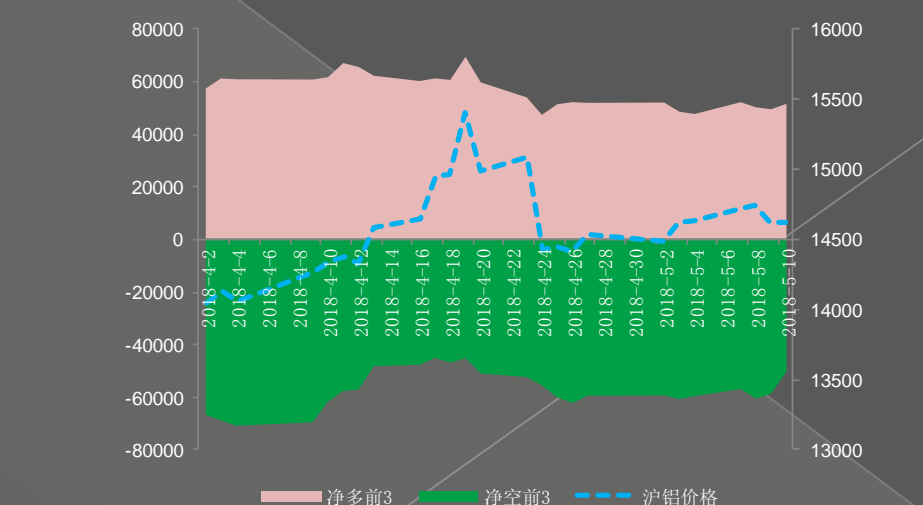
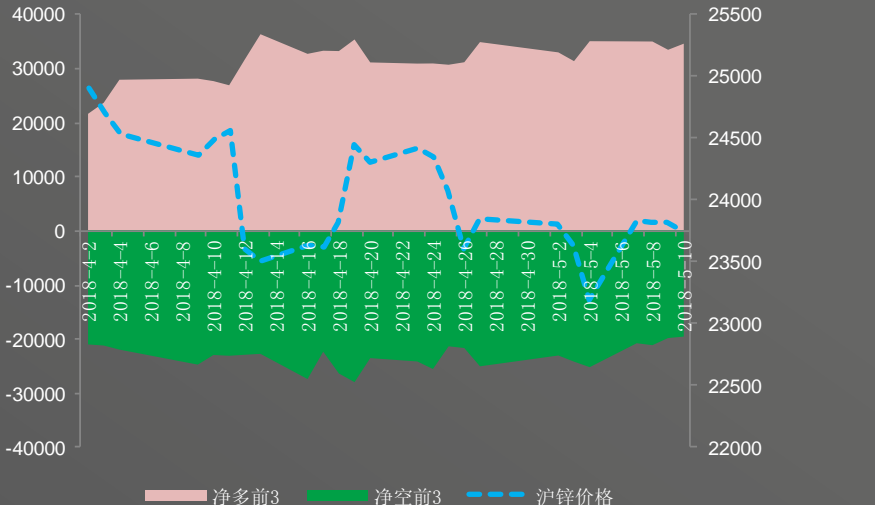
变动幅度		当日	最近5日	平均变化	波动率
ni持仓	多头前3	-19.98%	-21.71%	-4.34%	20.76%
	空头前3	2.36%	16.61%	3.32%	
ni涨幅		-0.34%	-0.89%	-0.18%	
震荡幅度	1.11%	1.88%(月均值)	投机度	1.08	1.77(月均值)

金属板块：Zn & Al

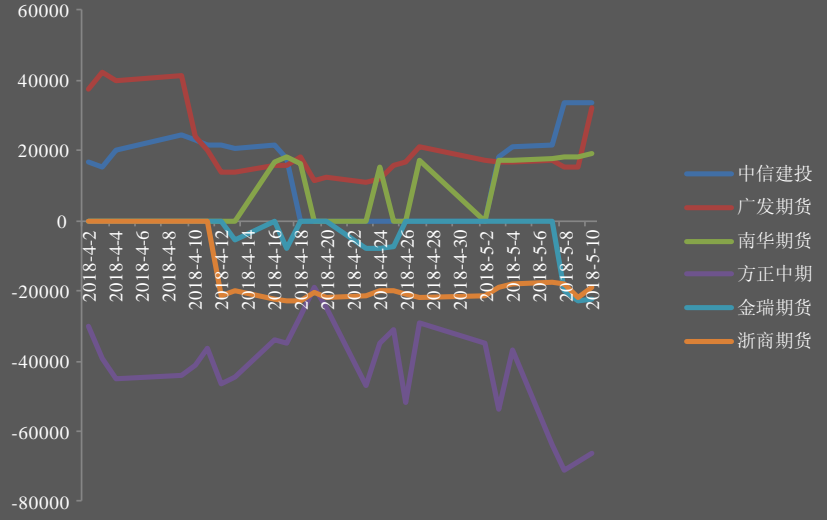
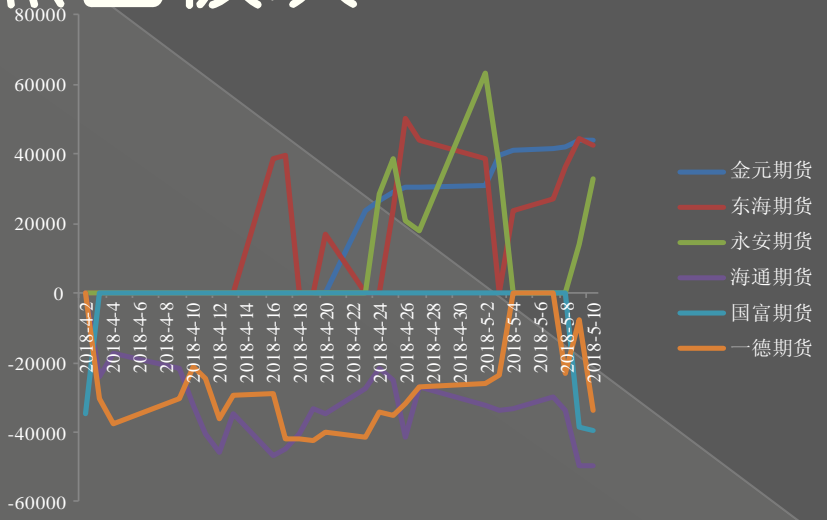


变动幅度		当日	最近5日	平均变化	波动率
zn持仓	多头前3	3.39%	10.33%	2.07%	21.99%
	空头前3	-1.34%	-19.06%	-3.81%	
zn涨幅		-0.32%	0.47%	0.09%	
震荡幅度	0.88%	1.77%(月均值)	投机度	1.03	1.29(月均值)

变动幅度		当日	最近5日	平均变化	波动率
al持仓	多头前3	4.19%	6.22%	1.24%	25.77%
	空头前3	-14.09%	-17.00%	-3.40%	
al涨幅		-0.02%	-0.01%	0.00%	
震荡幅度	0.67%	1.37%(月均值)	投机度	0.43	0.68(月均值)

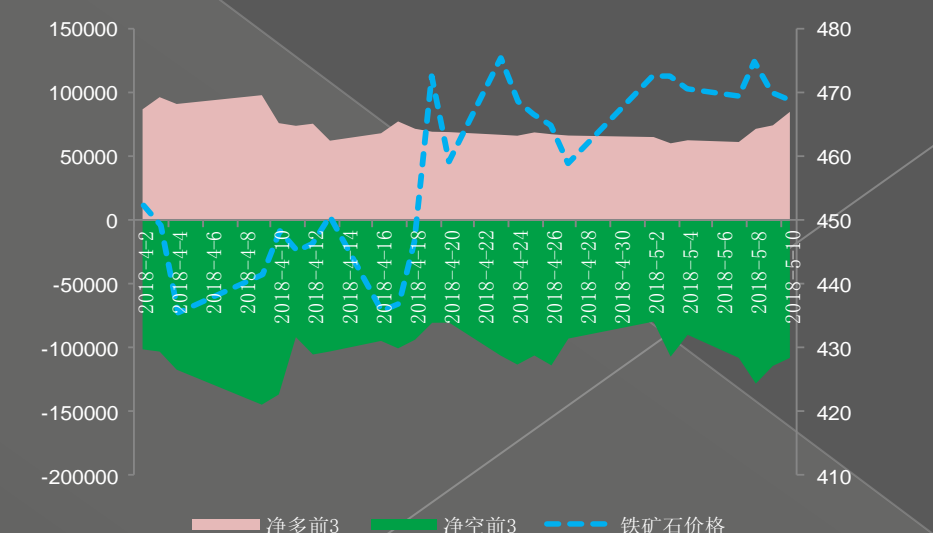
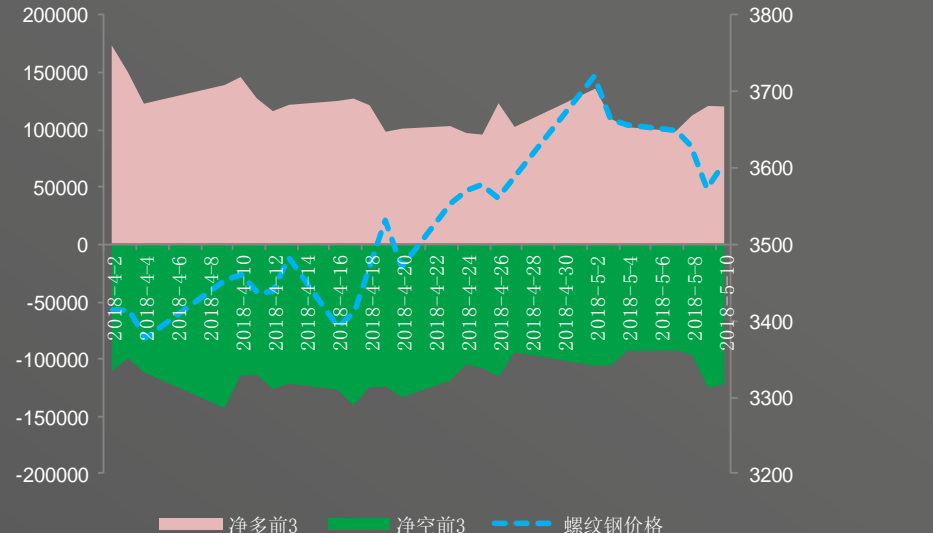


黑色板块：Rb & I

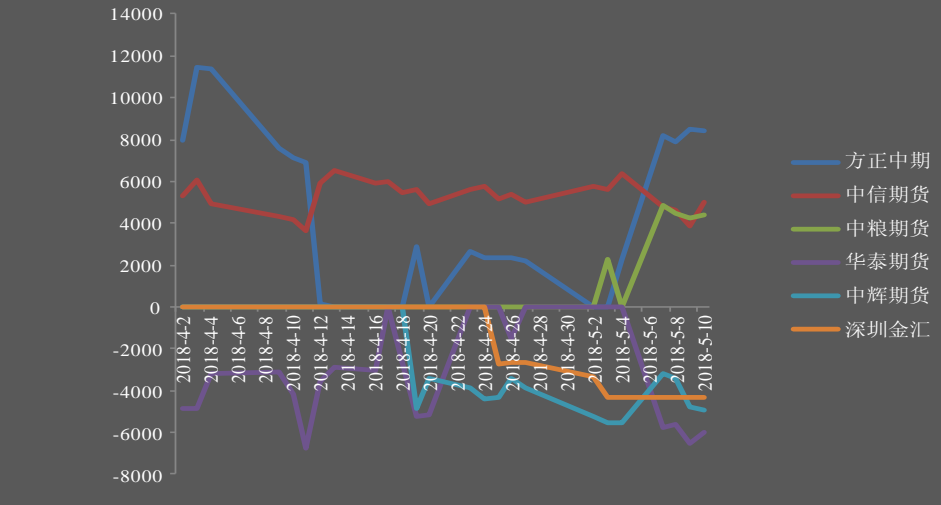
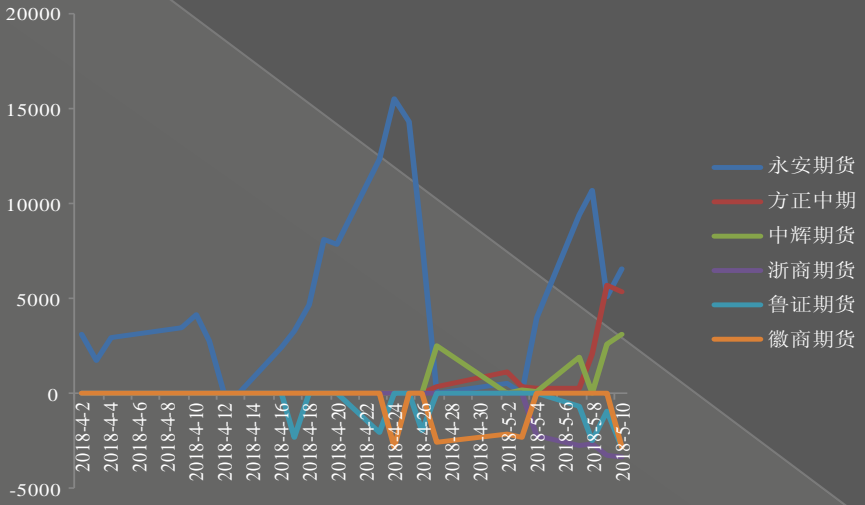


变动幅度		当日	最近5日	平均变化	波动率
rb持仓	多头前3	-0.38%	10.07%	2.01%	27.83%
	空头前3	-2.56%	15.34%	3.07%	
rb涨幅		0.84%	-1.64%	-0.33%	
震荡幅度	1.17%	1.93%(月均值)	投机度	1.16	1.40(月均值)

变动幅度		当日	最近5日	平均变化	波动率
I持仓	多头前3	14.13%	40.58%	8.12%	35.87%
	空头前3	-5.50%	0.94%	0.19%	
I涨幅		-0.24%	-0.80%	-0.16%	
震荡幅度	2.08%	2.87%(月均值)	投机度	1.15	1.40(月均值)

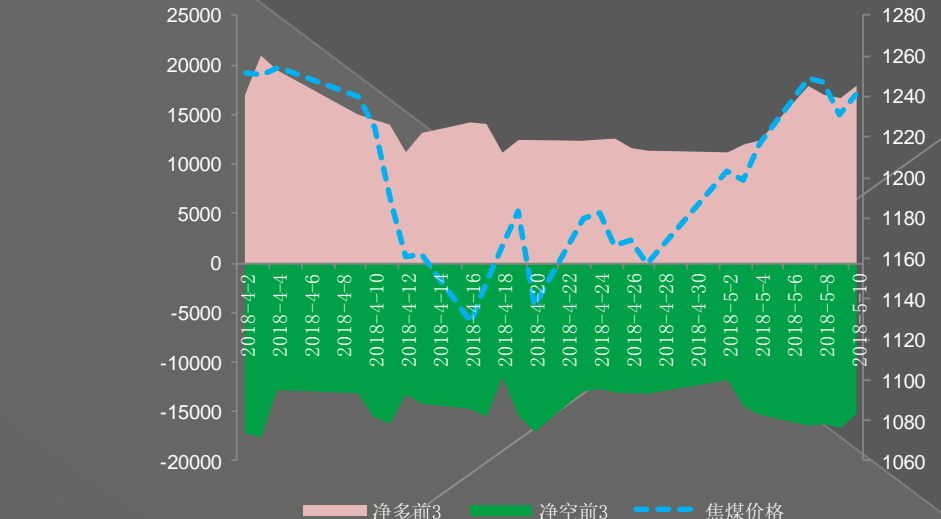
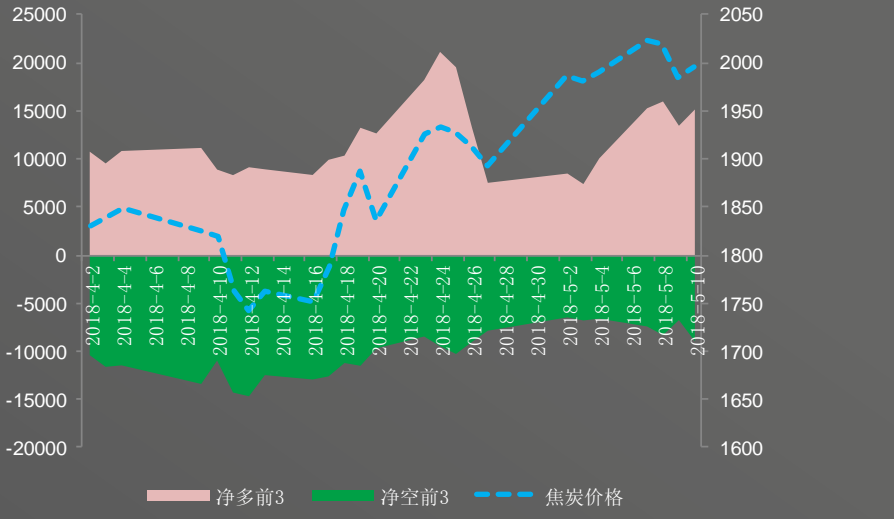


黑色板块：J & JM

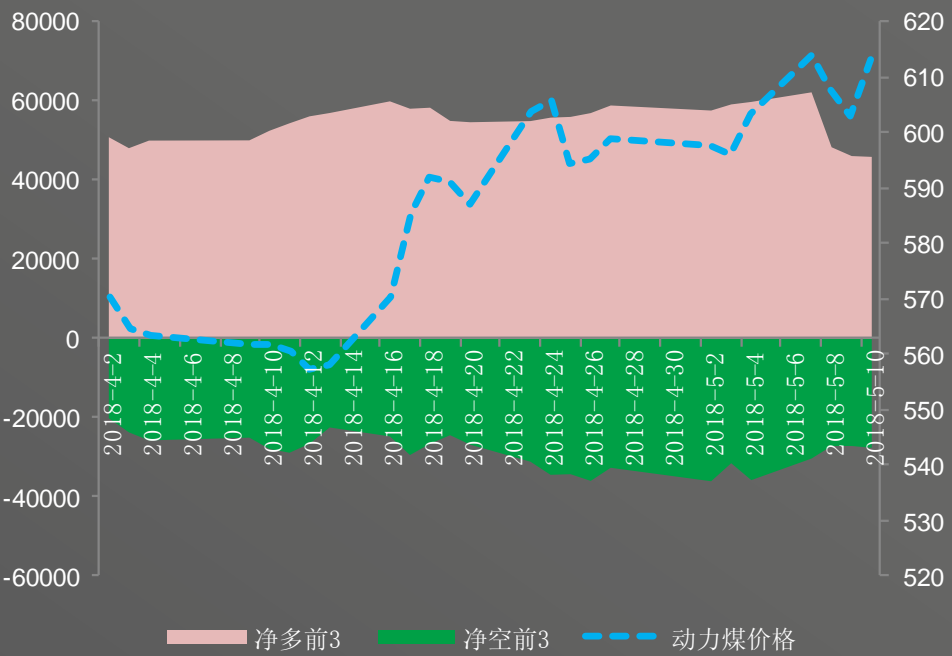
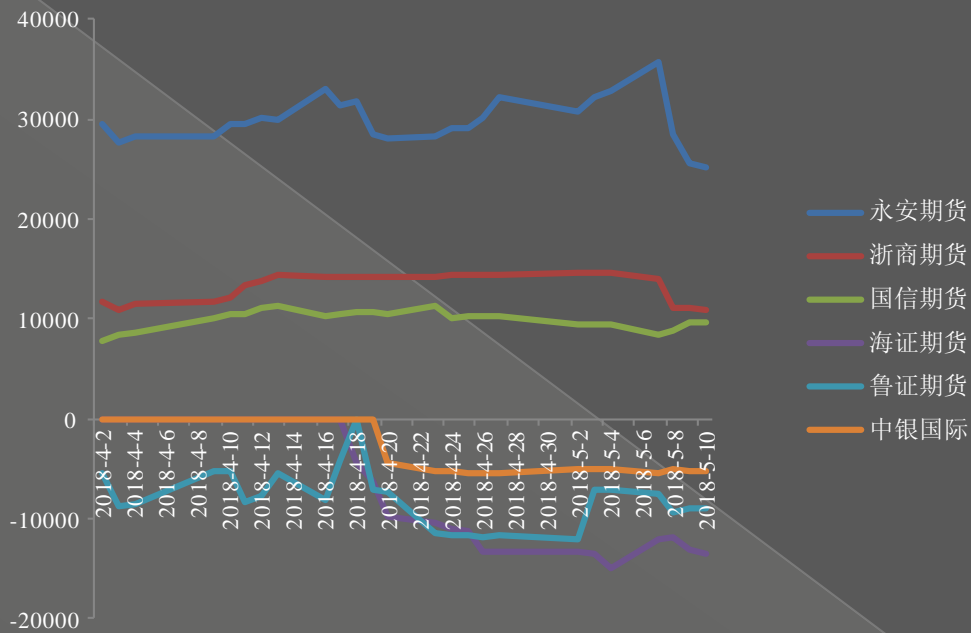


变动幅度		当日	最近5日	平均变化	波动率
j持仓	多头前3	12.60%	105.09%	21.02%	52.21%
	空头前3	32.41%	31.75%	6.35%	
j涨幅		0.55%	0.74%	0.15%	
震荡幅度	1.85%	2.86%(月均值)	投机度	1.25	1.49(月均值)

变动幅度		当日	最近5日	平均变化	波动率
jm持仓	多头前3	7.56%	49.61%	9.92%	38.88%
	空头前3	-8.49%	4.88%	0.98%	
jm涨幅		0.74%	3.49%	0.70%	
震荡幅度	1.55%	2.95%(月均值)	投机度	0.99	1.32(月均值)

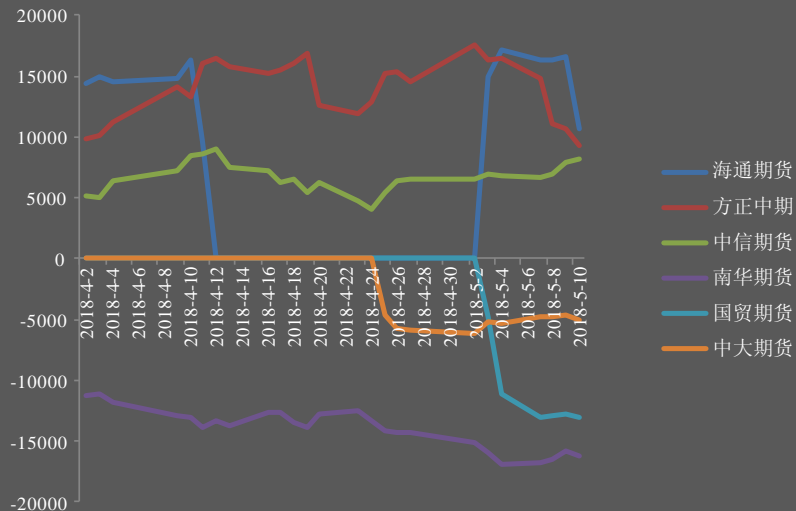
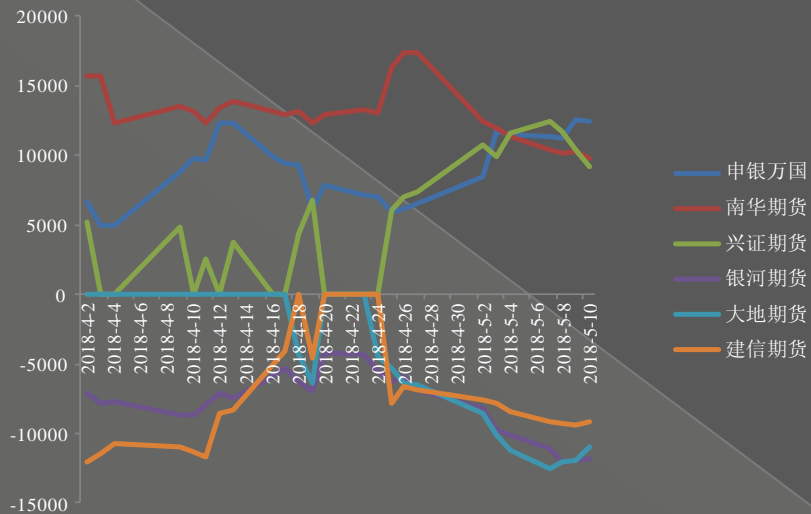


黑色：动力煤



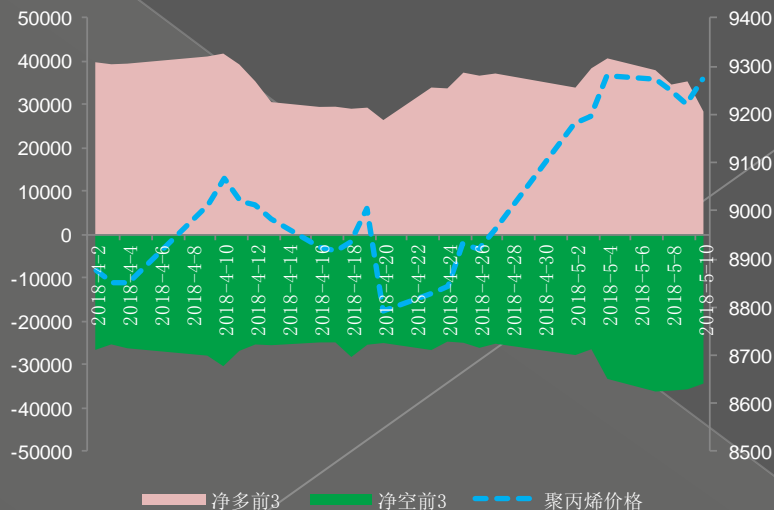
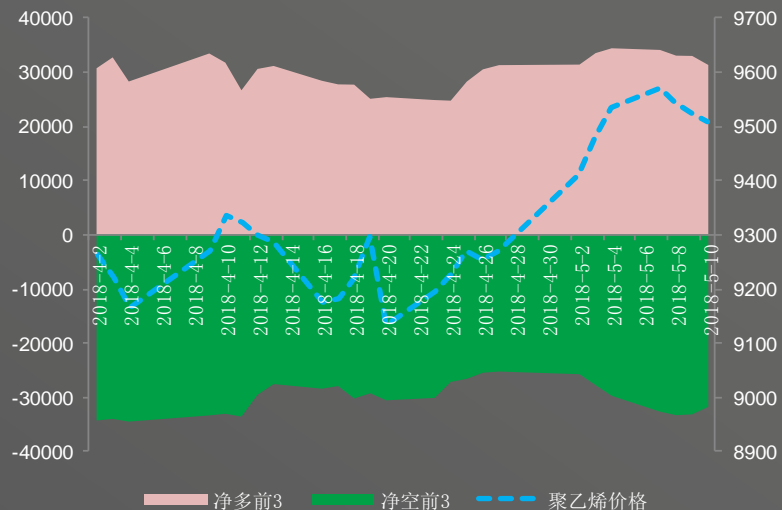
变动幅度		当日	最近5日	平均变化	波动率
zc持仓	多头前3	-0.46%	-22.39%	-4.48%	32.68%
	空头前3	1.73%	-12.36%	-2.47%	
zc涨幅		1.67%	2.87%	0.57%	
震荡幅度	2.00%	1.71%(月均值)	投机度	0.76	0.76(月均值)

化工：塑料 & PP

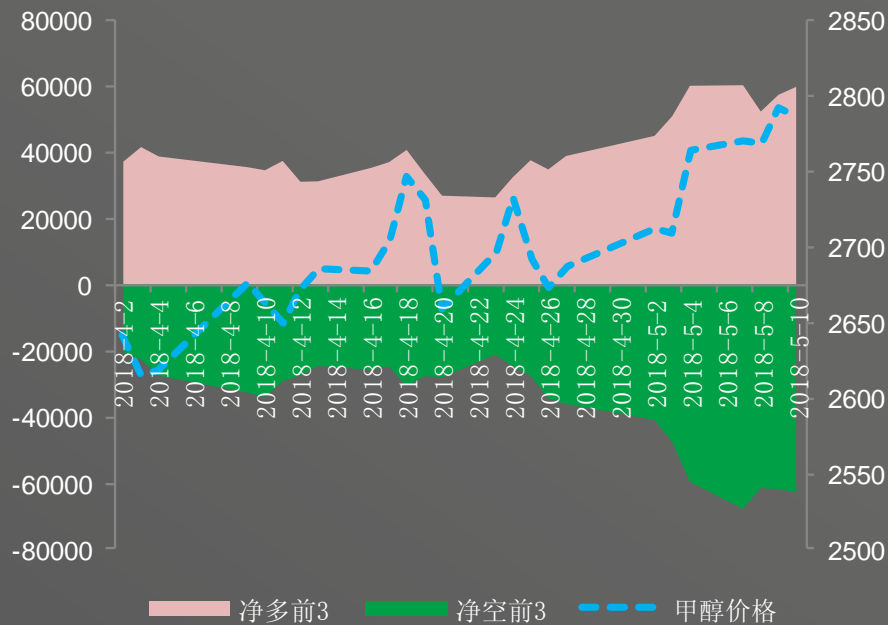
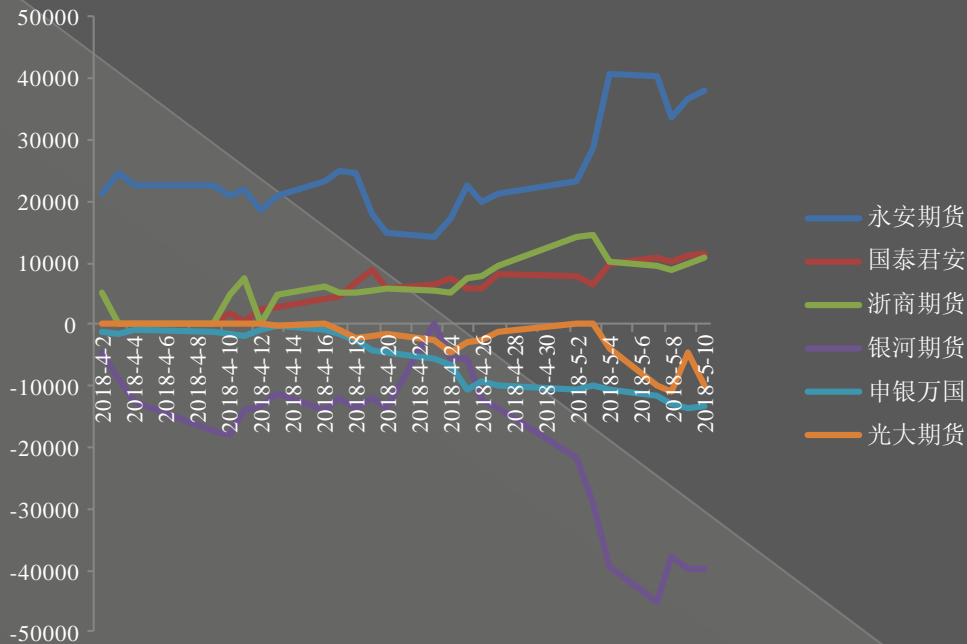


变动幅度		当日	最近5日	平均变化	波动率
I持仓	多头前3	-5.08%	-6.55%	-1.31%	11.90%
	空头前3	-4.20%	14.35%	2.87%	
I涨幅		-0.16%	0.30%	0.06%	
震荡幅度	1.10%	1.09% (月均值)	投机度	0.49	

变动幅度		当日	最近5日	平均变化	波动率
pp持仓	多头前3	-19.78%	-26.12%	-5.22%	18.62%
	空头前3	-3.73%	29.81%	5.96%	
pp涨幅		0.58%	0.84%	0.17%	
震荡幅度	0.86%	1.27% (月均值)	投机度	0.60	

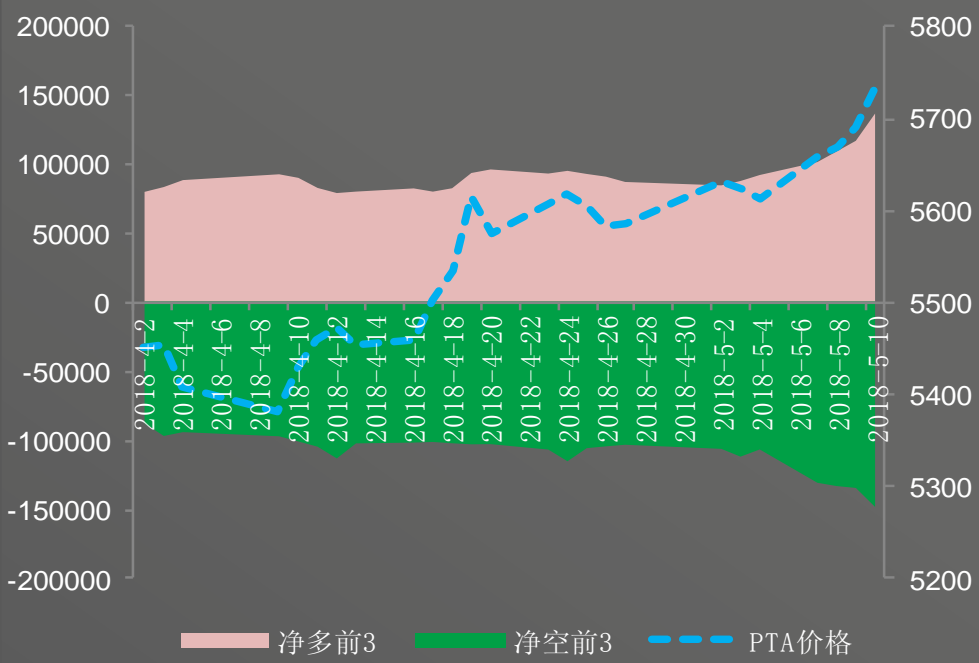
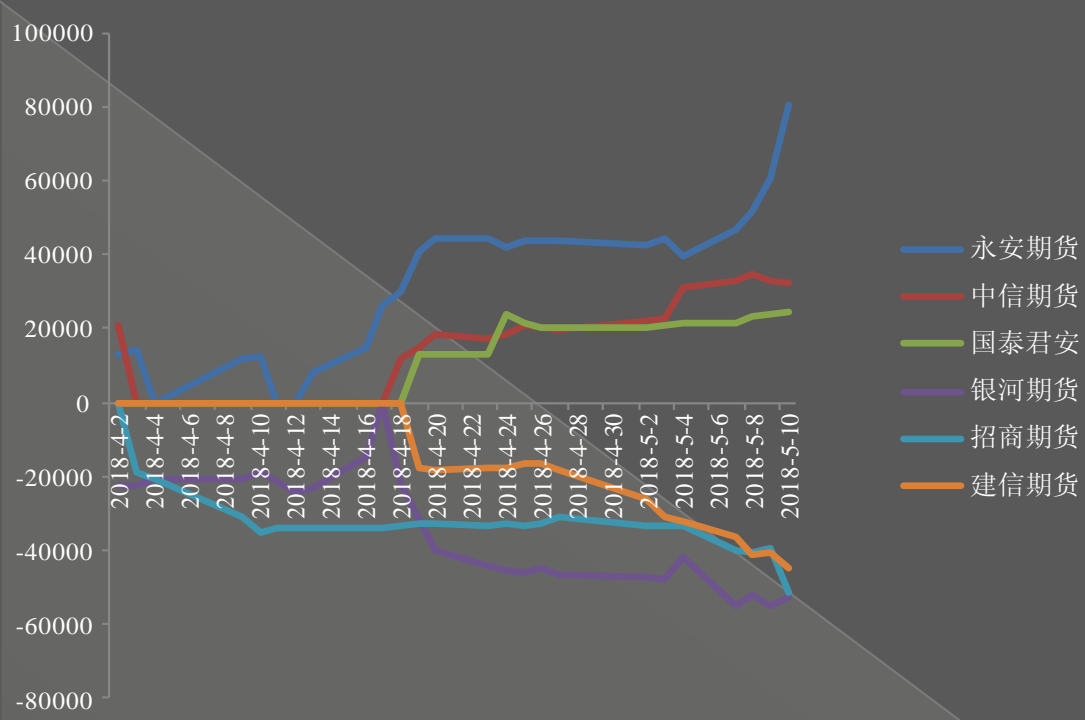


化工：甲醇



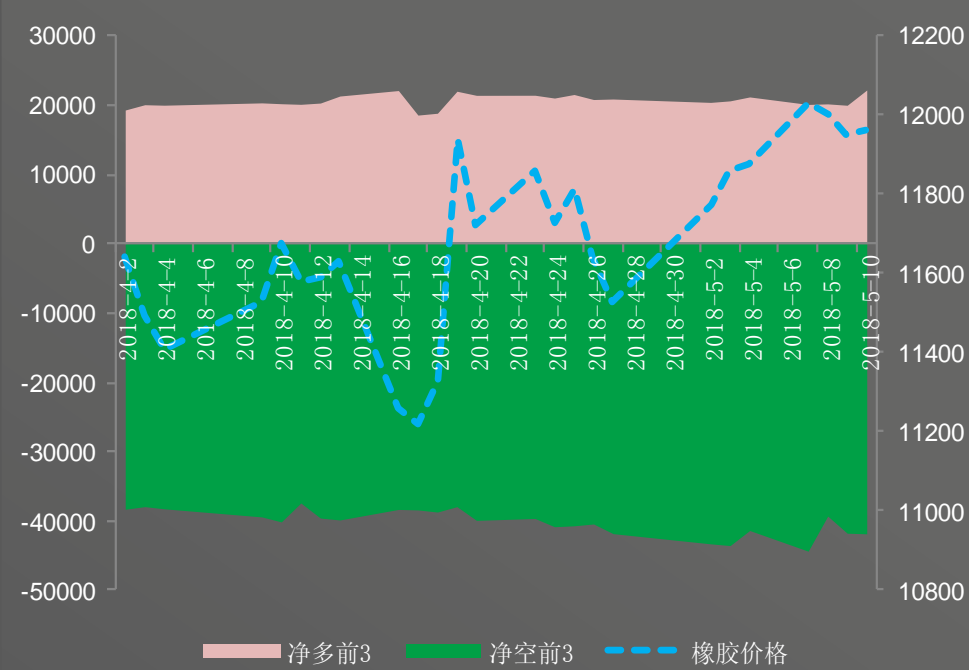
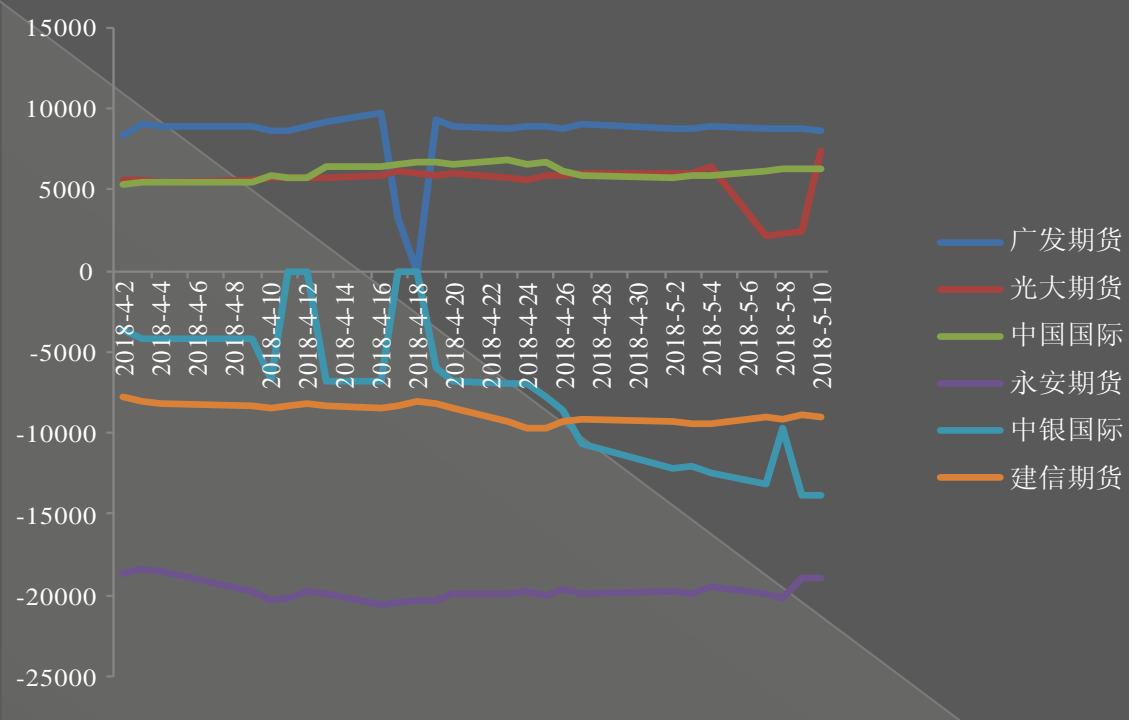
变动幅度		当日	最近5日	平均变化	波动率
ma持仓	多头前3	4.22%	17.49%	3.50%	22.67%
	空头前3	1.48%	31.67%	6.33%	
ma涨幅		-0.22%	2.81%	0.56%	
震荡幅度	1.05%	1.69%(月均值)	投机度	0.65	1.01(月均值)

化工：PTA



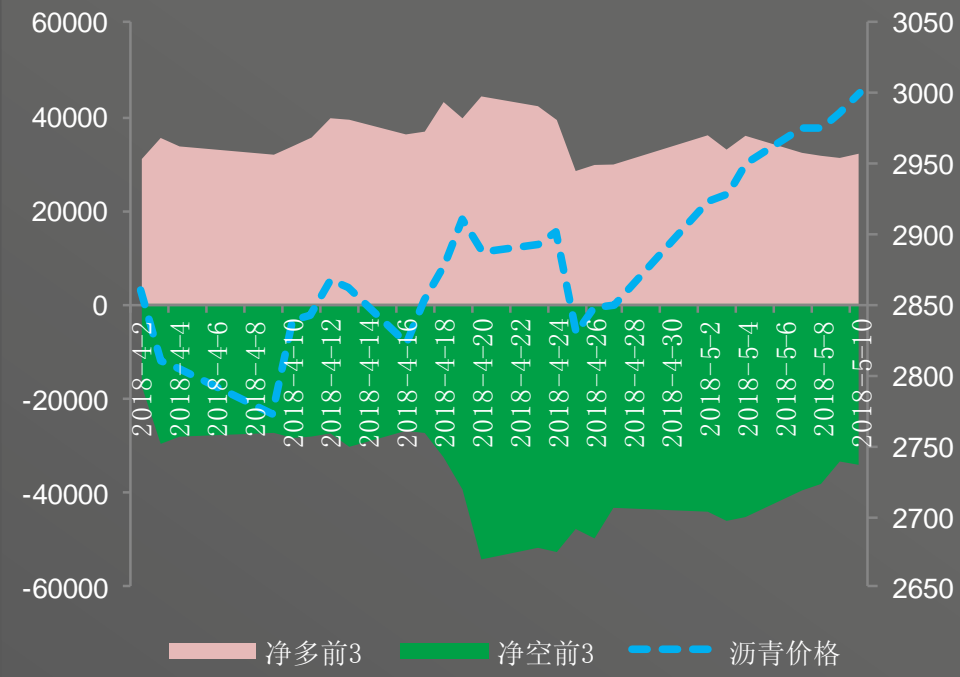
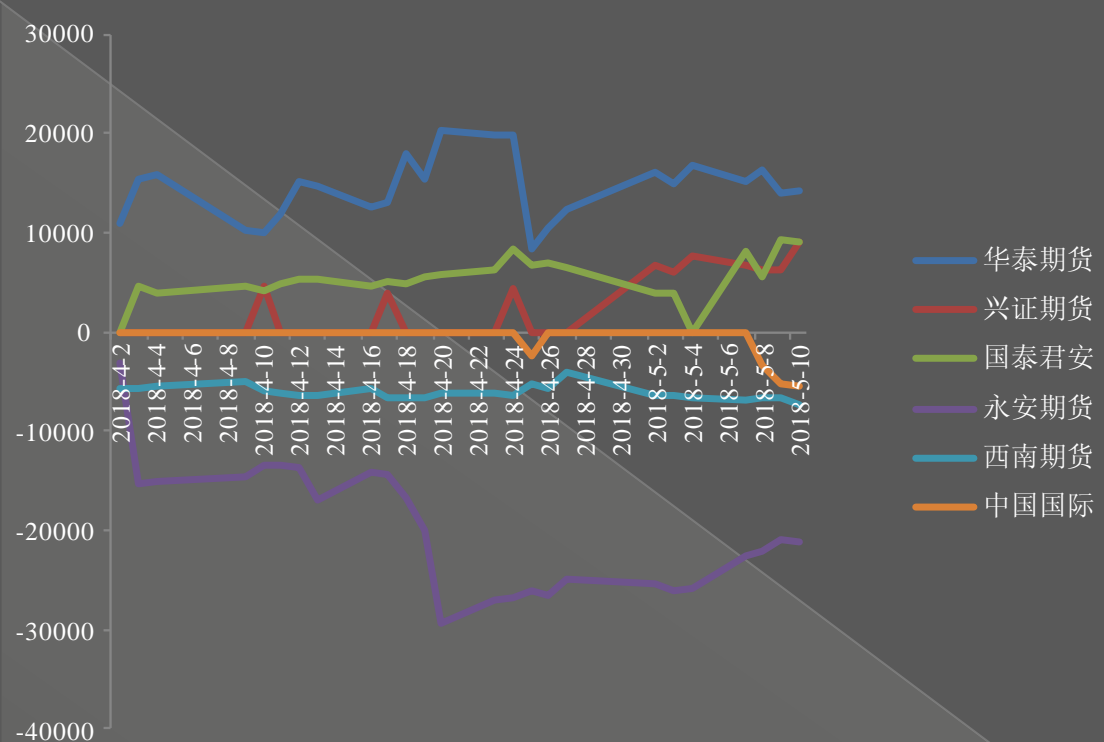
变动幅度		当日	最近5日	平均变化	波动率
pta持仓	多头前3	16.93%	55.92%	11.18%	11.64%
	空头前3	10.19%	32.42%	6.48%	
pta涨幅		0.77%	2.01%	0.40%	
震荡幅度	1.28%	1.09%(月均值)	投机度	0.51	0.41(月均值)

化工：橡胶



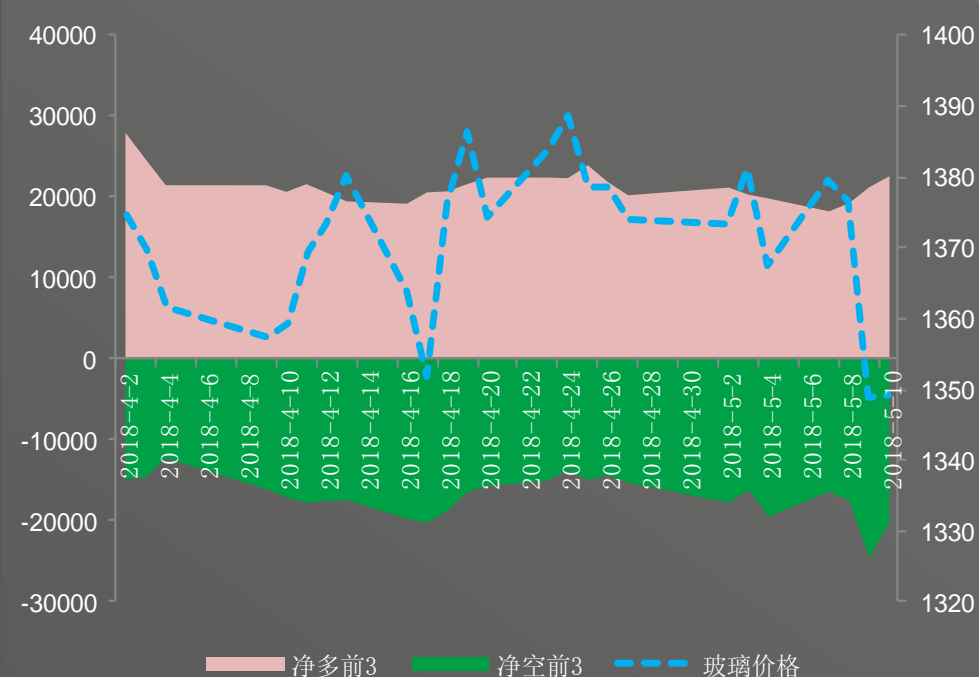
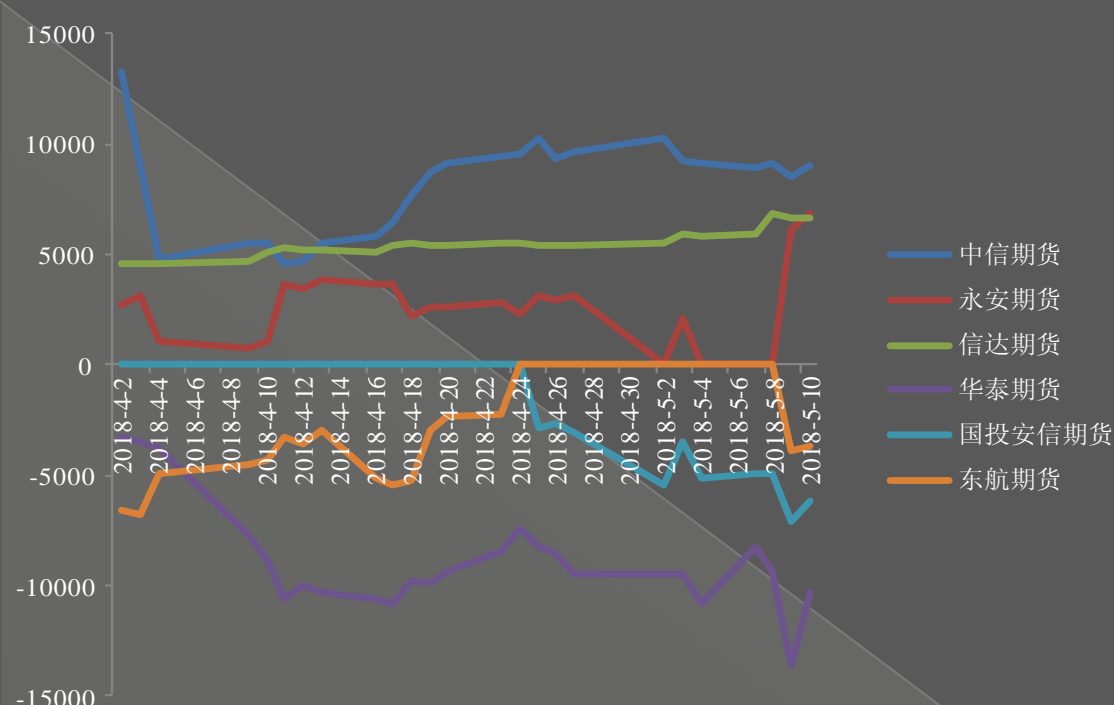
变动幅度		当日	最近5日	平均变化	波动率
ru持仓	多头前3	10.99%	7.58%	1.52%	34.57%
	空头前3	0.21%	-3.90%	-0.78%	
ru涨幅		0.10%	0.88%	0.18%	
震荡幅度	1.76%	1.98%(月均值)	投机度	0.95	0.85(月均值)

化工：沥青



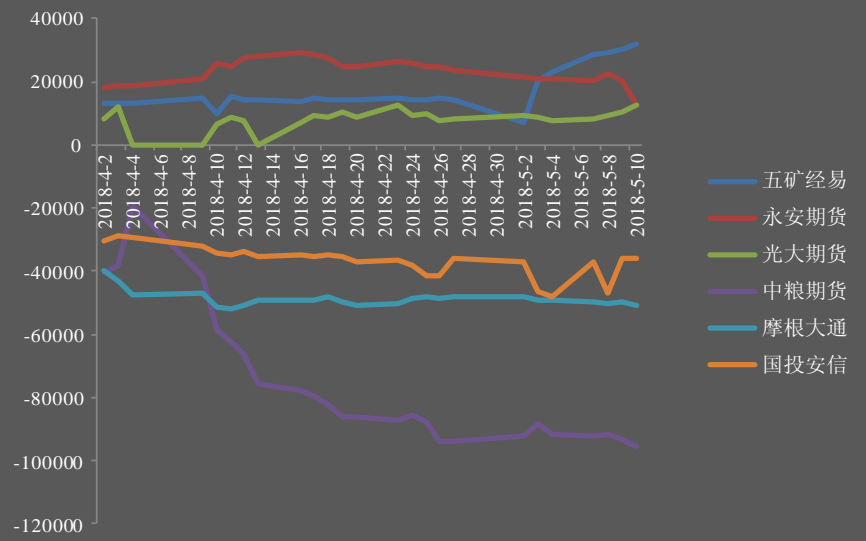
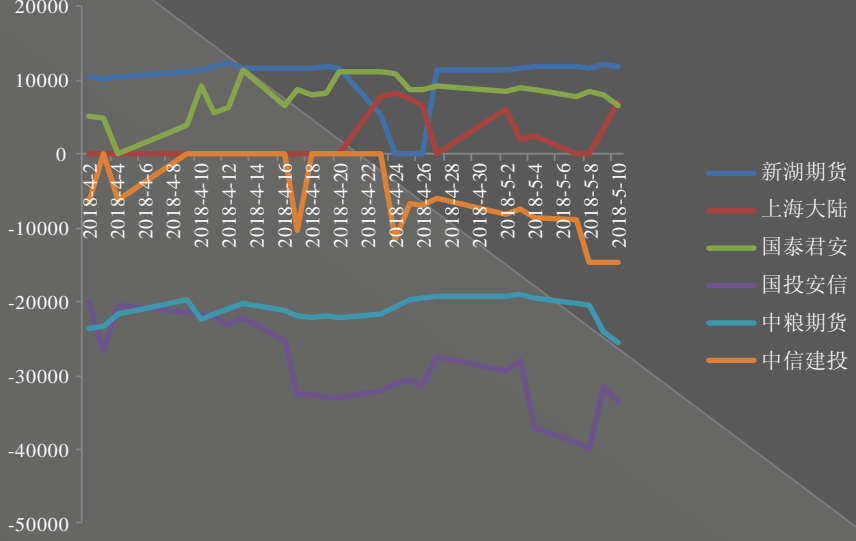
变动幅度		当日	最近5日	平均变化	波动率
bu持仓	多头前3	2.91%	-2.68%	-0.54%	18.66%
	空头前3	2.10%	-25.85%	-5.17%	
bu涨幅		0.43%	2.41%	0.48%	
震荡幅度	0.90%	1.52%(月均值)	投机度	0.81	0.82(月均值)

化工：玻璃



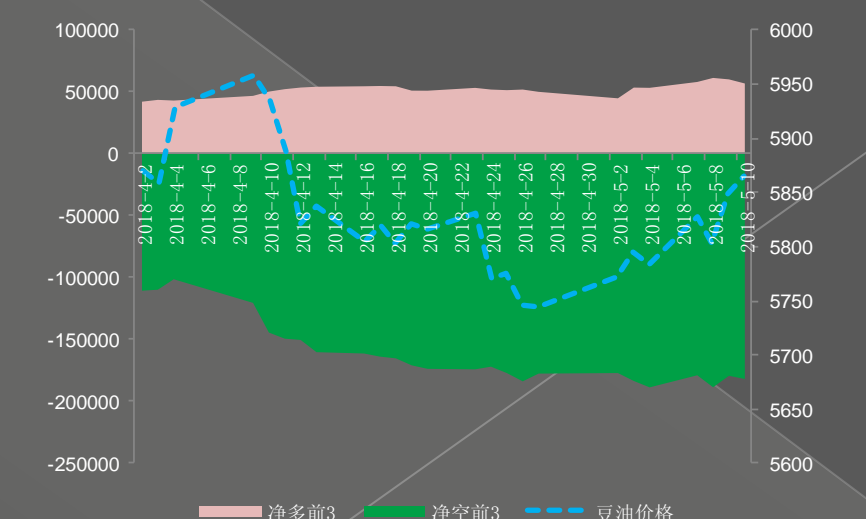
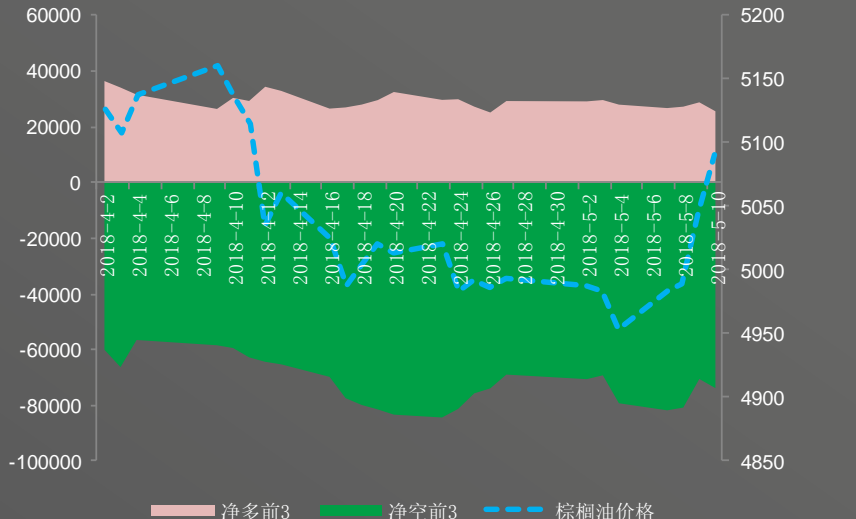
变动幅度		当日	最近5日	平均变化	波动率
fg持仓	多头前3	6.32%	11.21%	2.24%	21.55%
	空头前3	-17.94%	24.55%	4.91%	
fg涨幅		0.02%	-2.32%	-0.46%	
震荡幅度	1.02%	1.36%(月均值)	投机度	0.55	0.55(月均值)

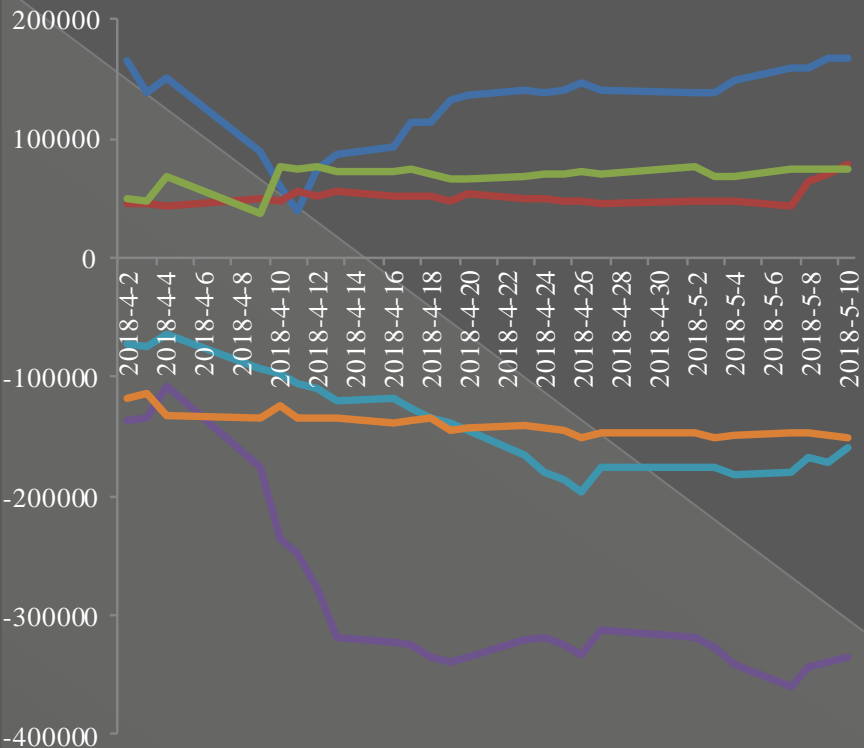
农产品：P & Y



变动幅度		当日	最近5日	平均变化	波动率
p持仓	多头前3	-11.11%	-13.55%	-2.71%	10.93%
	空头前3	4.65%	6.65%	1.33%	
p涨幅		0.90%	2.15%	0.43%	
震荡幅度	1.37%	0.98%(月均值)	投机度	0.53	0.52(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	-5.49%	6.18%	1.24%	14.45%
	空头前3	1.41%	-0.88%	-0.18%	
y涨幅		0.29%	1.20%	0.24%	
震荡幅度	0.58%	1.13%(月均值)	投机度	0.30	0.42(月均值)

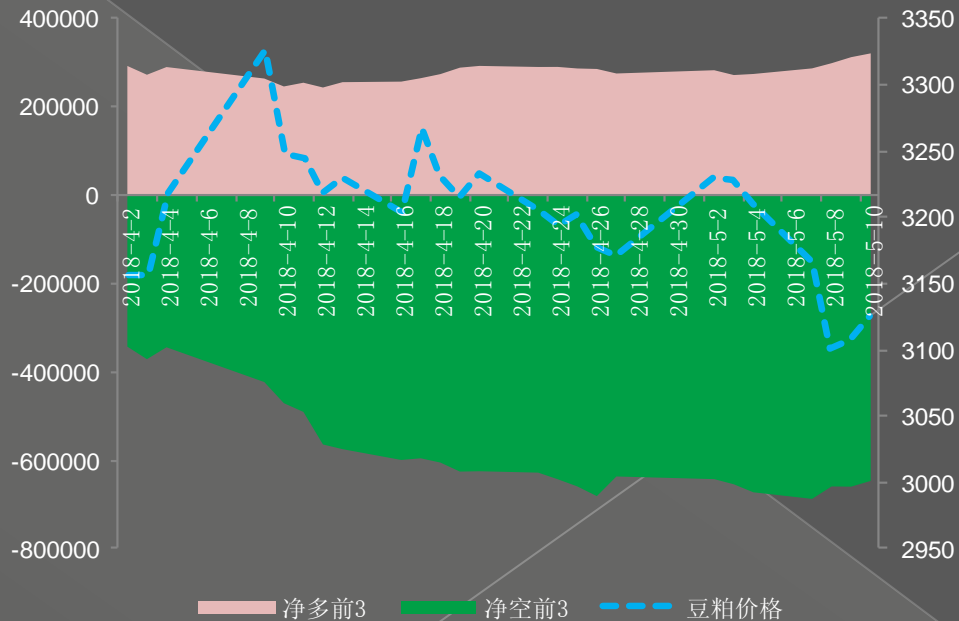




- 永安期货
- 申银万国
- 光大期货
- 中粮期货
- 国投安信
- 摩根大通

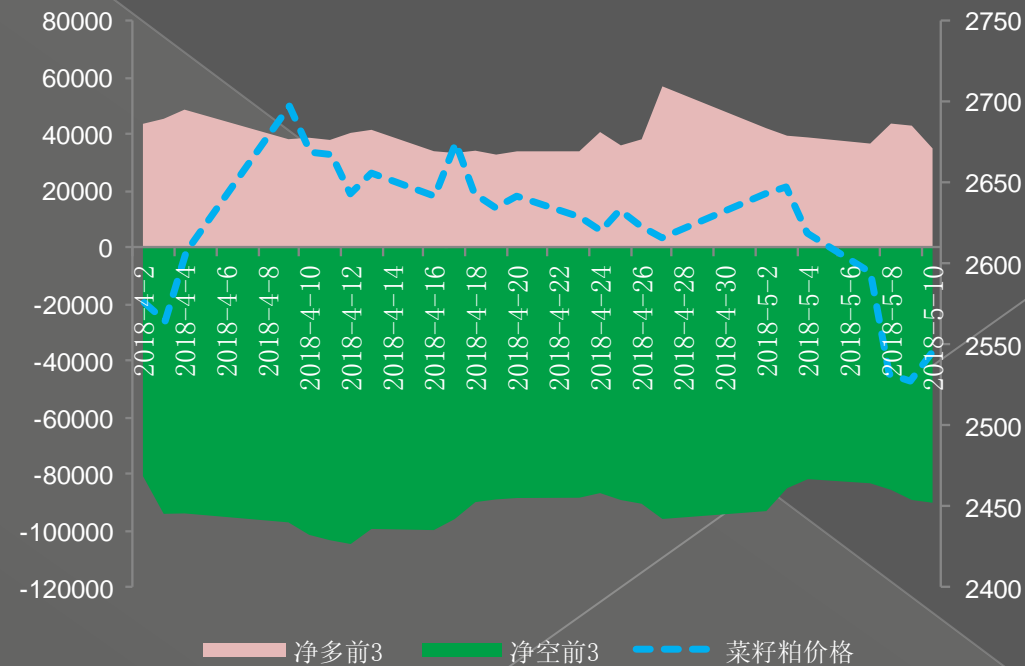
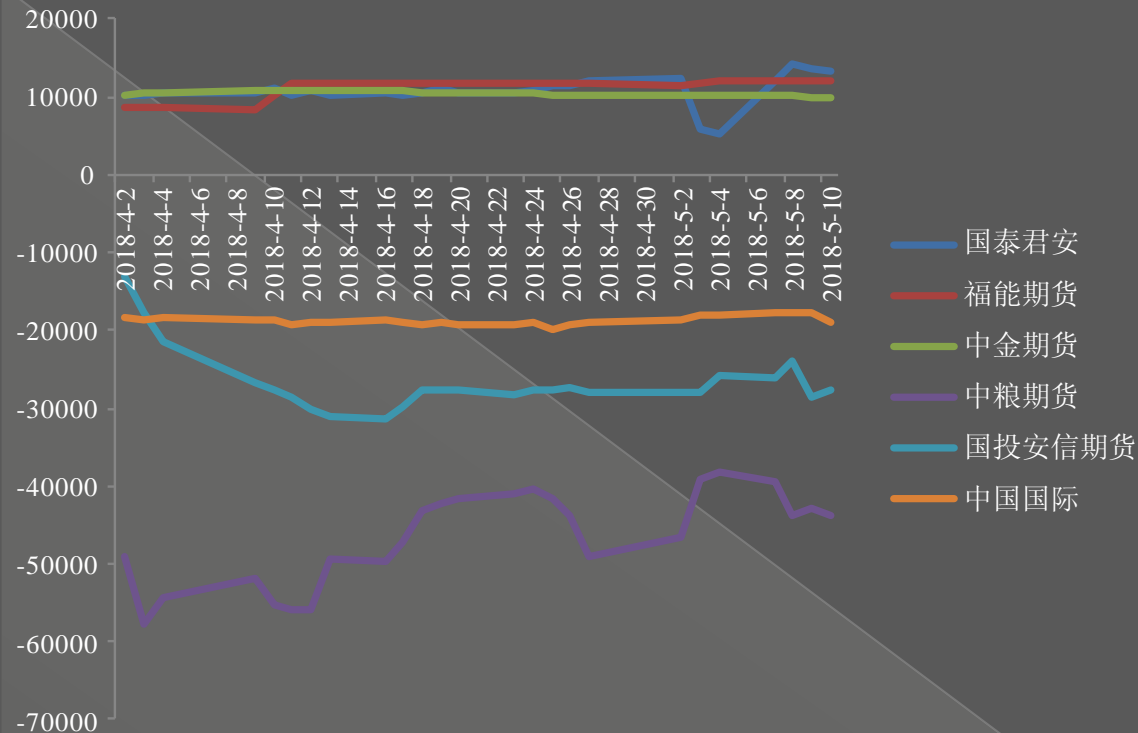
农产品：豆粕

变动幅度		当日	最近5日	平均变化	波动率
m持仓	多头前3	2.74%	17.91%	3.58%	34.31%
	空头前3	-1.99%	-1.18%	-0.24%	
m涨幅		0.56%	-3.20%	-0.64%	
震荡幅度	0.85%	1.82% (月均值)	投机度	0.32	0.64 (月均值)

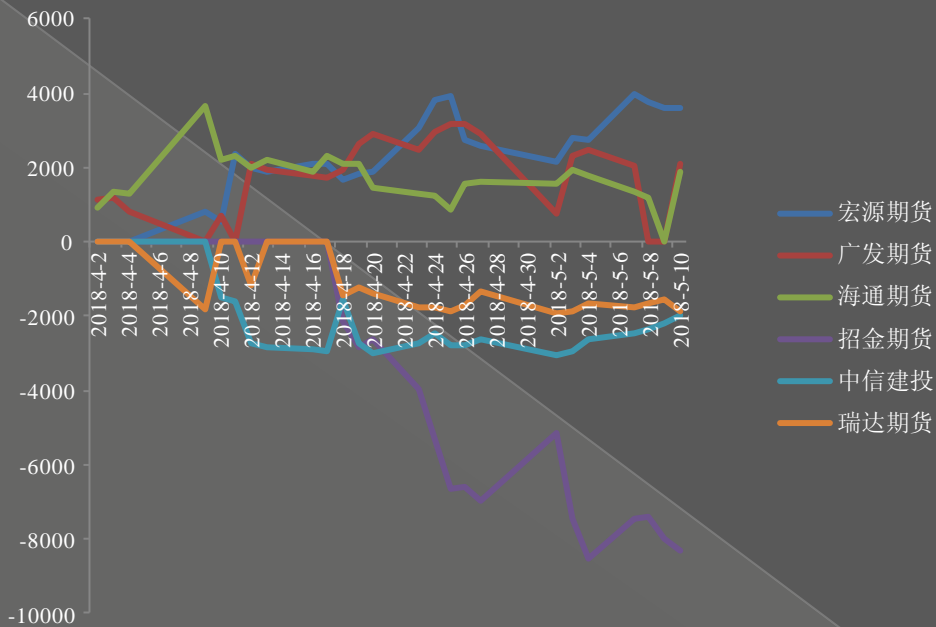


- 净多前3
- 净空前3
- 豆粕价格

农产品：菜粕

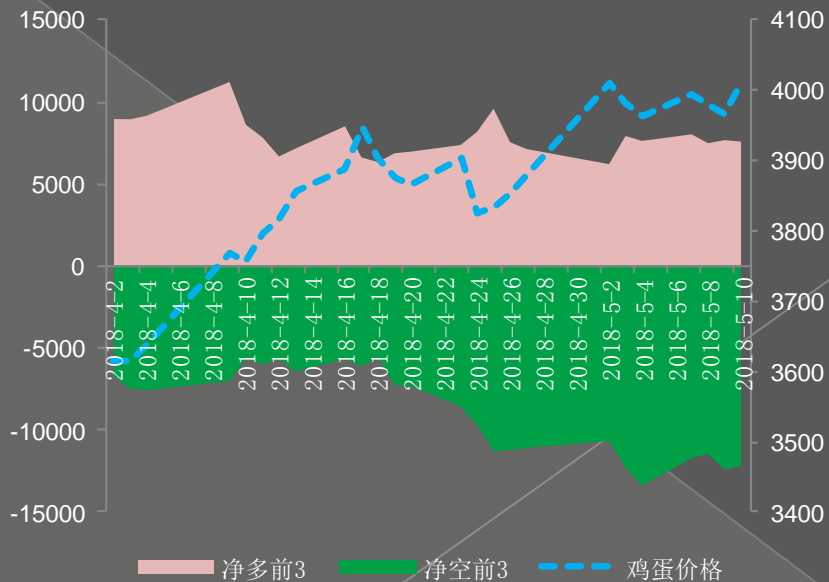


变动幅度		当日	最近5日	平均变化	波动率
rm持仓	多头前3	-18.58%	-11.30%	-2.26%	32.31%
	空头前3	1.10%	6.04%	1.21%	
rm涨幅		0.70%	-3.90%	-0.78%	
震荡幅度	1.07%	1.55%(月均值)	投机度	0.52	0.83(月均值)

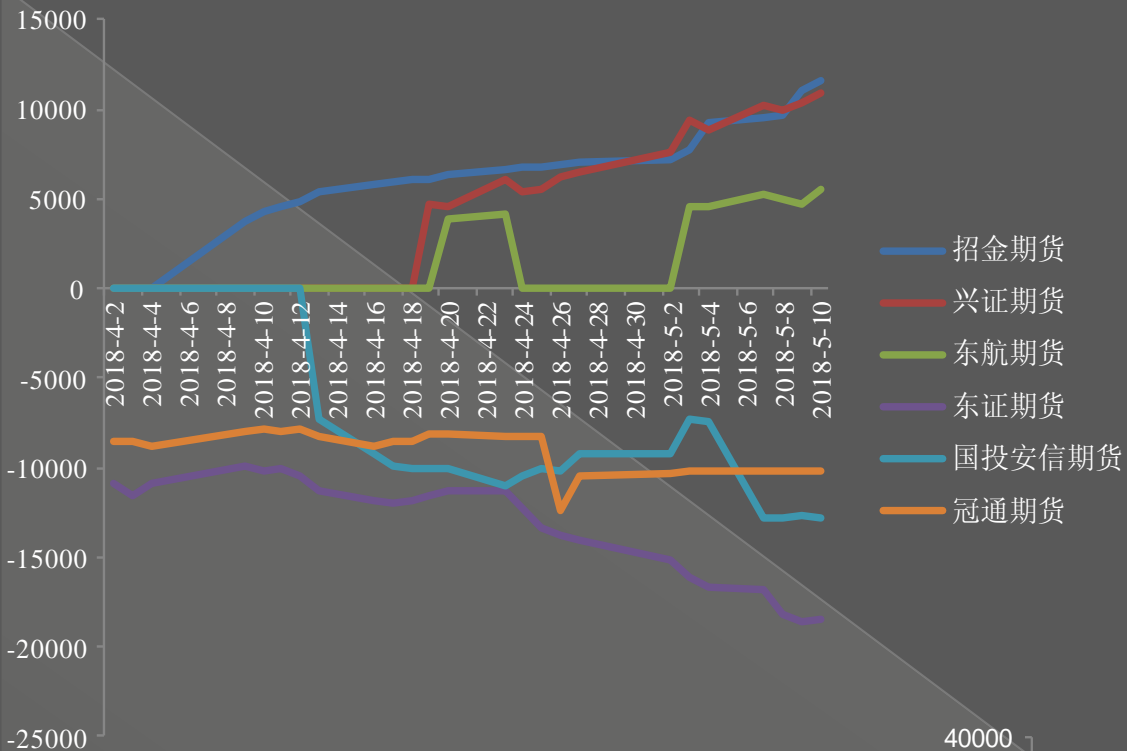


农产品：鸡蛋

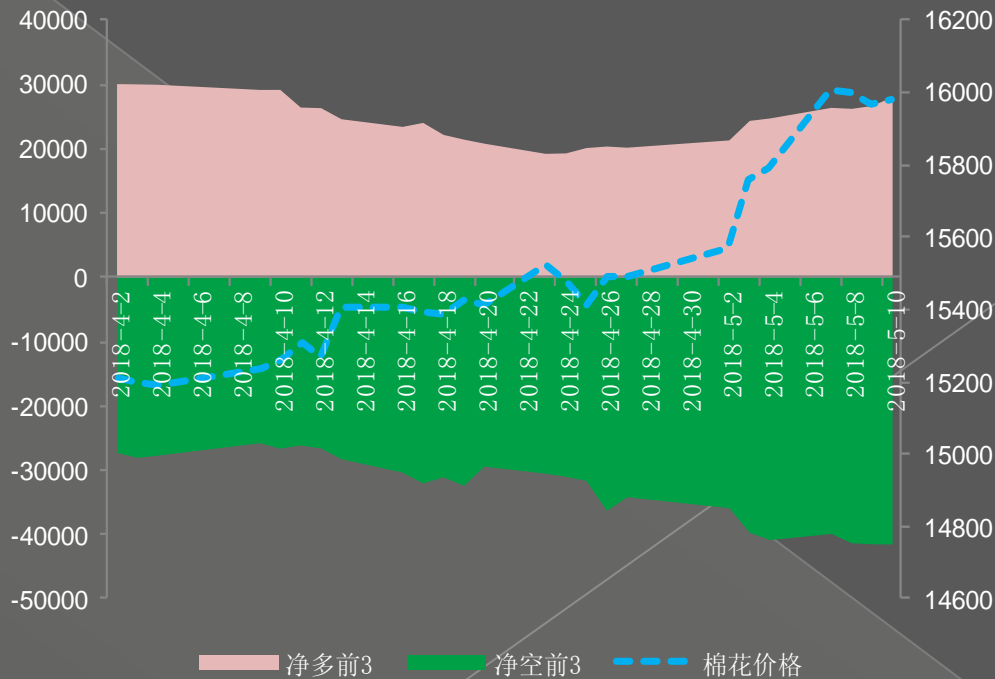
变动幅度		当日	最近5日	平均变化	波动率
jd持仓	多头前3	-1.18%	-4.32%	-0.86%	30.16%
	空头前3	-1.53%	-0.80%	-0.16%	
jd涨幅		1.19%	0.85%	0.17%	
震荡幅度	1.22%	1.67%(月均值)	投机度	0.50	0.73(月均值)



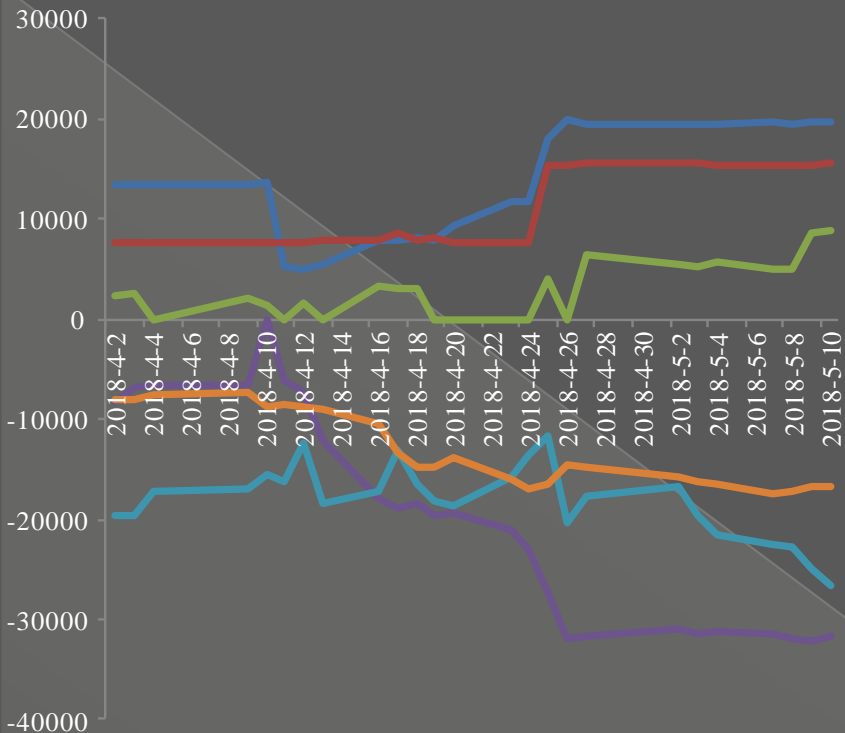
农产品：棉花



变动幅度		当日	最近5日	平均变化	波动率
cf持仓	多头前3	5.17%	15.12%	3.02%	7.51%
	空头前3	0.05%	4.58%	0.92%	
cf涨幅		0.09%	1.41%	0.28%	
震荡幅度	0.67%	0.74%(月均值)	投机度	0.31	0.37(月均值)

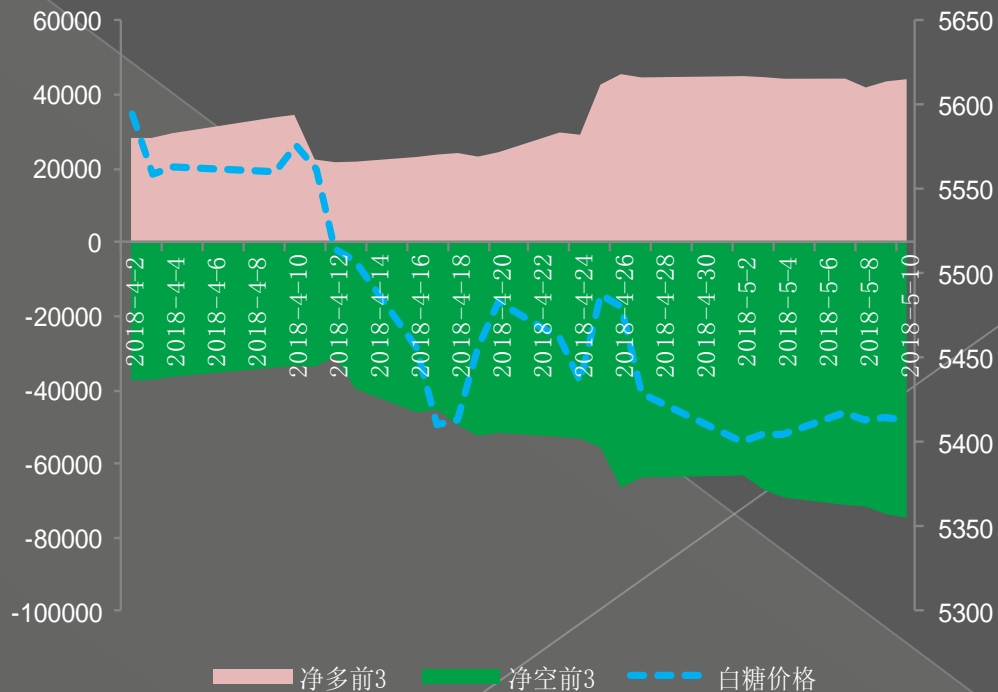


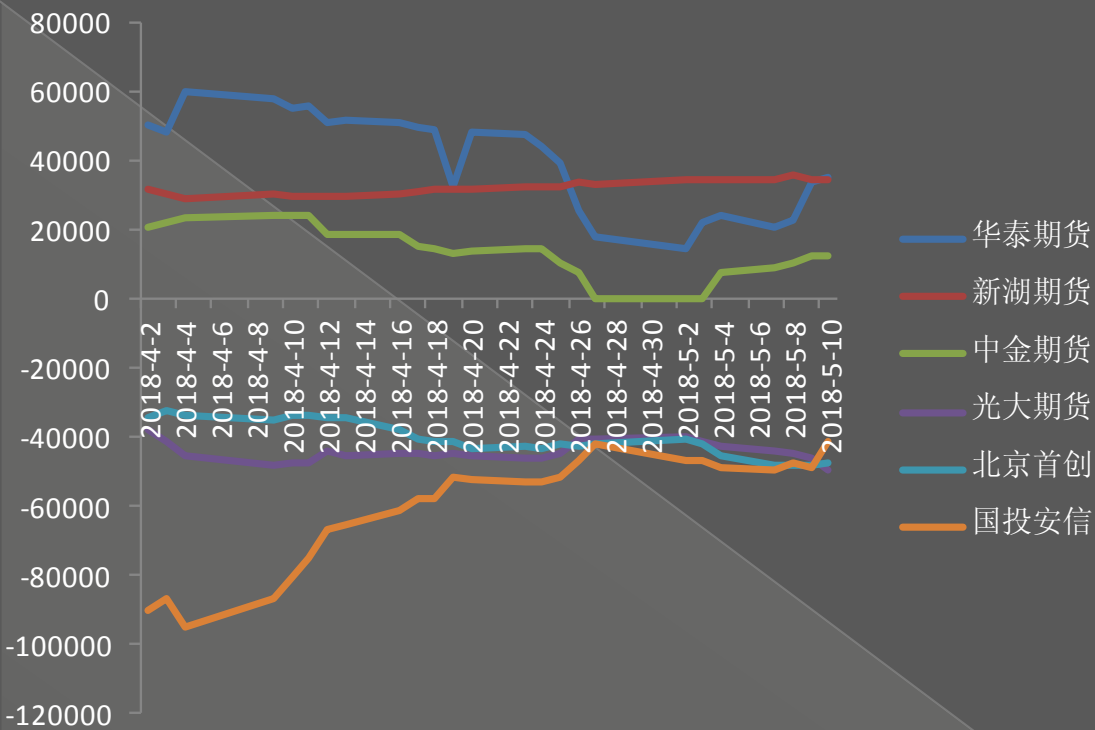
农产品：白糖



- 混沌天成期货
- 一德期货
- 宏源期货
- 永安期货
- 中粮期货
- 中信期货

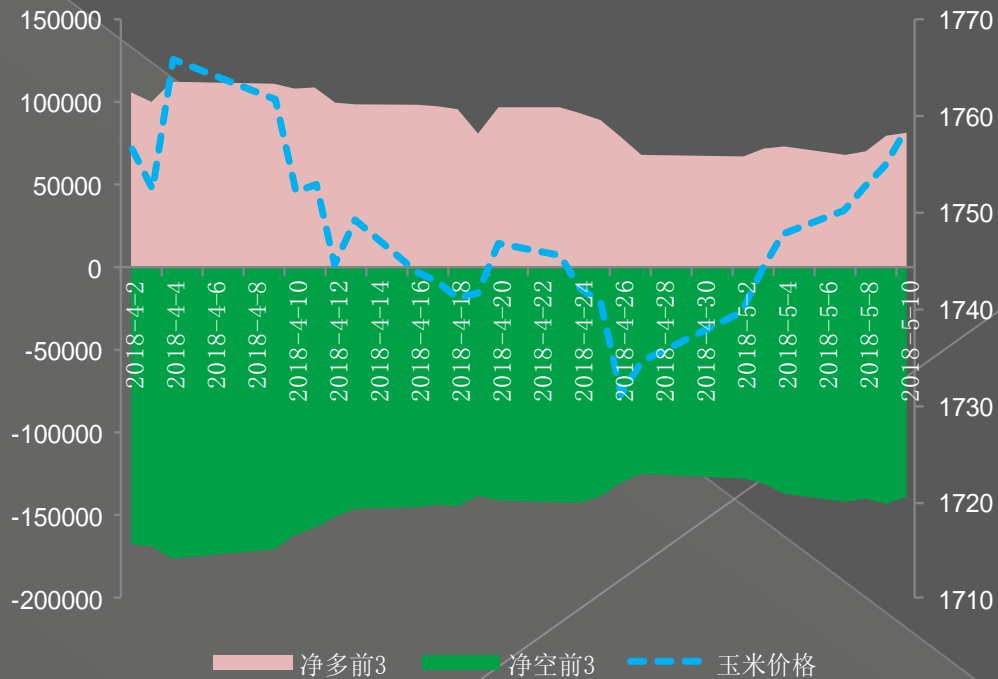
变动幅度		当日	最近5日	平均变化	波动率
sr持仓	多头前3	1.34%	-1.25%	-0.25%	10.65%
	空头前3	1.21%	11.24%	2.25%	
sr涨幅		-0.04%	0.16%	0.03%	
震荡幅度	0.29%	0.84% (月均值)	投机度	0.29	0.42 (月均值)





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	2.23%	13.17%	2.63%	6.56%
	空头前3	-2.97%	6.11%	1.22%	
c涨幅		0.21%	0.83%	0.17%	
震荡幅度	0.47%	0.59%(月均值)	投机度	0.25	0.37(月均值)



部分机构资金变动表

制表日期：2018年5月10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	23968.17	12.41%	36056.45	19.92%
南华期货	-1400.86	-1.56%	-219.82	-0.25%
混沌天成	0.00	--	-4142.14	-100.00%
海通期货	6267.71	5.05%	4327.88	3.43%
上海大陆	1004.93	5.59%	2693.44	16.53%
中信期货	-9713.07	-4.71%	-17289.13	-8.08%
新湖期货	9343.12	16.16%	-5053.00	-7.00%

中粮期货	7827.50	2.57%	44468.05	16.63%
中信建投	2840.43	6.75%	7346.53	19.56%
申银万国	-3918.56	-6.85%	1921.35	3.74%
华泰期货	-11081.37	-20.16%	-29474.24	-40.17%
光大期货	-10500.05	-10.88%	4682.31	5.76%
一德期货	-6393.18	-4.12%	-20332.39	-12.03%
国投期货	1616.54	2.37%	-7405.41	-9.59%
金瑞期货	3810.65	3.19%	13760.28	12.55%
鲁证期货	8563.10	27.32%	14898.17	59.59%
中国国际	-1827.30	-2.61%	14298.98	26.52%

部分机构持仓一览

机构	永安期货					
日期	2018-5-3	2018-5-4	2018-5-7	2018-5-8	2018-5-9	2018-5-10
黄金				2649		2609
白银						
沪铜		3901				
沪铝				1804	2207	2196
沪镍	18772	17513	18354	18971	18085	13867
沪锌	-7651	-10172	-3620			
沪铅	850	1025	1517	1566	1663	2307
螺纹钢	36627	-11349			13913	33101
铁矿石		-17774	-7864	7030	13138	
焦煤	-3124	-4187	2342	2220		-2590
焦炭	-134	3982	9460	10745	5094	6604
豆油	21107	20932	20620	22881	20319	12855
棕榈油						3877
菜籽油	4216	3934	3803	3181	4246	4975
豆粕	138565	149276	159001	160455	167109	168230
菜籽粕	-2405	-5148	-5404	-7065	-6791	-1471
棉花			-6341	-5937		-6836
白糖	-31541	-31293	-31521	-31798	-32157	-31608
玉米	-20595	-11252				-15878
鸡蛋						
PTA	44445	39801	46471	51624	60851	80365
聚乙烯		5271	6045	5538	4363	-3800
聚丙烯	5538	5117	4122		4108	
甲醇	28574	40635	40277	33584	36633	38011
玻璃	2152				6104	6902
橡胶	-19929	-19536	-19859	-20219	-18938	-18966
沥青	-26153	-25824	-22632	-22011	-20985	-21254
动力煤	32139	32814	35710	28466	25570	25301

部分机构持仓一览

机构	南华期货					
日期	2018-5-3	2018-5-4	2018-5-7	2018-5-8	2018-5-9	2018-5-10
黄金			-1078			
白银	8117	7877	4783	8503	8492	
沪铜	4331	4401	4304		5182	5051
沪铝	6130	6124				301
沪镍	-5898	-7268			-8066	-7942
沪锌						
沪铅		-563				
螺纹钢					-8947	-10903
铁矿石	17412	17329	17565	18398	18124	19163
焦煤				2422		
焦炭				1812		
豆油	-9344	-9563	-10035	-10422	-10264	-9550
棕榈油						3730
菜籽油	-7131	-4651	-7737	-7846	-7694	-7932
豆粕	-42175	-42739	-43874	-48570	-46374	-42555
菜籽粕	-7095	-8244	-8238	-8540	-8370	-8555
棉花						
白糖	6713	6861	6822	6927	6771	6753
玉米	-12687	-12068				
鸡蛋						-1781
PTA						
聚乙烯	12016	11364	10445	10134	10274	9780
聚丙烯	-15987	-16879	-16764	-16477	-15837	-16218
甲醇	5706			7441	8133	8690
玻璃					-2357	-2280
橡胶	2157	2132		1883	444	1473
沥青						
动力煤		4291	4695	3905		

部分机构持仓一览

机构	国泰君安					
日期	2018-5-3	2018-5-4	2018-5-7	2018-5-8	2018-5-9	2018-5-10
黄金	7565	7338	6722	6703	6505	6995
白银	-10496	-10903	-10783	-10665	-11395	-15534
沪铜		3956	4051	5612	5649	5266
沪铝						
沪镍	7203	6572	5987	5957	4847	5130
沪锌						
沪铅	-869			1465	1417	1399
螺纹钢	31585	30859	29568	33555		
铁矿石	7630	10550	8700	15511	13058	14454
焦煤	-1076	-535	2112	1482	975	1249
焦炭	1345	1399			-994	-1012
豆油	-10027		-11633		-12664	-12126
棕榈油	9030	8664	7889	8571	7935	6658
菜籽油	27982	28147	27841	31442	31917	31825
豆粕					30400	29968
菜籽粕	5933	5241	12214	14269	13530	13457
棉花						
白糖	-9323	-9500		-9930	-9911	-9920
玉米	-14017	-15733	-14266	-14152	-12694	
鸡蛋						
PTA	20836	21452	21739	23213	23554	24197
聚乙烯	-4906					
聚丙烯				3652		
甲醇	6700	9863	10941	10200	11394	11483
玻璃	-1459	-1857	-1218	-1190	-2537	-2305
橡胶						
沥青	3786		8052	5626	9278	8949
动力煤						-3958

部分机构持仓一览

机构	混沌天成					
日期	2018-5-3	2018-5-4	2018-5-7	2018-5-8	2018-5-9	2018-5-10
黄金						
白银						
沪铜						
沪铝						
沪镍						
沪锌	-3505	-4527				
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	2018-5-3	2018-5-4	2018-5-7	2018-5-8	2018-5-9	2018-5-10
黄金	3669	3973	4114	3862	3734	
白银	7084	7261				
沪铜	-13128	-13211	-12052	-12444	-12461	-13203
沪铝	-12853	-11241	-11384	-4502	-7887	-7931
沪镍	11424	9787	10171	10886	10281	7181
沪锌						-3432
沪铅	3623	3778	6367	6521	6701	6658
螺纹钢	-33493	-33433	-30043	-33878	-49542	-49475
铁矿石	-8346		-6363	-4947	-9489	-9906
焦煤		1263	3321		-740	1050
焦炭	581	1803	1398	1714	1585	2283
豆油						
棕榈油			2842	3906	4127	4117
菜籽油	-5365	-5548	-5576	-5485		-6551
豆粕	52064	51569	34805	36626	35851	33740
菜籽粕	7237	5812	3521	4550	3383	
棉花						5052
白糖						
玉米			-12927	-12695	-12667	
鸡蛋	1942	1779	1358	1175		1910
PTA			22465	21904	19945	21373
聚乙烯	5032	4491	4613			4873
聚丙烯	14933	17130	16295	16412	16649	10756
甲醇	4661	8326	7380	8012	7048	6029
玻璃	1475	2268	1624		2150	1592
橡胶						
沥青					3705	4759
动力煤			4568		3419	3352

部分机构持仓一览

机构	上海大陆					
日期	2018-5-3	2018-5-4	2018-5-7	2018-5-8	2018-5-9	2018-5-10
黄金						
白银						
沪铜	5958	5892	5923	5768	6007	6001
沪铝						
沪镍						
沪锌						
沪铅						
螺纹钢						
铁矿石						
焦煤						
焦炭						
豆油						
棕榈油	1983	2504			3499	7083
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		-2880	-2912	-2853	-2780	
动力煤						

部分机构持仓一览

机构	中粮期货					
日期	2018-5-3	2018-5-4	2018-5-7	2018-5-8	2018-5-9	2018-5-10
黄金						
白银	7601		6634	7082	7070	7385
沪铜	-8044	-8551	-8234	-8812	-9093	-9343
沪铝	-11313	-13052	-14118	-14455	-14227	-15123
沪镍	-7161	-7029	-7969	-11861	-9316	-10361
沪锌	8549	11928	11327	11440	11437	11510
沪铅						
螺纹钢						
铁矿石						
焦煤	2270		4886	4460	4286	4417
焦炭						
豆油	-88181	-91519	-92357	-91816	-93437	-95261
棕榈油	-19087	-19366	-20213	-20315	-24011	-25568
菜籽油	-18739	-18375	-18420	-18586	-19653	-19883
豆粕	-327436	-340201	-359303	-343239	-338941	-335271
菜籽粕	-39155	-38047	-39437	-43842	-42927	-43649
棉花			-7386	-7609	-7573	-7905
白糖	-19545	-21648	-22454	-22729	-24895	-26553
玉米	-18478	-18191	-17594	-18600	-19102	-26789
鸡蛋						
PTA	14316	14221	22377	22600	22531	20882
聚乙烯						
聚丙烯						
甲醇						
玻璃						
橡胶	-7008	-6835	-7134	-7903	-7239	-7852
沥青						
动力煤	-4738	-5489	-5197	-4928	-4547	-4552

部分机构持仓一览

机构	中信期货					
日期	2018-5-3	2018-5-4	2018-5-7	2018-5-8	2018-5-9	2018-5-10
黄金	12144	13162	12727	12879	12936	13520
白银	-29658	-29258	-28789	-28799	-31855	-32518
沪铜	-13689	-13093	-14252	-14378	-14999	-14138
沪铝						861
沪镍	-9674	-12403	-11940	-11492	-12452	-13570
沪锌	12265	11563	13364	14630	13390	14355
沪铅	1038	661				-1384
螺纹钢	-26184	-19909	-11346			
铁矿石	-13714					
焦煤	5607	6362	4785	4627	3851	5041
焦炭		-303	-564	-1325	-1301	-1239
豆油	-13067	-10819	-10434	-13198	-10804	
棕榈油	-22056	-22542	-22302	-20306	-14054	-8967
菜籽油	-16759	-14133	-13521	-13686	-13305	-14156
豆粕	62378	57839	48444	50060	52694	48748
菜籽粕	7722	6761	5943	4683	3688	7454
棉花						
白糖	-16132	-16389	-17373	-17275	-16827	-16609
玉米						
鸡蛋					1446	1376
PTA	22629	31027	32805	34590	32819	32507
聚乙烯	-7961	-7122	-7181	-7848	-7629	-5984
聚丙烯	6956	6894	6693	7028	7866	8154
甲醇	7014	9884	8172	8654	8611	8510
玻璃	9277	9157	8991	9147	8521	9088
橡胶			-3157		-3701	
沥青	4954	4034	4434	5426	5540	5191
动力煤						1489

部分机构持仓一览

机构	中信建投					
日期	2018-5-3	2018-5-4	2018-5-7	2018-5-8	2018-5-9	2018-5-10
黄金						
白银						
沪铜						
沪铝						
沪镍						
沪锌						
沪铅						
螺纹钢						
铁矿石	18305	21171	21591	33729	33833	33541
焦煤					2401	
焦炭						
豆油						
棕榈油	-7503	-8616	-8837	-14555	-14625	-14551
菜籽油						4017
豆粕	65674	59121	55613			
菜籽粕						
棉花			5875	5340	5066	4870
白糖						
玉米	9819	7223	8822	7760	7917	10086
鸡蛋	-2948	-2600	-2434	-2371	-2177	-1980
PTA						
聚乙烯			3536	3979		
聚丙烯						
甲醇						6642
玻璃						
橡胶			4750	4816	4693	4865
沥青	-3669	-3647	-3341	-3346	-3546	-3602
动力煤						

部分机构持仓一览

机构	新湖期货					
日期	2018-5-3	2018-5-4	2018-5-7	2018-5-8	2018-5-9	2018-5-10
黄金	-770	-814	-1082	-1073	-854	-839
白银						
沪铜						
沪铝						
沪镍	4041					
沪锌						
沪铅						
螺纹钢	21624			17923		22683
铁矿石						
焦煤						
焦炭						
豆油						
棕榈油	11610	11879	11831	11753	12180	11843
菜籽油			-4596	-5668	-5671	
豆粕	-96637	-96348	-96362	-96545	-96788	-97075
菜籽粕						
棉花						
白糖						
玉米	34577	34440	34383	35806	34726	34741
鸡蛋	1537	1600	1597	1398	1415	1614
PTA	-17047	-14936	-15342	-15710		-16463
聚乙烯						
聚丙烯	3210	3433	3209			
甲醇						
玻璃						
橡胶	-6102	-6132	-6136	-6017	-6018	-6076
沥青	-2823	-5139			-5481	-5207
动力煤				3731	3516	

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

