



市场持仓分析

2018/5/11

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
焦炭	19.88%	24.53%	21.27%	-6.50%	4.12%	6.07%	26.38%	☆☆☆☆
沪银	18.80%	11.00%	9.98%	-5.30%	-4.04%	-4.23%	24.10%	☆☆☆☆
动力煤	6.18%	8.38%	14.18%	-13.26%	-7.91%	-0.96%	19.44%	☆☆☆
菜籽粕	13.80%	3.62%	-3.78%	-1.58%	-0.76%	1.11%	15.38%	☆☆☆
沪金	2.08%	3.52%	3.09%	-6.11%	-1.23%	11.86%	8.19%	☆☆
玻璃	1.81%	4.44%	-6.82%	-5.69%	-6.42%	-3.54%	7.50%	☆☆
沥青	1.79%	0.24%	0.73%	-3.67%	-5.32%	-5.21%	5.46%	☆☆
鸡蛋	1.67%	0.11%	-1.65%	-3.54%	-2.46%	-2.39%	5.21%	☆☆
沪锌	-1.80%	1.85%	6.30%	-6.12%	-2.67%	0.04%	4.32%	☆
棕榈油	12.25%	22.26%	20.44%	8.06%	5.79%	-0.29%	4.19%	☆
PTA	19.50%	17.09%	11.85%	15.40%	12.52%	12.06%	4.10%	☆
甲醇	-2.49%	2.30%	10.08%	-3.99%	-3.64%	3.14%	1.50%	☆
聚乙烯	-3.09%	-2.43%	-4.88%	-4.13%	1.56%	2.10%	1.04%	☆
螺纹钢	-7.79%	-9.55%	-8.20%	-8.19%	-7.12%	-4.71%	0.40%	☆
棉花	7.99%	8.72%	6.92%	7.84%	2.79%	2.33%	0.14%	☆
豆油	2.78%	4.90%	8.94%	2.65%	2.02%	2.01%	0.13%	☆
沪铜	-2.34%	0.53%	-6.56%	-1.48%	-6.96%	-9.93%	-0.85%	☆
玉米	-1.32%	-2.01%	-1.37%	-0.21%	3.36%	3.74%	-1.11%	☆
橡胶	2.09%	0.86%	1.58%	4.10%	2.94%	1.58%	-2.02%	☆
沪铝	-0.88%	2.43%	14.22%	3.14%	5.50%	8.22%	-4.01%	☆
白糖	-0.05%	-1.26%	-2.49%	5.27%	4.18%	3.29%	-5.32%	☆☆
豆粕	-4.84%	-3.78%	-5.34%	1.62%	0.89%	0.22%	-6.45%	☆☆
聚丙烯	-7.59%	-6.16%	-2.97%	7.67%	7.64%	2.63%	-15.26%	☆☆☆
沪镍	-0.89%	-0.54%	2.55%	14.86%	14.00%	5.93%	-15.75%	☆☆☆
铁矿石	-21.23%	-32.72%	-34.78%	2.40%	-1.15%	-16.98%	-23.63%	☆☆☆☆
焦煤	11.00%	10.58%	12.43%	44.63%	37.18%	24.42%	-33.63%	☆☆☆☆

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	80.52%	72.89%	67.83%	26.57%	21.65%	31.67%	53.95%	☆☆☆☆
沪锌	-3.09%	1.34%	5.98%	-27.08%	-18.52%	-13.51%	24.00%	☆☆
沪铝	7.16%	6.07%	-1.09%	-12.79%	-6.34%	-5.44%	19.95%	☆☆
沥青	-9.05%	-11.22%	-8.34%	-27.28%	-22.75%	-16.06%	18.23%	☆☆
玻璃	15.91%	31.65%	14.37%	-2.28%	-5.63%	-5.83%	18.19%	☆☆
PTA	77.51%	66.33%	57.06%	60.27%	50.63%	38.85%	17.24%	☆☆
焦煤	60.54%	45.28%	30.46%	43.88%	35.99%	42.91%	16.66%	☆☆
动力煤	-18.46%	-20.23%	-18.25%	-33.07%	-31.73%	-24.12%	14.61%	☆☆
豆粕	11.23%	6.67%	-4.87%	-2.30%	-6.96%	-6.81%	13.52%	☆☆
鸡蛋	1.08%	-3.03%	-6.01%	-12.07%	-9.58%	-7.78%	13.15%	☆☆
棉花	22.41%	13.51%	12.43%	9.63%	9.15%	17.46%	12.79%	☆☆
豆油	9.53%	12.55%	11.98%	-1.05%	-0.62%	-0.40%	10.58%	☆☆
玉米	9.76%	4.21%	7.88%	1.11%	8.73%	8.70%	8.66%	☆
沪金	2.19%	1.02%	-1.60%	-2.56%	-4.49%	-7.42%	4.75%	☆
沪银	14.81%	5.76%	3.64%	10.55%	4.60%	3.46%	4.26%	☆
棕榈油	2.70%	4.35%	2.40%	0.63%	-1.11%	-10.86%	2.07%	☆
橡胶	6.89%	2.39%	-0.63%	5.30%	2.56%	4.11%	1.59%	☆
沪铜	-0.22%	3.74%	-2.57%	2.23%	-3.32%	-9.44%	-2.45%	☆
甲醇	-3.00%	0.58%	5.67%	1.04%	0.65%	-0.98%	-4.05%	☆
菜籽粕	2.53%	2.22%	-1.20%	8.48%	7.07%	-1.66%	-5.96%	☆
螺纹钢	8.65%	4.11%	8.94%	20.36%	15.95%	17.35%	-11.71%	☆☆
白糖	-0.33%	-1.32%	-1.93%	13.53%	10.79%	6.88%	-13.86%	☆☆
聚乙烯	-11.80%	-9.29%	-12.24%	2.36%	5.31%	1.94%	-14.16%	☆☆
铁矿石	6.53%	-17.35%	-38.26%	23.15%	8.89%	-17.35%	-16.61%	☆☆
沪镍	-16.67%	-15.92%	-13.96%	14.12%	18.38%	12.56%	-30.79%	☆☆☆
聚丙烯	-35.58%	-23.32%	-11.22%	11.14%	10.76%	8.91%	-46.73%	☆☆☆

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11日机构持仓异动表

金属

金属	
方正中期	白银净多单变动幅度为：-3407手
华泰期货	白银净多单变动幅度为：10353手
平安期货	白银净多单变动幅度为：2994手
南华期货	沪镍净空单变动幅度为：7171手
永安期货	沪铅净多单变动幅度为：886手
中信期货	沪铅净空单变动幅度为：2525手

黑色

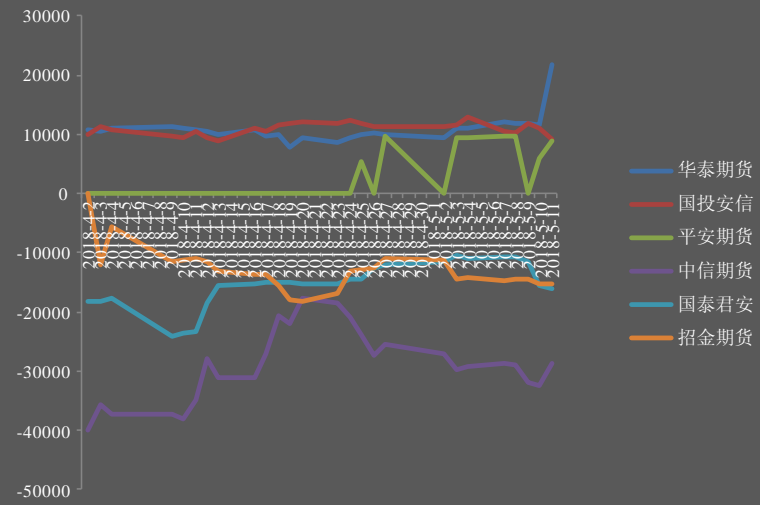
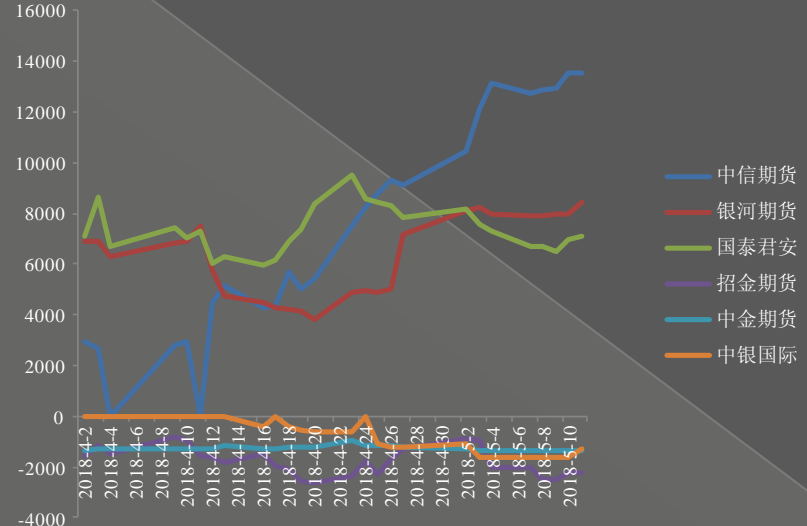
黑色	
东海期货	螺纹钢净多单变动幅度为：-20757手
永安期货	螺纹钢净多单变动幅度为：-11774手
广发期货	铁矿石净多单变动幅度为：-23683手
中粮期货	焦煤净多单变动幅度为：-1821手
方正中期	焦煤净多单变动幅度为：3081手
兴证期货	焦煤净多单变动幅度为：1083手
永安期货	焦煤净空单变动幅度为：6260手
中辉期货	焦煤净空单变动幅度为：3520手
海通期货	焦炭净多单变动幅度为：1837手
大地期货	焦炭净空单变动幅度为：2524手
中电投先融	动力煤净空单变动幅度为：7777手

2018年5月11日机构持仓异动表

农产品	
申银万国	豆油净多单变动幅度为：8678手
永安期货	棕榈油净多单变动幅度为：4173手
永安期货	菜籽油净多单变动幅度为：2104手
申银万国	豆粕净多单变动幅度为：-21978手
海通期货	鸡蛋净多单变动幅度为：-1910手
瑞达期货	鸡蛋净空单变动幅度为：-1881手
中辉期货	鸡蛋净多单变动幅度为：2014手
东证期货	鸡蛋净空单变动幅度为：1820手

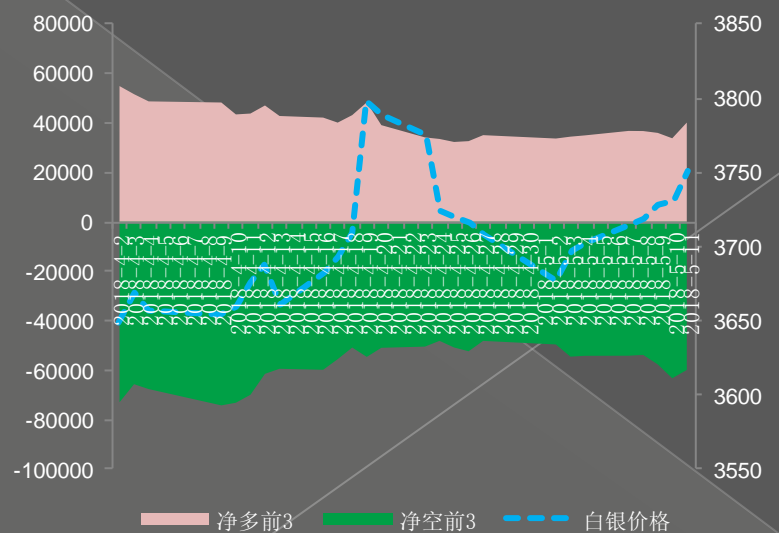
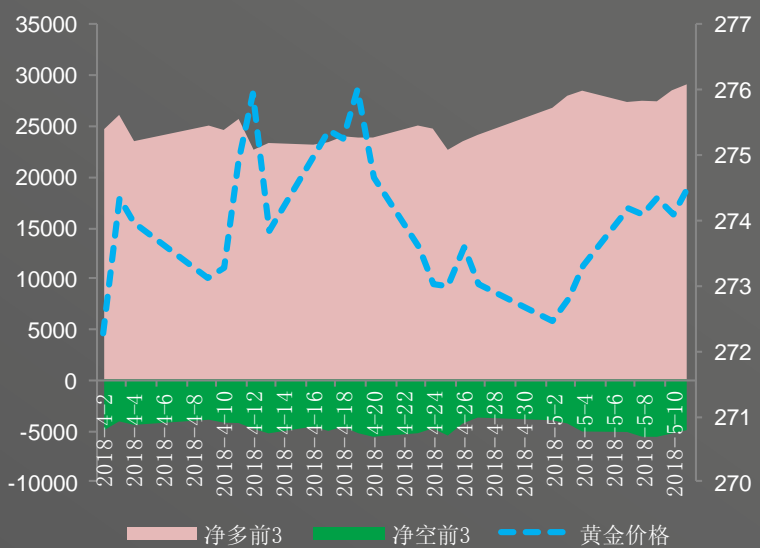
化工	
建信期货	PTA净空单变动幅度为：16643手
浙商期货	聚丙烯净空单变动幅度为：2588手
华泰期货	甲醇净多单变动幅度为：14837手
海通期货	甲醇净多单变动幅度为：5155手
弘业期货	玻璃净空单变动幅度为：1462手
国泰君安	沥青净多单变动幅度为：-3575手

金属板块：AU & AG

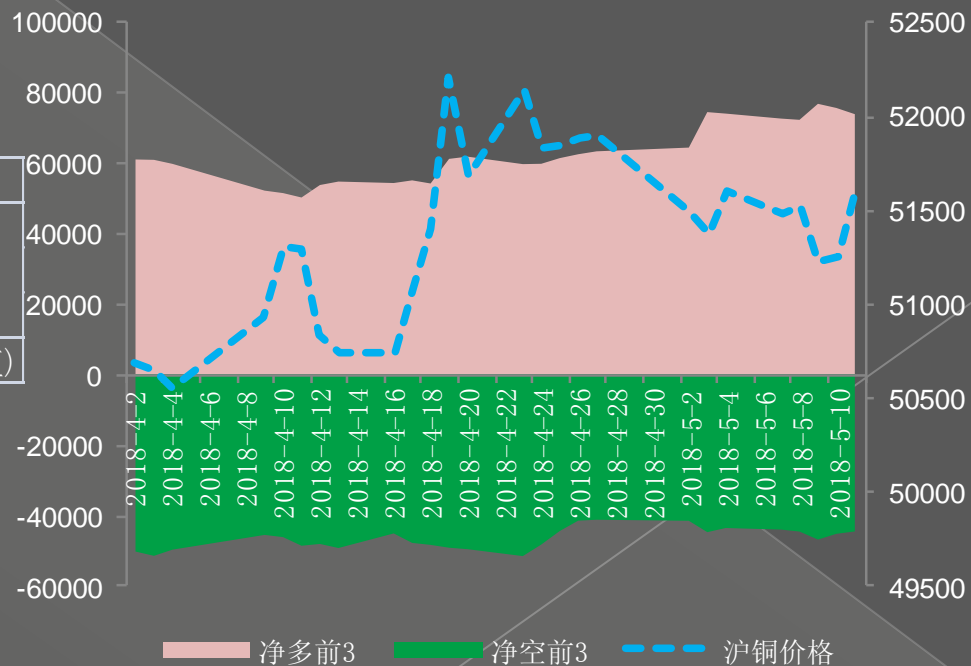
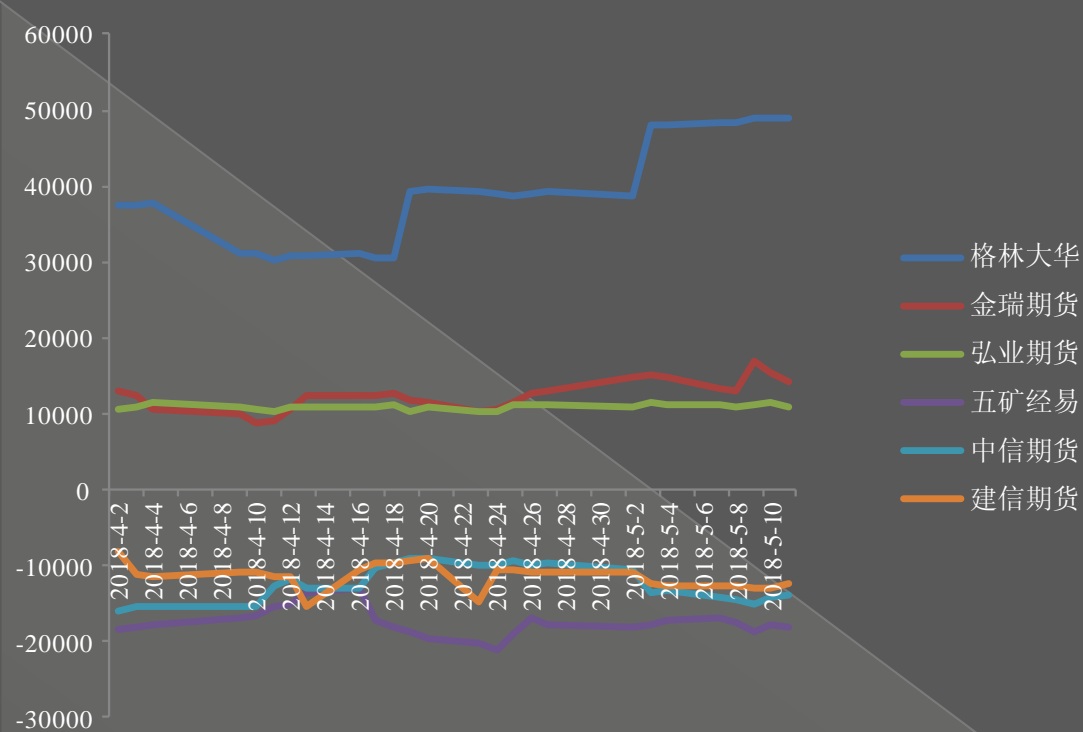


变动幅度		当日	最近5日	平均变化	波动率
au持仓	多头前3	2.08%	2.19%	0.44%	6.25%
	空头前3	-6.11%	-2.56%	-0.51%	
au涨幅		0.15%	0.43%	0.09%	
震荡幅度	0.37%	0.47%(月均值)	投机度	0.32	0.44(月均值)

变动幅度		当日	最近5日	平均变化	波动率
ag持仓	多头前3	18.80%	14.81%	2.96%	12.34%
	空头前3	-5.30%	10.55%	2.11%	
ag涨幅		0.52%	1.30%	0.26%	
震荡幅度	0.37%	0.66%(月均值)	投机度	0.46	0.45(月均值)



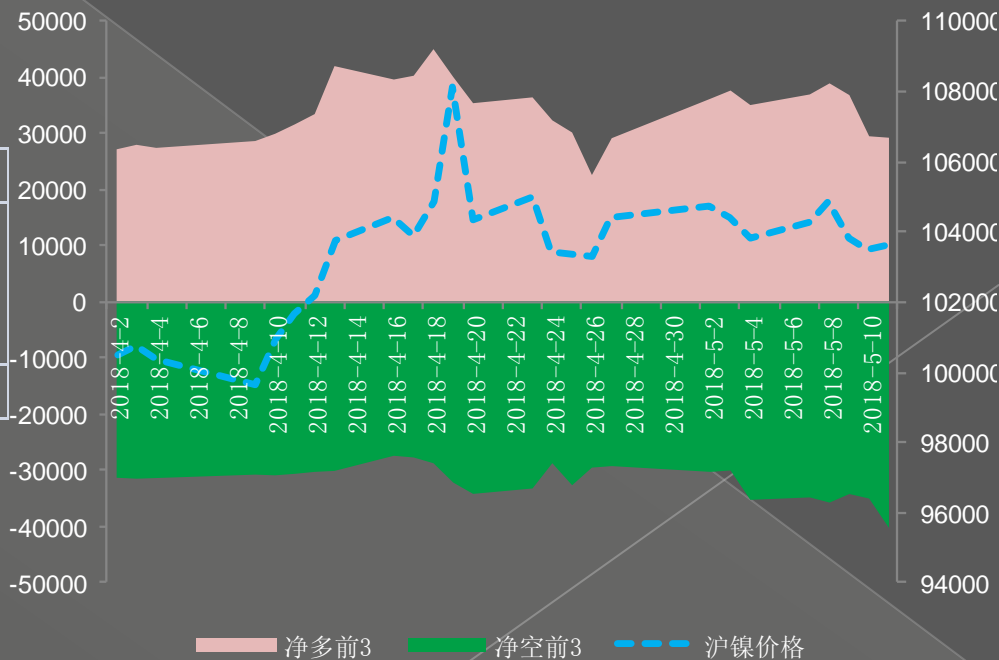
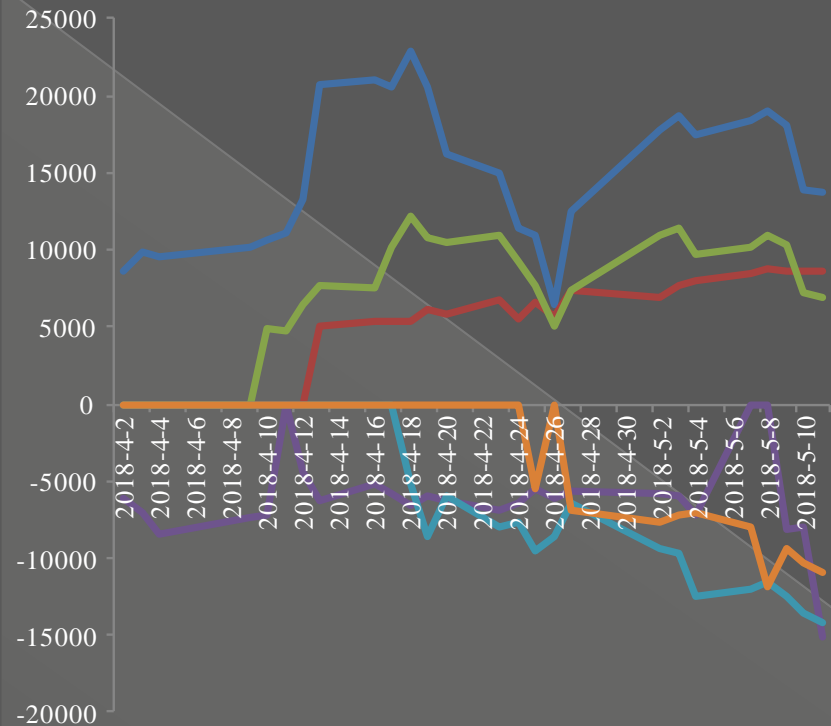
金属板块：Cu



变动幅度		当日	最近5日	平均变化	波动率
cu持仓	多头前3	-2.34%	-0.22%	-0.04%	12.61%
	空头前3	-1.48%	2.23%	0.45%	
cu涨幅		0.70%	0.02%	0.00%	
震荡幅度	0.57%	1.05%(月均值)	投机度	0.48	0.49(月均值)

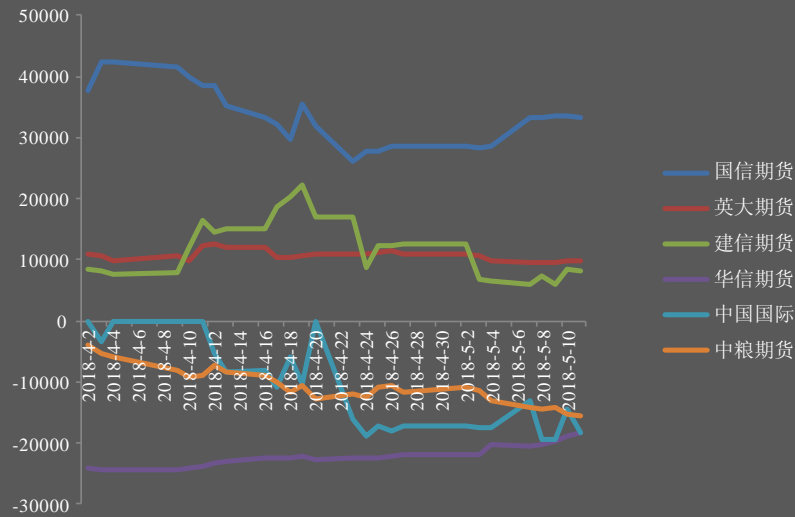
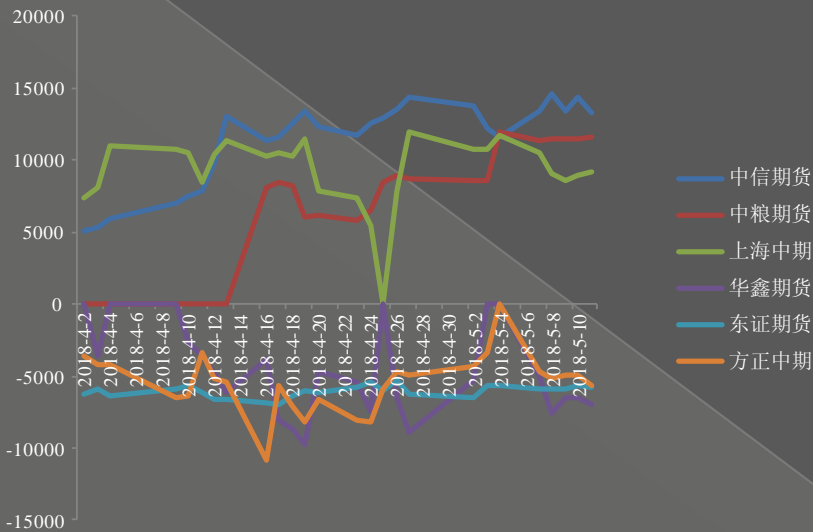
金属板块：Ni

- 永安期货
- 首创期货
- 海通期货
- 南华期货
- 中信期货
- 中粮期货



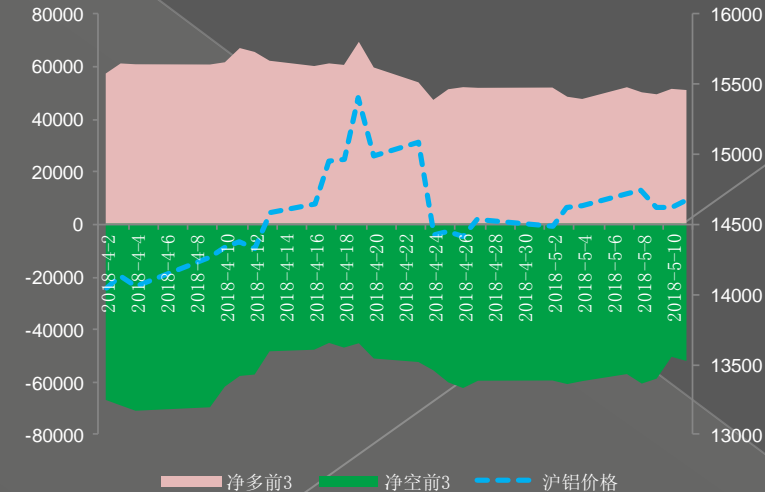
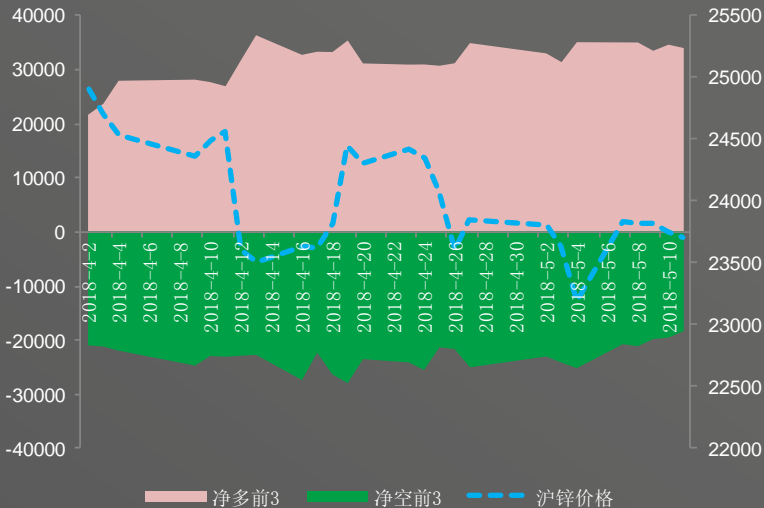
变动幅度		当日	最近5日	平均变化	波动率
ni持仓	多头前3	-0.89%	-16.67%	-3.33%	20.53%
	空头前3	14.86%	14.12%	2.82%	
ni涨幅		0.11%	-0.19%	-0.04%	
震荡幅度	0.79%	1.86%(月均值)	投机度	0.98	1.73(月均值)

金属板块：Zn & Al

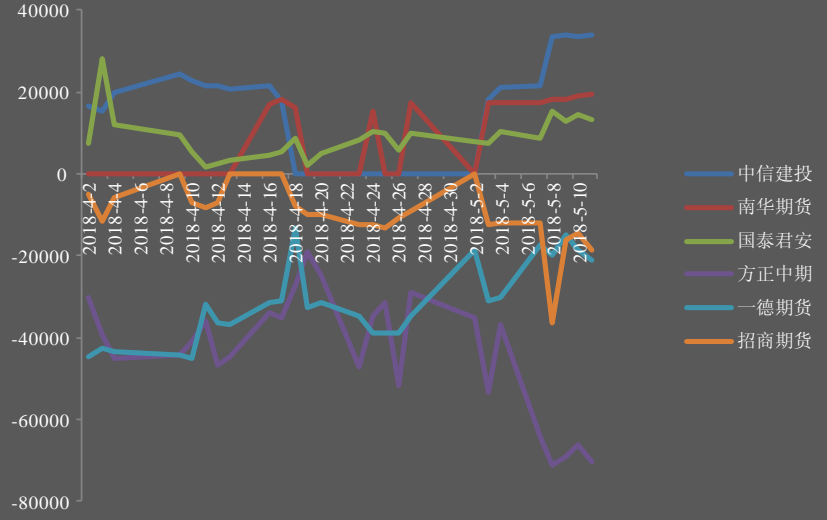
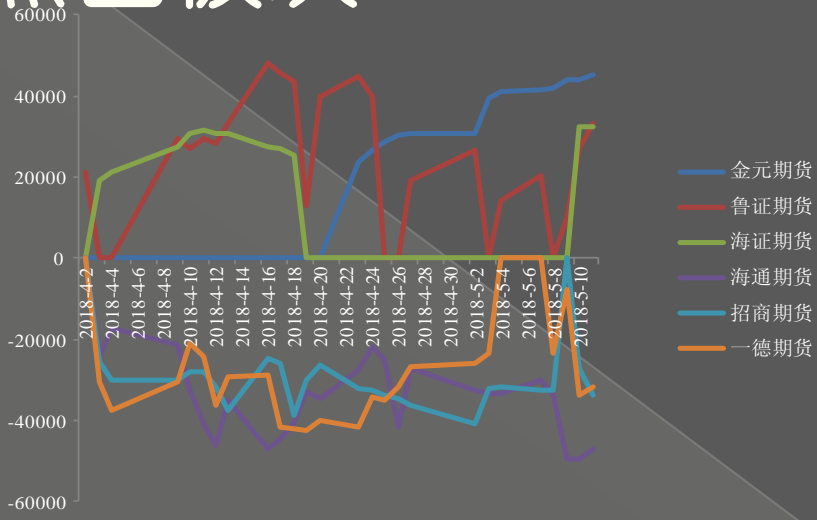


变动幅度		当日	最近5日	平均变化	波动率
zn持仓	多头前3	-1.80%	-3.09%	-0.62%	21.85%
	空头前3	-6.12%	-27.08%	-5.42%	
zn涨幅		-0.17%	2.19%	0.44%	
震荡幅度	1.20%	1.77% (月均值)	投机度	1.01	1.28 (月均值)

变动幅度		当日	最近5日	平均变化	波动率
al持仓	多头前3	-0.88%	7.16%	1.43%	25.46%
	空头前3	3.14%	-12.79%	-2.56%	
al涨幅		0.31%	0.22%	0.04%	
震荡幅度	0.93%	1.35% (月均值)	投机度	0.46	0.68 (月均值)

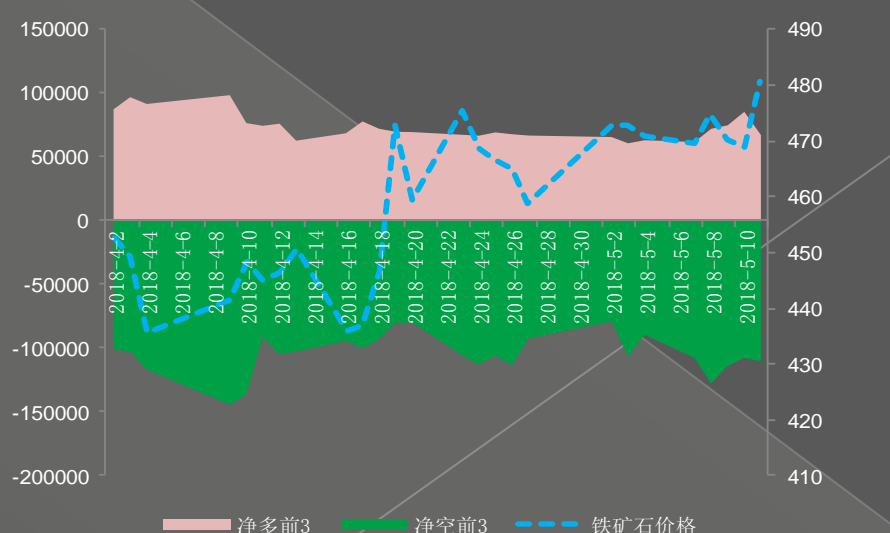
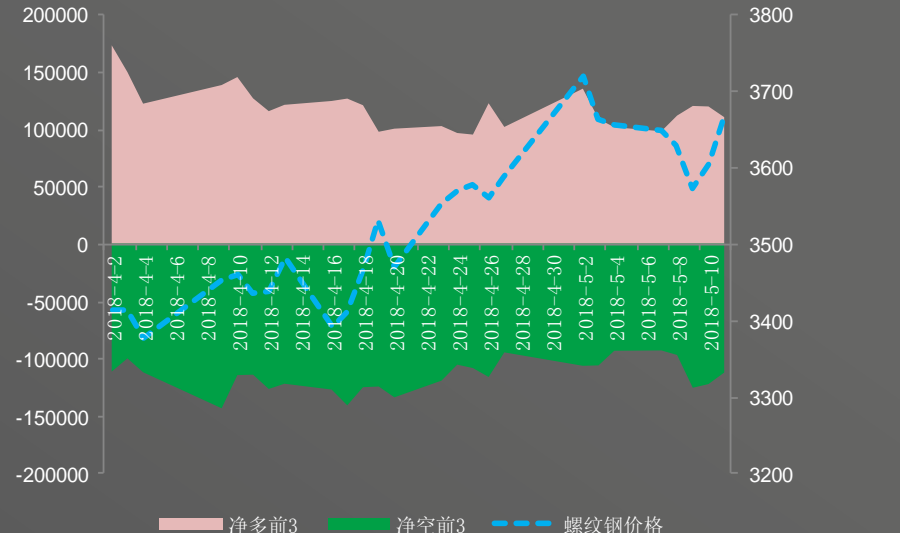


黑色板块：Rb & I

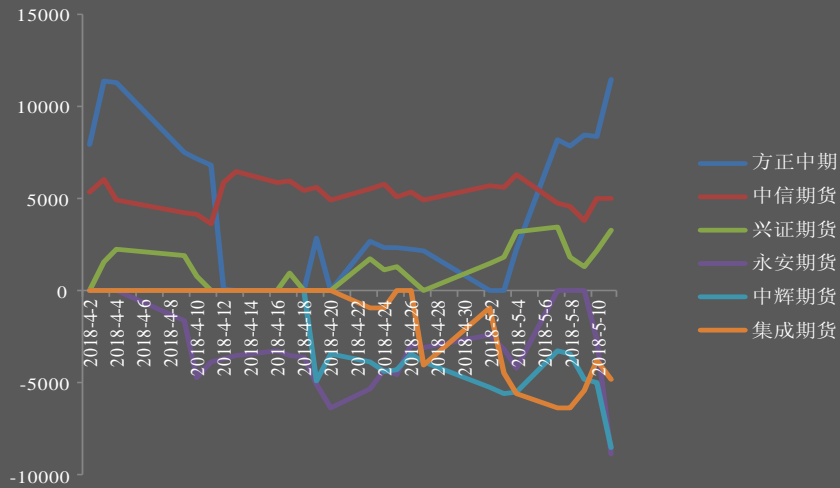
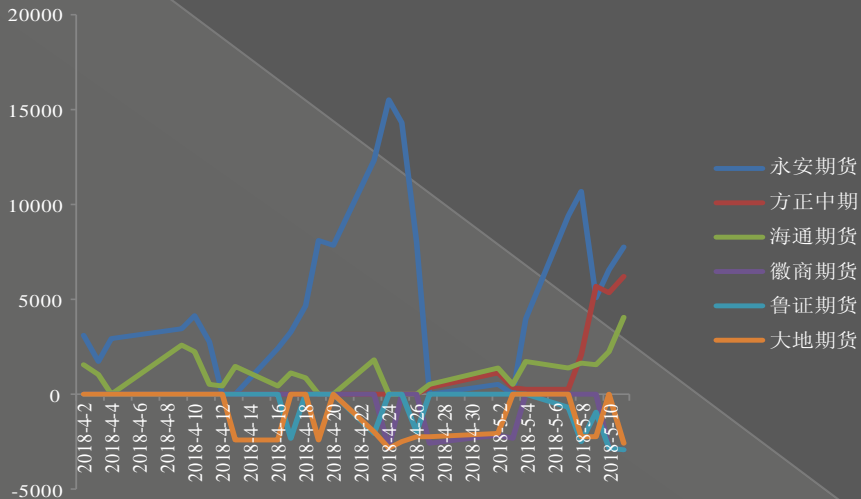


变动幅度		当日	最近5日	平均变化	波动率
rb持仓	多头前3	-7.79%	8.65%	1.73%	27.45%
	空头前3	-8.19%	20.36%	4.07%	
rb涨幅		1.62%	0.19%	0.04%	
震荡幅度	1.77%	1.92%(月均值)	投机度	1.24	1.39(月均值)

变动幅度		当日	最近5日	平均变化	波动率
I持仓	多头前3	-21.23%	6.53%	1.31%	36.44%
	空头前3	2.40%	23.15%	4.63%	
I涨幅		2.48%	2.08%	0.42%	
震荡幅度	3.59%	2.82%(月均值)	投机度	1.49	1.40(月均值)

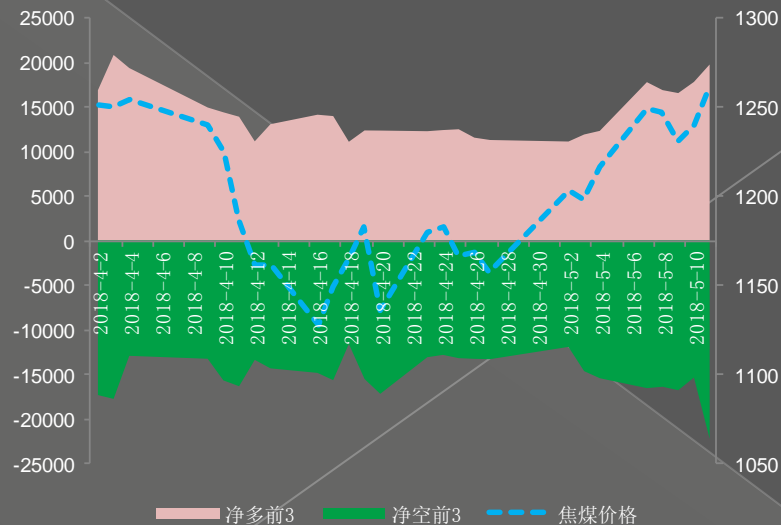
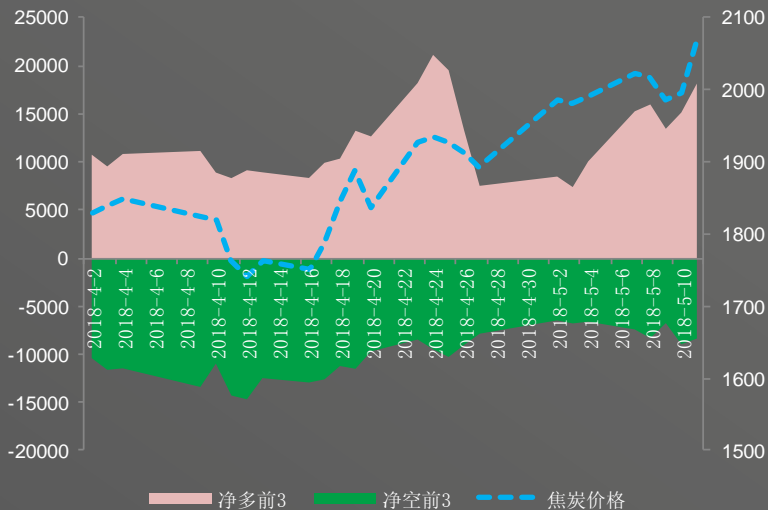


黑色板块：J & JM

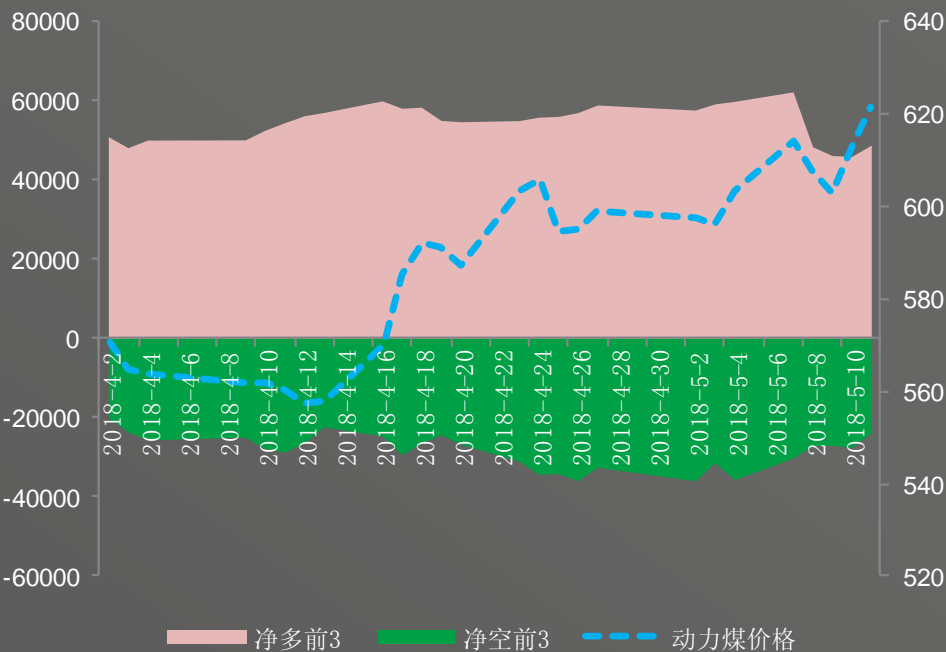
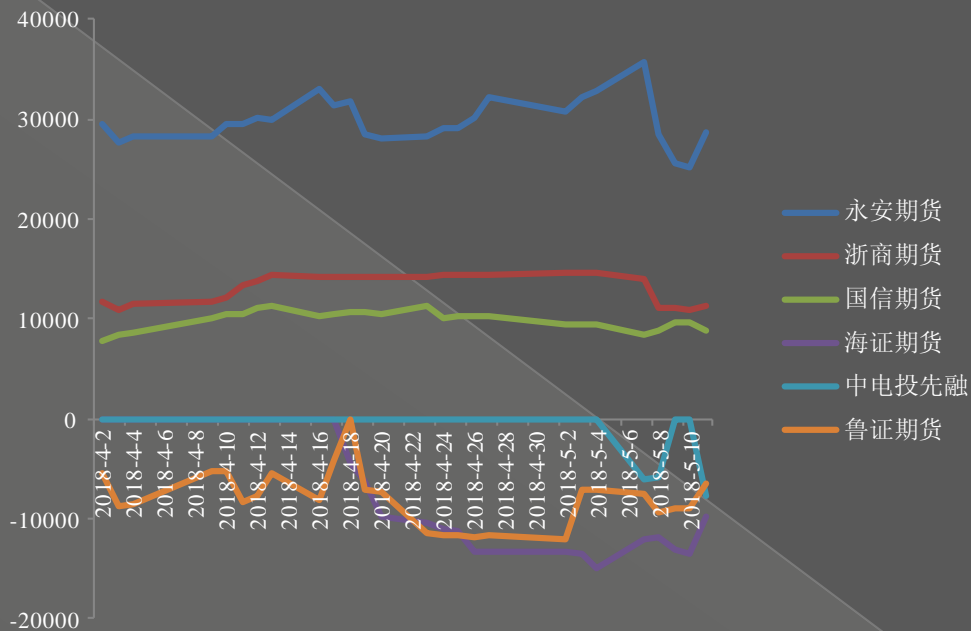


变动幅度		当日	最近5日	平均变化	波动率
j持仓	多头前3	19.88%	80.52%	16.10%	52.72%
	空头前3	-6.50%	26.57%	5.31%	
j涨幅		3.41%	3.72%	0.74%	
震荡幅度	3.68%	2.89%(月均值)	投机度	1.43	1.48(月均值)

变动幅度		当日	最近5日	平均变化	波动率
jm持仓	多头前3	11.00%	60.54%	12.11%	39.22%
	空头前3	44.63%	43.88%	8.78%	
jm涨幅		1.60%	3.58%	0.72%	
震荡幅度	2.47%	2.91%(月均值)	投机度	1.14	1.30(月均值)

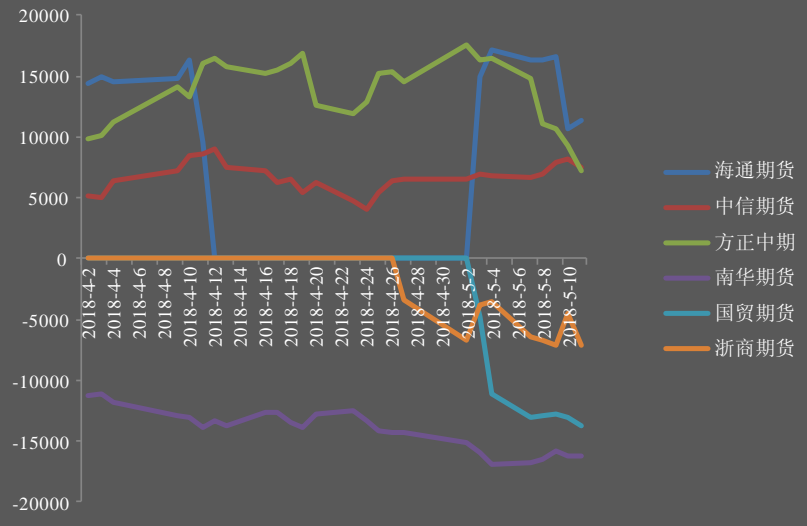
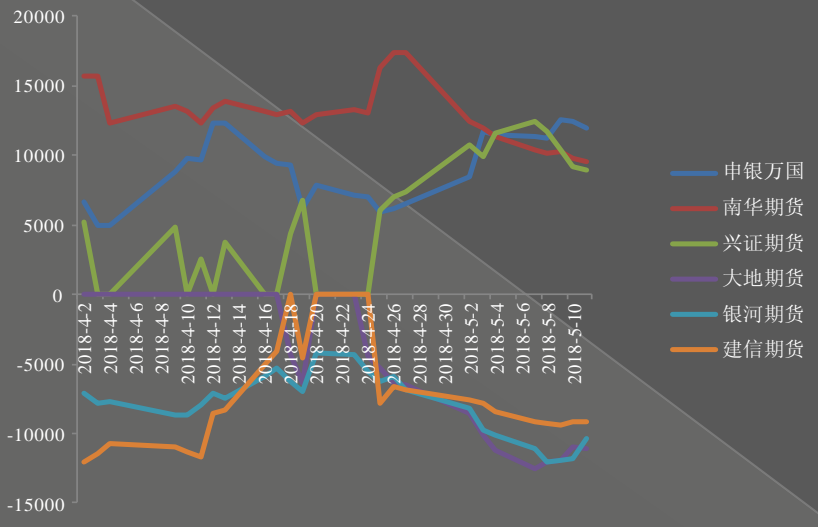


黑色：动力煤



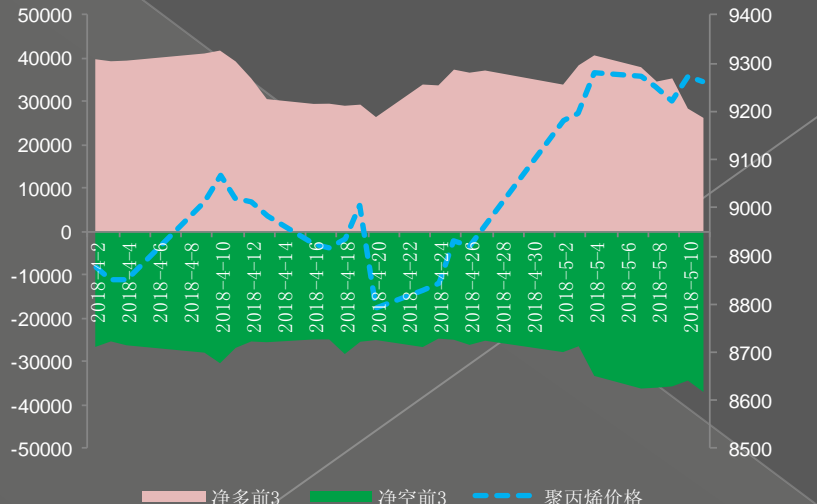
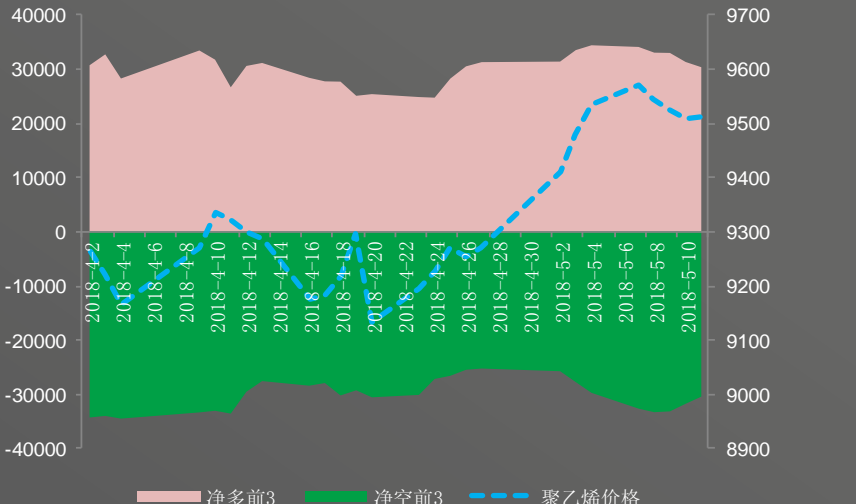
变动幅度		当日	最近5日	平均变化	波动率
zc持仓	多头前3	6.18%	-18.46%	-3.69%	32.66%
	空头前3	-13.26%	-33.07%	-6.61%	
zc涨幅		1.37%	3.01%	0.60%	
震荡幅度	1.88%	1.75%(月均值)	投机度	0.81	0.77(月均值)

化工：塑料 & PP

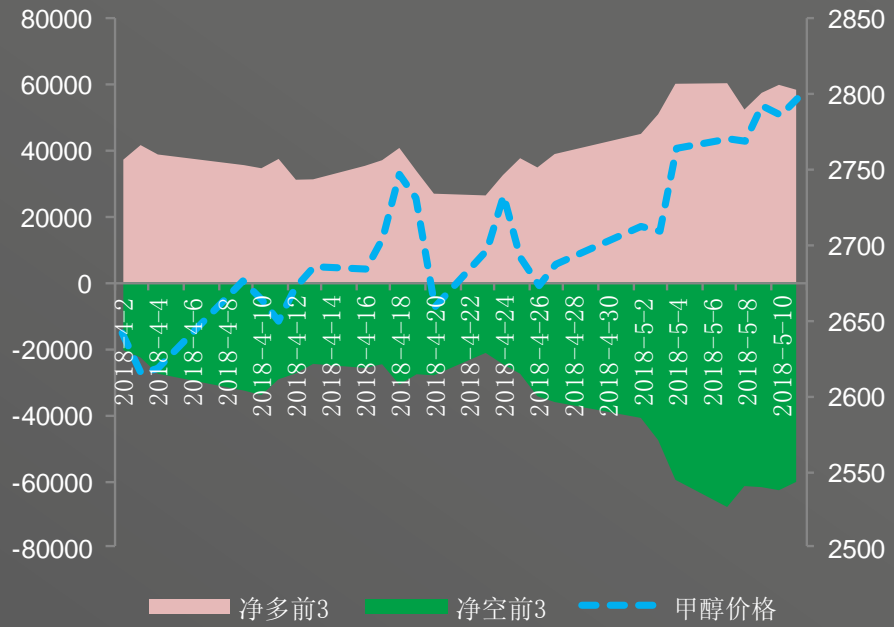
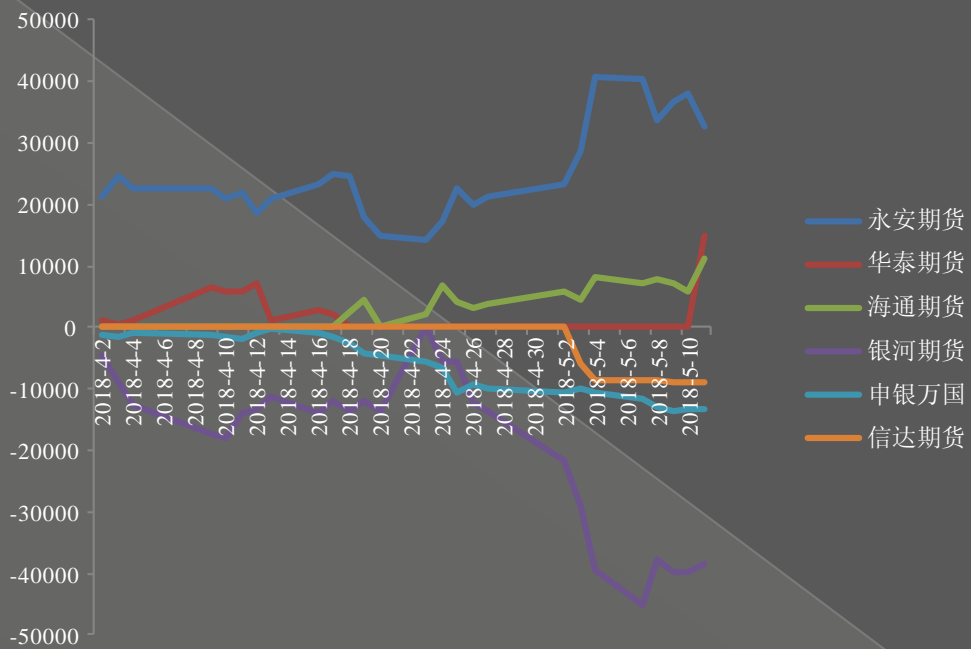


变动幅度		当日	最近5日	平均变化	波动率
I持仓	多头前3	-3.09%	-11.80%	-2.36%	11.44%
	空头前3	-4.13%	2.36%	0.47%	
I涨幅		0.02%	-0.23%	-0.05%	
震荡幅度	1.04%	1.09% (月均值)	投机度	0.54	0.60 (月均值)

变动幅度		当日	最近5日	平均变化	波动率
pp持仓	多头前3	-7.59%	-35.58%	-7.12%	17.99%
	空头前3	7.67%	11.14%	2.23%	
pp涨幅		-0.14%	-0.22%	-0.04%	
震荡幅度	1.03%	1.22% (月均值)	投机度	0.66	0.75 (月均值)

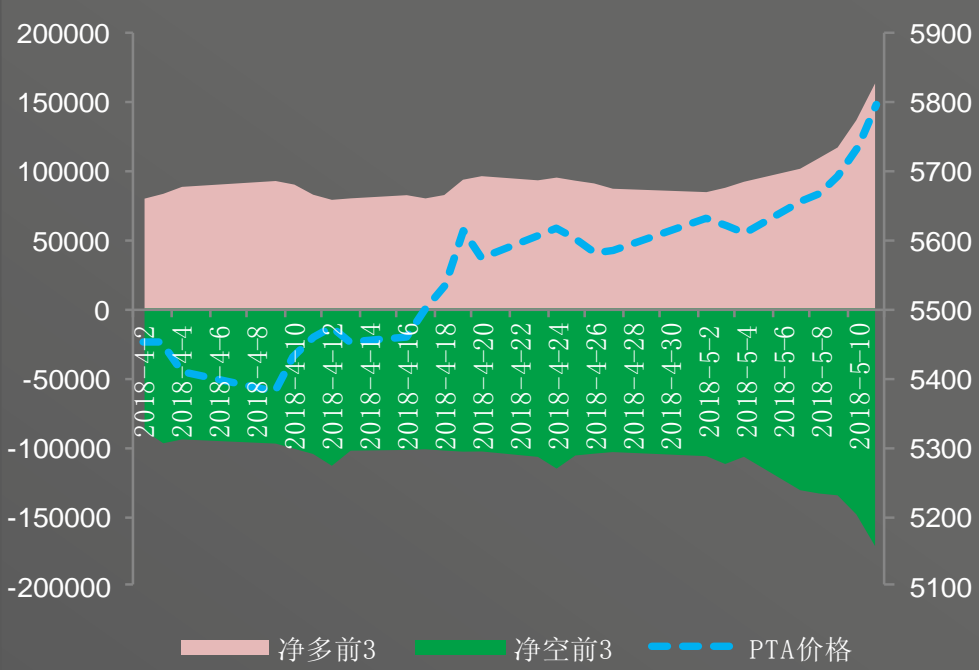
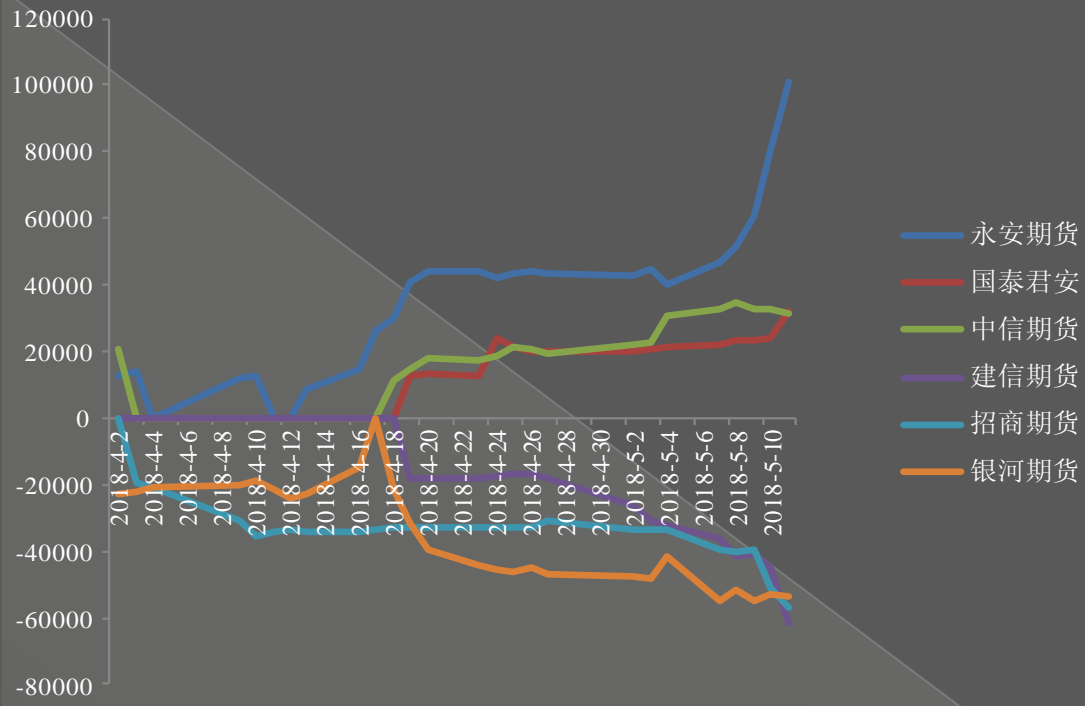


化工：甲醇



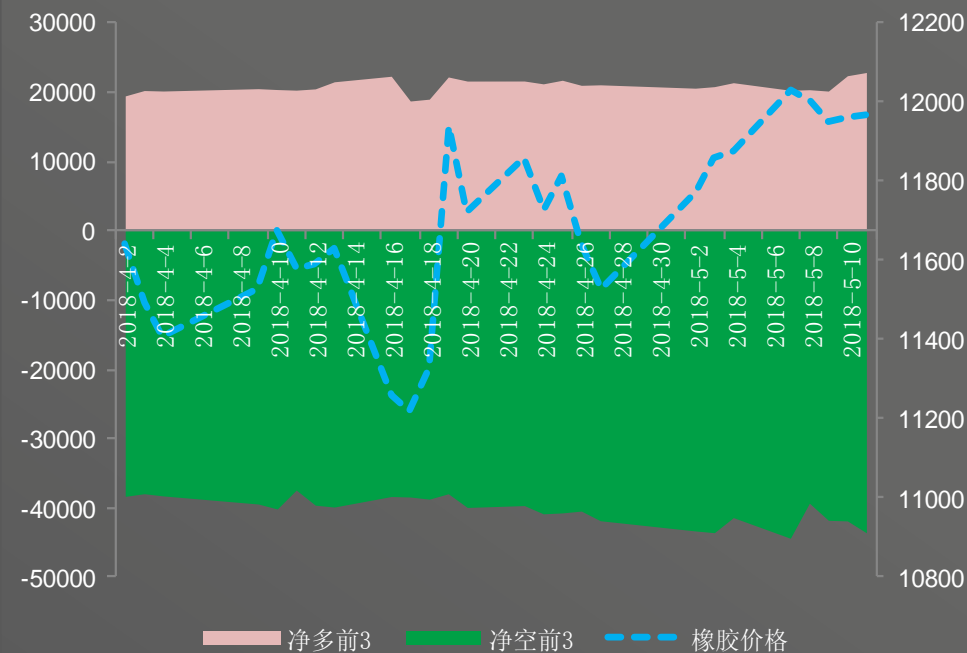
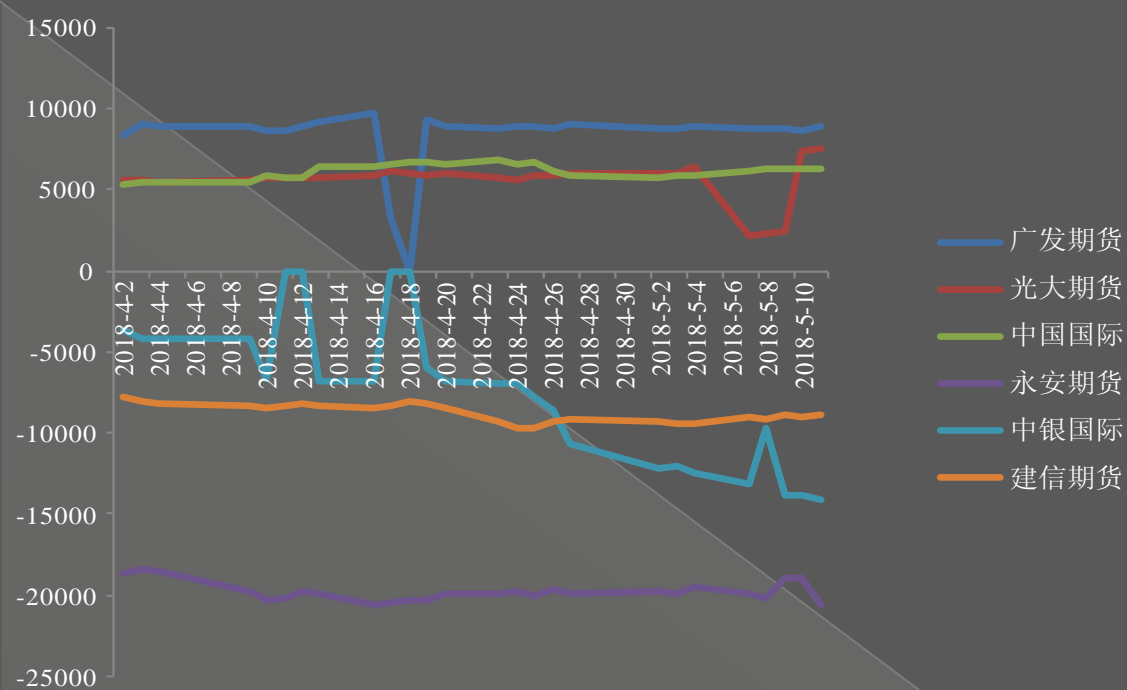
变动幅度		当日	最近5日	平均变化	波动率
ma持仓	多头前3	-2.49%	-3.00%	-0.60%	21.51%
	空头前3	-3.99%	1.04%	0.21%	
ma涨幅		0.41%	1.20%	0.24%	
震荡幅度	1.65%	1.69%(月均值)	投机度	0.79	1.00(月均值)

化工：PTA



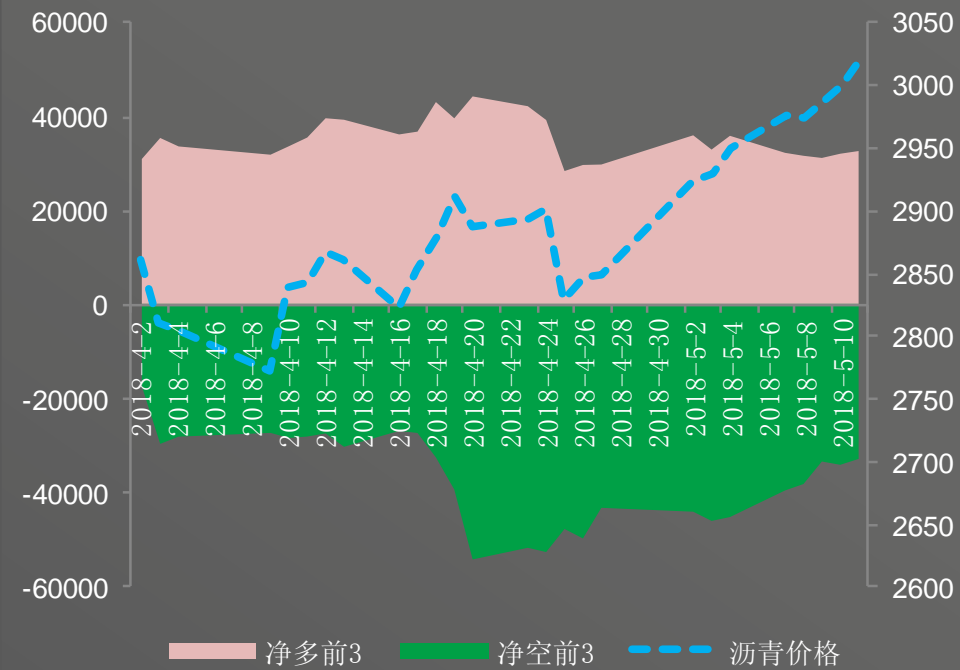
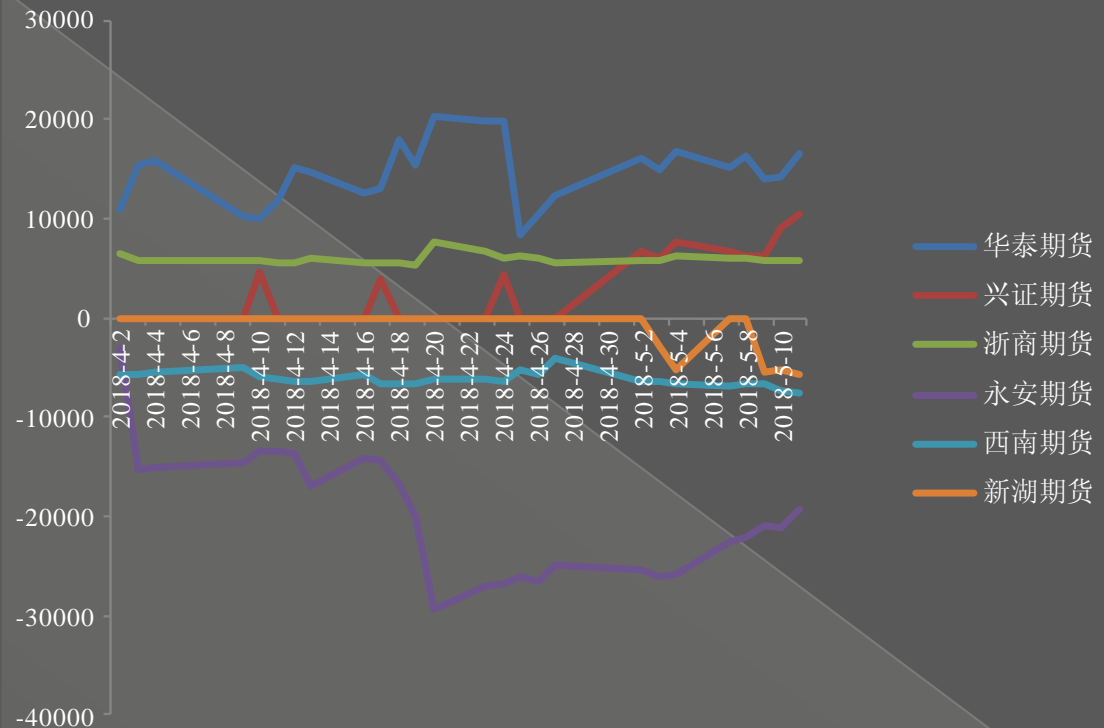
变动幅度		当日	最近5日	平均变化	波动率
pta持仓	多头前3	19.50%	77.51%	15.50%	11.51%
	空头前3	15.40%	60.27%	12.05%	
pta涨幅		1.04%	3.28%	0.66%	
震荡幅度	1.62%	1.11%(月均值)	投机度	0.56	0.42(月均值)

化工：橡胶



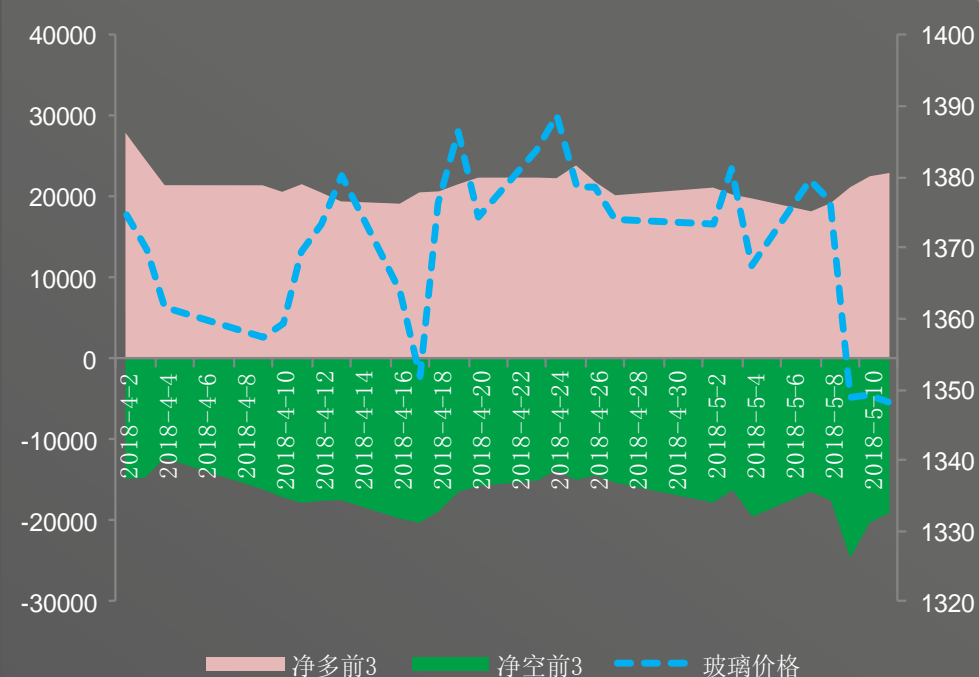
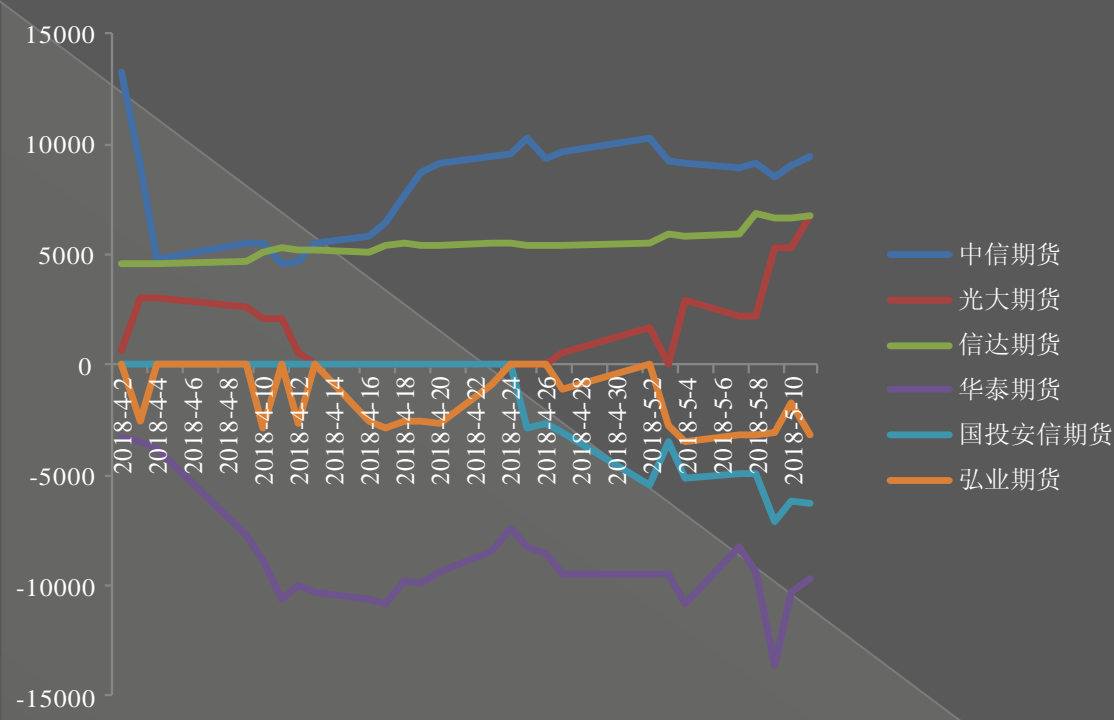
变动幅度		当日	最近5日	平均变化	波动率
ru持仓	多头前3	2.09%	6.89%	1.38%	34.36%
	空头前3	4.10%	5.30%	1.06%	
ru涨幅		0.03%	0.76%	0.15%	
震荡幅度	1.10%	1.95%(月均值)	投机度	0.85	0.86(月均值)

化工：沥青



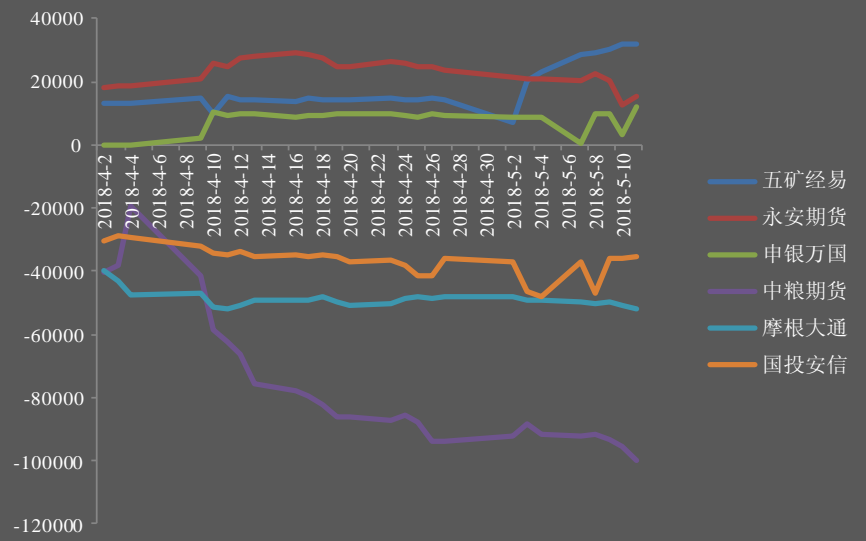
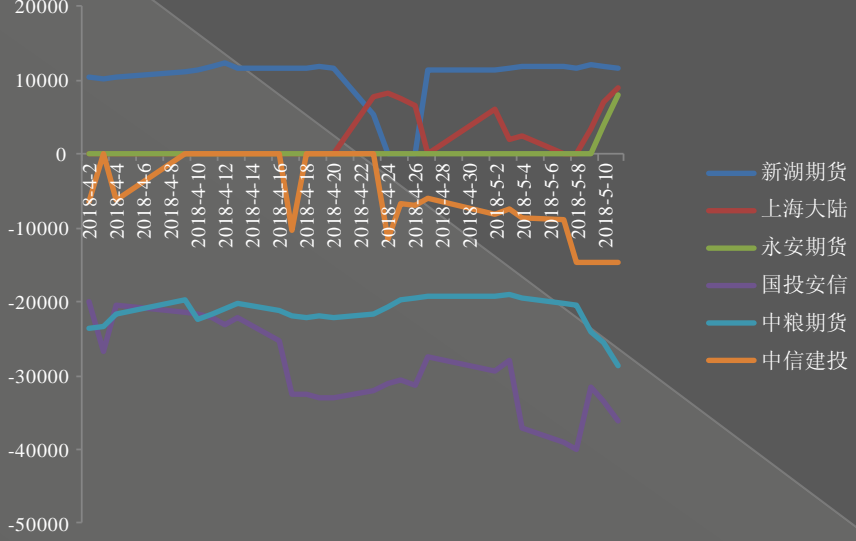
变动幅度		当日	最近5日	平均变化	波动率
bu持仓	多头前3	1.79%	-9.05%	-1.81%	17.93%
	空头前3	-3.67%	-27.28%	-5.46%	
bu涨幅		0.73%	2.41%	0.48%	
震荡幅度	1.57%	1.55%(月均值)	投机度	0.97	0.83(月均值)

化工：玻璃



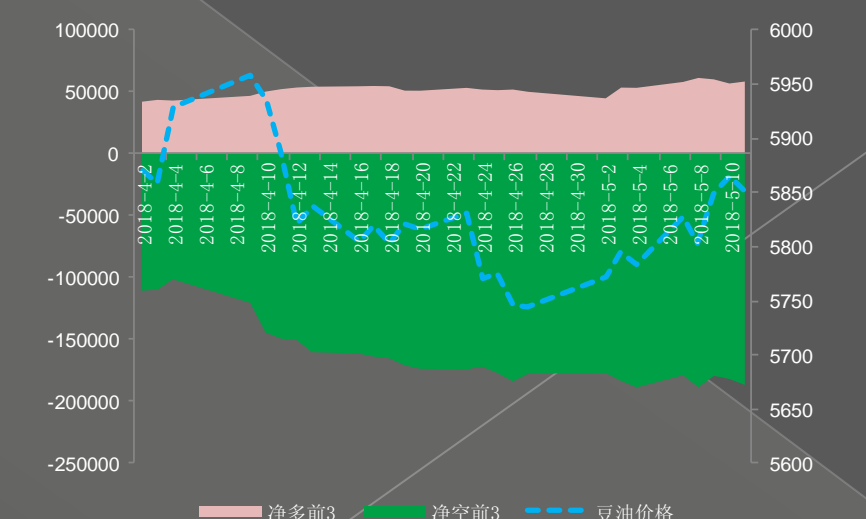
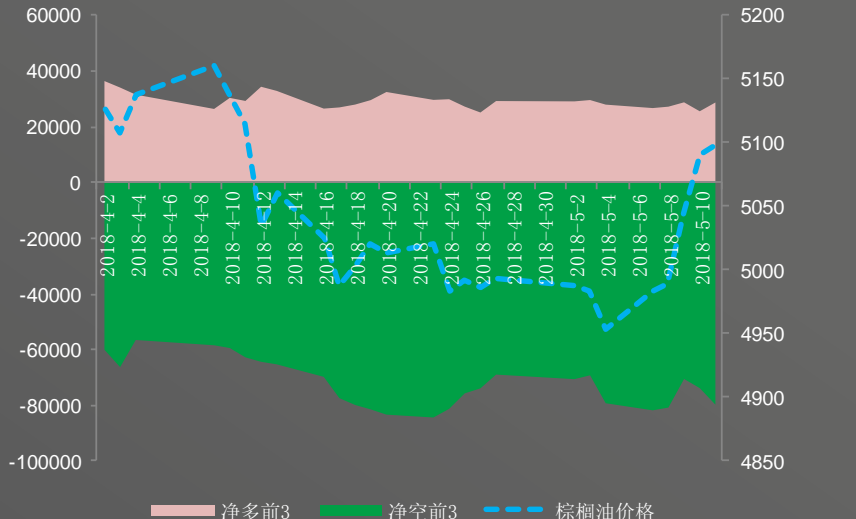
变动幅度		当日	最近5日	平均变化	波动率
fg持仓	多头前3	1.81%	15.91%	3.18%	21.56%
	空头前3	-5.69%	-2.28%	-0.46%	
fg涨幅		-0.08%	-1.41%	-0.28%	
震荡幅度	0.87%	1.34%(月均值)	投机度	0.55	0.55(月均值)

农产品：P & Y



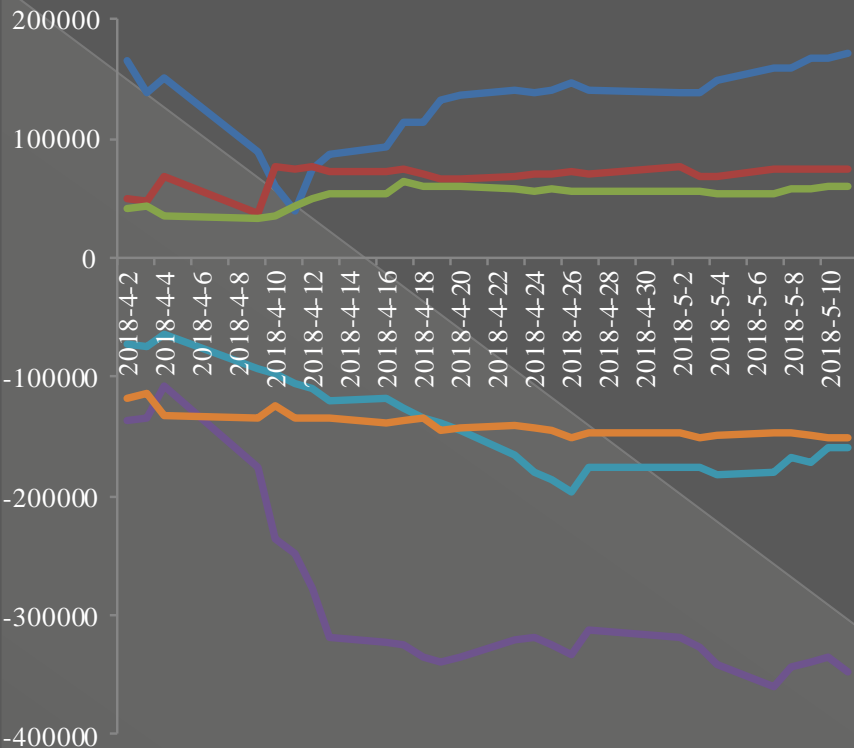
变动幅度		当日	最近5日	平均变化	波动率
p持仓	多头前3	12.25%	2.70%	0.54%	10.80%
	空头前3	8.06%	0.63%	0.13%	
p涨幅		0.15%	2.91%	0.58%	
震荡幅度	0.74%	0.97%(月均值)	投机度	0.42	0.50(月均值)

变动幅度		当日	最近5日	平均变化	波动率
y持仓	多头前3	2.78%	9.53%	1.91%	14.41%
	空头前3	2.65%	-1.05%	-0.21%	
y涨幅		-0.23%	1.18%	0.24%	
震荡幅度	0.85%	1.10%(月均值)	投机度	0.31	0.40(月均值)



净多前3 净空前3 棕榈油价格

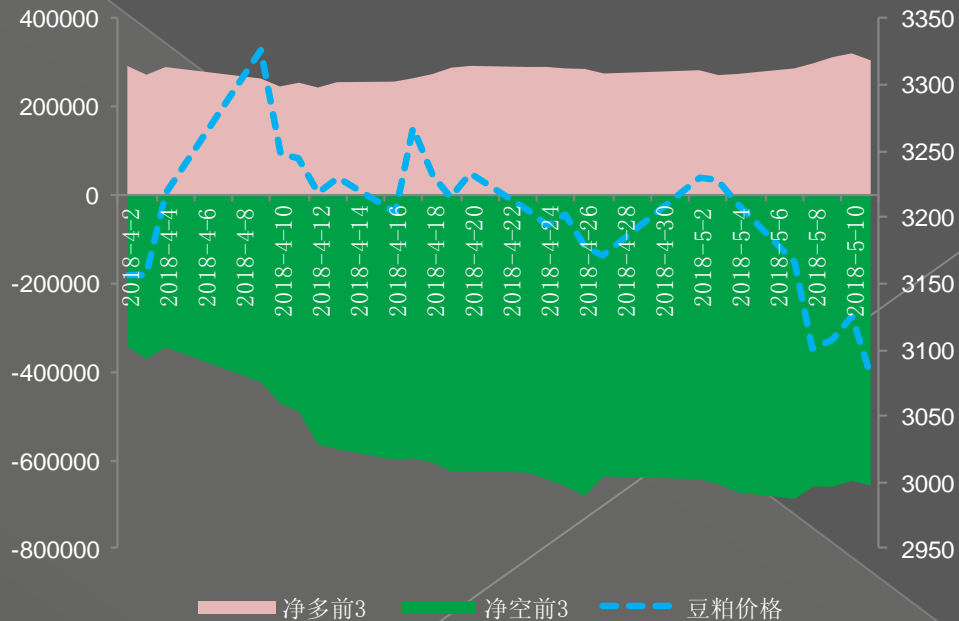
净多前3 净空前3 豆油价格



- 永安期货
- 光大期货
- 方正中期
- 中粮期货
- 国投安信
- 摩根大通

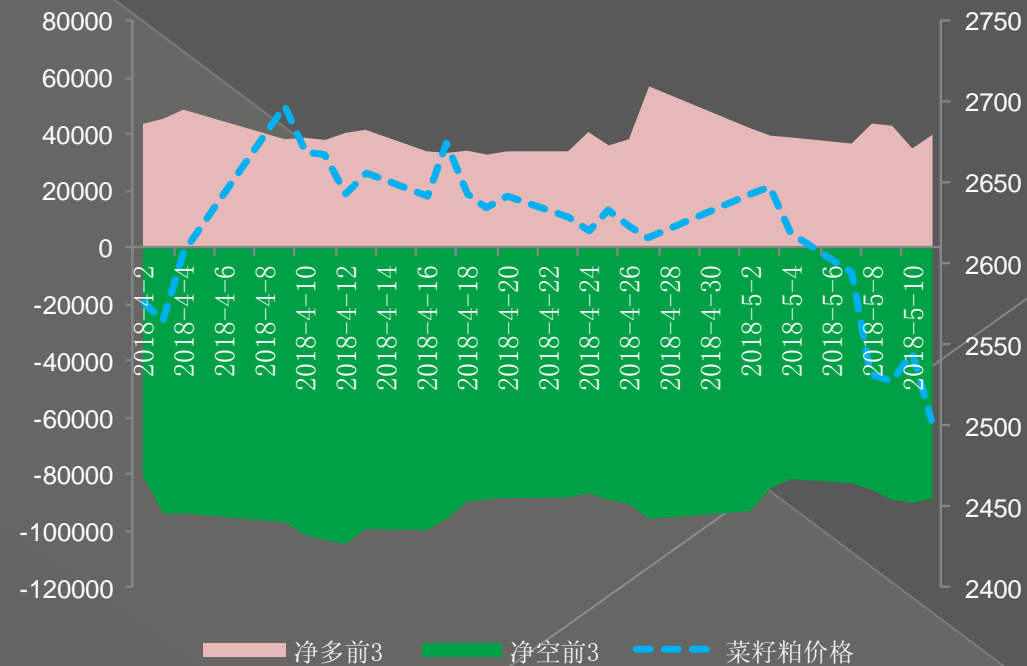
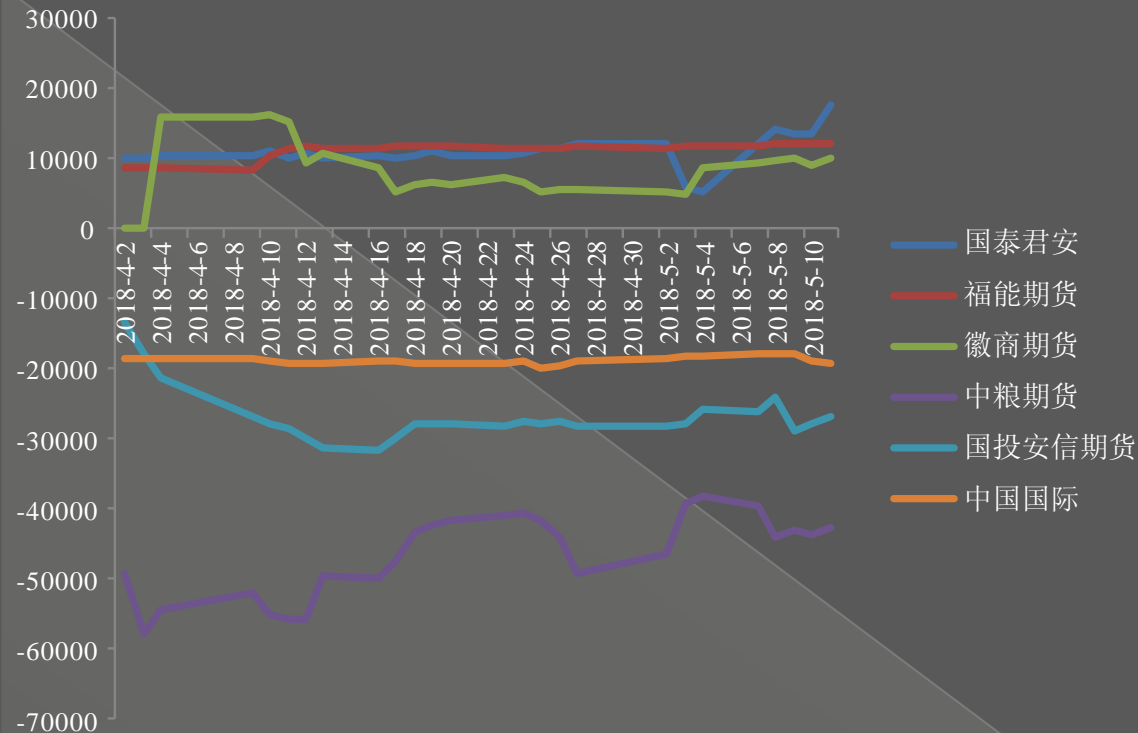
农产品：豆粕

变动幅度		当日	最近5日	平均变化	波动率
m持仓	多头前3	-4.84%	11.23%	2.25%	32.82%
	空头前3	1.62%	-2.30%	-0.46%	
m涨幅		-1.34%	-3.94%	-0.79%	
震荡幅度	1.60%	1.79%(月均值)	投机度	0.40	0.61(月均值)

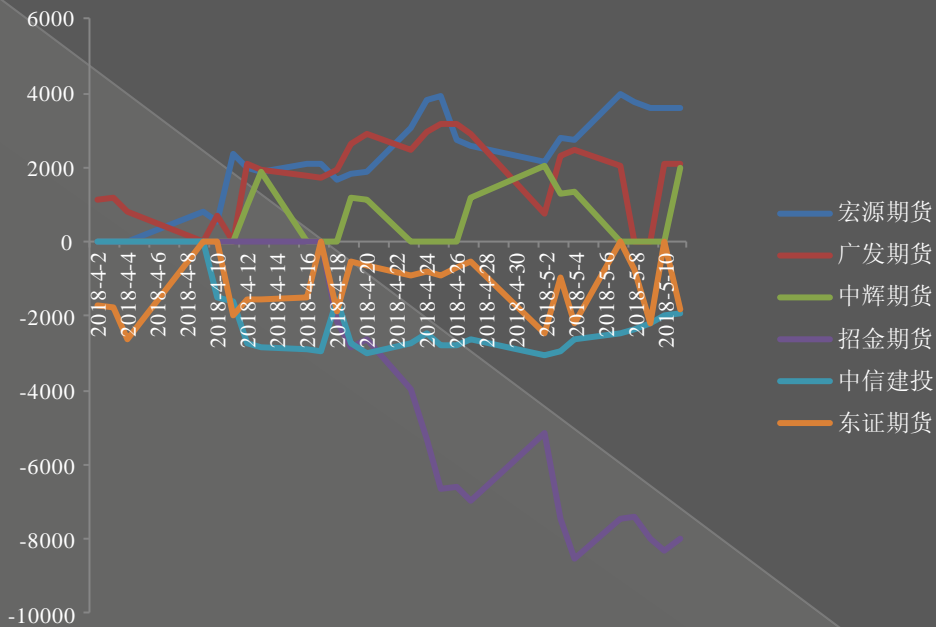


- 净多前3
- 净空前3
- 豆粕价格

农产品：菜粕

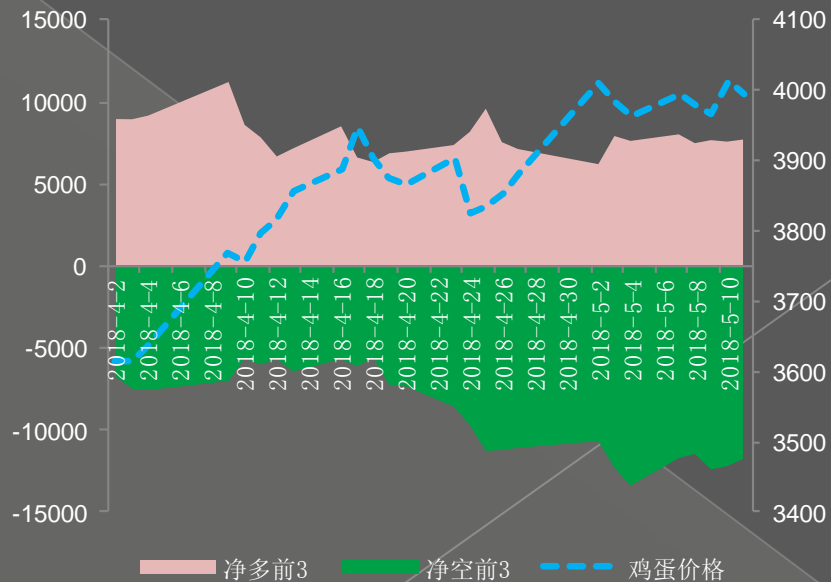


变动幅度		当日	最近5日	平均变化	波动率
rm持仓	多头前3	13.80%	2.53%	0.51%	30.83%
	空头前3	-1.58%	8.48%	1.70%	
rm涨幅		-1.65%	-4.42%	-0.88%	
震荡幅度	1.97%	1.55%(月均值)	投机度	0.62	0.80(月均值)

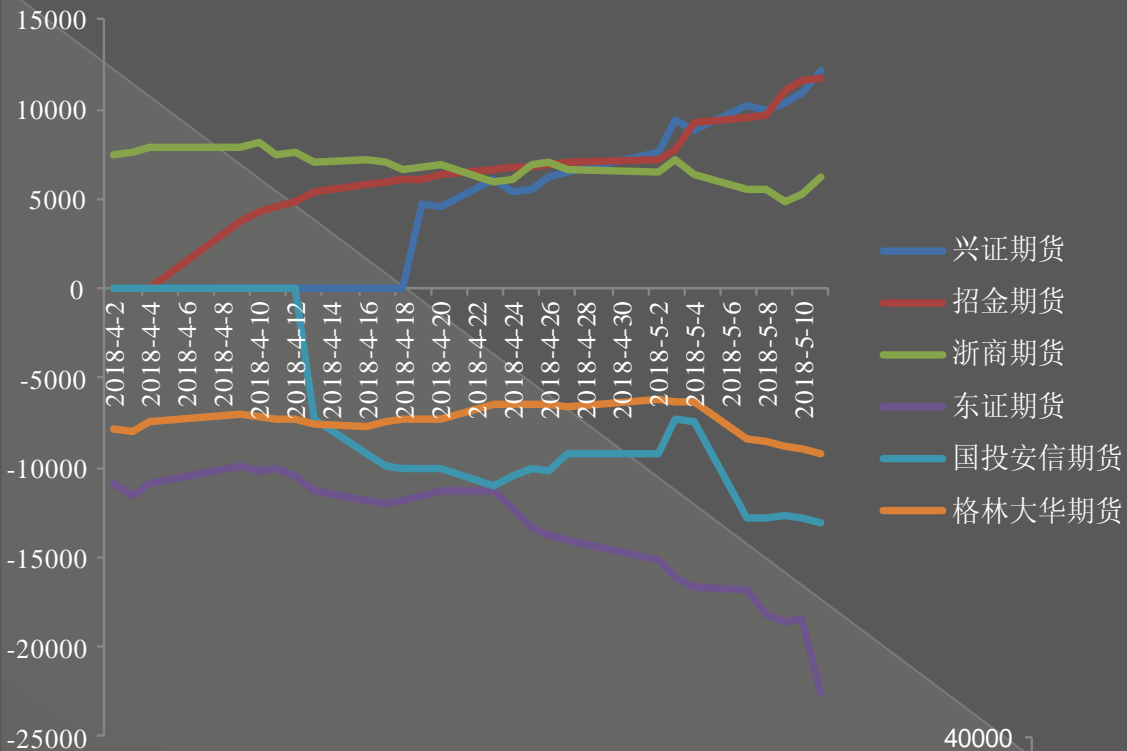


农产品：鸡蛋

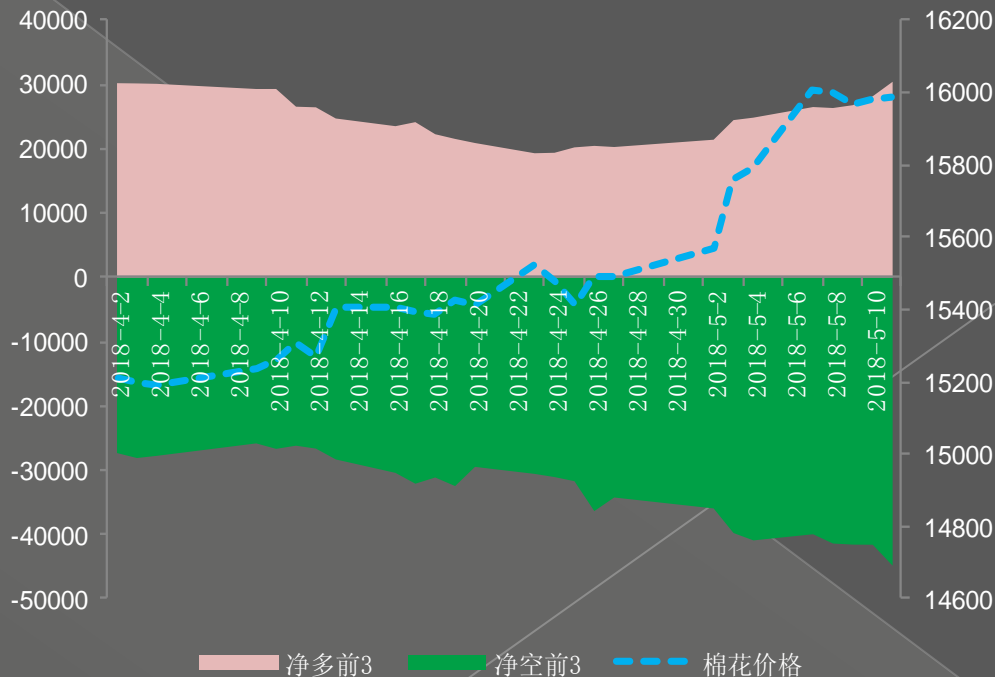
变动幅度		当日	最近5日	平均变化	波动率
jd持仓	多头前3	1.67%	1.08%	0.22%	28.67%
	空头前3	-3.54%	-12.07%	-2.41%	
jd涨幅		-0.53%	0.76%	0.15%	
震荡幅度	1.02%	1.66%(月均值)	投机度	0.41	0.73(月均值)



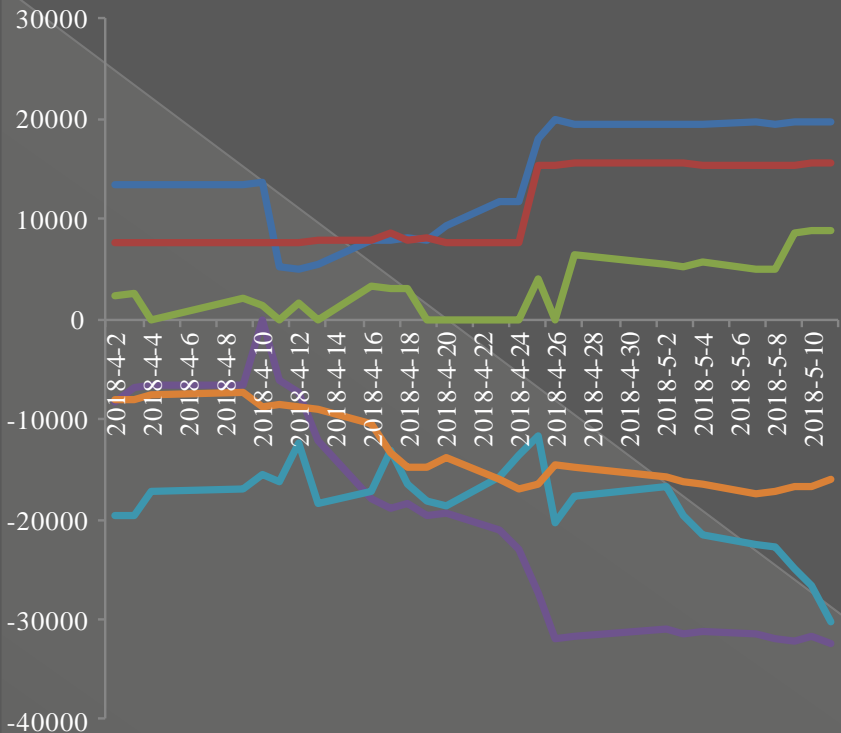
农产品：棉花



变动幅度		当日	最近5日	平均变化	波动率
cf持仓	多头前3	7.99%	22.41%	4.48%	7.53%
	空头前3	7.84%	9.63%	1.93%	
cf涨幅		0.05%	1.26%	0.25%	
震荡幅度	0.92%	0.74%(月均值)	投机度	0.52	0.37(月均值)

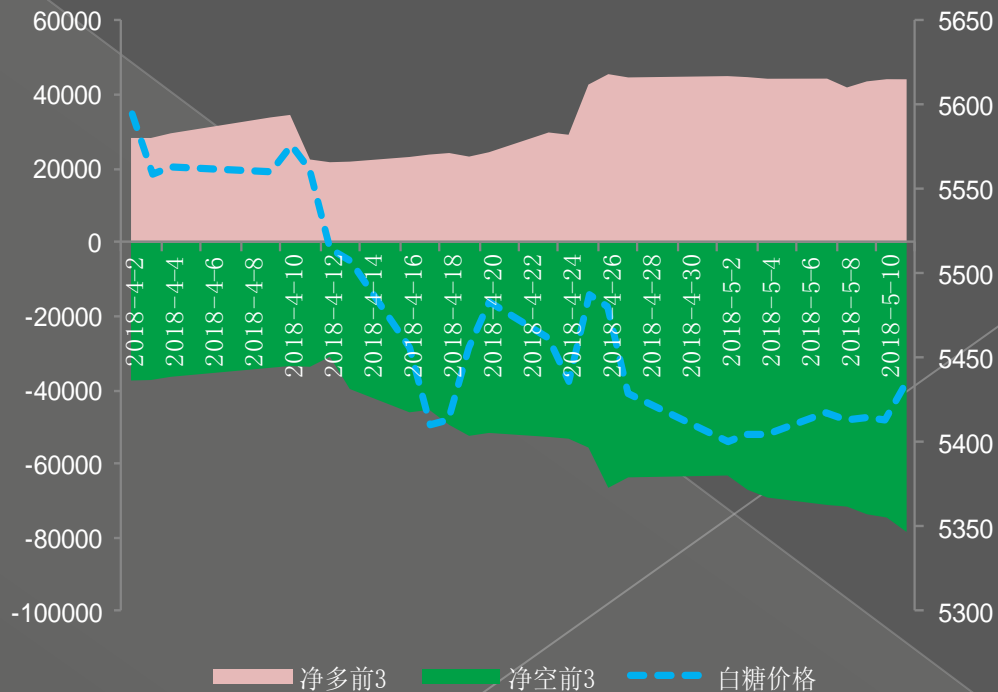


农产品：白糖

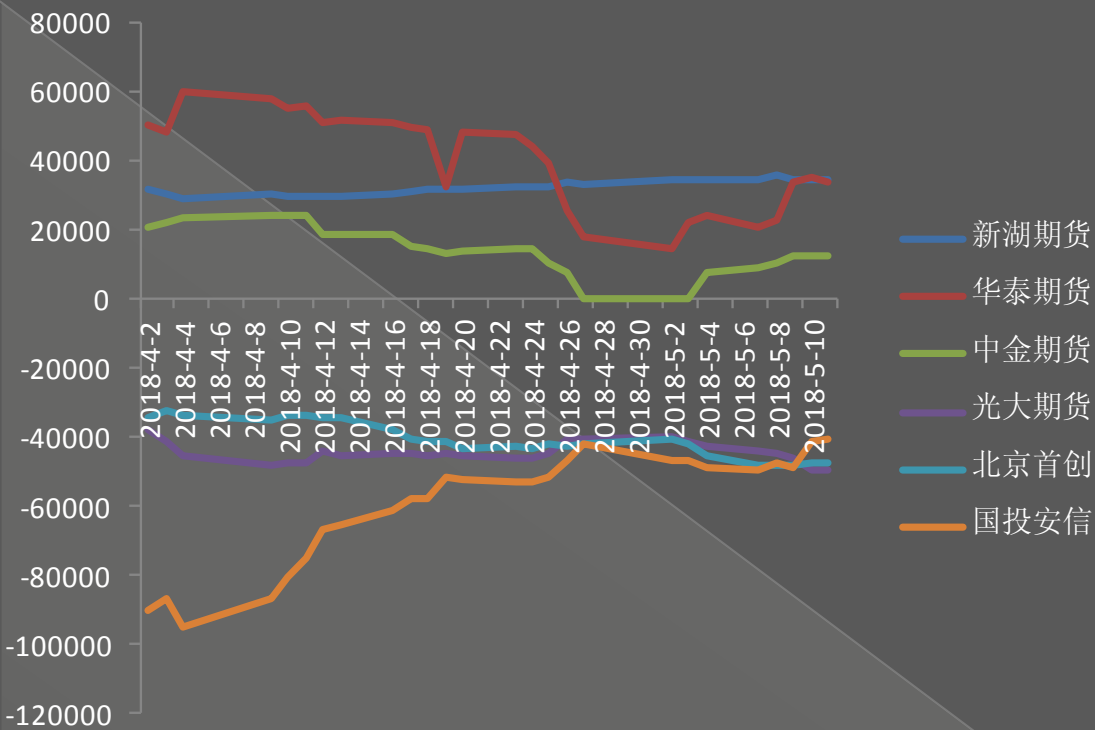


- 混沌天成期货
- 一德期货
- 宏源期货
- 永安期货
- 中粮期货
- 中信期货

变动幅度		当日	最近5日	平均变化	波动率
sr持仓	多头前3	-0.05%	-0.33%	-0.07%	10.87%
	空头前3	5.27%	13.53%	2.71%	
sr涨幅		0.41%	0.58%	0.12%	
震荡幅度	1.14%	0.87% (月均值)	投机度	0.46	0.43 (月均值)

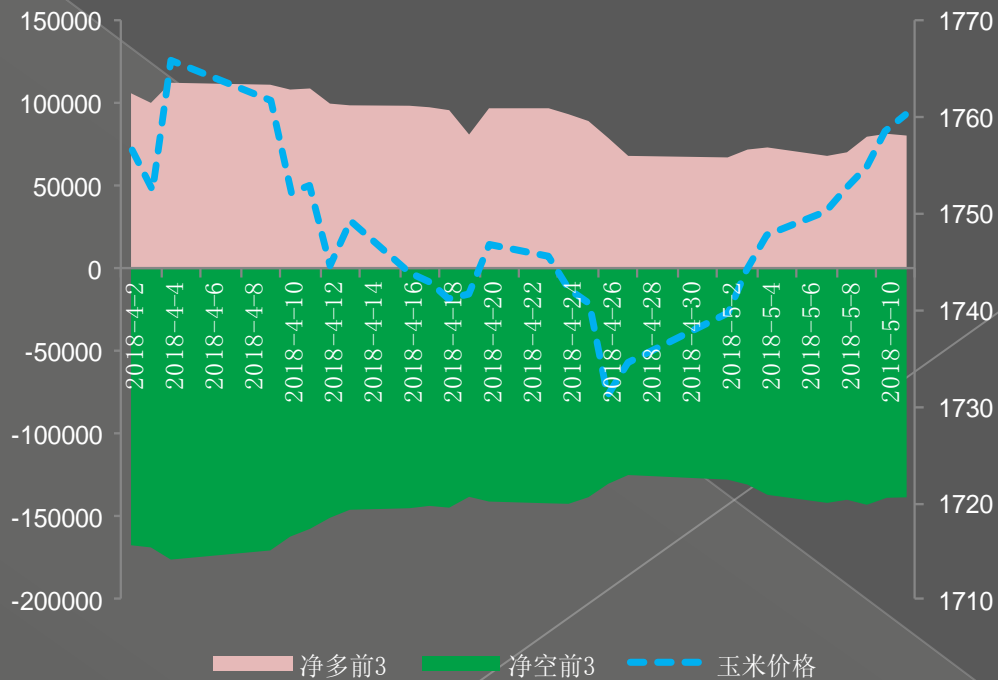


- 净多前3
- 净空前3
- 白糖价格



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	-1.32%	9.76%	1.95%	6.57%
	空头前3	-0.21%	1.11%	0.22%	
c涨幅		0.09%	0.72%	0.14%	
震荡幅度	0.38%	0.57%(月均值)	投机度	0.16	0.35(月均值)



部分机构资金变动表

制表日期：2018年5月11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	18765.73	8.64%	27935.62	13.44%
南华期货	5586.41	6.31%	6233.15	7.09%
混沌天成	0.00	--	-5250.66	-100.00%
海通期货	-13693.97	-10.51%	-8491.03	-6.79%
上海大陆	1013.44	5.34%	2705.25	15.64%
中信期货	9133.92	4.65%	-694.12	-0.34%
新湖期货	11041.08	16.44%	17922.17	29.73%

中粮期货	6426.20	2.06%	44925.23	16.43%
中信建投	-3730.09	-8.31%	4592.02	12.55%
申银万国	1405.90	2.64%	4732.59	9.47%
华泰期货	28366.89	64.62%	-4688.10	-6.09%
光大期货	10697.59	12.44%	4874.59	5.31%
一德期货	-7465.35	-5.02%	-25225.64	-15.16%
国投期货	11263.66	16.13%	11466.59	16.47%
金瑞期货	-5925.77	-4.80%	16789.01	16.68%
鲁证期货	-5918.79	-14.83%	5558.56	19.56%
中国国际	-2560.89	-3.75%	10118.29	18.22%

部分机构持仓一览

机构	永安期货					
日期	2018-5-4	2018-5-7	2018-5-8	2018-5-9	2018-5-10	2018-5-11
黄金			2649		2609	2614
白银						
沪铜	3901					1649
沪铝			1804	2207	2196	2150
沪镍	17513	18354	18971	18085	13867	13735
沪锌	-10172	-3620				
沪铅	1025	1517	1566	1663	2307	3193
螺纹钢	-11349			13913	33101	21327
铁矿石	-17774	-7864	7030	13138		1291
焦煤	-4187	2342	2220		-2590	-8850
焦炭	3982	9460	10745	5094	6604	7827
豆油	20932	20620	22881	20319	12855	15240
棕榈油					3877	8050
菜籽油	3934	3803	3181	4246	4975	7079
豆粕	149276	159001	160455	167109	168230	171243
菜籽粕	-5148	-5404	-7065	-6791	-1471	-2104
棉花		-6341	-5937		-6836	-7220
白糖	-31293	-31521	-31798	-32157	-31608	-32426
玉米	-11252				-15878	-19353
鸡蛋						
PTA	39801	46471	51624	60851	80365	100786
聚乙烯	5271	6045	5538	4363	-3800	
聚丙烯	5117	4122		4108		
甲醇	40635	40277	33584	36633	38011	32869
玻璃				6104	6902	6480
橡胶	-19536	-19859	-20219	-18938	-18966	-20627
沥青	-25824	-22632	-22011	-20985	-21254	-19354
动力煤	32814	35710	28466	25570	25301	28688

部分机构持仓一览

机构	南华期货					
日期	2018-5-4	2018-5-7	2018-5-8	2018-5-9	2018-5-10	2018-5-11
黄金		-1078				
白银	7877	4783	8503	8492		8659
沪铜	4401	4304		5182	5051	4622
沪铝	6124				301	6795
沪镍	-7268			-8066	-7942	-15113
沪锌						
沪铅	-563					
螺纹钢				-8947	-10903	-10195
铁矿石	17329	17565	18398	18124	19163	19592
焦煤			2422			
焦炭			1812			
豆油	-9563	-10035	-10422	-10264	-9550	
棕榈油					3730	3633
菜籽油	-4651	-7737	-7846	-7694	-7932	
豆粕	-42739	-43874	-48570	-46374	-42555	-43960
菜籽粕	-8244	-8238	-8540	-8370	-8555	-9987
棉花						
白糖	6861	6822	6927	6771	6753	6862
玉米	-12068					
鸡蛋					-1781	-1746
PTA						
聚乙烯	11364	10445	10134	10274	9780	9600
聚丙烯	-16879	-16764	-16477	-15837	-16218	-16149
甲醇			7441	8133	8690	9683
玻璃				-2357	-2280	
橡胶	2132		1883	444	1473	1570
沥青						
动力煤	4291	4695	3905			

部分机构持仓一览

机构	国泰君安					
日期	2018-5-4	2018-5-7	2018-5-8	2018-5-9	2018-5-10	2018-5-11
黄金	7338	6722	6703	6505	6995	7094
白银	-10903	-10783	-10665	-11395	-15534	-16060
沪铜	3956	4051	5612	5649	5266	8894
沪铝						
沪镍	6572	5987	5957	4847	5130	5567
沪锌						
沪铅			1465	1417	1399	1593
螺纹钢	30859	29568	33555			
铁矿石	10550	8700	15511	13058	14454	13302
焦煤	-535	2112	1482	975	1249	1041
焦炭	1399			-994	-1012	
豆油		-11633		-12664	-12126	-12943
棕榈油	8664	7889	8571	7935	6658	7522
菜籽油	28147	27841	31442	31917	31825	32014
豆粕				30400	29968	
菜籽粕	5241	12214	14269	13530	13457	17877
棉花						
白糖	-9500		-9930	-9911	-9920	-9870
玉米	-15733	-14266	-14152	-12694		-11903
鸡蛋						1390
PTA	21452	21739	23213	23554	24197	31717
聚乙烯						
聚丙烯			3652			
甲醇	9863	10941	10200	11394	11483	10517
玻璃	-1857	-1218	-1190	-2537	-2305	-1904
橡胶						
沥青		8052	5626	9278	8949	5374
动力煤					-3958	-4561

部分机构持仓一览

机构	混沌天成					
日期	2018-5-4	2018-5-7	2018-5-8	2018-5-9	2018-5-10	2018-5-11
黄金						
白银						
沪铜						
沪铝						
沪镍						
沪锌	-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	2018-5-4	2018-5-7	2018-5-8	2018-5-9	2018-5-10	2018-5-11
黄金	3973	4114	3862	3734		
白银	7261					7166
沪铜	-13211	-12052	-12444	-12461	-13203	-6027
沪铝	-11241	-11384	-4502	-7887	-7931	-14268
沪镍	9787	10171	10886	10281	7181	6965
沪锌					-3432	
沪铅	3778	6367	6521	6701	6658	6772
螺纹钢	-33433	-30043	-33878	-49542	-49475	-47051
铁矿石		-6363	-4947	-9489	-9906	-6381
焦煤	1263	3321		-740	1050	1975
焦炭	1803	1398	1714	1585	2283	4120
豆油						
棕榈油		2842	3906	4127	4117	3951
菜籽油	-5548	-5576	-5485		-6551	-5782
豆粕	51569	34805	36626	35851	33740	26949
菜籽粕	5812	3521	4550	3383		-1660
棉花					5052	5808
白糖						
玉米		-12927	-12695	-12667		
鸡蛋	1779	1358	1175		1910	
PTA		22465	21904	19945	21373	24875
聚乙烯	4491	4613			4873	
聚丙烯	17130	16295	16412	16649	10756	11317
甲醇	8326	7380	8012	7048	6029	11184
玻璃	2268	1624		2150	1592	-1548
橡胶						-1141
沥青				3705	4759	4718
动力煤		4568		3419	3352	6366

部分机构持仓一览

机构	上海大陆					
日期	2018-5-4	2018-5-7	2018-5-8	2018-5-9	2018-5-10	2018-5-11
黄金						
白银						
沪铜	5892	5923	5768	6007	6001	5979
沪铝						
沪镍						
沪锌						
沪铅						
螺纹钢						
铁矿石						
焦煤						
焦炭						
豆油						
棕榈油	2504			3499	7083	8959
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	2018-5-4	2018-5-7	2018-5-8	2018-5-9	2018-5-10	2018-5-11
黄金						
白银		6634	7082	7070	7385	
沪铜	-8551	-8234	-8812	-9093	-9343	-9783
沪铝	-13052	-14118	-14455	-14227	-15123	-15610
沪镍	-7029	-7969	-11861	-9316	-10361	-10947
沪锌	11928	11327	11440	11437	11510	11594
沪铅						
螺纹钢						
铁矿石						
焦煤		4886	4460	4286	4417	2596
焦炭						
豆油	-91519	-92357	-91816	-93437	-95261	-99694
棕榈油	-19366	-20213	-20315	-24011	-25568	-28710
菜籽油	-18375	-18420	-18586	-19653	-19883	-23829
豆粕	-340201	-359303	-343239	-338941	-335271	-346630
菜籽粕	-38047	-39437	-43842	-42927	-43649	-42715
棉花		-7386	-7609	-7573	-7905	-7302
白糖	-21648	-22454	-22729	-24895	-26553	-30200
玉米	-18191	-17594	-18600	-19102	-26789	-27217
鸡蛋						
PTA	14221	22377	22600	22531	20882	20573
聚乙烯						
聚丙烯						
甲醇						
玻璃						
橡胶	-6835	-7134	-7903	-7239	-7852	-7819
沥青						
动力煤	-5489	-5197	-4928	-4547	-4552	-4816

部分机构持仓一览

机构	中信期货					
日期	2018-5-4	2018-5-7	2018-5-8	2018-5-9	2018-5-10	2018-5-11
黄金	13162	12727	12879	12936	13520	13525
白银	-29258	-28789	-28799	-31855	-32518	-28691
沪铜	-13093	-14252	-14378	-14999	-14138	-13770
沪铝					861	
沪镍	-12403	-11940	-11492	-12452	-13570	-14188
沪锌	11563	13364	14630	13390	14355	13347
沪铅	661				-1384	-3909
螺纹钢	-19909	-11346				
铁矿石						-5422
焦煤	6362	4785	4627	3851	5041	5026
焦炭	-303	-564	-1325	-1301	-1239	-2138
豆油	-10819	-10434	-13198	-10804		-10641
棕榈油	-22542	-22302	-20306	-14054	-8967	-2140
菜籽油	-14133	-13521	-13686	-13305	-14156	-11769
豆粕	57839	48444	50060	52694	48748	50021
菜籽粕	6761	5943	4683	3688	7454	5856
棉花						
白糖	-16389	-17373	-17275	-16827	-16609	-16084
玉米						7260
鸡蛋				1446	1376	
PTA	31027	32805	34590	32819	32507	31301
聚乙烯	-7122	-7181	-7848	-7629	-5984	-8743
聚丙烯	6894	6693	7028	7866	8154	7554
甲醇	9884	8172	8654	8611	8510	
玻璃	9157	8991	9147	8521	9088	9501
橡胶		-3157		-3701		-3881
沥青	4034	4434	5426	5540	5191	5608
动力煤					1489	2412

部分机构持仓一览

机构	中信建投					
日期	2018-5-4	2018-5-7	2018-5-8	2018-5-9	2018-5-10	2018-5-11
黄金						
白银						
沪铜						
沪铝						
沪镍						
沪锌						
沪铅						
螺纹钢						
铁矿石	21171	21591	33729	33833	33541	34006
焦煤				2401		
焦炭						
豆油						
棕榈油	-8616	-8837	-14555	-14625	-14551	-14596
菜籽油					4017	
豆粕	59121	55613				
菜籽粕						
棉花		5875	5340	5066	4870	5041
白糖						
玉米	7223	8822	7760	7917	10086	9429
鸡蛋	-2600	-2434	-2371	-2177	-1980	-1924
PTA						
聚乙烯		3536	3979			
聚丙烯						
甲醇					6642	
玻璃						
橡胶		4750	4816	4693	4865	4837
沥青	-3647	-3341	-3346	-3546	-3602	-3692
动力煤						

部分机构持仓一览

机构	新潮期货					
日期	2018-5-4	2018-5-7	2018-5-8	2018-5-9	2018-5-10	2018-5-11
黄金	-814	-1082	-1073	-854	-839	-834
白银						
沪铜						
沪铝						
沪镍						
沪锌						
沪铅						
螺纹钢			17923		22683	24818
铁矿石						
焦煤						
焦炭						
豆油						
棕榈油	11879	11831	11753	12180	11843	11709
菜籽油		-4596	-5668	-5671		-5205
豆粕	-96348	-96362	-96545	-96788	-97075	-96515
菜籽粕						
棉花						
白糖						
玉米	34440	34383	35806	34726	34741	34677
鸡蛋	1600	1597	1398	1415	1614	1326
PTA	-14936	-15342	-15710		-16463	-26754
聚乙烯						4475
聚丙烯	3433	3209				
甲醇						
玻璃						
橡胶	-6132	-6136	-6017	-6018	-6076	-6073
沥青	-5139			-5481	-5207	-5682
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

