



市场持仓分析

2018/5/15

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
螺纹钢	33.41%	30.64%	17.15%	-3.56%	-3.60%	-2.33%	36.97%	☆☆☆☆
铁矿石	15.54%	7.28%	-0.32%	-15.82%	-13.32%	-5.07%	31.36%	☆☆☆☆
甲醇	11.43%	7.44%	4.97%	-17.00%	-10.83%	-6.14%	28.42%	☆☆☆☆
聚丙烯	14.02%	9.49%	4.56%	-0.29%	0.94%	1.40%	14.31%	☆☆☆
鸡蛋	4.20%	-1.57%	-2.31%	-9.98%	-3.27%	3.15%	14.18%	☆☆☆
沪镍	0.22%	-2.05%	-10.14%	-9.82%	-9.68%	-7.60%	10.04%	☆☆☆
沪锌	-8.19%	-9.28%	-10.54%	-16.83%	-15.55%	-13.21%	8.64%	☆☆
沪铝	-0.25%	-0.11%	-6.01%	-8.34%	-6.54%	-6.05%	8.10%	☆☆
玉米	7.17%	8.41%	9.47%	-0.28%	0.41%	2.59%	7.45%	☆☆
沪银	-1.42%	-2.54%	-1.21%	-6.83%	-2.78%	-1.40%	5.41%	☆☆
橡胶	3.44%	2.75%	11.30%	-0.78%	-1.32%	3.61%	4.22%	☆
白糖	4.21%	3.35%	3.45%	0.38%	1.83%	-0.54%	3.83%	☆
沪铜	1.24%	1.80%	3.00%	-2.14%	1.31%	-0.18%	3.37%	☆
玻璃	2.09%	-3.91%	3.38%	1.38%	2.90%	10.24%	0.71%	☆
豆粕	-2.64%	-2.38%	-2.44%	-2.25%	-4.74%	-5.07%	-0.39%	☆
动力煤	-3.24%	-4.98%	-4.30%	-1.93%	-0.69%	-8.43%	-1.32%	☆
棉花	1.26%	2.02%	2.30%	3.07%	2.56%	-1.67%	-1.81%	☆
聚乙烯	-1.02%	-0.54%	1.46%	1.15%	0.82%	5.42%	-2.17%	☆
豆油	-2.53%	-2.55%	-1.31%	0.66%	-1.33%	-2.18%	-3.19%	☆
沪金	-0.08%	3.13%	3.30%	4.21%	4.10%	13.76%	-4.29%	☆
棕榈油	0.97%	0.13%	3.29%	5.52%	2.42%	5.73%	-4.55%	☆
PTA	-17.09%	-13.40%	-5.85%	-7.77%	-4.73%	-0.13%	-9.31%	☆☆
沥青	-4.34%	-3.24%	-2.35%	7.35%	5.79%	2.81%	-11.69%	☆☆☆
菜籽粕	-8.09%	-5.59%	-6.65%	4.45%	3.70%	3.18%	-12.54%	☆☆☆
焦煤	-0.28%	-2.79%	-4.25%	19.96%	17.35%	5.65%	-20.24%	☆☆☆☆
焦炭	-11.42%	-7.12%	2.78%	14.19%	27.39%	32.39%	-25.61%	☆☆☆☆

近5日持仓变化

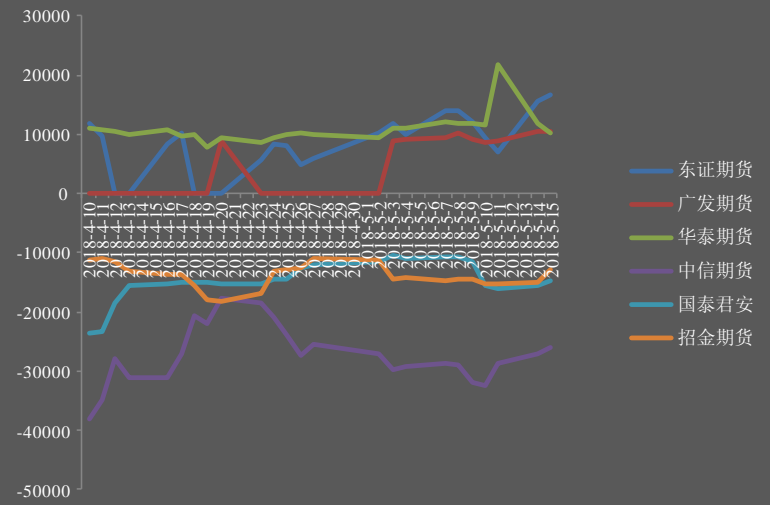
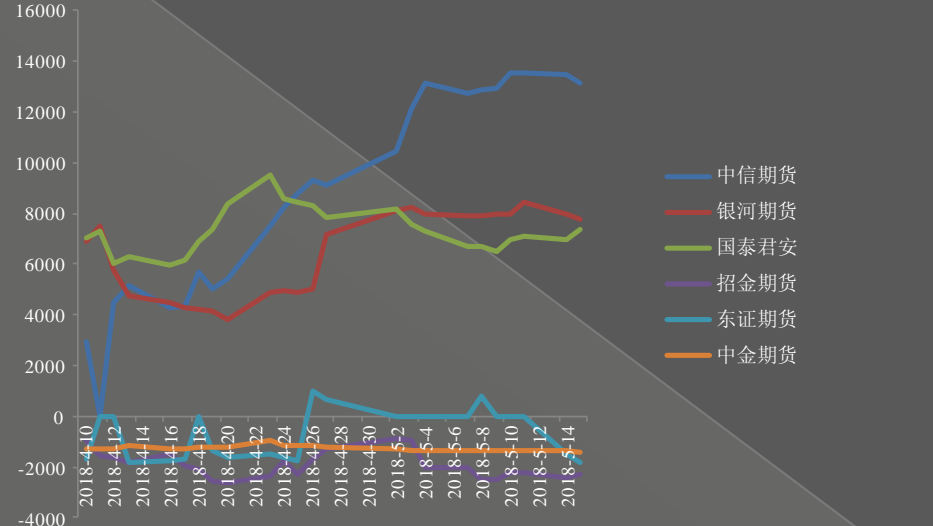
品种	五日变化						近五日头寸变化参考	
	净多前3	净多前5	净多前10	净空前3	净空前5	净空前10	净多前3-净空前3	指标参考
铁矿石	25.30%	2.13%	-27.44%	-35.81%	-30.92%	-23.78%	61.10%	☆☆☆☆
甲醇	16.02%	16.13%	15.31%	-32.88%	-20.71%	-15.10%	48.90%	☆☆☆
玉米	26.98%	24.31%	11.54%	0.54%	8.03%	9.43%	26.45%	☆☆
沪铝	2.48%	1.79%	-2.46%	-22.25%	-17.64%	-15.80%	24.72%	☆☆
焦炭	32.86%	30.33%	14.84%	11.45%	10.09%	10.95%	21.40%	☆☆
沪镍	2.74%	-0.39%	-9.39%	-16.33%	-15.92%	-15.37%	19.07%	☆☆
棕榈油	25.50%	25.87%	28.34%	6.65%	-1.23%	0.87%	18.86%	☆☆
沪锌	-6.29%	-3.49%	-3.46%	-22.82%	-17.39%	-9.77%	16.53%	☆☆
鸡蛋	4.02%	0.21%	-0.99%	-9.26%	-0.94%	9.44%	13.28%	☆☆
PTA	27.26%	20.21%	13.30%	16.02%	12.30%	13.46%	11.24%	☆☆
沪铜	4.92%	9.19%	4.95%	-3.08%	-1.01%	-7.95%	8.00%	☆
橡胶	16.58%	13.27%	8.78%	10.24%	5.14%	6.98%	6.34%	☆
螺纹钢	9.33%	9.80%	9.29%	5.67%	3.20%	-1.33%	3.66%	☆
豆粕	4.23%	2.42%	0.42%	0.71%	0.29%	-0.06%	3.52%	☆
沪银	2.38%	-1.70%	-1.13%	-0.89%	-3.01%	-1.41%	3.28%	☆
沪金	3.33%	3.32%	-0.14%	0.55%	3.39%	21.24%	2.79%	☆
棉花	15.75%	12.24%	7.34%	15.11%	8.66%	6.61%	0.64%	☆
沥青	-5.86%	-5.37%	-1.30%	-4.55%	-2.31%	1.34%	-1.31%	☆
动力煤	-24.16%	-26.72%	-24.30%	-22.53%	-18.84%	-23.21%	-1.63%	☆
菜籽粕	4.11%	-4.53%	-10.51%	6.76%	6.02%	3.25%	-2.65%	☆
白糖	9.06%	5.86%	5.44%	11.91%	12.60%	11.59%	-2.84%	☆
玻璃	13.01%	25.11%	24.60%	18.25%	17.72%	11.72%	-5.24%	☆
聚乙烯	-15.33%	-13.10%	-11.60%	-9.29%	-3.43%	2.28%	-6.04%	☆
豆油	-7.14%	-2.62%	-4.26%	-0.44%	-1.47%	-1.97%	-6.70%	☆
聚丙烯	-31.49%	-21.73%	-7.37%	-2.86%	-2.57%	-2.41%	-28.63%	☆☆
焦煤	11.11%	10.32%	8.31%	59.51%	45.48%	21.13%	-48.40%	☆☆☆

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。

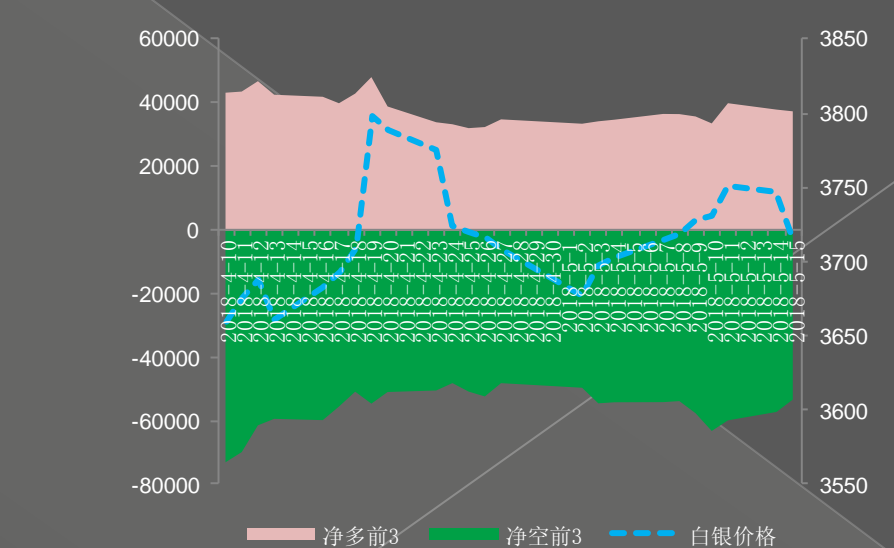
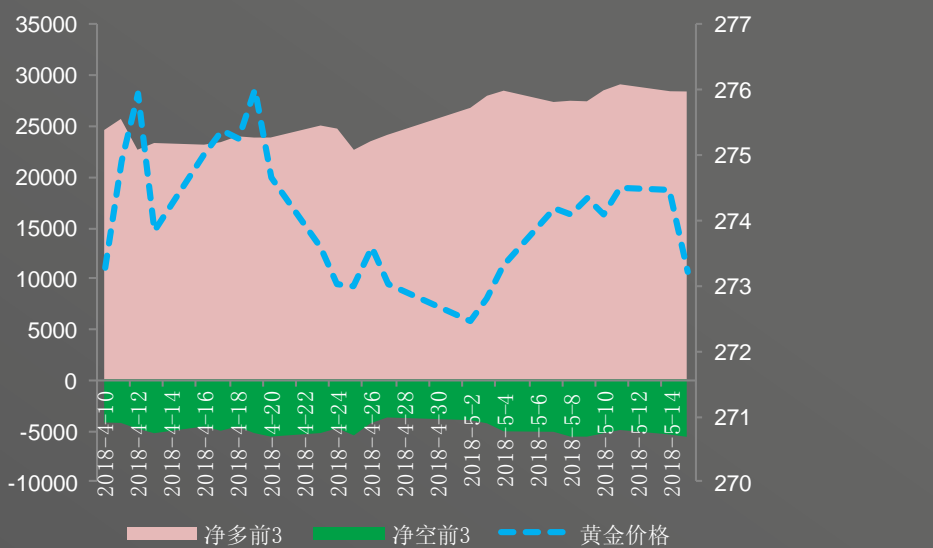
绝对值 $\geq 50\%$	$20\% \leq \text{绝对值} < 50\%$	$10\% \leq \text{绝对值} < 20\%$	$5\% \leq \text{绝对值} < 10\%$	绝对值 $< 5\%$
☆☆☆☆☆	☆☆☆☆	☆☆☆	☆☆	☆

金属板块：AU & AG



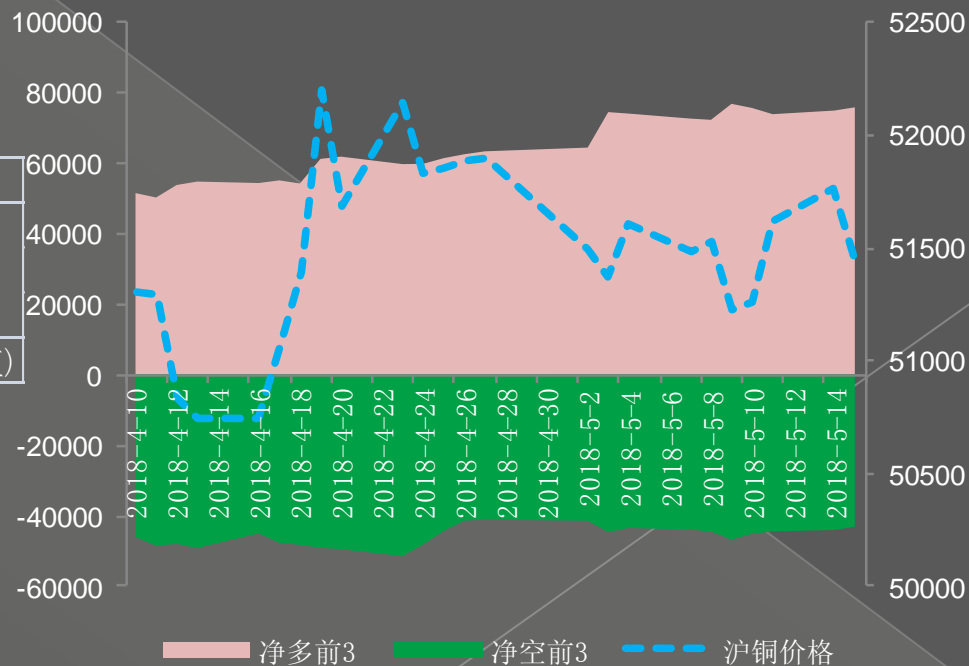
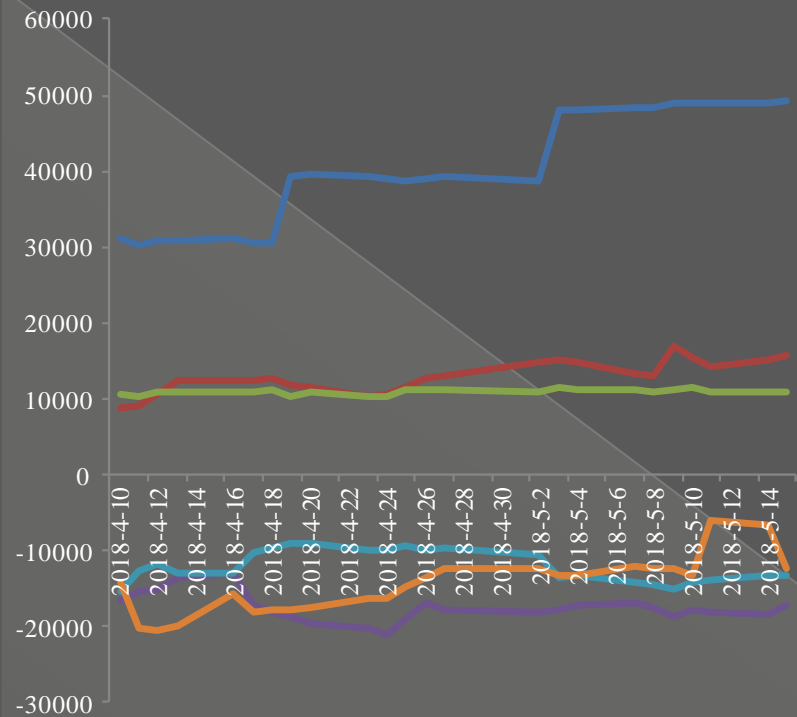
变动幅度		当日	最近5日	平均变化	波动率
au持仓	多头前3	-0.08%	3.33%	0.67%	4.88%
	空头前3	4.21%	0.55%	0.11%	
au涨幅		-0.46%	-0.33%	-0.07%	
震荡幅度	0.57%	0.47%(月均值)	投机度	0.27	0.44(月均值)

变动幅度		当日	最近5日	平均变化	波动率
ag持仓	多头前3	-1.42%	2.38%	0.48%	12.75%
	空头前3	-6.83%	-0.89%	-0.18%	
ag涨幅		-0.92%	-0.16%	-0.03%	
震荡幅度	1.02%	0.69%(月均值)	投机度	0.43	0.46(月均值)



金属板块：Cu

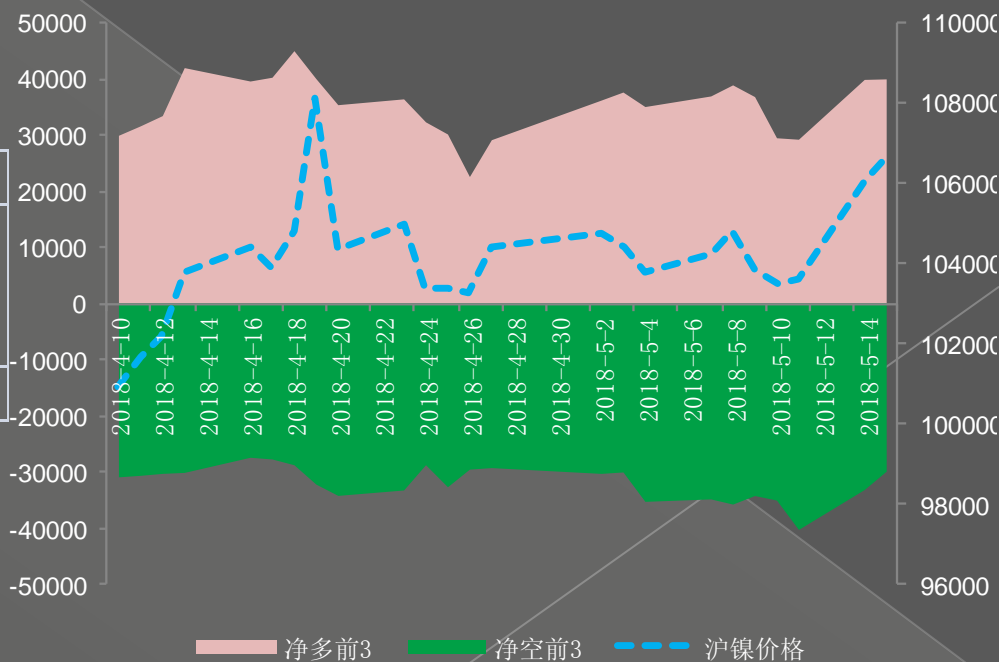
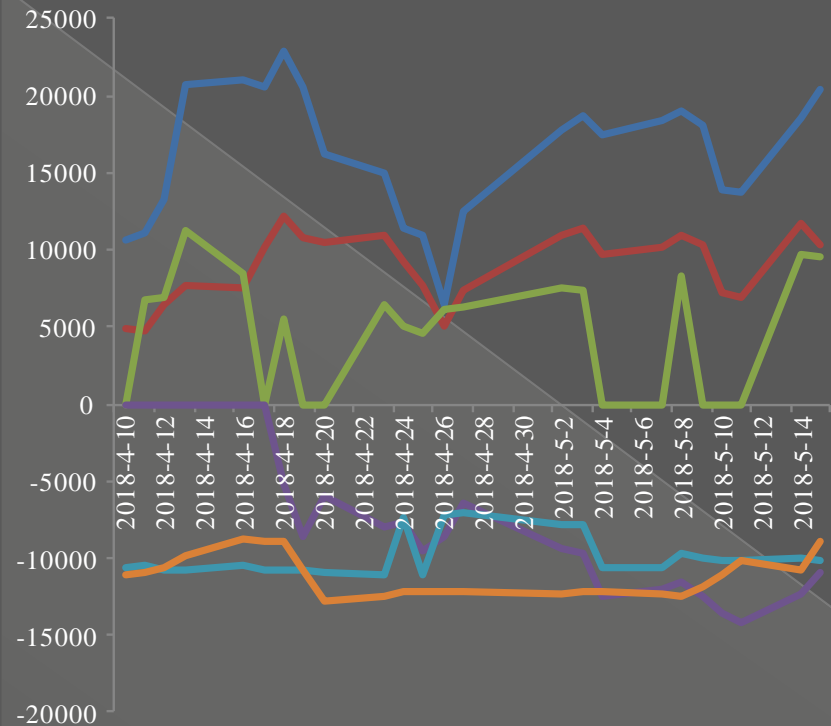
- 格林大华
- 金瑞期货
- 弘业期货
- 五矿经易
- 中信期货
- 海通期货



变动幅度		当日	最近5日	平均变化	波动率
cu持仓	多头前3	1.24%	4.92%	0.98%	12.51%
	空头前3	-2.14%	-3.08%	-0.62%	
cu涨幅		-0.67%	-0.20%	-0.04%	
震荡幅度	0.75%	0.99%(月均值)	投机度	0.43	0.49(月均值)

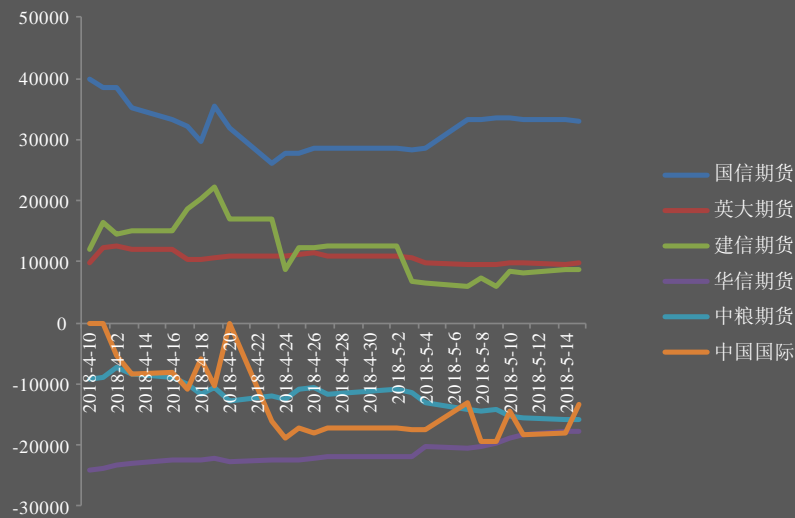
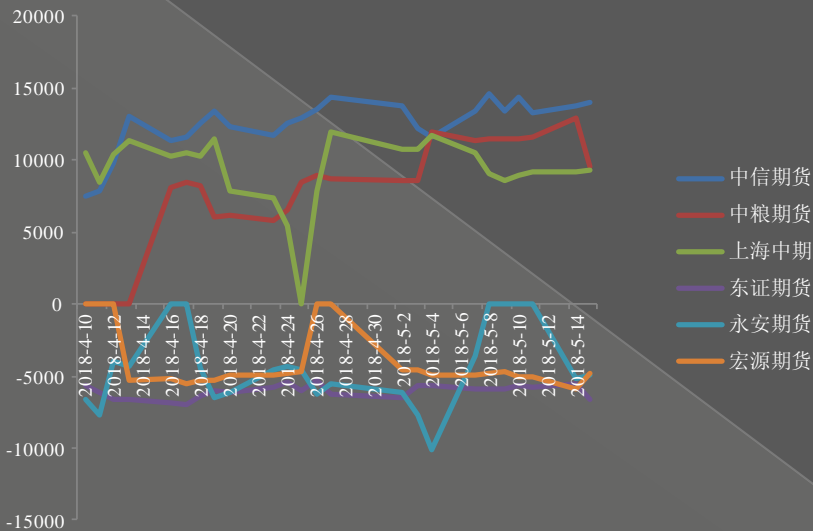
金属板块：Ni

- 永安期货
- 海通期货
- 兴证期货
- 中信期货
- 建信期货
- 兴业期货



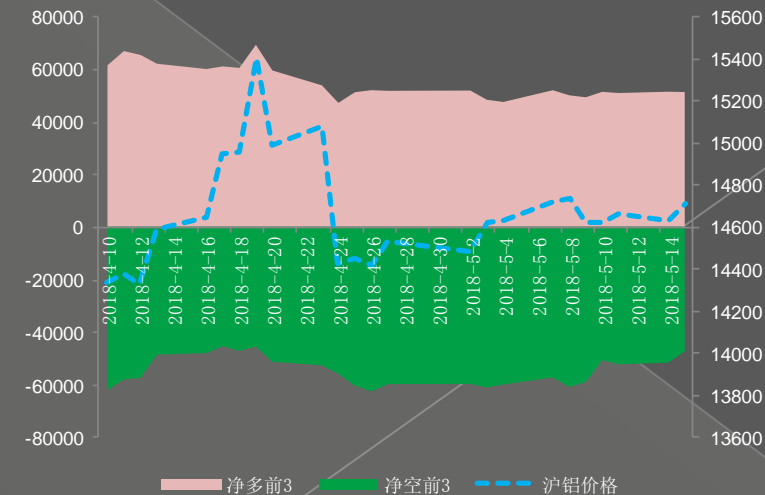
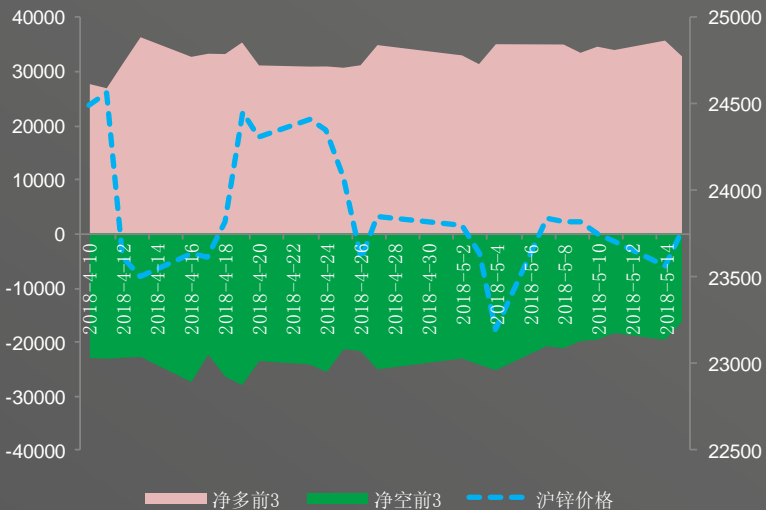
变动幅度		当日	最近5日	平均变化	波动率
ni 持仓	多头前3	0.22%	2.74%	0.55%	21.54%
	空头前3	-9.82%	-16.33%	-3.27%	
ni 涨幅		0.60%	1.79%	0.36%	
震荡幅度	1.44%	1.82%(月均值)	投机度	1.26	1.68(月均值)

金属板块：Zn & Al

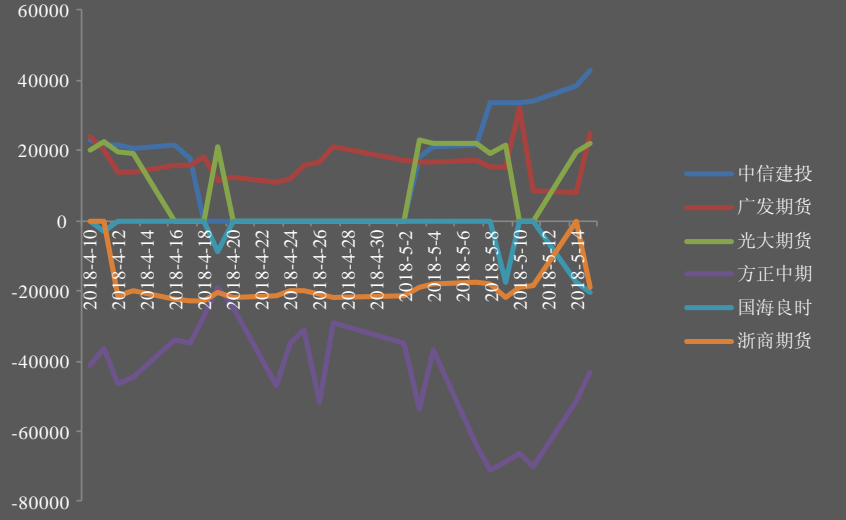
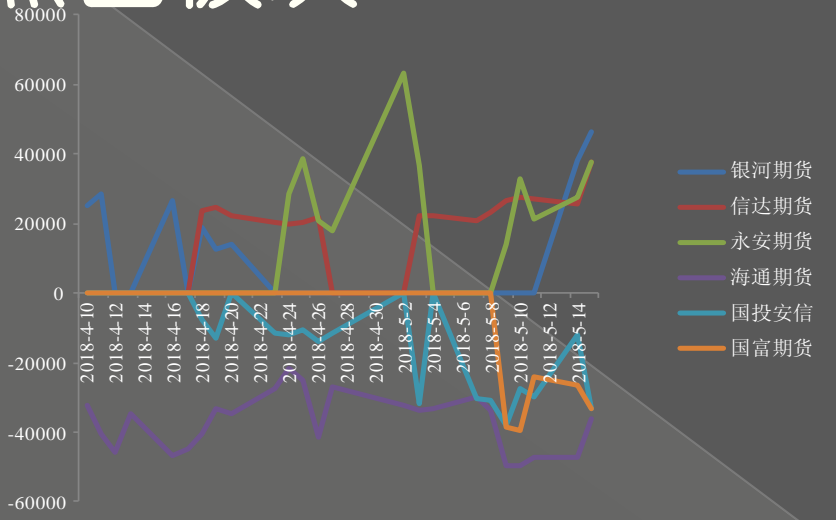


变动幅度		当日	最近5日	平均变化	波动率
zn持仓	多头前3	-8.19%	-6.29%	-1.26%	21.94%
	空头前3	-16.83%	-22.82%	-4.56%	
zn涨幅		0.92%	-0.17%	-0.03%	
震荡幅度	1.39%	1.72%(月均值)	投机度	1.22	1.27(月均值)

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%	2.48%	0.50%	24.00%
	空头前3	-8.34%	-22.25%	-4.45%	
al涨幅		0.56%	-0.19%	-0.04%	
震荡幅度	0.75%	1.30%(月均值)	投机度	0.38	0.65(月均值)

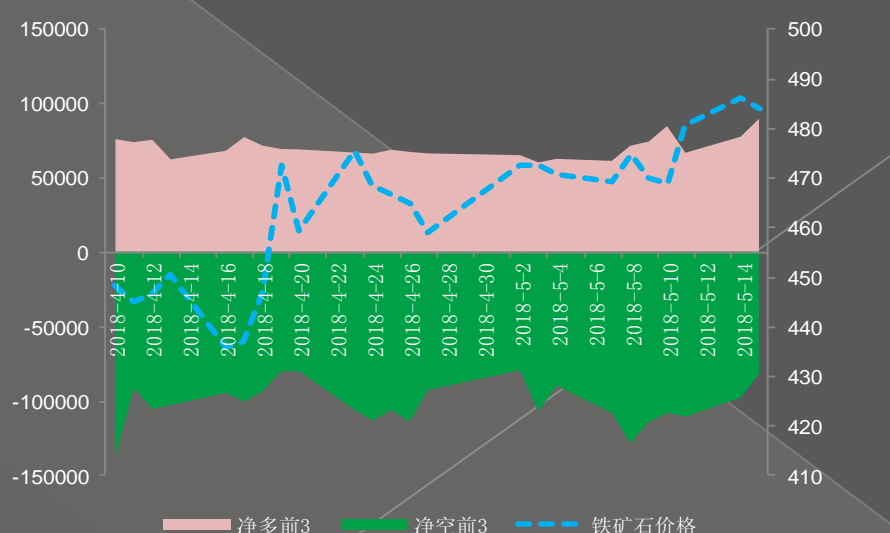
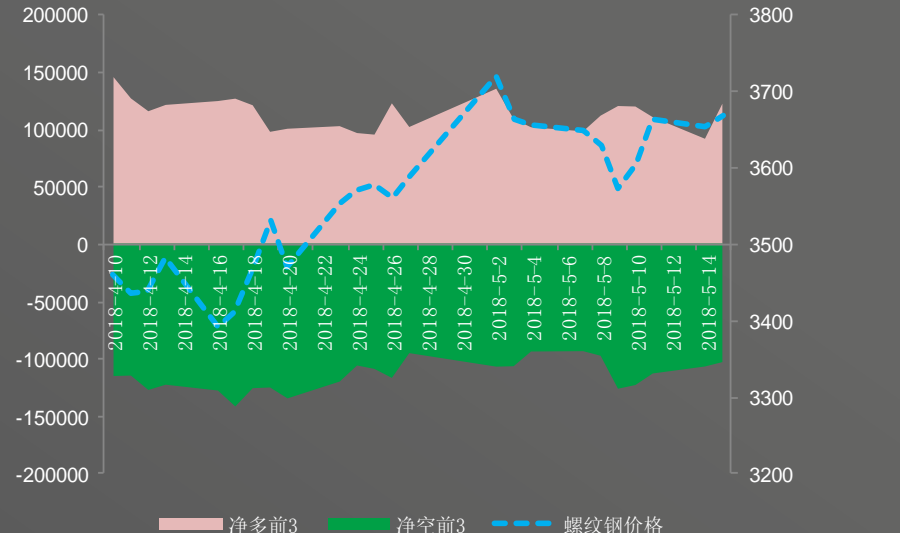


黑色板块：Rb & I

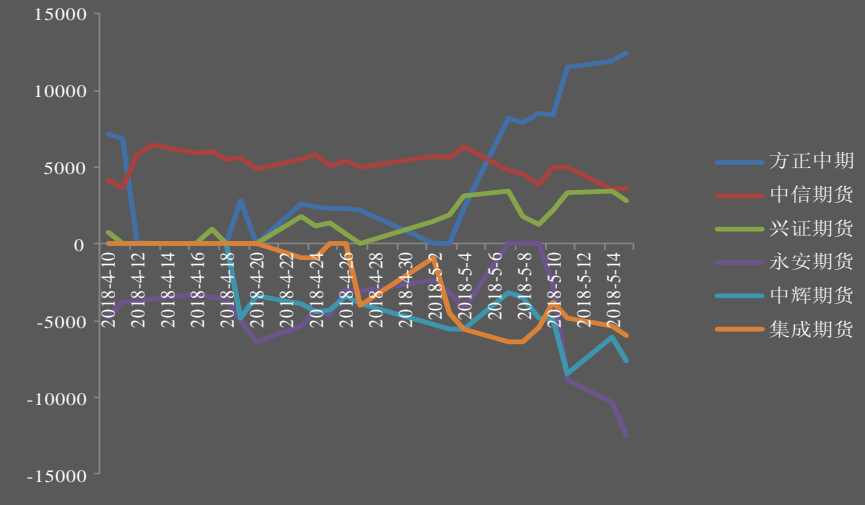
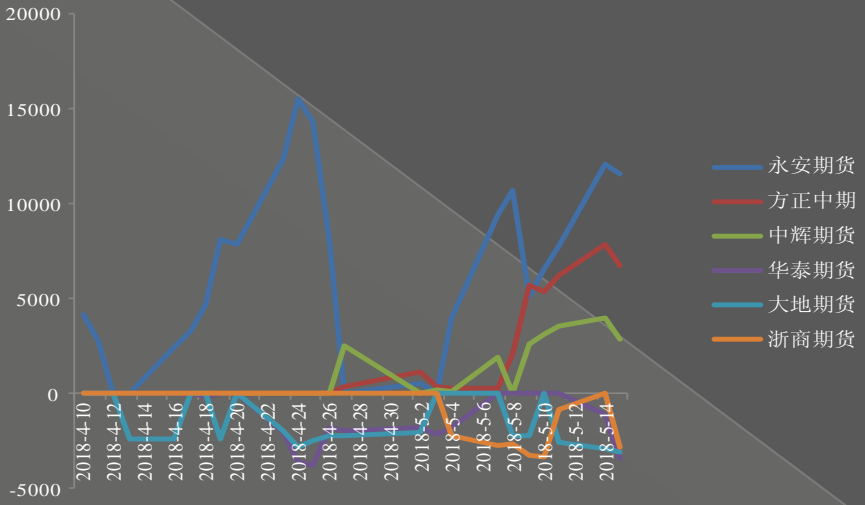


变动幅度		当日	最近5日	平均变化	波动率
rb持仓	多头前3	33.41%	9.33%	1.87%	25.02%
	空头前3	-3.56%	5.67%	1.13%	
rb涨幅		0.39%	1.12%	0.22%	
震荡幅度	2.13%	1.87%(月均值)	投机度	1.61	1.38(月均值)

变动幅度		当日	最近5日	平均变化	波动率
I持仓	多头前3	15.54%	25.30%	5.06%	32.96%
	空头前3	-15.82%	-35.81%	-7.16%	
I涨幅		-0.46%	1.92%	0.38%	
震荡幅度	2.91%	2.79%(月均值)	投机度	1.52	1.41(月均值)

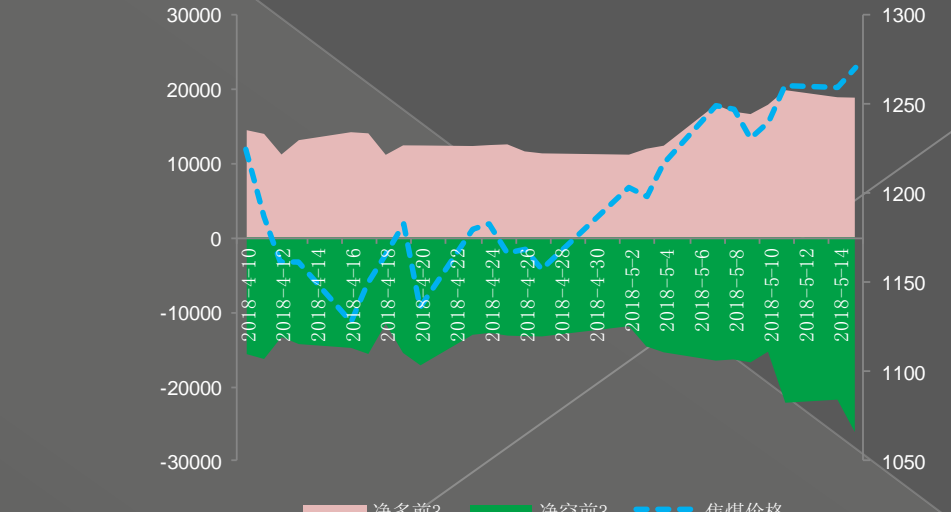
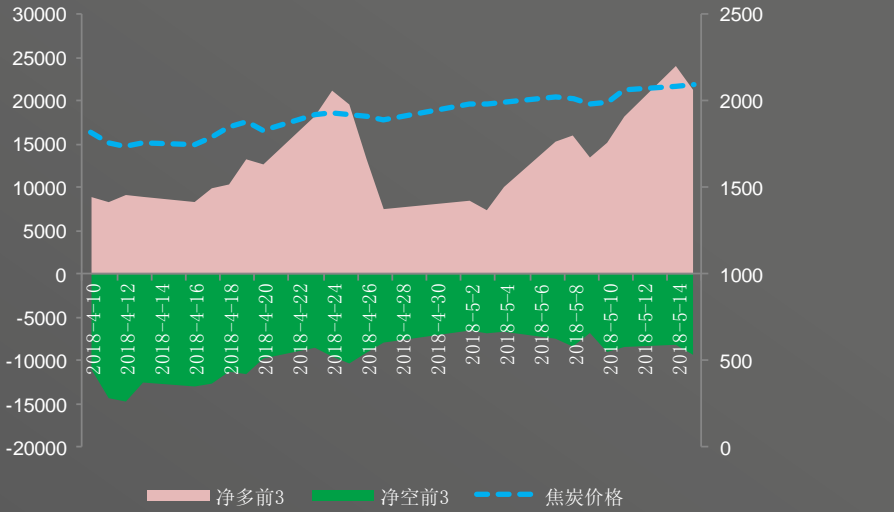


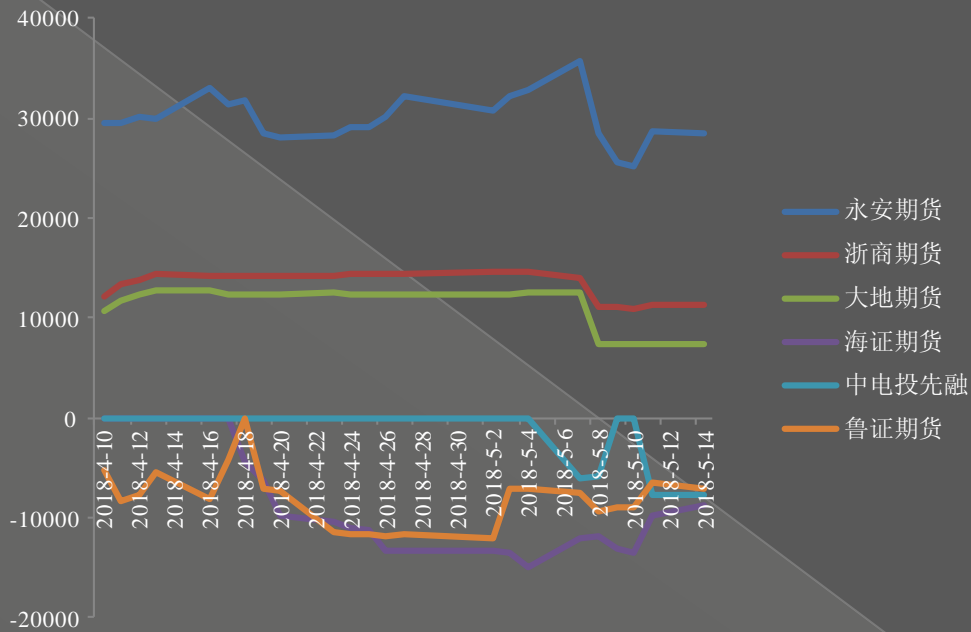
黑色板块：J & JM



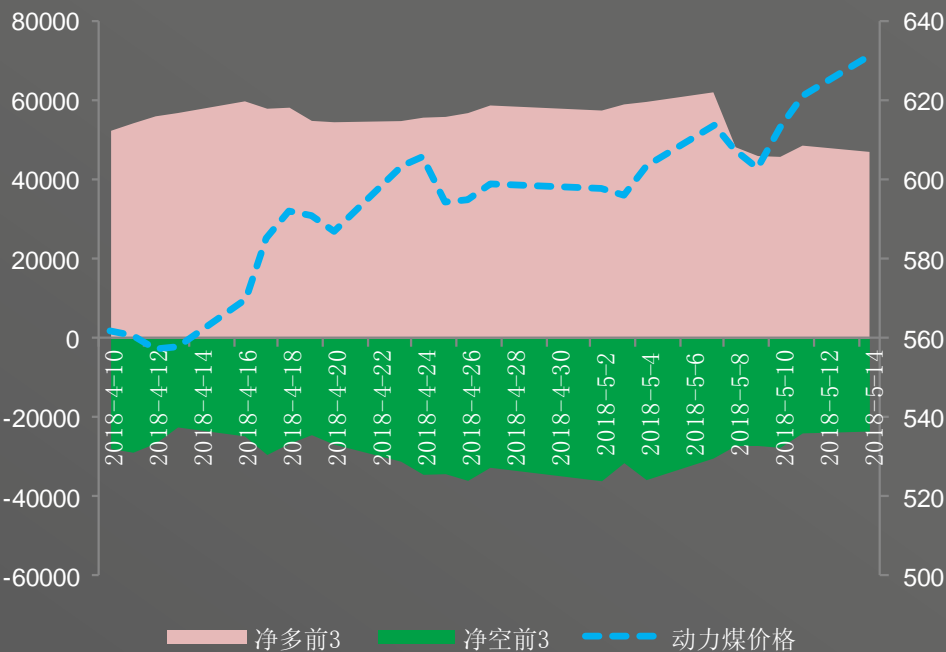
变动幅度		当日	最近5日	平均变化	波动率
j持仓	多头前3	-11.42%	32.86%	6.57%	38.57%
	空头前3	14.19%	11.45%	2.29%	
j涨幅		0.89%	4.05%	0.81%	
震荡幅度	3.31%	2.82%(月均值)	投机度	1.57	1.47(月均值)

变动幅度		当日	最近5日	平均变化	波动率
jm持仓	多头前3	-0.28%	11.11%	2.22%	30.19%
	空头前3	19.96%	59.51%	11.90%	
jm涨幅		0.88%	1.86%	0.37%	
震荡幅度	3.68%	2.92%(月均值)	投机度	1.46	1.30(月均值)



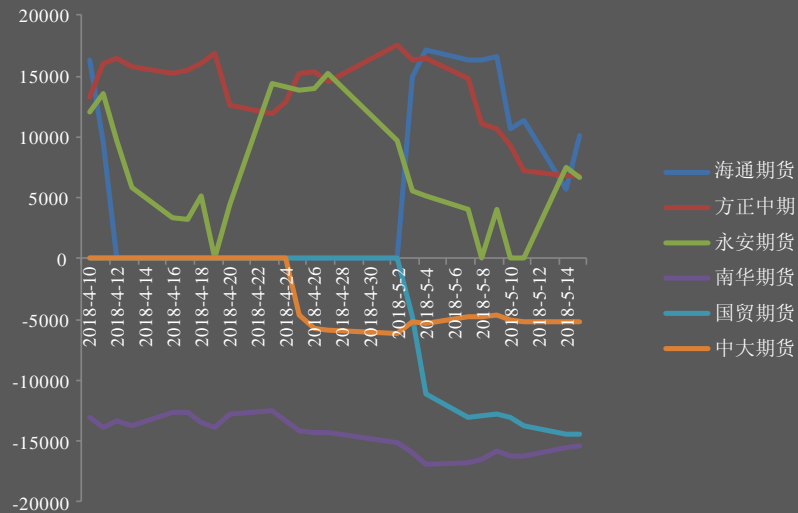
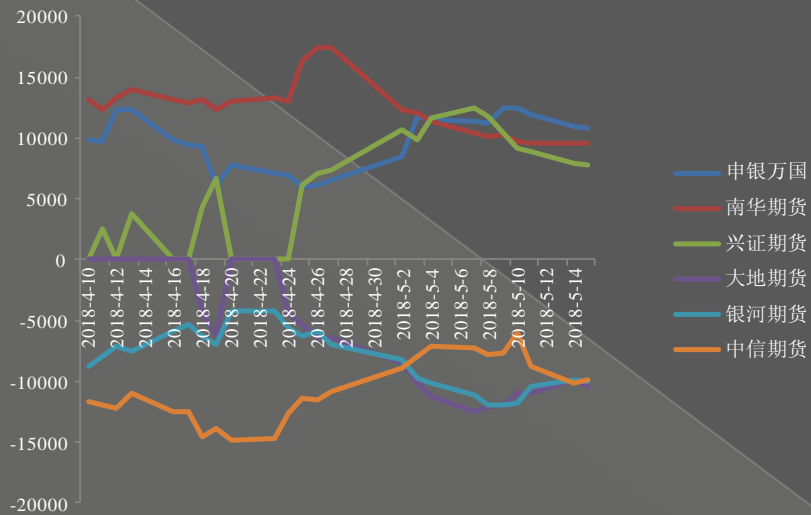


黑色：动力煤



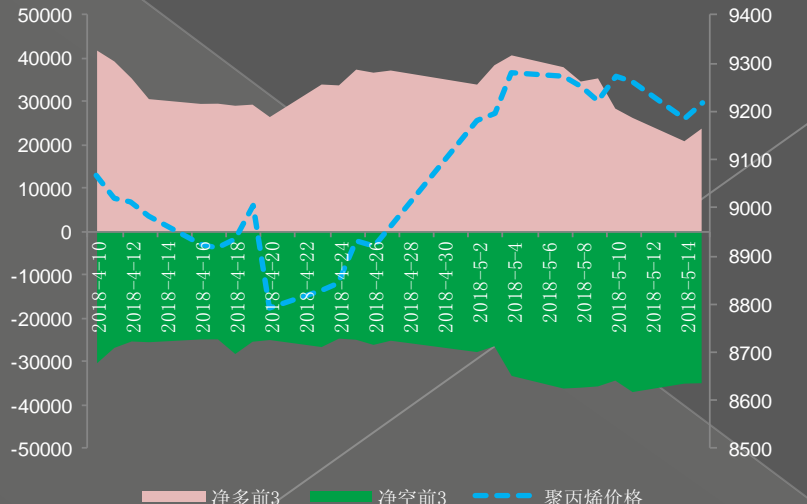
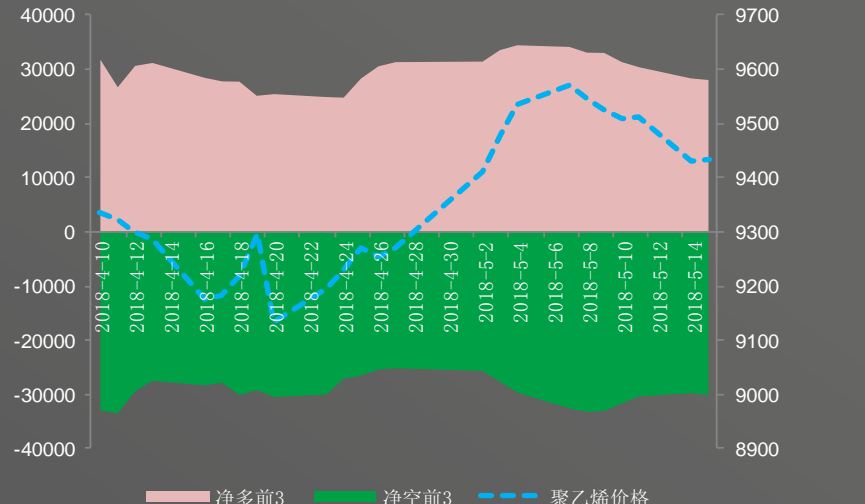
变动幅度		当日	最近5日	平均变化	波动率
zc持仓	多头前3	-3.24%	-24.16%	-4.83%	27.55%
	空头前3	-1.93%	-22.53%	-4.51%	
zc涨幅		1.64%	2.88%	0.58%	
震荡幅度	2.18%	1.84% (月均值)	投机度	1.39	0.82 (月均值)

化工：塑料 & PP

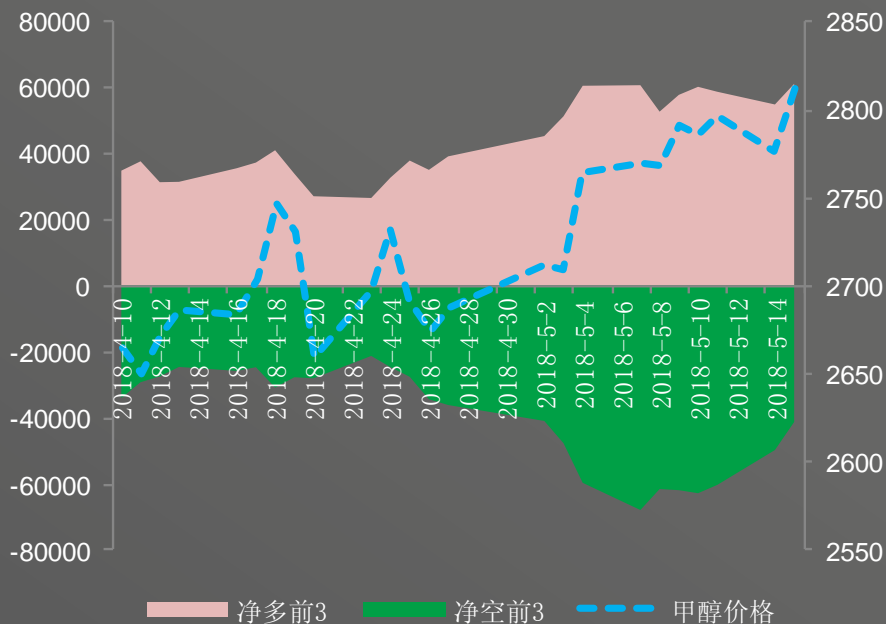
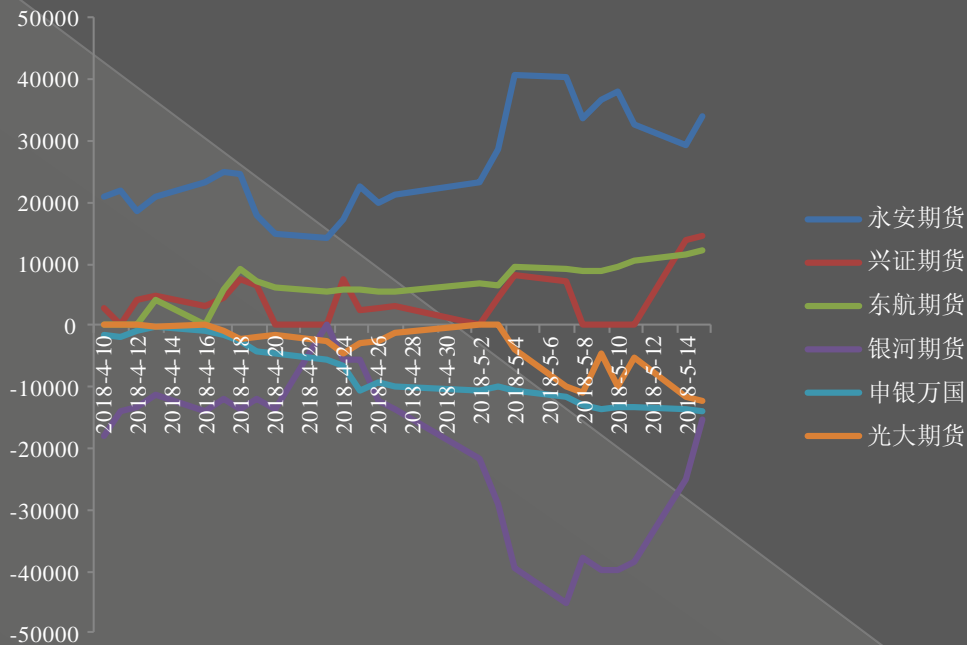


变动幅度		当日	最近5日	平均变化	波动率
I持仓	多头前3	-1.02%	-15.33%	-3.07%	11.49%
	空头前3	1.15%	-9.29%	-1.86%	
I涨幅		0.00%	-1.18%	-0.24%	
震荡幅度	0.68%	1.09% (月均值)	投机度	0.37	0.59 (月均值)

变动幅度		当日	最近5日	平均变化	波动率
pp持仓	多头前3	14.02%	-31.49%	-6.30%	15.03%
	空头前3	-0.29%	-2.86%	-0.57%	
pp涨幅		0.36%	-0.34%	-0.07%	
震荡幅度	0.86%	1.24% (月均值)	投机度	0.54	0.75 (月均值)

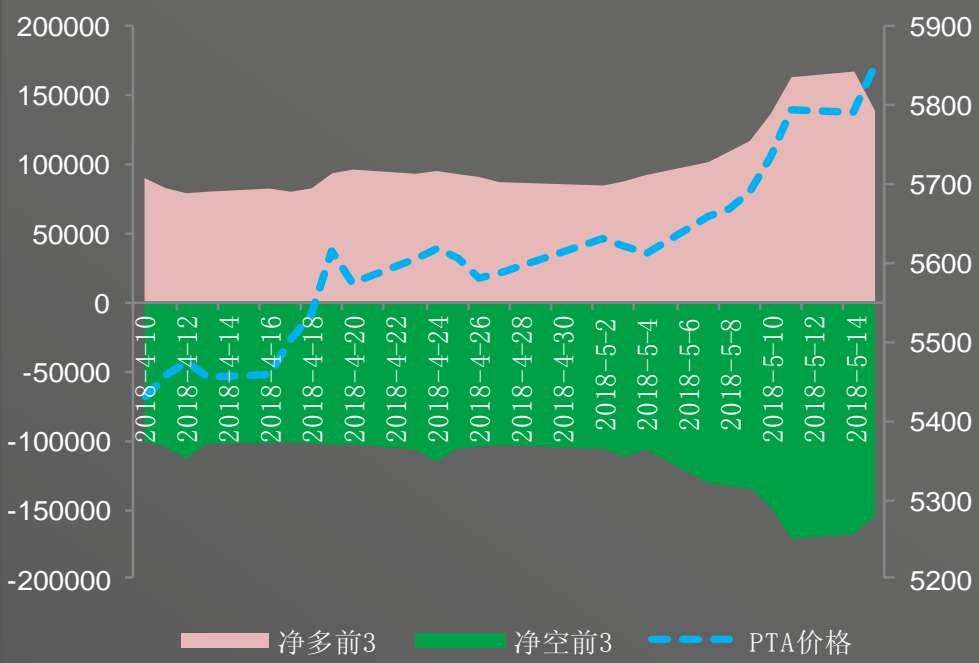
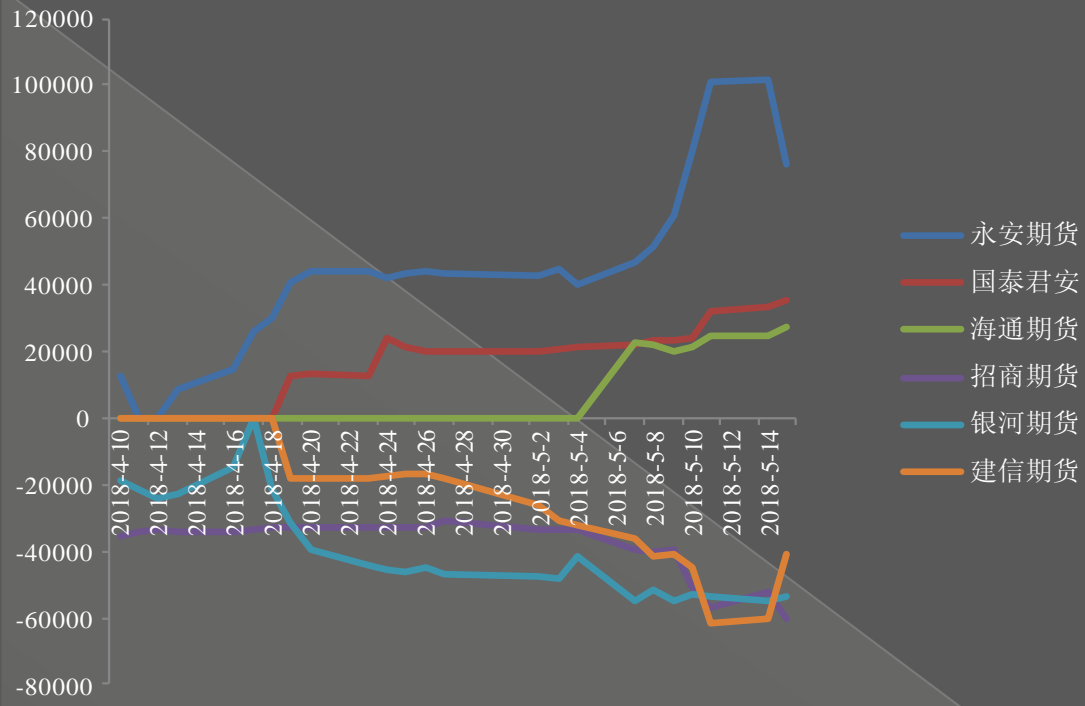


化工：甲醇



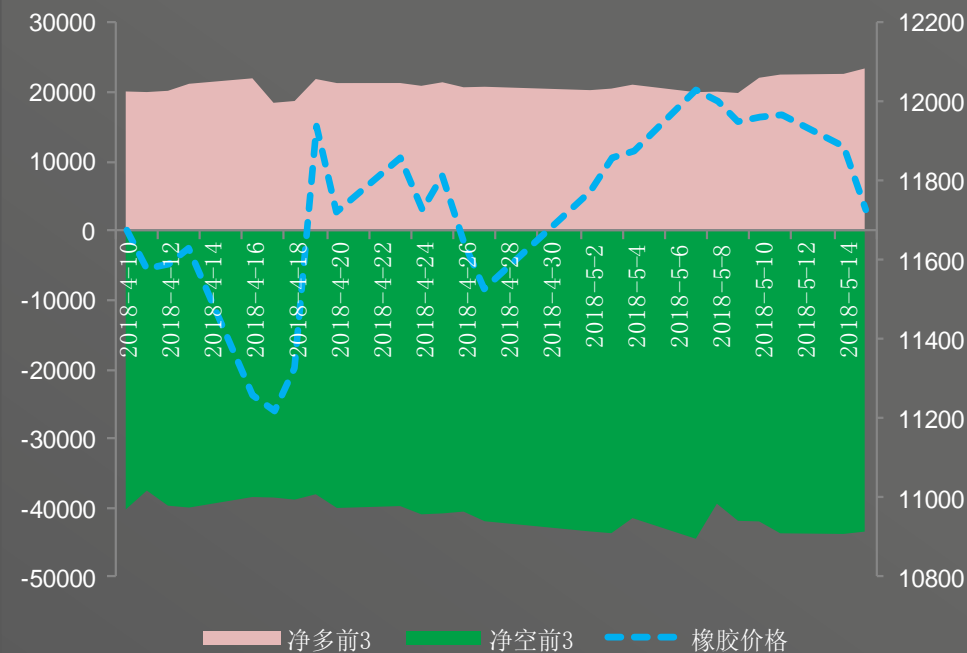
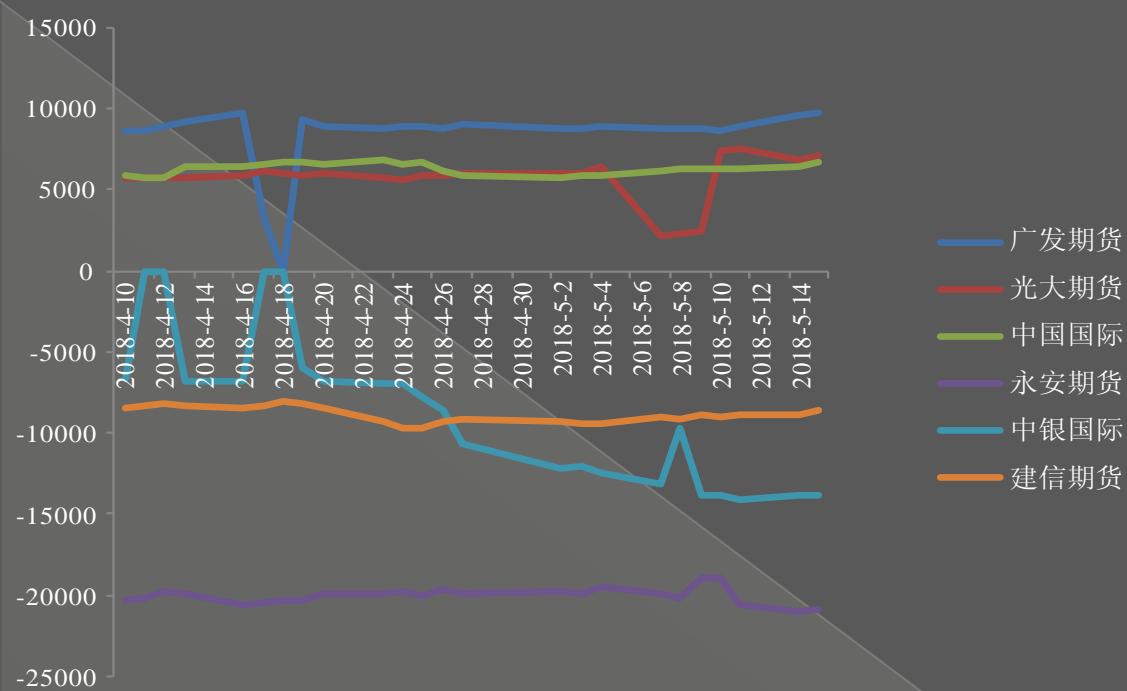
变动幅度		当日	最近5日	平均变化	波动率
ma持仓	多头前3	11.43%	16.02%	3.20%	17.22%
	空头前3	-17.00%	-32.88%	-6.58%	
ma涨幅		1.31%	1.58%	0.32%	
震荡幅度	1.75%	1.66%(月均值)	投机度	0.80	0.97(月均值)

化工：PTA



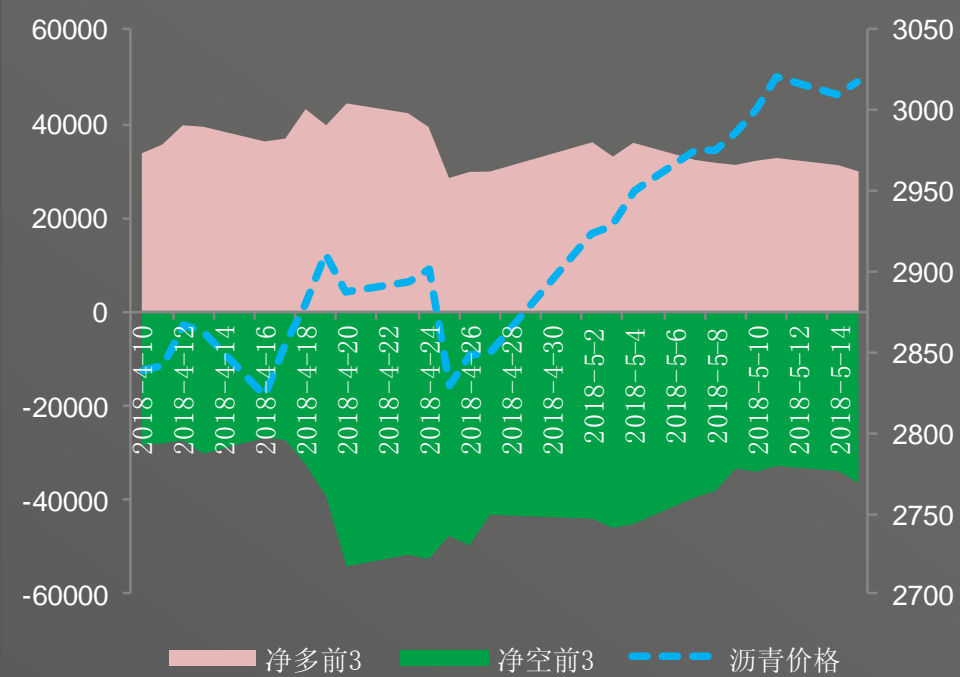
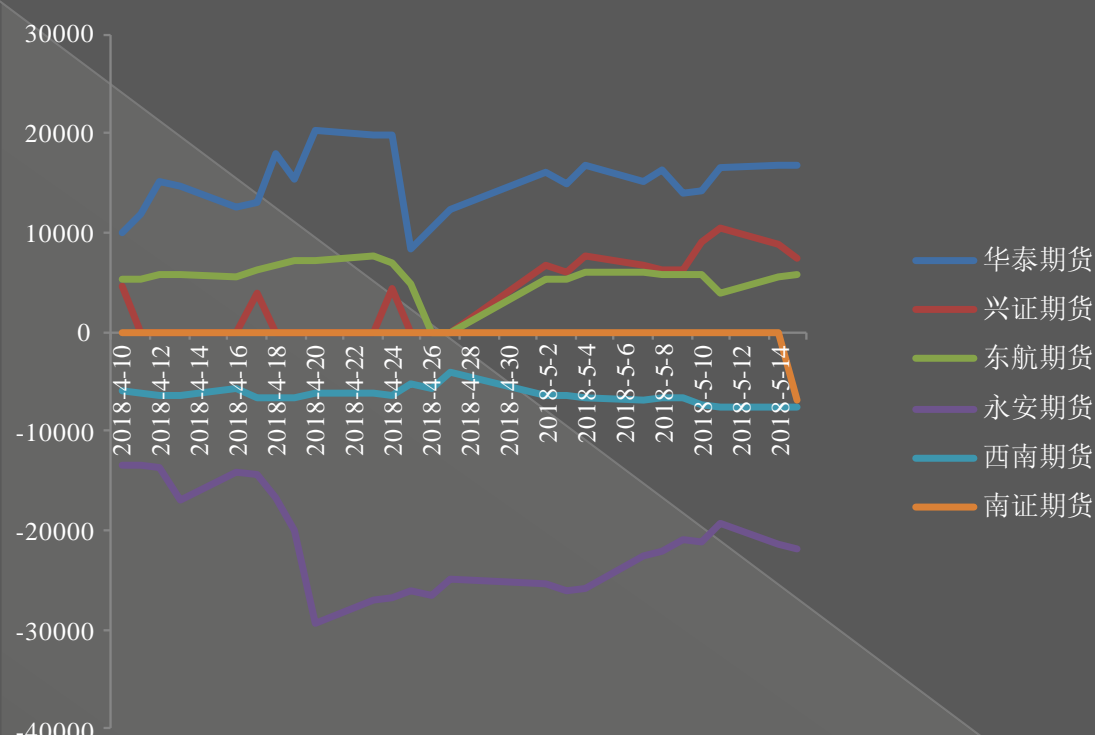
变动幅度		当日	最近5日	平均变化	波动率
pta持仓	多头前3	-17.09%	27.26%	5.45%	10.60%
	空头前3	-7.77%	16.02%	3.20%	
pta涨幅		0.95%	3.16%	0.63%	
震荡幅度	1.16%	1.09%(月均值)	投机度	0.41	0.43(月均值)

化工：橡胶



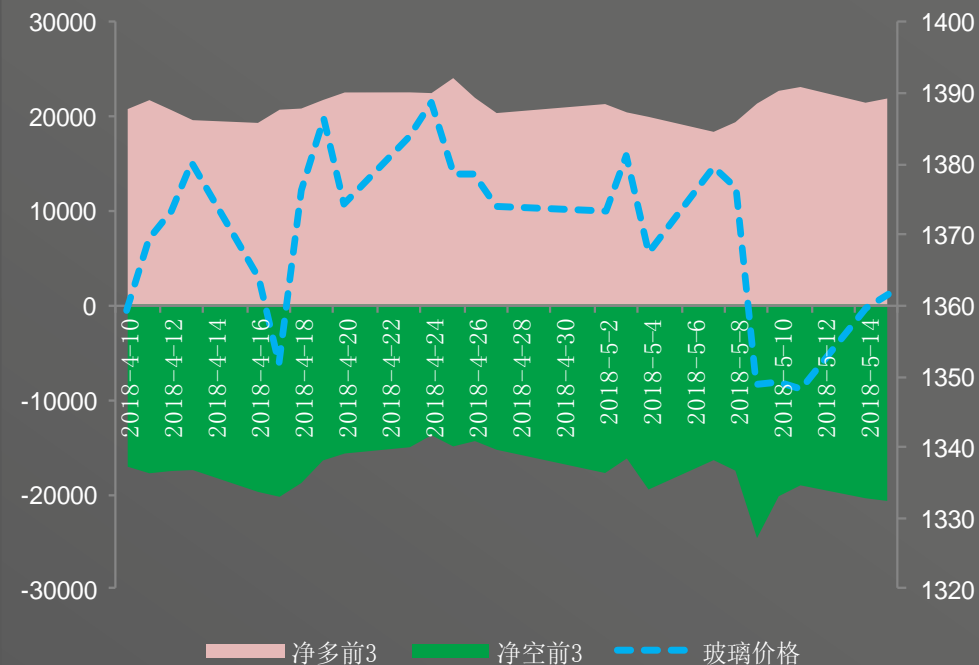
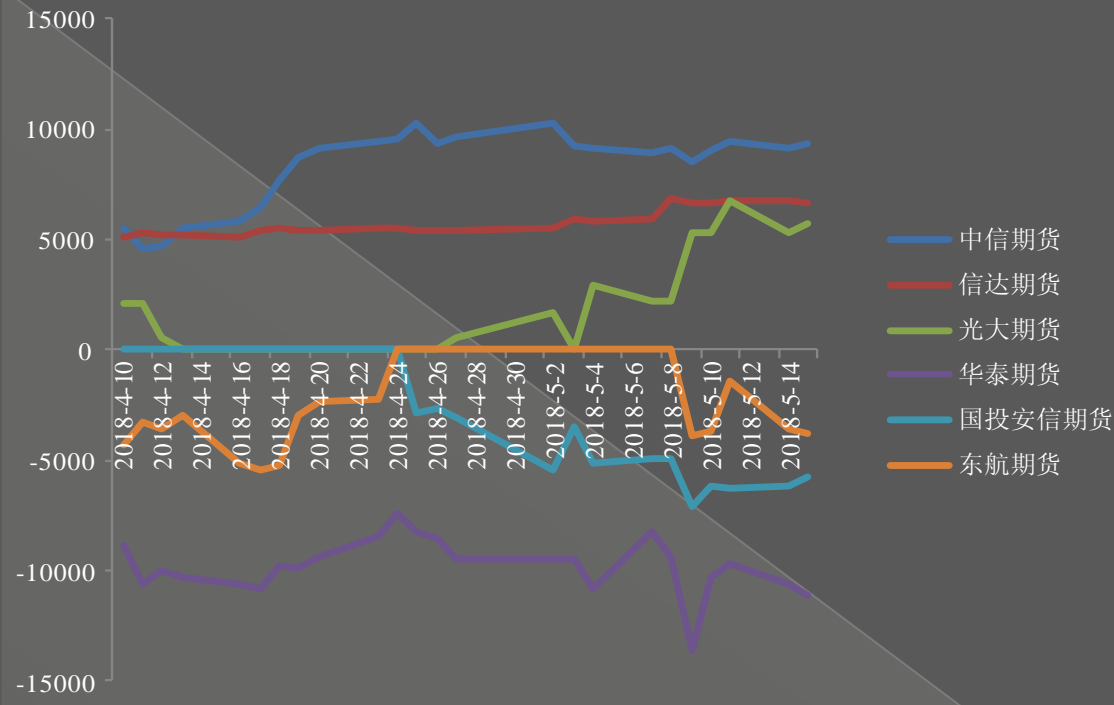
变动幅度		当日	最近5日	平均变化	波动率
ru持仓	多头前3	3.44%	16.58%	3.32%	24.88%
	空头前3	-0.78%	10.24%	2.05%	
ru涨幅		-1.37%	-2.28%	-0.46%	
震荡幅度	2.84%	2.01%(月均值)	投机度	1.11	0.88(月均值)

化工：沥青



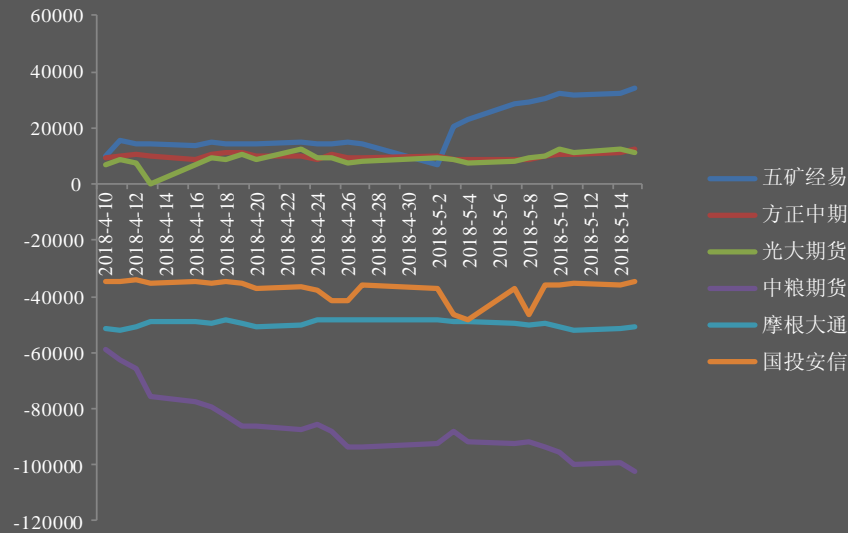
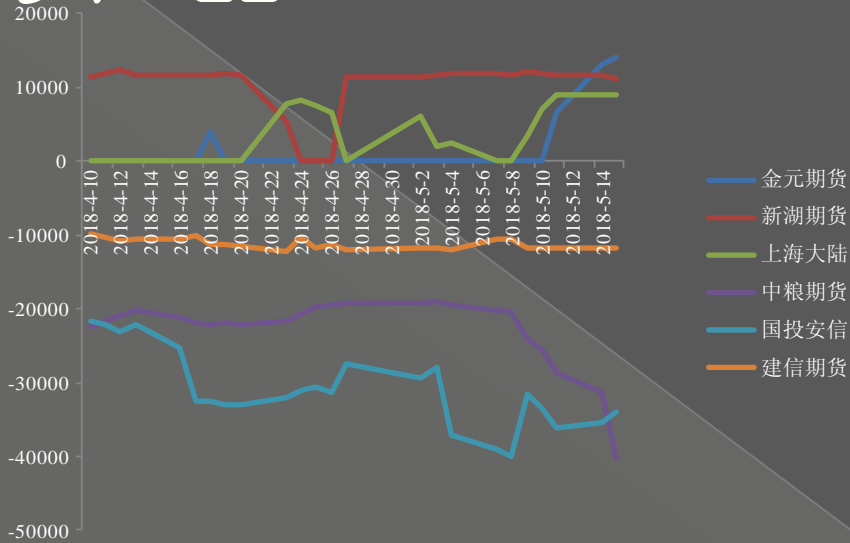
变动幅度		当日	最近5日	平均变化	波动率
bu持仓	多头前3	-4.34%	-5.86%	-1.17%	15.98%
	空头前3	7.35%	-4.55%	-0.91%	
bu涨幅		0.26%	1.44%	0.29%	
震荡幅度	1.19%	1.47%(月均值)	投机度	0.78	0.81(月均值)

化工：玻璃



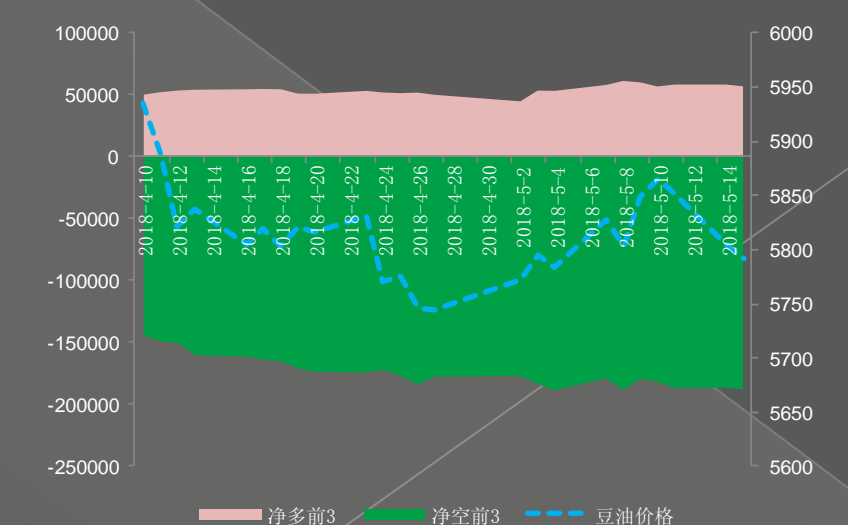
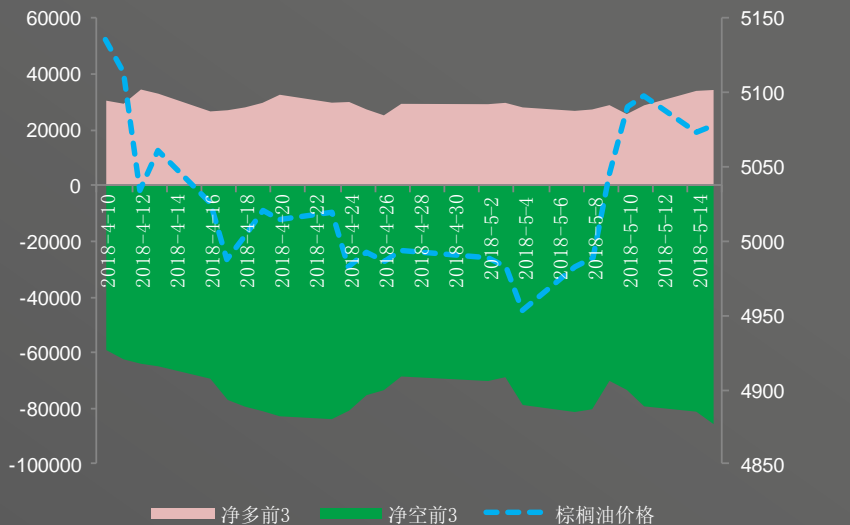
变动幅度		当日	最近5日	平均变化	波动率
fg持仓	多头前3	2.09%	13.01%	2.60%	13.57%
	空头前3	1.38%	18.25%	3.65%	
fg涨幅		0.15%	-1.09%	-0.22%	
震荡幅度	1.21%	1.31%(月均值)	投机度	0.69	0.57(月均值)

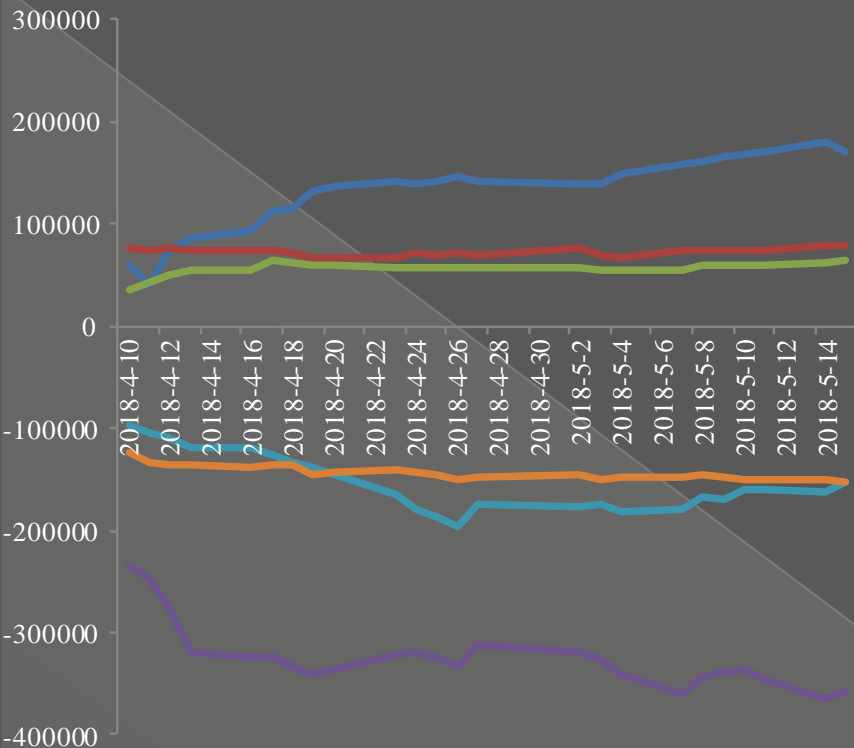
农产品：P & Y



变动幅度		当日	最近5日	平均变化	波动率
p持仓	多头前3	0.97%	25.50%	5.10%	10.76%
	空头前3	5.52%	6.65%	1.33%	
p涨幅		0.10%	1.79%	0.36%	
震荡幅度	0.80%	0.85%(月均值)	投机度	0.43	0.48(月均值)

变动幅度		当日	最近5日	平均变化	波动率
y持仓	多头前3	-2.53%	-7.14%	-1.43%	9.71%
	空头前3	0.66%	-0.44%	-0.09%	
y涨幅		-0.22%	-0.18%	-0.04%	
震荡幅度	1.10%	0.98%(月均值)	投机度	0.33	0.36(月均值)

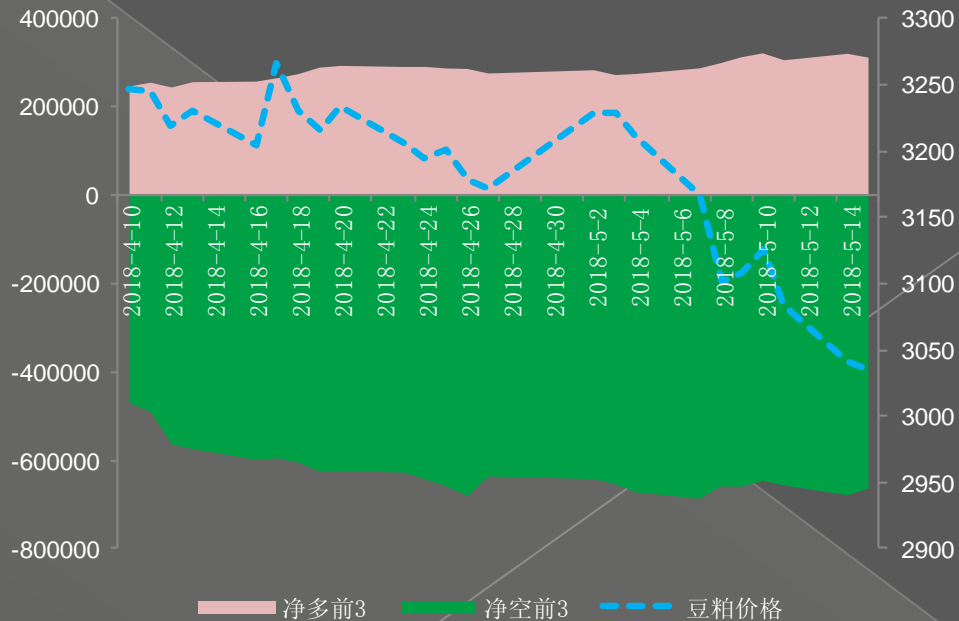




- 永安期货
- 光大期货
- 方正中期
- 中粮期货
- 国投安信
- 摩根大通

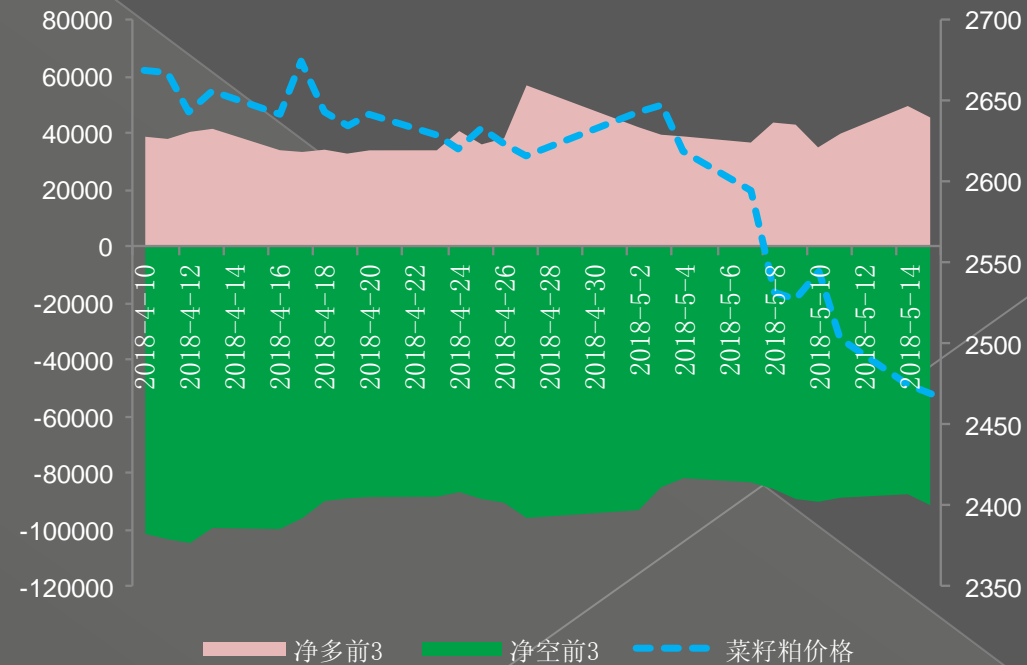
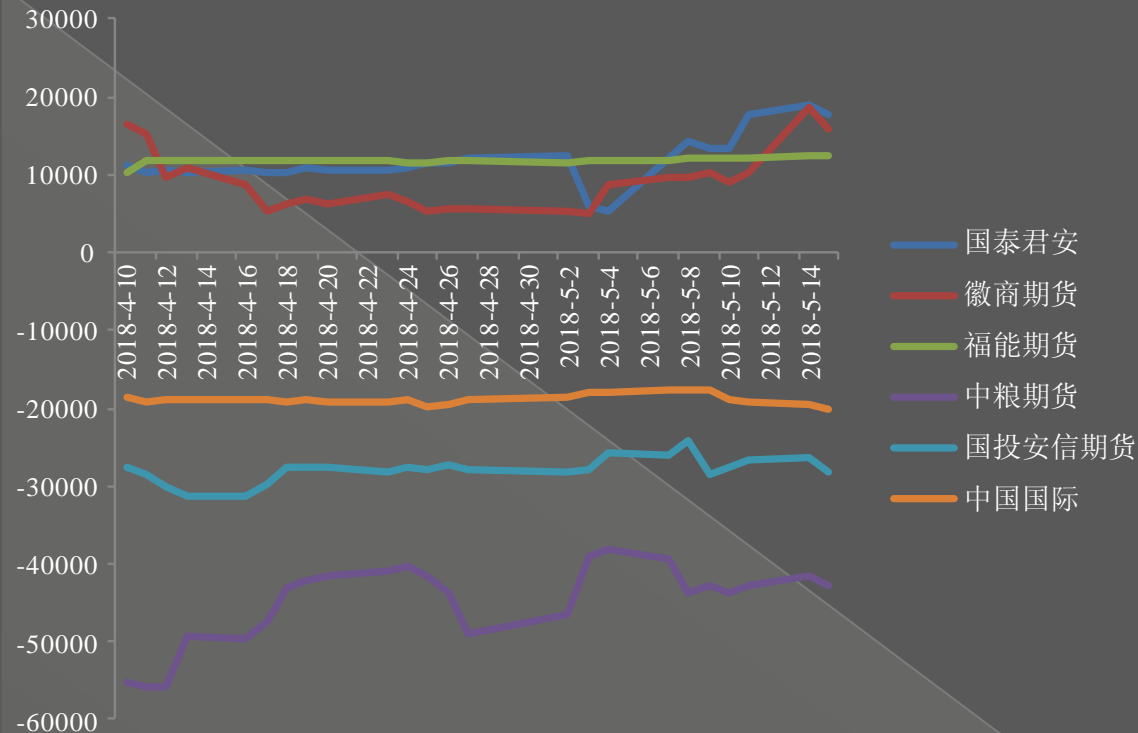
农产品：豆粕

变动幅度		当日	最近5日	平均变化	波动率
m持仓	多头前3	-2.64%	4.23%	0.85%	15.88%
	空头前3	-2.25%	0.71%	0.14%	
m涨幅		-0.18%	-2.12%	-0.42%	
震荡幅度	1.52%	1.64%(月均值)	投机度	0.46	0.54(月均值)

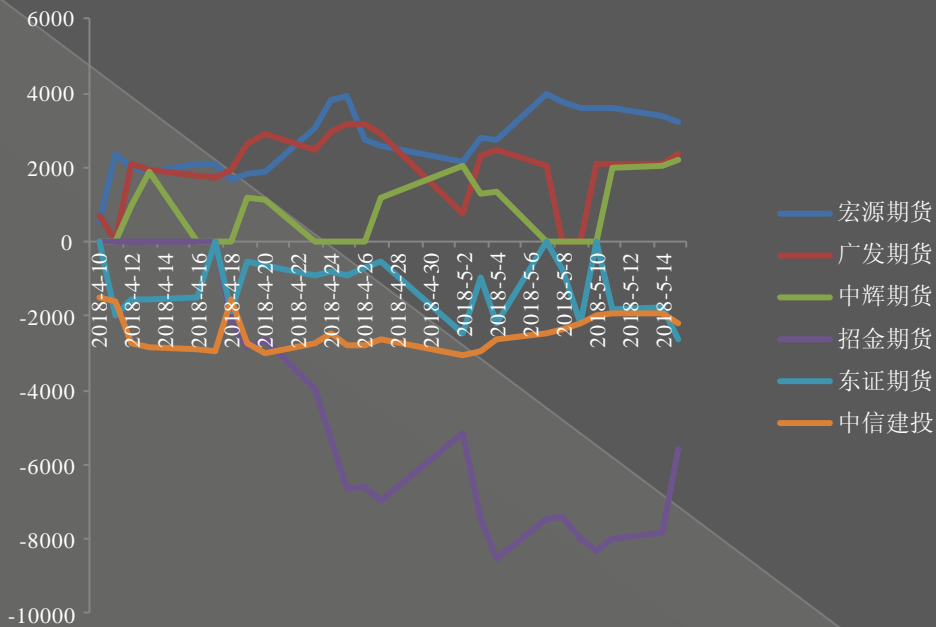


- 净多前3
- 净空前3
- 豆粕价格

农产品：菜粕

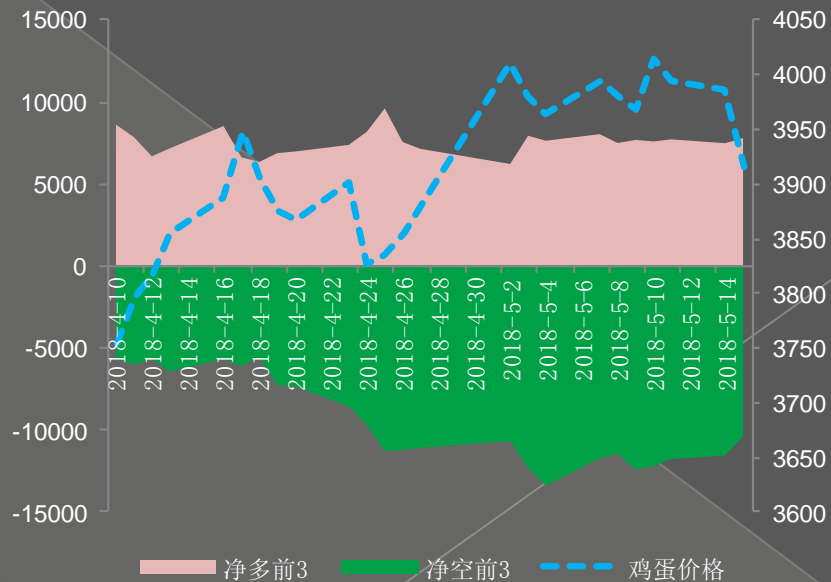


变动幅度		当日	最近5日	平均变化	波动率
rm持仓	多头前3	-8.09%	4.11%	0.82%	13.94%
	空头前3	4.45%	6.76%	1.35%	
rm涨幅		-0.27%	-2.53%	-0.51%	
震荡幅度	1.53%	1.51%(月均值)	投机度	0.66	0.72(月均值)

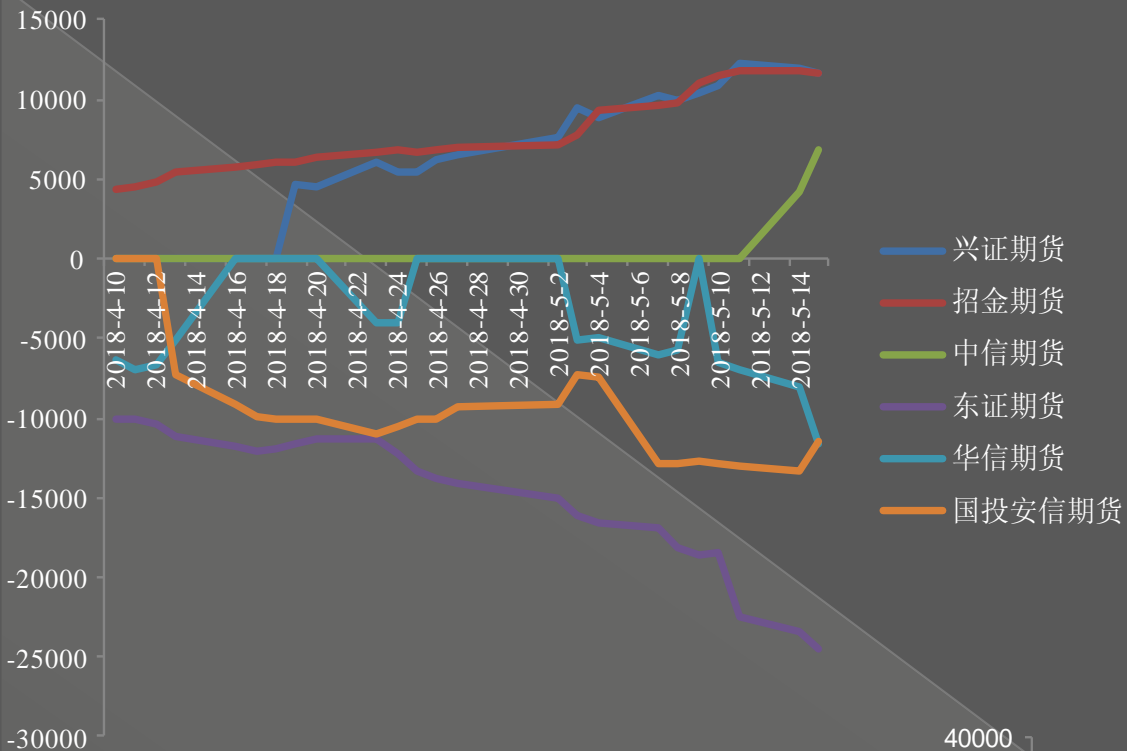


农产品：鸡蛋

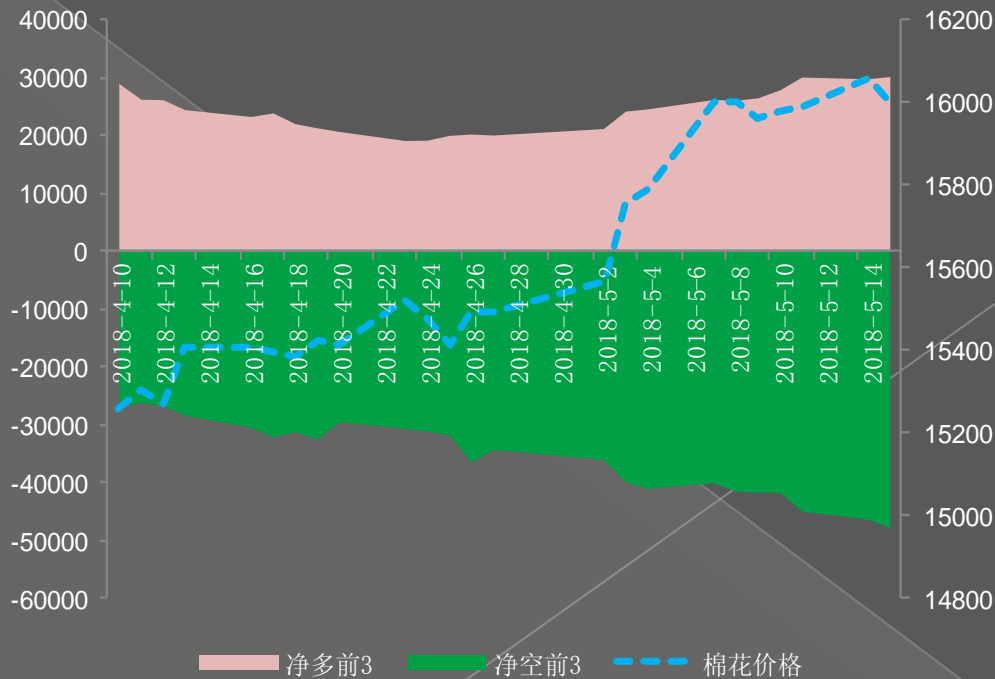
变动幅度		当日	最近5日	平均变化	波动率
jd持仓	多头前3	4.20%	4.02%	0.80%	19.86%
	空头前3	-9.98%	-9.26%	-1.85%	
jd涨幅		-1.75%	-1.63%	-0.33%	
震荡幅度	2.47%	1.63%(月均值)	投机度	0.90	0.72(月均值)



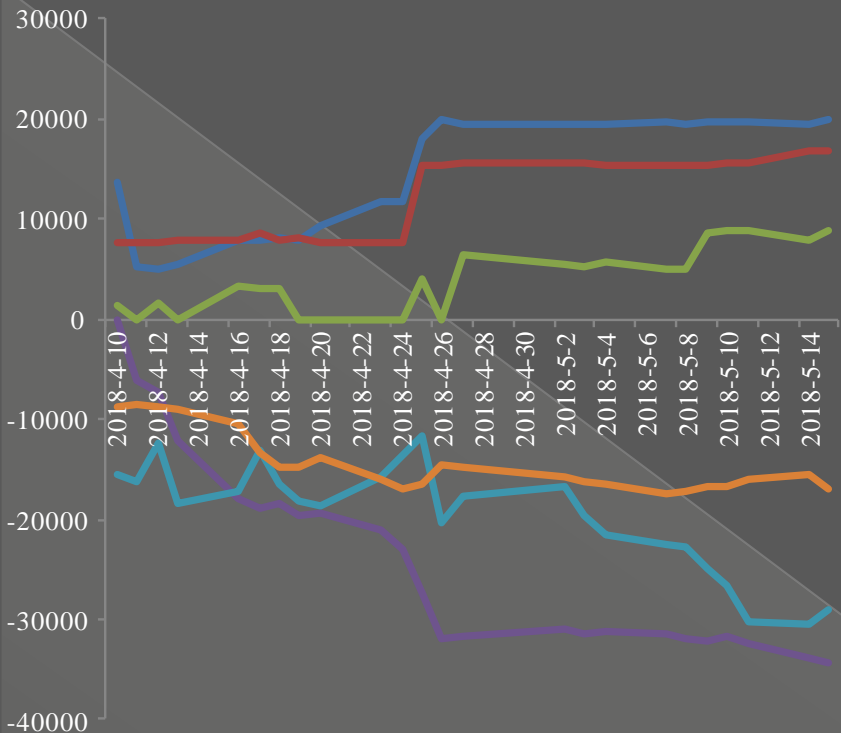
农产品：棉花



变动幅度		当日	最近5日	平均变化	波动率
cf持仓	多头前3	1.26%	15.75%	3.15%	7.77%
	空头前3	3.07%	15.11%	3.02%	
cf涨幅		-0.40%	-0.02%	0.00%	
震荡幅度	1.06%	0.76%(月均值)	投机度	0.50	0.39(月均值)

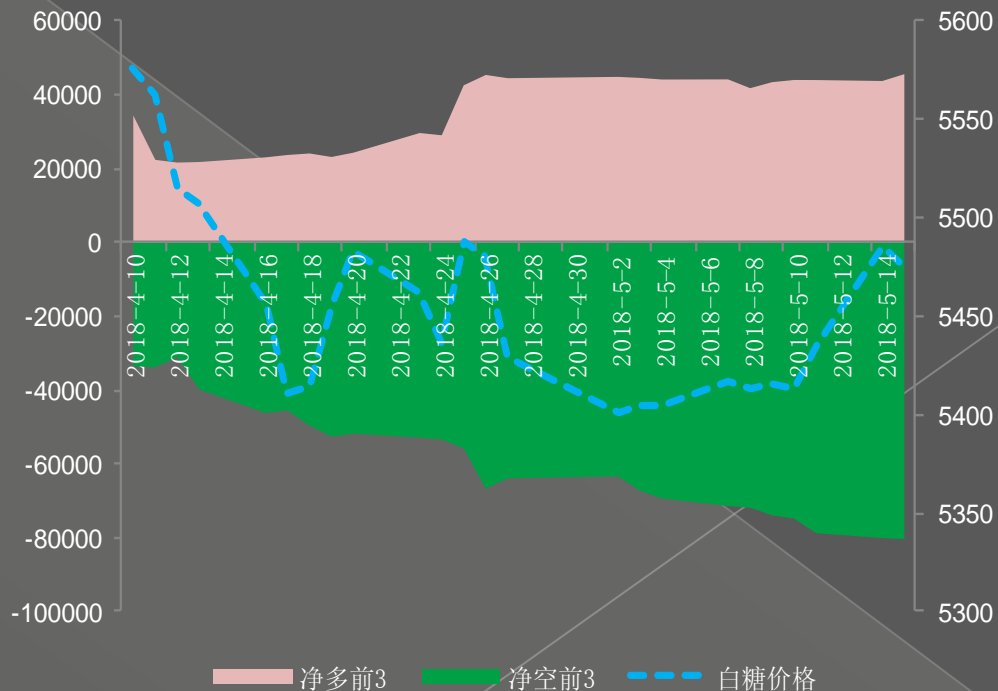


农产品：白糖



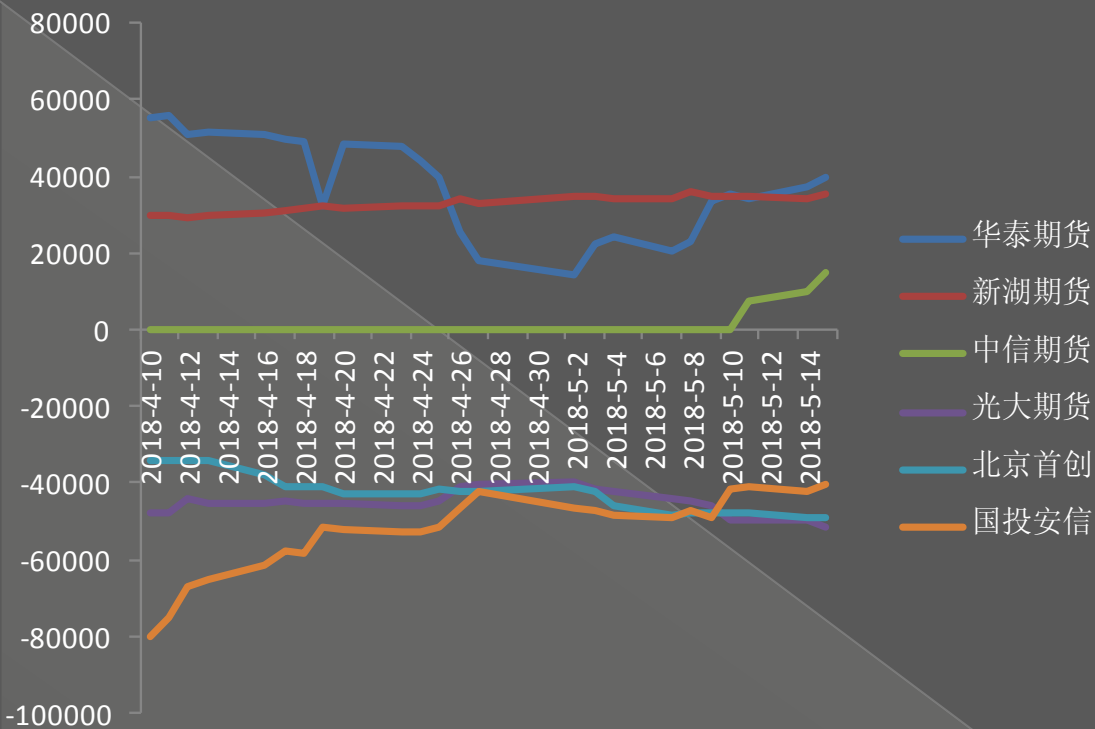
- 混沌天成期货
- 一德期货
- 宏源期货
- 永安期货
- 中粮期货
- 中信期货

变动幅度		当日	最近5日	平均变化	波动率
sr持仓	多头前3	4.21%	9.06%	1.81%	10.05%
	空头前3	0.38%	11.91%	2.38%	
sr涨幅		-0.21%	1.11%	0.22%	
震荡幅度	0.65%	0.89% (月均值)	投机度	0.44	0.45 (月均值)

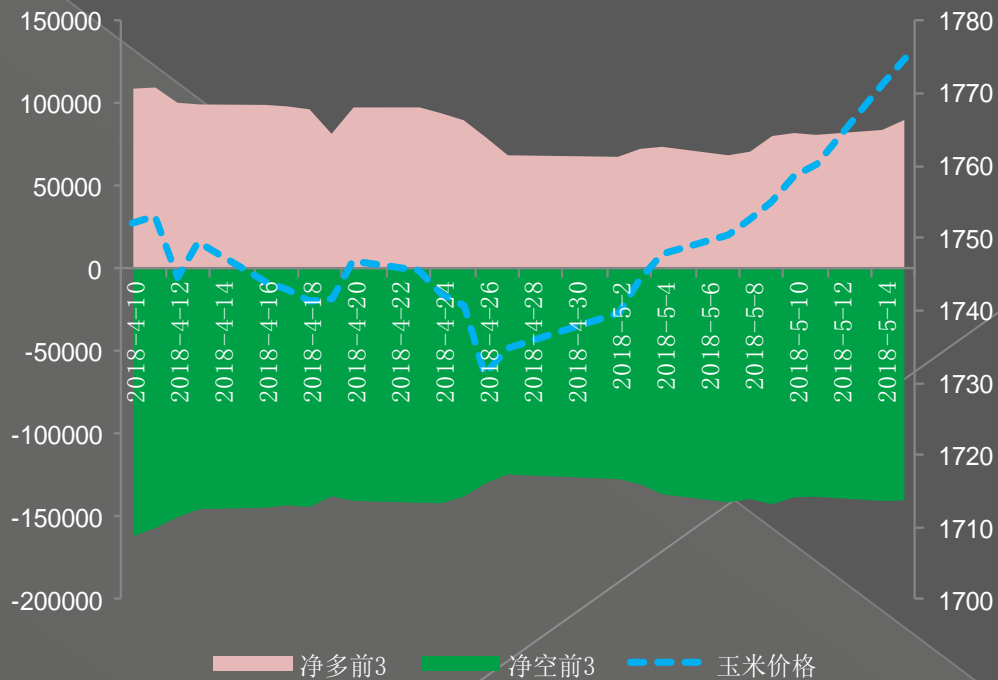


- 净多前3
- 净空前3
- 白糖价格

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	7.17%	26.98%	5.40%	5.50%
	空头前3	-0.28%	0.54%	0.11%	
c涨幅		0.21%	1.26%	0.25%	
震荡幅度	0.56%	0.56%(月均值)	投机度	0.25	0.32(月均值)



部分机构资金变动表

制表日期：2018年5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	-2839.59	-1.03%	61476.94	29.23%
南华期货	-30249.37	-33.91%	-13767.53	-18.93%
混沌天成	0.00	--	0.00	--
海通期货	5112.75	5.11%	-13239.19	-11.18%
上海大陆	702.42	3.38%	5765.83	36.70%
中信期货	-9666.18	-4.63%	-4746.18	-2.33%
新湖期货	-2228.16	-3.24%	-1021.81	-1.51%

中粮期货	-2488.37	-0.76%	21440.07	7.06%
中信建投	-2520.88	-5.19%	1345.10	3.01%
申银万国	7099.67	15.90%	-5111.96	-8.99%
华泰期货	5394.79	7.96%	11189.72	18.04%
光大期货	578.09	0.56%	16188.05	18.29%
一德期货	9447.29	6.88%	-20499.59	-12.26%
国投期货	15421.62	17.63%	20523.72	24.91%
金瑞期货	-1844.10	-1.49%	-1955.64	-1.57%
鲁证期货	10814.61	33.41%	10588.04	32.48%
中国国际	-15111.14	-25.40%	-8380.56	-15.88%

部分机构持仓一览

机构	永安期货					
日期	2018-5-8	2018-5-9	2018-5-10	2018-5-11	2018-5-14	2018-5-15
黄金	2649		2609	2614	2333	2367
白银						
沪铜				1649	3860	4154
沪铝	1804	2207	2196	2150	1751	2208
沪镍	18971	18085	13867	13735	18610	20416
沪锌					-5217	-4873
沪铅	1566	1663	2307	3193	4508	4466
螺纹钢		13913	33101	21327	27528	37782
铁矿石	7030	13138		1291		
焦煤	2220		-2590	-8850	-10303	-12464
焦炭	10745	5094	6604	7827	12114	11582
豆油	22881	20319	12855	15240	14390	10713
棕榈油			3877	8050	7960	7248
菜籽油	3181	4246	4975	7079	6943	8352
豆粕	160455	167109	168230	171243	180232	171109
菜籽粕	-7065	-6791	-1471	-2104	-3098	-3044
棉花	-5937		-6836	-7220	-8887	-9465
白糖	-31798	-32157	-31608	-32426	-33965	-34441
玉米			-15878	-19353	-23323	-23859
鸡蛋						
PTA	51624	60851	80365	100786	101557	76442
聚乙烯	5538	4363	-3800			
聚丙烯		4108			7577	6636
甲醇	33584	36633	38011	32869	29448	34117
玻璃		6104	6902	6480	5515	3664
橡胶	-20219	-18938	-18966	-20627	-21054	-20899
沥青	-22011	-20985	-21254	-19354	-21464	-21803
动力煤	28466	25570	25301	28688	28593	

部分机构持仓一览

机构	南华期货					
日期	2018-5-8	2018-5-9	2018-5-10	2018-5-11	2018-5-14	2018-5-15
黄金						
白银	8503	8492		8659		
沪铜		5182	5051	4622	4621	4160
沪铝			301	6795	6633	6732
沪镍		-8066	-7942	-15113	-7788	-6344
沪锌						
沪铅						
螺纹钢		-8947	-10903	-10195	-9273	
铁矿石	18398	18124	19163	19592	19481	
焦煤	2422					
焦炭	1812					
豆油	-10422	-10264	-9550		-10081	
棕榈油			3730	3633		
菜籽油	-7846	-7694	-7932		-7690	
豆粕	-48570	-46374	-42555	-43960	-43716	-43027
菜籽粕	-8540	-8370	-8555	-9987	-9333	-9588
棉花						
白糖	6927	6771	6753	6862	6567	6617
玉米						
鸡蛋			-1781	-1746	-1722	
PTA						
聚乙烯	10134	10274	9780	9600	9524	9537
聚丙烯	-16477	-15837	-16218	-16149	-15475	-15330
甲醇	7441	8133	8690	9683	8883	
玻璃		-2357	-2280			
橡胶	1883	444	1473	1570	1565	1219
沥青						
动力煤	3905					

部分机构持仓一览

机构	国泰君安					
日期	2018-5-8	2018-5-9	2018-5-10	2018-5-11	2018-5-14	2018-5-15
黄金	6703	6505	6995	7094	6953	7407
白银	-10665	-11395	-15534	-16060	-15509	-14770
沪铜	5612	5649	5266	8894	8566	8937
沪铝						
沪镍	5957	4847	5130	5567	5596	
沪锌						
沪铅	1465	1417	1399	1593	1567	1570
螺纹钢	33555					
铁矿石	15511	13058	14454	13302	15385	14614
焦煤	1482	975	1249	1041		2088
焦炭		-994	-1012		-521	
豆油		-12664	-12126	-12943	-13594	-11105
棕榈油	8571	7935	6658	7522	8506	8951
菜籽油	31442	31917	31825	32014	32144	32077
豆粕		30400	29968		28579	26678
菜籽粕	14269	13530	13457	17877	18983	17821
棉花						
白糖	-9930	-9911	-9920	-9870	-9328	
玉米	-14152	-12694		-11903		
鸡蛋				1390		
PTA	23213	23554	24197	31717	33497	35329
聚乙烯						
聚丙烯	3652					
甲醇	10200	11394	11483	10517	10439	10370
玻璃	-1190	-2537	-2305	-1904	-1492	-2176
橡胶						
沥青	5626	9278	8949	5374	4556	4935
动力煤			-3958	-4561		

部分机构持仓一览

机构	混沌天成					
日期	2018-5-8	2018-5-9	2018-5-10	2018-5-11	2018-5-14	2018-5-15
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						
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	2018-5-8	2018-5-9	2018-5-10	2018-5-11	2018-5-14	2018-5-15
黄金	3862	3734				
白银				7166	6234	
沪铜	-12444	-12461	-13203	-6027	-6660	-12430
沪铝	-4502	-7887	-7931	-14268	-8175	-7169
沪镍	10886	10281	7181	6965	11782	10307
沪锌			-3432			
沪铅	6521	6701	6658	6772	6954	7052
螺纹钢	-33878	-49542	-49475	-47051	-47165	-36343
铁矿石	-4947	-9489	-9906	-6381		-2482
焦煤		-740	1050	1975	2601	1600
焦炭	1714	1585	2283	4120	1249	1460
豆油						
棕榈油	3906	4127	4117	3951	4162	
菜籽油	-5485		-6551	-5782		-5550
豆粕	36626	35851	33740	26949	27411	
菜籽粕	4550	3383		-1660	-703	-597
棉花			5052	5808	6239	4907
白糖						5573
玉米	-12695	-12667				
鸡蛋	1175		1910		1242	
PTA	21904	19945	21373	24875	24378	27488
聚乙烯			4873			
聚丙烯	16412	16649	10756	11317	5769	10128
甲醇	8012	7048	6029	11184		8763
玻璃		2150	1592	-1548		
橡胶				-1141		
沥青		3705	4759	4718	5031	4697
动力煤		3419	3352	6366	5305	

部分机构持仓一览

机构	上海大陆					
日期	2018-5-8	2018-5-9	2018-5-10	2018-5-11	2018-5-14	2018-5-15
黄金						
白银						
沪铜	5768	6007	6001	5979	6261	6579
沪铝						
沪镍						
沪锌						
沪铅						
螺纹钢						
铁矿石						
焦煤						
焦炭						
豆油						
棕榈油		3499	7083	8959	9002	8978
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	-2853	-2780				
动力煤						

部分机构持仓一览

机构	中粮期货					
日期	2018-5-8	2018-5-9	2018-5-10	2018-5-11	2018-5-14	2018-5-15
黄金						
白银	7082	7070	7385			
沪铜	-8812	-9093	-9343	-9783	-11130	-10512
沪铝	-14455	-14227	-15123	-15610	-15848	-15878
沪镍	-11861	-9316	-10361	-10947	-9075	-8432
沪锌	11440	11437	11510	11594	12897	9605
沪铅						-1963
螺纹钢						
铁矿石						
焦煤	4460	4286	4417	2596		
焦炭						
豆油	-91816	-93437	-95261	-99694	-99418	-102058
棕榈油	-20315	-24011	-25568	-28710	-31331	-40163
菜籽油	-18586	-19653	-19883	-23829	-24058	-25046
豆粕	-343239	-338941	-335271	-346630	-365119	-357943
菜籽粕	-43842	-42927	-43649	-42715	-41461	-42916
棉花	-7609	-7573	-7905	-7302	-7272	-5853
白糖	-22729	-24895	-26553	-30200	-30499	-29025
玉米	-18600	-19102	-26789	-27217	-27511	-28153
鸡蛋						
PTA	22600	22531	20882	20573	16186	17561
聚乙烯					-4235	-4196
聚丙烯						
甲醇						
玻璃						
橡胶	-7903	-7239	-7852	-7819	-7850	-7824
沥青						
动力煤	-4928	-4547	-4552	-4816	-5290	

部分机构持仓一览

机构	中信期货					
日期	2018-5-8	2018-5-9	2018-5-10	2018-5-11	2018-5-14	2018-5-15
黄金	12879	12936	13520	13525	13477	13180
白银	-28799	-31855	-32518	-28691	-26933	-25934
沪铜	-14378	-14999	-14138	-13770	-13331	-13366
沪铝			861		-3399	
沪镍	-11492	-12452	-13570	-14188	-12372	-10956
沪锌	14630	13390	14355	13347	13790	14038
沪铅			-1384	-3909	-5229	-5047
螺纹钢						
铁矿石				-5422	-626	
焦煤	4627	3851	5041	5026	3520	3628
焦炭	-1325	-1301	-1239	-2138	-1980	-2246
豆油	-13198	-10804		-10641	-10081	
棕榈油	-20306	-14054	-8967	-2140	-2630	
菜籽油	-13686	-13305	-14156	-11769	-10951	-10433
豆粕	50060	52694	48748	50021	54304	53971
菜籽粕	4683	3688	7454	5856	6664	5689
棉花					4184	6908
白糖	-17275	-16827	-16609	-16084	-15581	-16885
玉米				7260	10123	15036
鸡蛋		1446	1376			1536
PTA	34590	32819	32507	31301	32903	23058
聚乙烯	-7848	-7629	-5984	-8743	-10197	-9810
聚丙烯	7028	7866	8154	7554	6344	6060
甲醇	8654	8611	8510		9165	9262
玻璃	9147	8521	9088	9501	9156	9403
橡胶		-3701		-3881		
沥青	5426	5540	5191	5608	4891	4642
动力煤			1489	2412		

部分机构持仓一览

机构	中信建投					
日期	2018-5-8	2018-5-9	2018-5-10	2018-5-11	2018-5-14	2018-5-15
黄金						
白银						6459
沪铜						
沪铝						
沪镍					-4976	-5316
沪锌						
沪铅					-799	
螺纹钢						
铁矿石	33729	33833	33541	34006	38608	43010
焦煤		2401				
焦炭						
豆油						
棕榈油	-14555	-14625	-14551	-14596	-14647	-9893
菜籽油			4017			
豆粕						
菜籽粕						
棉花	5340	5066	4870	5041	5430	5639
白糖						
玉米	7760	7917	10086	9429		
鸡蛋	-2371	-2177	-1980	-1924	-1902	-2176
PTA						
聚乙烯	3979					
聚丙烯						
甲醇			6642			
玻璃						
橡胶	4816	4693	4865	4837	4819	
沥青	-3346	-3546	-3602	-3692	-3691	-3512
动力煤						

部分机构持仓一览

机构	新湖期货					
日期	2018-5-8	2018-5-9	2018-5-10	2018-5-11	2018-5-14	2018-5-15
黄金	-1073	-854	-839	-834	-827	-899
白银						
沪铜						
沪铝						
沪镍						
沪锌						
沪铅						
螺纹钢	17923		22683	24818	-25520	-21997
铁矿石						
焦煤						
焦炭						
豆油						
棕榈油	11753	12180	11843	11709	11763	11170
菜籽油	-5668	-5671		-5205	-5462	-4874
豆粕	-96545	-96788	-97075	-96515	-96000	-94769
菜籽粕						
棉花						
白糖						
玉米	35806	34726	34741	34677	34251	35558
鸡蛋	1398	1415	1614	1326	1348	
PTA	-15710		-16463	-26754		
聚乙烯				4475	3344	3239
聚丙烯						
甲醇						
玻璃						
橡胶	-6017	-6018	-6076	-6073	-6165	-6585
沥青		-5481	-5207	-5682	-3989	-3829
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

