



# 市场持仓分析

2018/5/17

# 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
PTA	5.01%	3.81%	0.48%	-7.65%	-6.85%	-7.84%	12.66%	☆☆☆
白糖	6.92%	10.23%	8.59%	-1.65%	-0.06%	1.64%	8.57%	☆☆
螺纹钢	12.08%	6.05%	5.70%	3.56%	9.45%	7.47%	8.52%	☆☆
聚丙烯	6.27%	5.29%	4.51%	-1.74%	-1.54%	-0.17%	8.01%	☆☆
橡胶	7.88%	7.59%	10.74%	0.27%	0.34%	2.91%	7.61%	☆☆
动力煤	12.68%	9.47%	-2.70%	7.30%	7.40%	7.13%	5.38%	☆☆
沪镍	5.71%	3.16%	4.46%	2.21%	1.43%	-3.09%	3.50%	☆
沪锌	-0.84%	-1.12%	-0.59%	-2.40%	-0.87%	-4.21%	1.56%	☆
玻璃	-2.11%	-8.01%	-2.51%	-3.04%	-1.46%	1.81%	0.93%	☆
沪铝	-1.48%	-3.44%	-5.24%	-1.22%	-3.17%	-3.45%	-0.25%	☆
沪铜	1.01%	-0.08%	0.11%	1.45%	2.49%	2.08%	-0.44%	☆
豆粕	-4.90%	-9.35%	-11.87%	-3.42%	-2.95%	-2.38%	-1.48%	☆
聚乙烯	-12.61%	-8.99%	-5.03%	-9.96%	-6.10%	-3.37%	-2.64%	☆
焦煤	-11.51%	-10.97%	-14.07%	-8.80%	-4.97%	-5.37%	-2.71%	☆
棕榈油	2.95%	6.46%	7.23%	6.89%	4.95%	2.35%	-3.94%	☆
玉米	-0.34%	1.00%	2.81%	3.68%	3.83%	4.06%	-4.01%	☆
沪银	0.00%	0.83%	-2.90%	4.21%	2.19%	0.50%	-4.21%	☆
焦炭	-5.17%	-4.45%	-2.15%	2.64%	1.29%	4.76%	-7.81%	☆☆
棉花	-0.04%	1.91%	2.49%	10.27%	8.60%	10.01%	-10.32%	☆☆☆
豆油	-14.55%	-10.03%	3.15%	1.74%	-0.37%	3.02%	-16.28%	☆☆☆
甲醇	-2.45%	-1.75%	-2.23%	15.49%	12.55%	16.63%	-17.93%	☆☆☆
沥青	-24.81%	-20.03%	-13.59%	-6.06%	-5.00%	-3.73%	-18.75%	☆☆☆
沪金	-4.60%	-3.34%	-0.50%	18.01%	12.67%	22.22%	-22.61%	☆☆☆☆
鸡蛋	-22.92%	-15.98%	-10.29%	5.30%	0.67%	-2.24%	-28.22%	☆☆☆☆
菜籽粕	-26.76%	-20.74%	-16.40%	2.72%	1.94%	-4.74%	-29.48%	☆☆☆☆
铁矿石	-5.78%	9.80%	17.73%	27.22%	16.02%	7.94%	-32.99%	☆☆☆☆

## 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
沪镍	46.76%	43.57%	36.56%	-13.37%	-17.48%	-20.29%	60.13%	☆☆☆☆
焦炭	66.57%	57.83%	60.14%	31.31%	54.25%	82.28%	35.25%	☆☆☆
沪银	13.97%	11.07%	10.92%	-19.61%	-12.31%	-6.05%	33.58%	☆☆☆
动力煤	-2.49%	-1.97%	-10.35%	-31.87%	-20.99%	-14.75%	29.37%	☆☆
螺纹钢	15.35%	6.46%	0.52%	-12.74%	-9.24%	-12.29%	28.08%	☆☆
棕榈油	38.03%	45.51%	42.33%	15.56%	8.07%	8.15%	22.48%	☆☆
甲醇	-8.52%	-4.18%	-1.81%	-20.35%	-9.91%	-3.82%	11.83%	☆☆
PTA	1.99%	13.32%	9.39%	-6.91%	-0.41%	4.18%	8.90%	☆
白糖	11.61%	15.65%	11.69%	5.52%	7.84%	6.51%	6.08%	☆
沪铜	6.07%	7.69%	2.65%	2.76%	-3.80%	-1.76%	3.31%	☆
玉米	7.14%	7.93%	0.33%	5.80%	11.27%	14.32%	1.34%	☆
玻璃	-3.49%	-10.75%	-12.60%	-4.28%	0.09%	9.19%	0.79%	☆
沪金	-7.37%	-4.82%	-5.83%	-6.54%	3.14%	32.49%	-0.83%	☆
橡胶	0.05%	-1.50%	8.98%	1.96%	-2.08%	-0.84%	-1.91%	☆
沪铝	-0.61%	4.18%	18.69%	2.72%	-4.34%	-0.90%	-3.33%	☆
铁矿石	-10.32%	-9.39%	-16.09%	-5.95%	-8.57%	-15.48%	-4.37%	☆
菜籽粕	-7.77%	-11.99%	-17.58%	-0.97%	0.43%	5.78%	-6.80%	☆
豆粕	-10.87%	-15.08%	-16.47%	-3.30%	-3.03%	-3.54%	-7.58%	☆
沪锌	-21.77%	-20.75%	-16.14%	-13.66%	-12.83%	-12.22%	-8.11%	☆
鸡蛋	-23.68%	-16.77%	-14.88%	-13.14%	-10.70%	-10.60%	-10.54%	☆☆
聚丙烯	5.37%	-2.26%	-2.00%	16.28%	14.96%	10.94%	-10.91%	☆☆
聚乙烯	-24.63%	-19.27%	-13.19%	-13.47%	-3.43%	5.88%	-11.16%	☆☆
豆油	-12.18%	-9.35%	-8.72%	1.96%	-2.61%	-2.45%	-14.14%	☆☆
沥青	-24.67%	-21.18%	-15.74%	5.49%	1.95%	-2.04%	-30.16%	☆☆☆
棉花	35.34%	50.42%	47.17%	93.21%	101.44%	81.39%	-57.87%	☆☆☆☆
焦煤	5.92%	6.48%	13.08%	69.32%	56.25%	41.00%	-63.41%	☆☆☆☆

# 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 $< 5\%$
☆☆☆☆☆	☆☆☆☆	☆☆☆	☆☆	☆

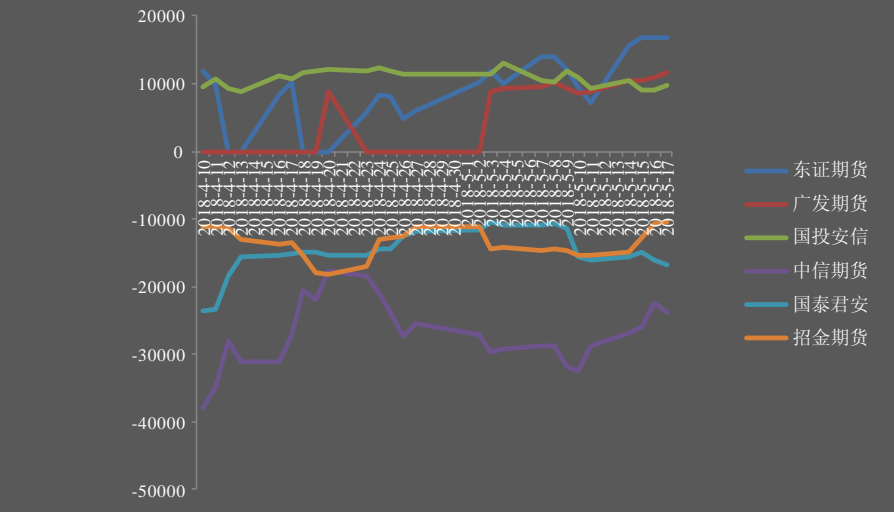
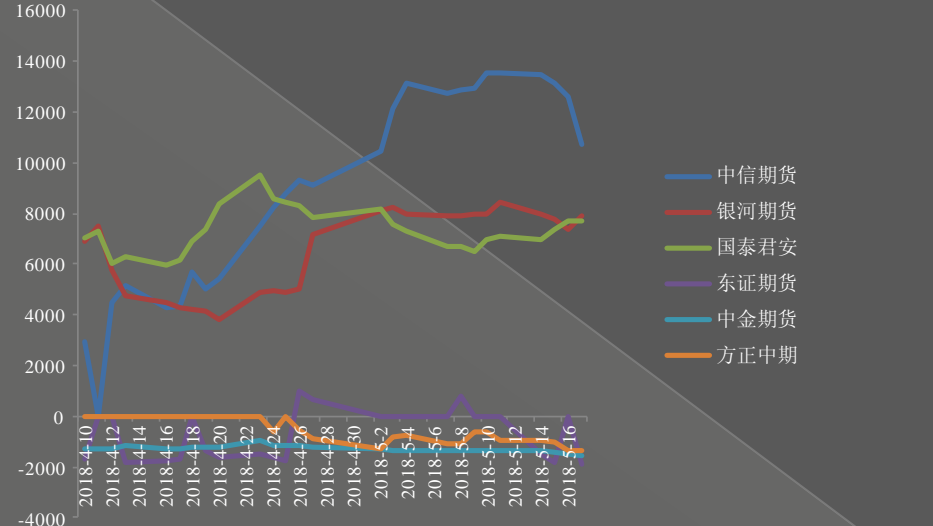


## 2018年5月17日机构持仓异动表

农产品	
海通期货	棕榈油净多单变动幅度为：3432手
中信建投	棕榈油净空单变动幅度为：5223手
光大期货	豆粕净多单变动幅度为：-28816手
国泰君安	菜籽粕净多单变动幅度为：-5635手
徽商期货	菜籽粕净多单变动幅度为：-6298手
徽商期货	菜籽粕净多单变动幅度为：-6298手
海通期货	棉花净多单变动幅度为：-3493手
中信建投	棉花净多单变动幅度为：3404手
海通期货	白糖净多单变动幅度为：5108手
宏源期货	鸡蛋净多单变动幅度为：-1526手
宏源期货	鸡蛋净多单变动幅度为：-1526手

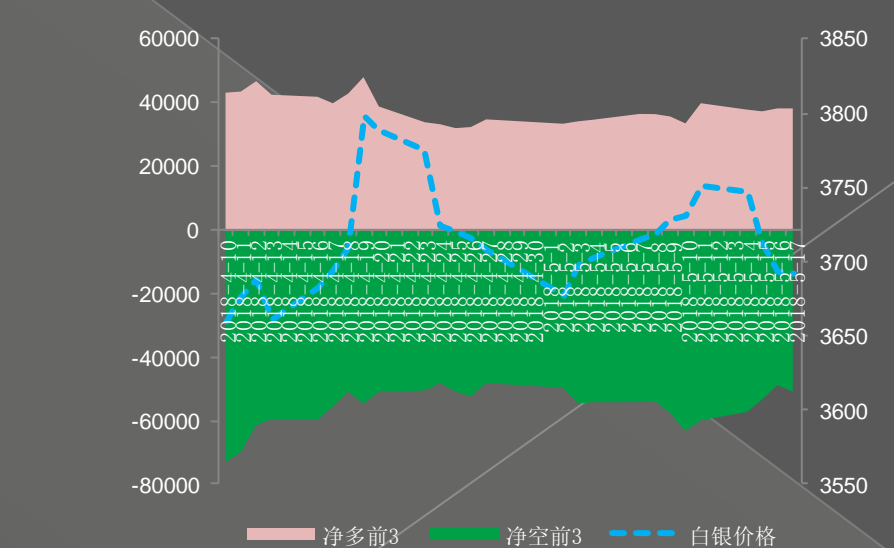
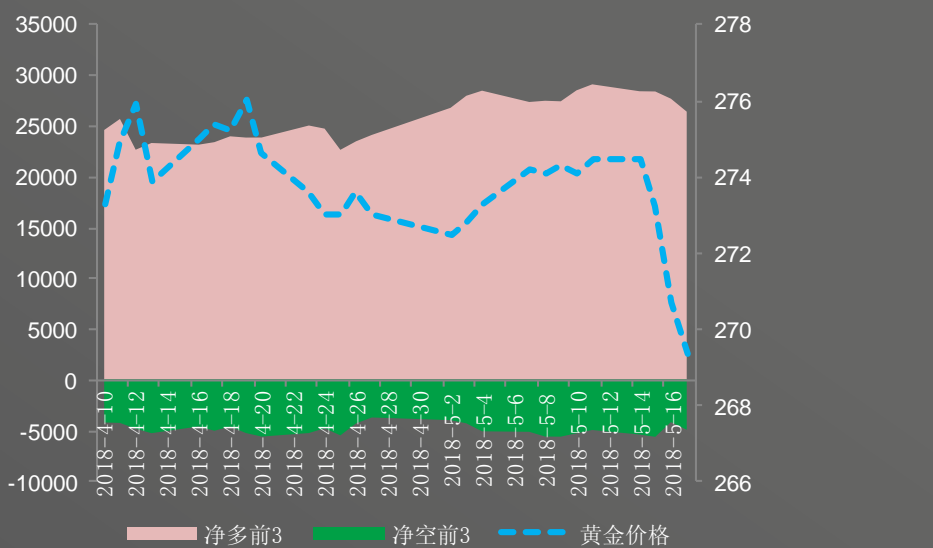
化工	
永安期货	聚丙烯净多单变动幅度为：4953手
银河期货	甲醇净空单变动幅度为：7680手
光大期货	甲醇净空单变动幅度为：6432手
永安期货	玻璃净多单变动幅度为：-3841手
国泰君安	沥青净多单变动幅度为：-2195手
兴证期货	沥青净多单变动幅度为：-2720手
光大期货	橡胶净多单变动幅度为：4566手

# 金属板块：AU & AG

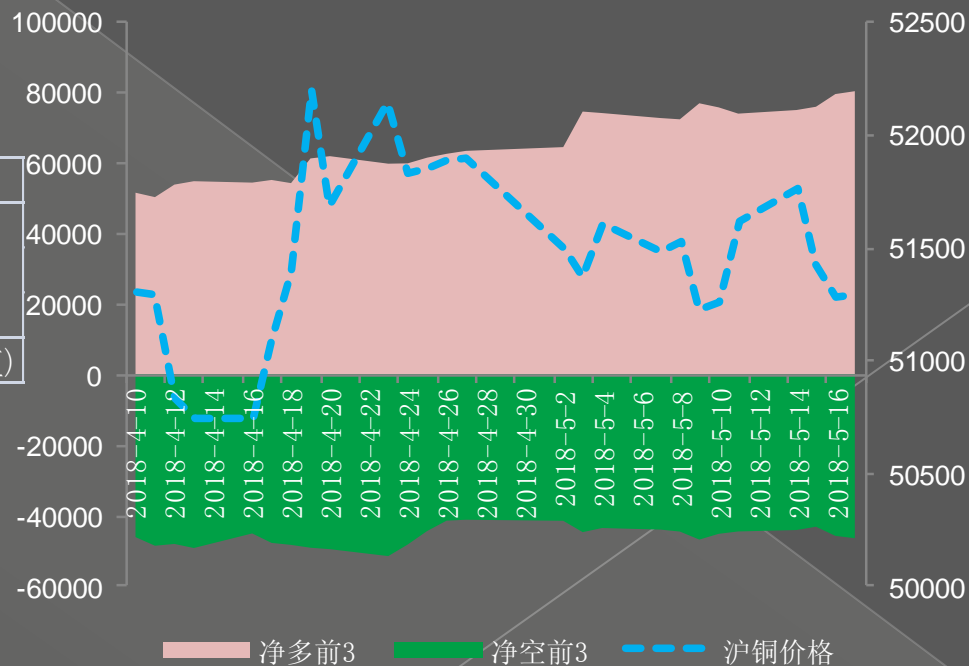
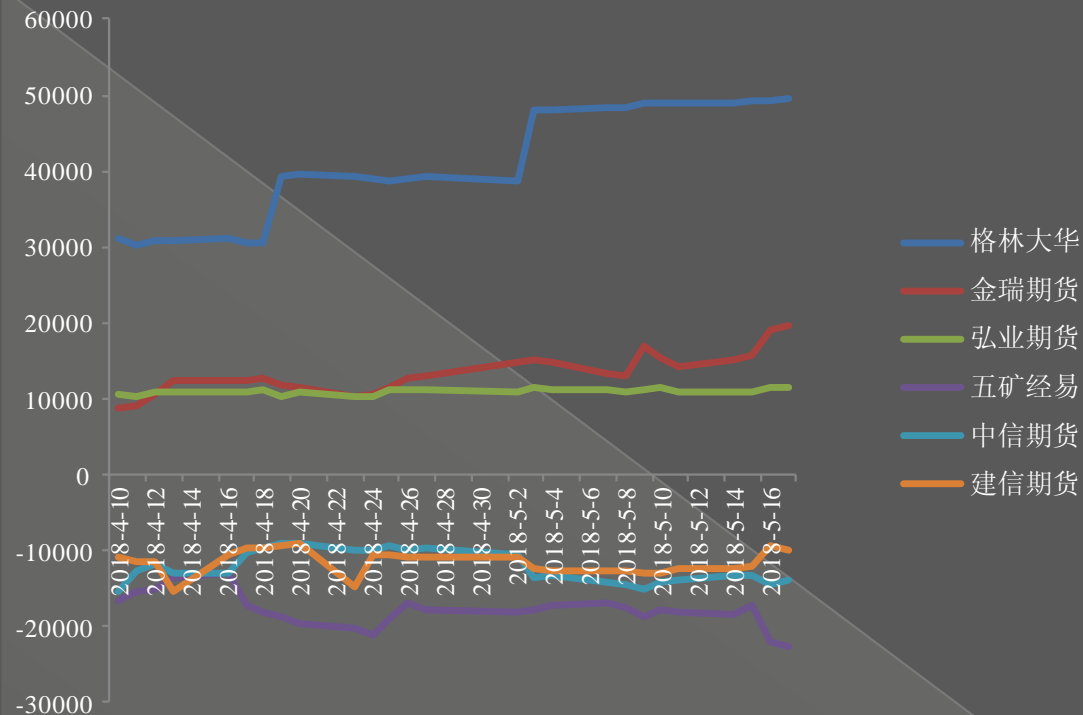


变动幅度		当日	最近5日	平均变化	波动率
au持仓	多头前3	-4.60%	-7.37%	-1.47%	5.15%
	空头前3	18.01%	-6.54%	-1.31%	
au涨幅		-0.50%	-1.73%	-0.35%	
震荡幅度	0.77%	0.48%(月均值)	投机度	0.35	0.41(月均值)

变动幅度		当日	最近5日	平均变化	波动率
ag持仓	多头前3	0.00%	13.97%	2.79%	12.62%
	空头前3	4.21%	-19.61%	-3.92%	
ag涨幅		-0.03%	-1.04%	-0.21%	
震荡幅度	0.81%	0.69%(月均值)	投机度	0.30	0.45(月均值)



# 金属板块：Cu

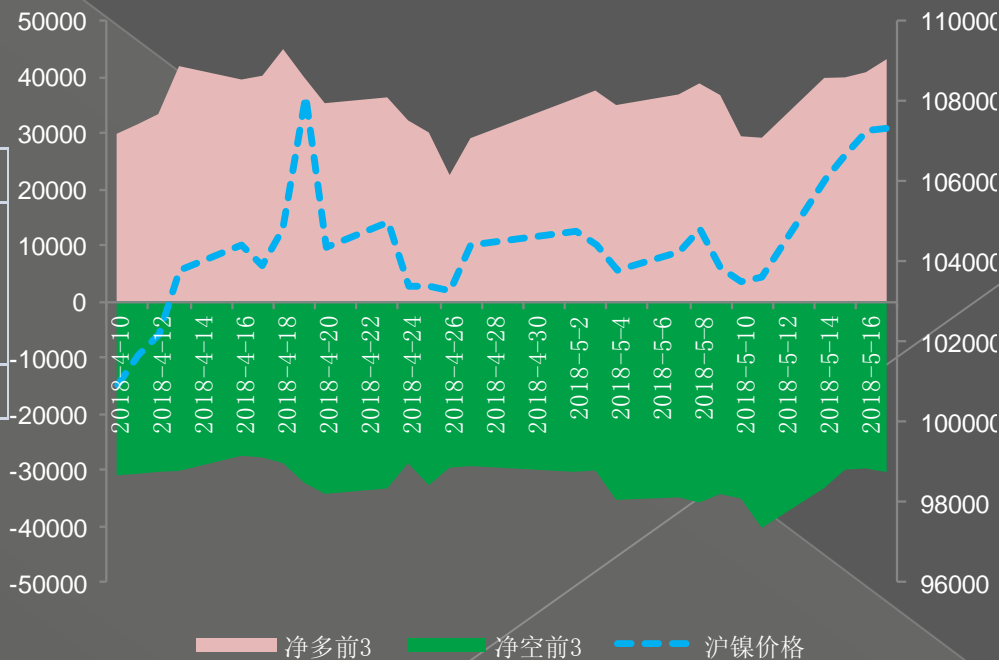
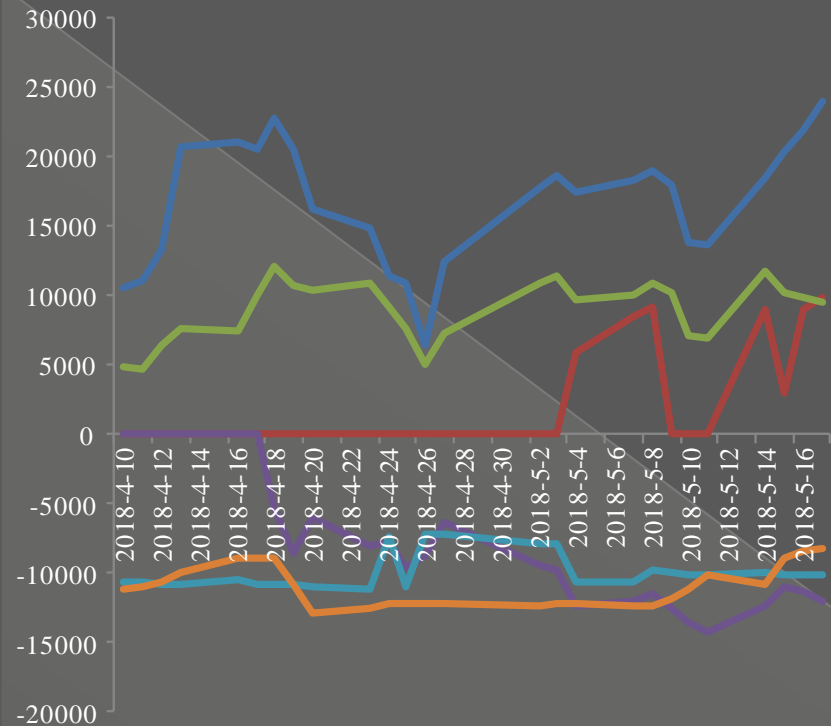


变动幅度		当日	最近5日	平均变化	波动率
cu持仓	多头前3	1.01%	6.07%	1.21%	12.04%
	空头前3	1.45%	2.76%	0.55%	
cu涨幅		0.02%	0.07%	0.01%	
震荡幅度	0.74%	0.92%(月均值)	投机度	0.36	0.47(月均值)



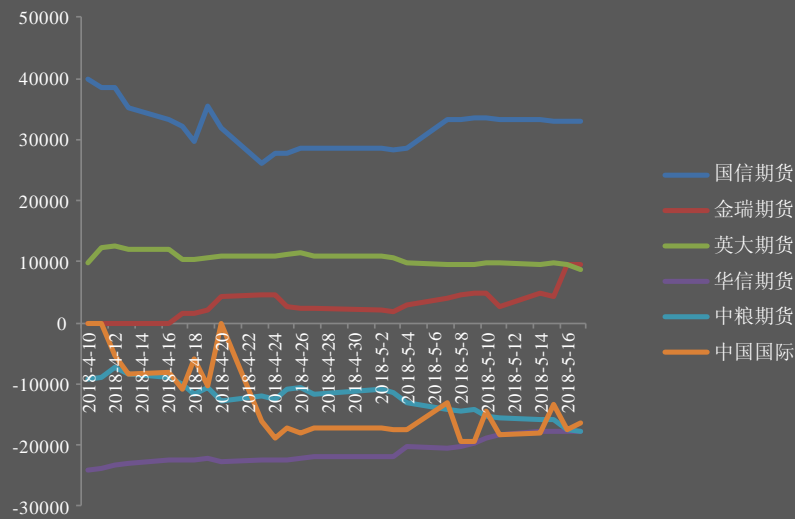
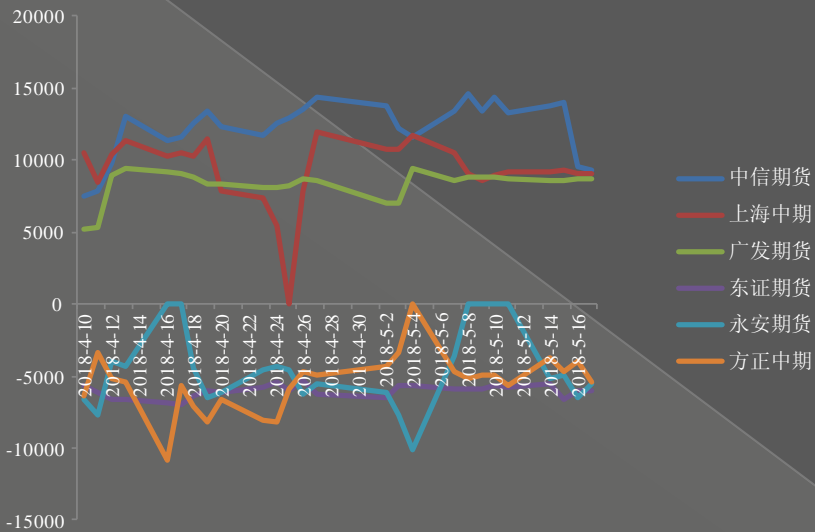
# 金属板块：Ni

- 永安期货
- 华泰期货
- 海通期货
- 中信期货
- 建信期货
- 兴业期货



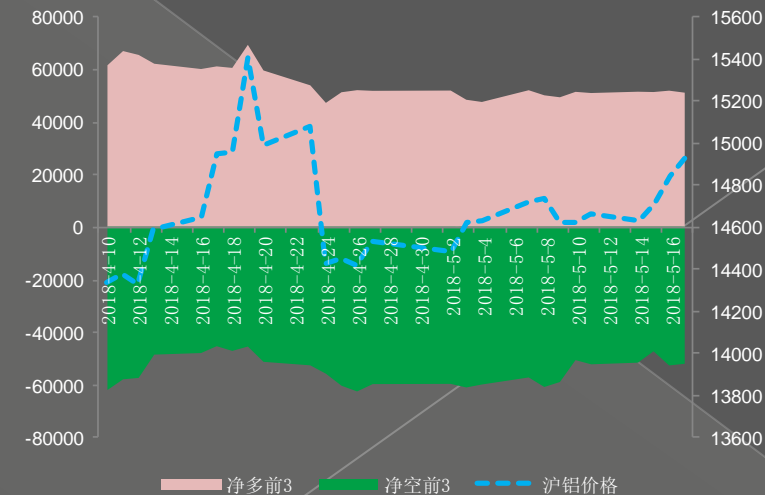
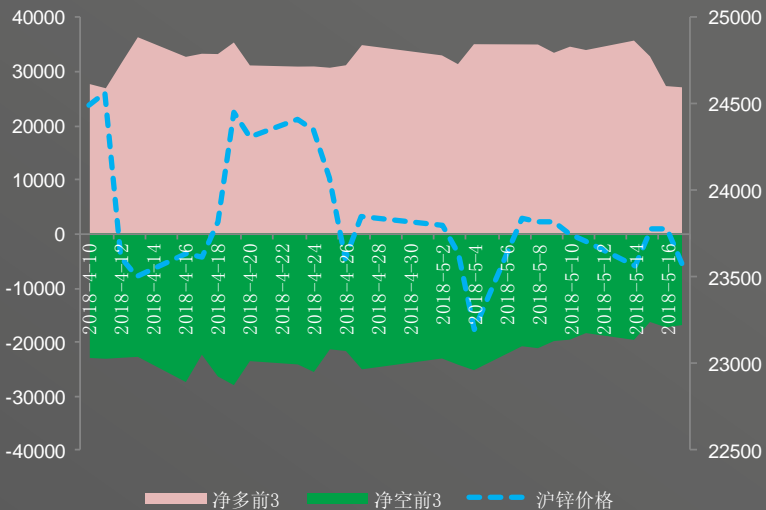
变动幅度		当日	最近5日	平均变化	波动率
ni持仓	多头前3	5.71%	46.76%	9.35%	21.04%
	空头前3	2.21%	-13.37%	-2.67%	
ni涨幅		0.05%	3.72%	0.74%	
震荡幅度	1.14%	1.83%(月均值)	投机度	0.88	1.55(月均值)

# 金属板块：Zn & Al

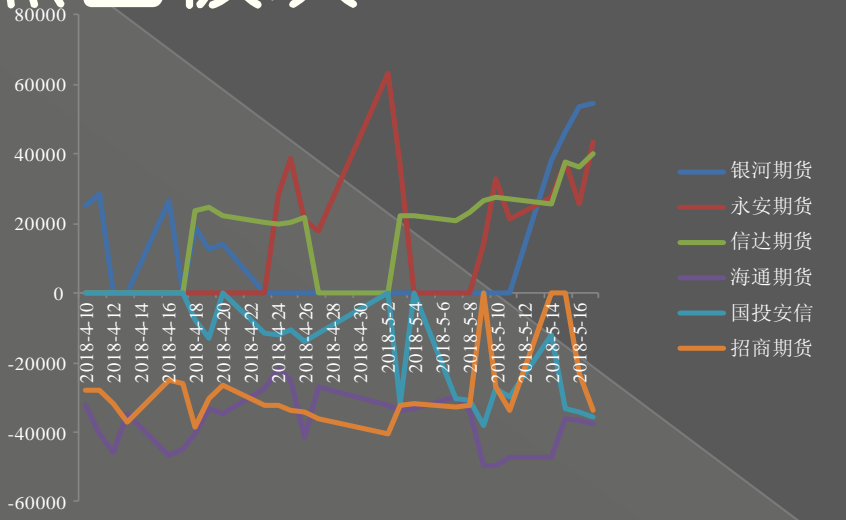


变动幅度		当日	最近5日	平均变化	波动率
zn持仓	多头前3	-0.84%	-21.77%	-4.35%	17.12%
	空头前3	-2.40%	-13.66%	-2.73%	
zn涨幅		-0.89%	-0.75%	-0.15%	
震荡幅度	1.66%	1.60%(月均值)	投机度	1.03	1.20(月均值)

变动幅度		当日	最近5日	平均变化	波动率
al持仓	多头前3	-1.48%	-0.61%	-0.12%	23.47%
	空头前3	-1.22%	2.72%	0.54%	
al涨幅		0.58%	2.14%	0.43%	
震荡幅度	1.01%	1.29%(月均值)	投机度	0.44	0.63(月均值)

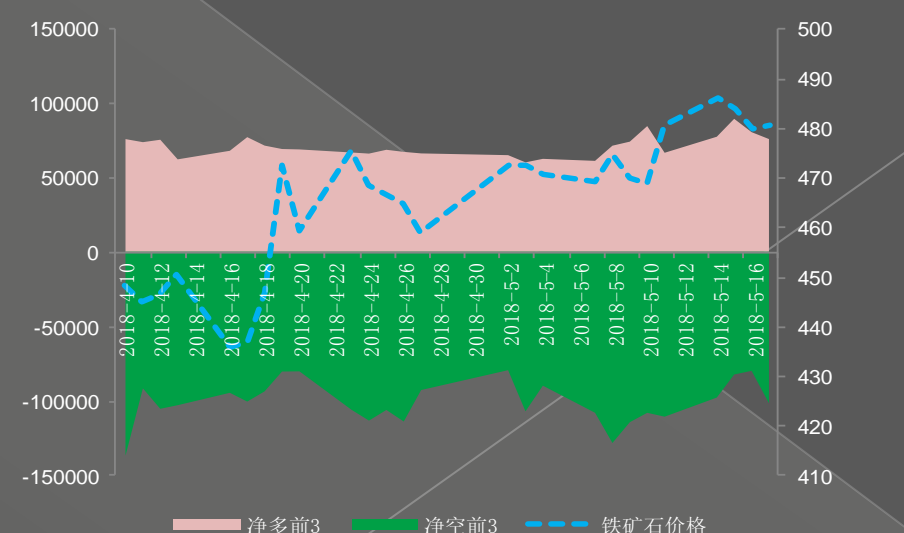
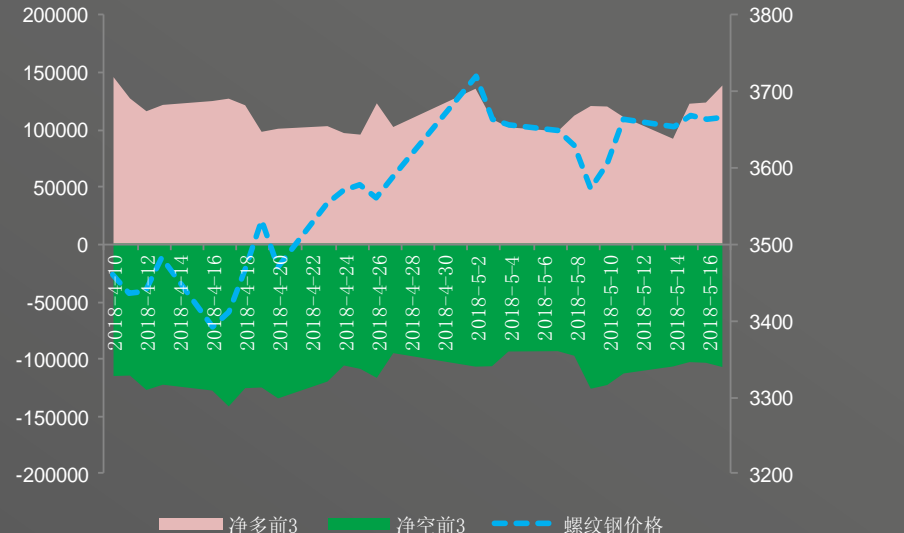


# 黑色板块：Rb & I

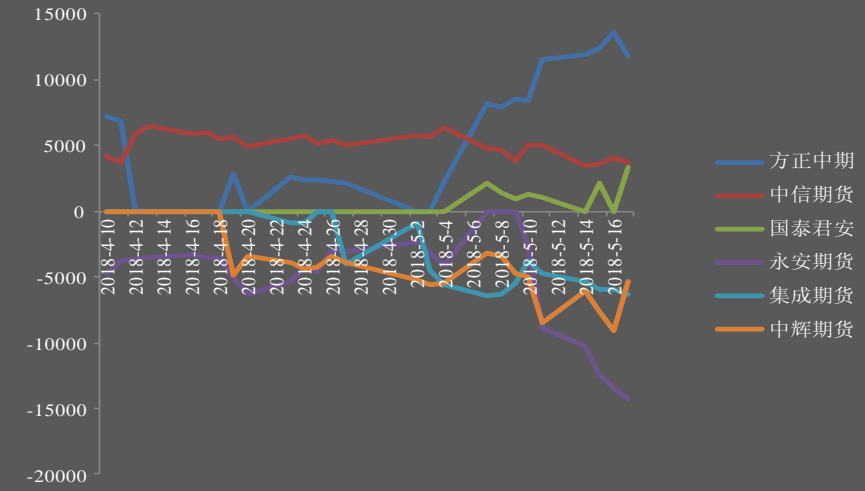
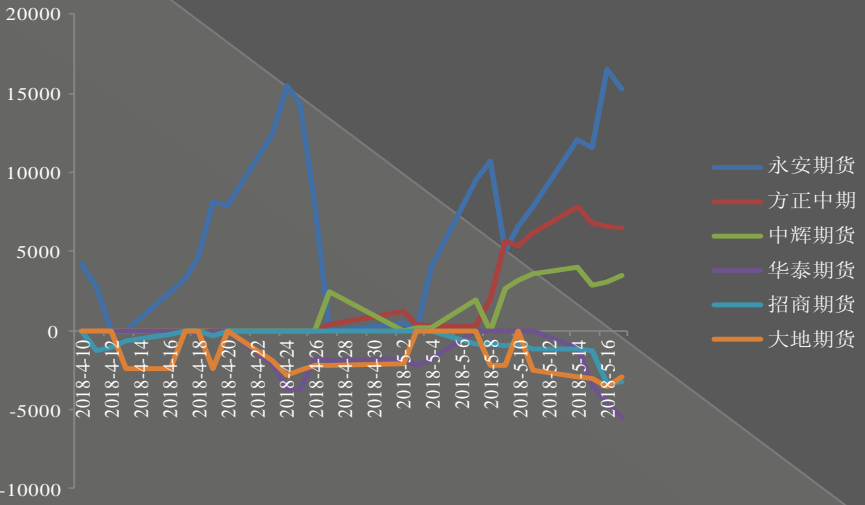


变动幅度		当日	最近5日	平均变化	波动率
rb持仓	多头前3	12.08%	15.35%	3.07%	24.93%
	空头前3	3.56%	-12.74%	-2.55%	
rb涨幅		0.03%	1.69%	0.34%	
震荡幅度	0.81%	1.81%(月均值)	投机度	0.92	1.35(月均值)

变动幅度		当日	最近5日	平均变化	波动率
I持仓	多头前3	-5.78%	-10.32%	-2.06%	33.21%
	空头前3	27.22%	-5.95%	-1.19%	
I涨幅		0.15%	2.53%	0.51%	
震荡幅度	1.46%	2.69%(月均值)	投机度	0.95	1.38(月均值)

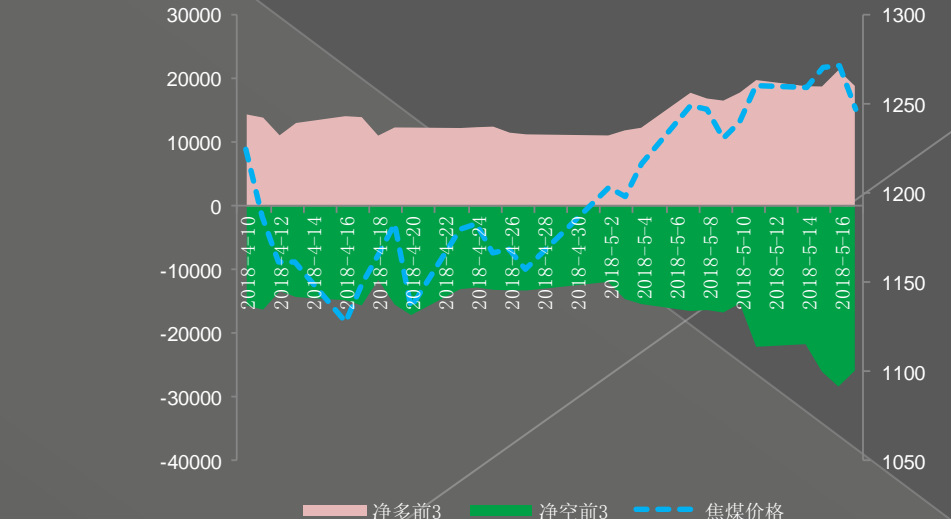
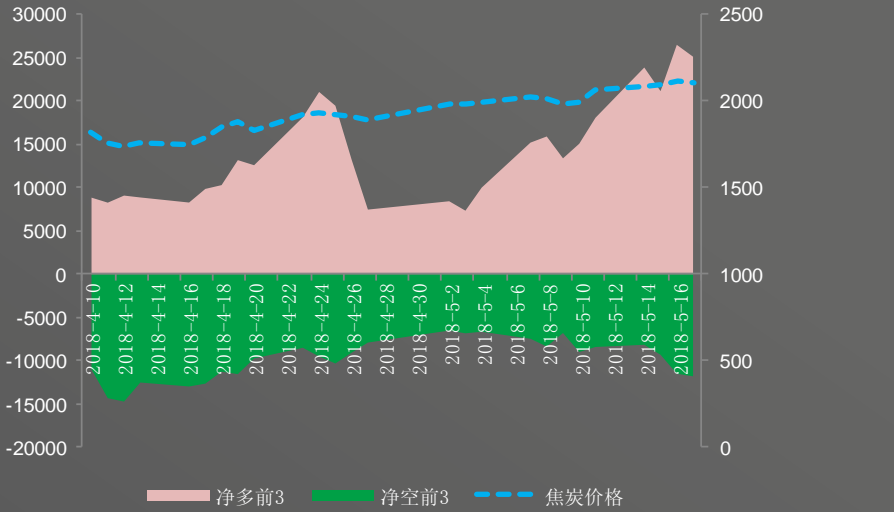


# 黑色板块：J & JM

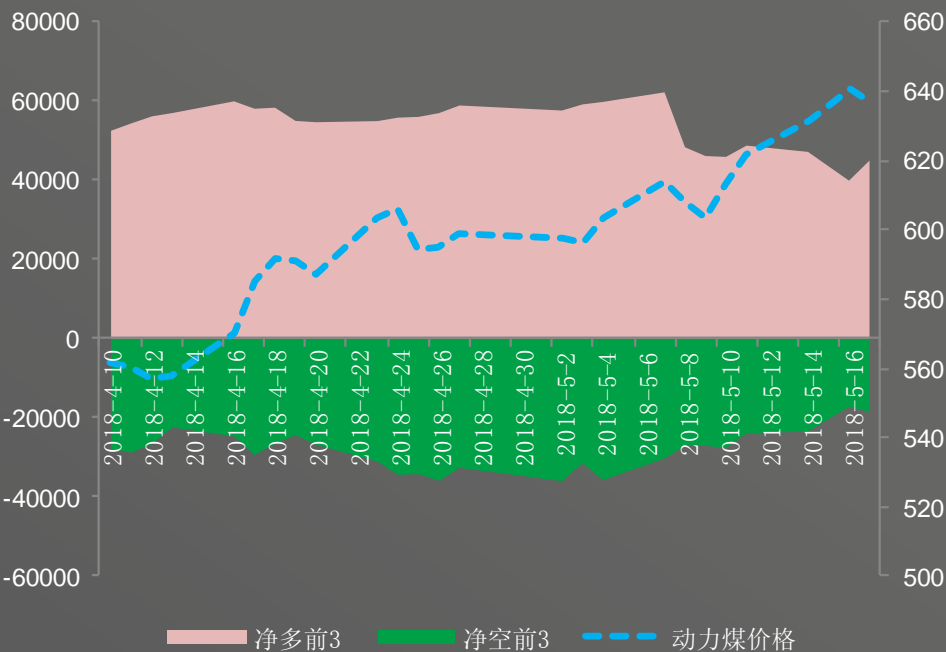
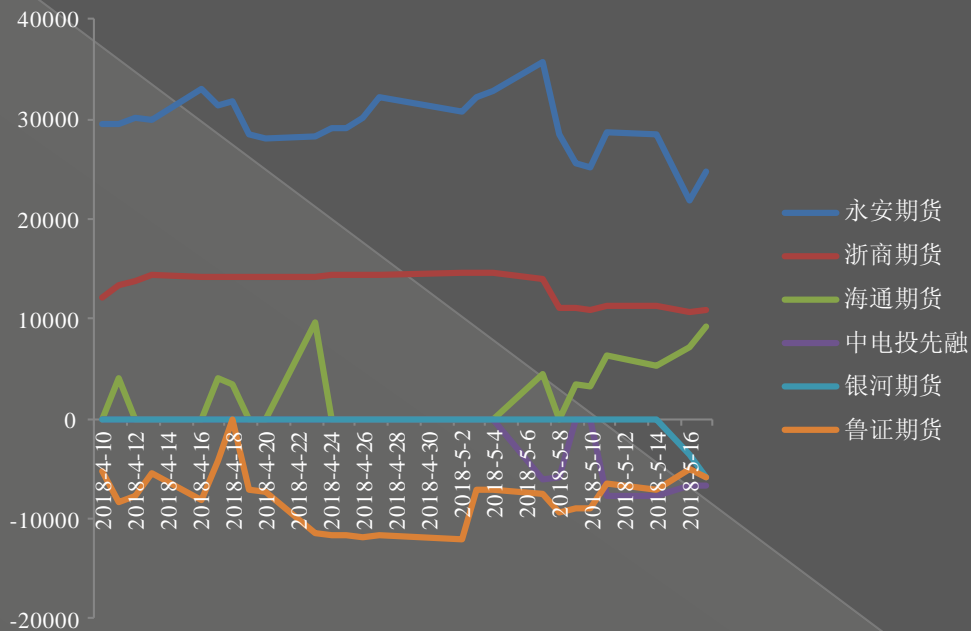


变动幅度		当日	最近5日	平均变化	波动率
j持仓	多头前3	-5.17%	66.57%	13.31%	38.20%
	空头前3	2.64%	31.31%	6.26%	
j涨幅		-0.58%	5.51%	1.10%	
震荡幅度	2.04%	2.74%(月均值)	投机度	1.19	1.44(月均值)

变动幅度		当日	最近5日	平均变化	波动率
jm持仓	多头前3	-11.51%	5.92%	1.18%	29.88%
	空头前3	-8.80%	69.32%	13.86%	
jm涨幅		-1.89%	0.58%	0.12%	
震荡幅度	2.73%	2.87%(月均值)	投机度	1.12	1.29(月均值)

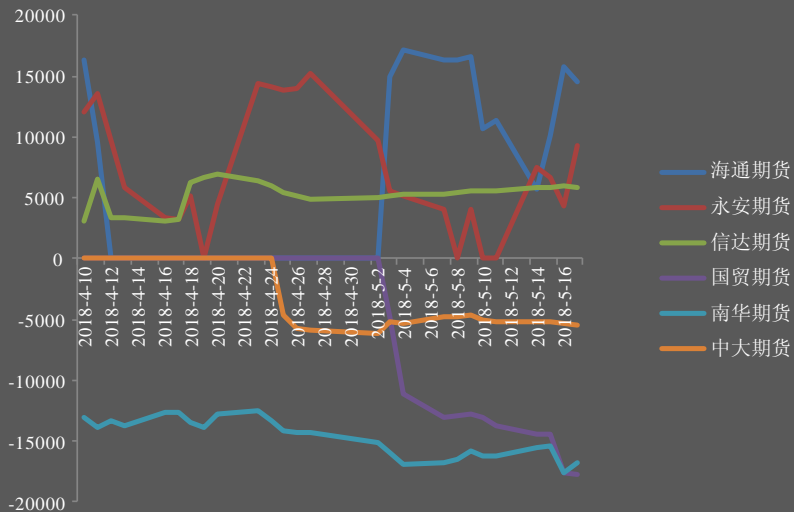
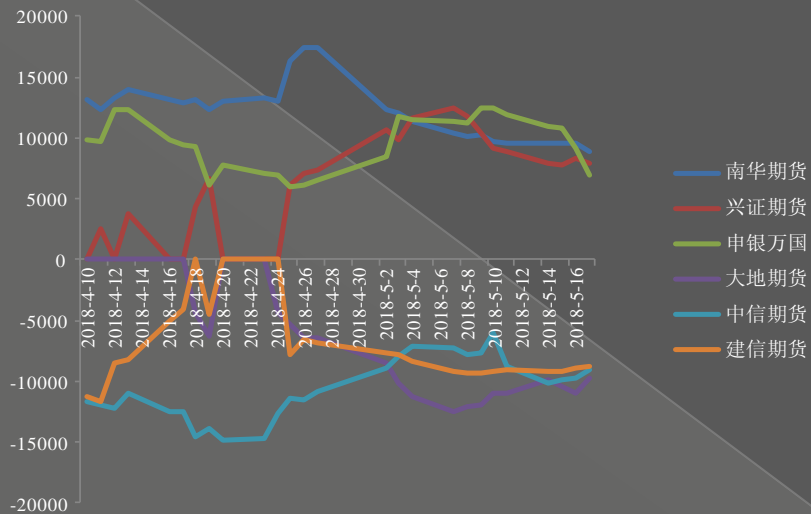


# 黑色：动力煤



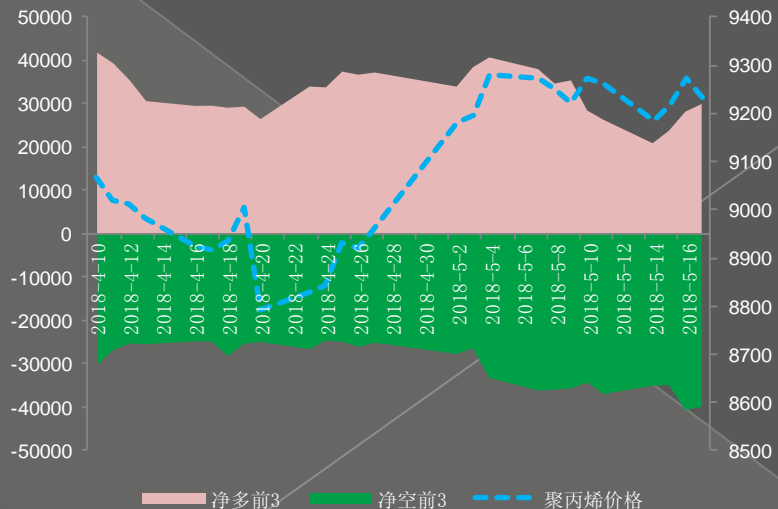
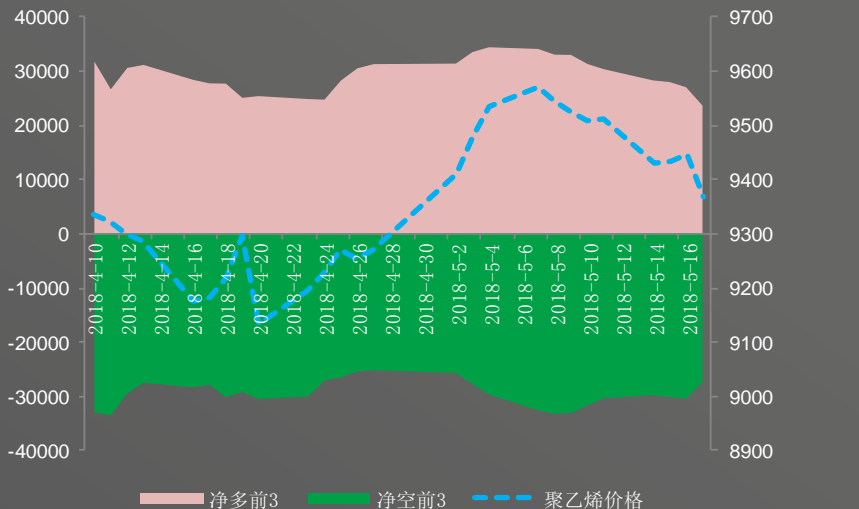
变动幅度		当日	最近5日	平均变化	波动率
zc持仓	多头前3	12.68%	-2.49%	-0.50%	27.40%
	空头前3	7.30%	-31.87%	-6.37%	
zc涨幅		-0.55%	5.61%	1.12%	
震荡幅度	0.95%	1.86%(月均值)	投机度	0.78	0.84(月均值)

# 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	-12.61%	-24.63%	-4.93%	11.84%
	空头前3	-9.96%	-13.47%	-2.69%	
I涨幅		-0.84%	-1.49%	-0.30%	
震荡幅度	1.47%	1.11%(月均值)	投机度	0.69	0.59(月均值)

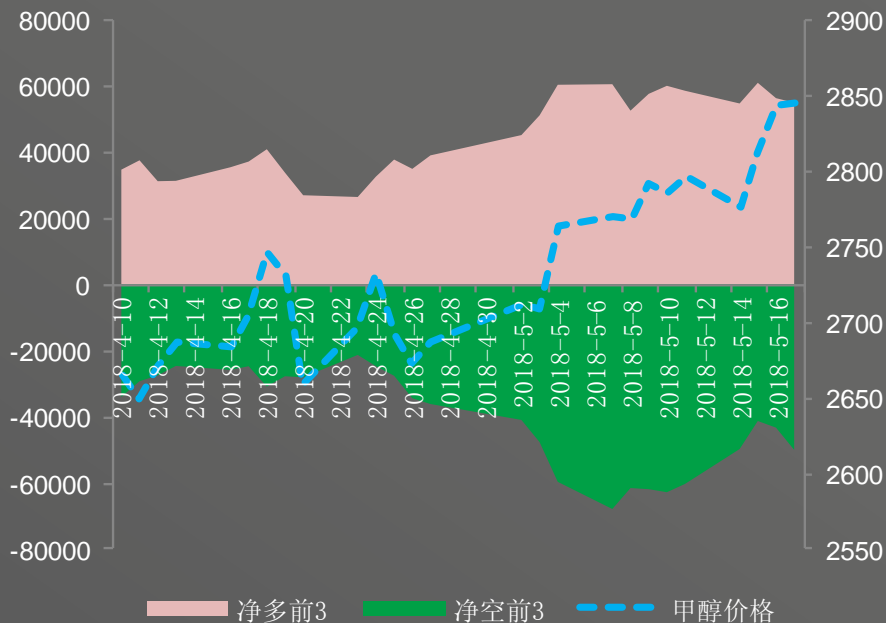
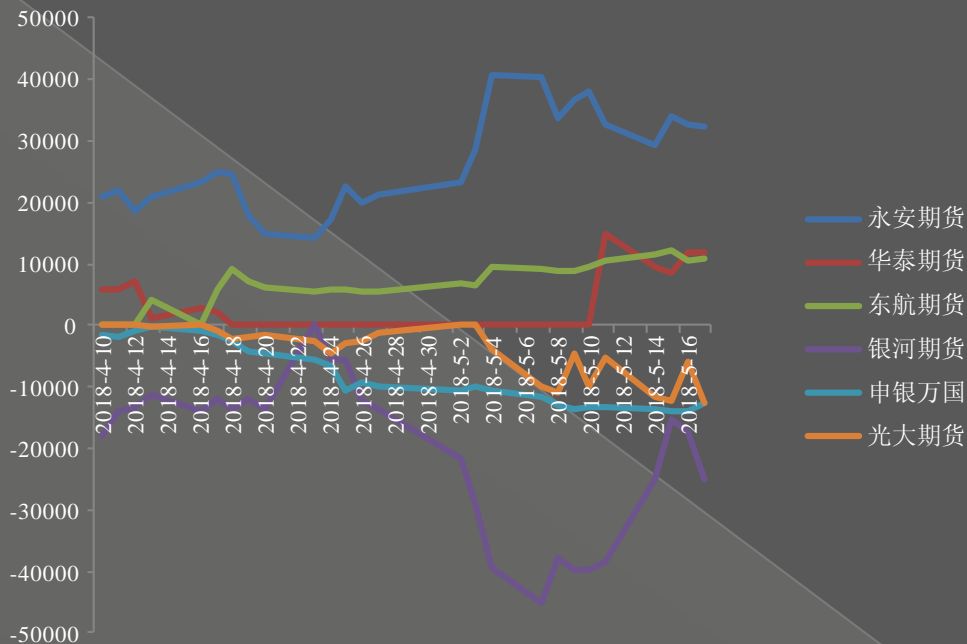
变动幅度		当日	最近5日	平均变化	波动率
pp持仓	多头前3	6.27%	5.37%	1.07%	15.14%
	空头前3	-1.74%	16.28%	3.26%	
pp涨幅		-0.43%	-0.43%	-0.09%	
震荡幅度	1.18%	1.23%(月均值)	投机度	0.75	0.75(月均值)



净多前3 净空前3 聚乙烯价格

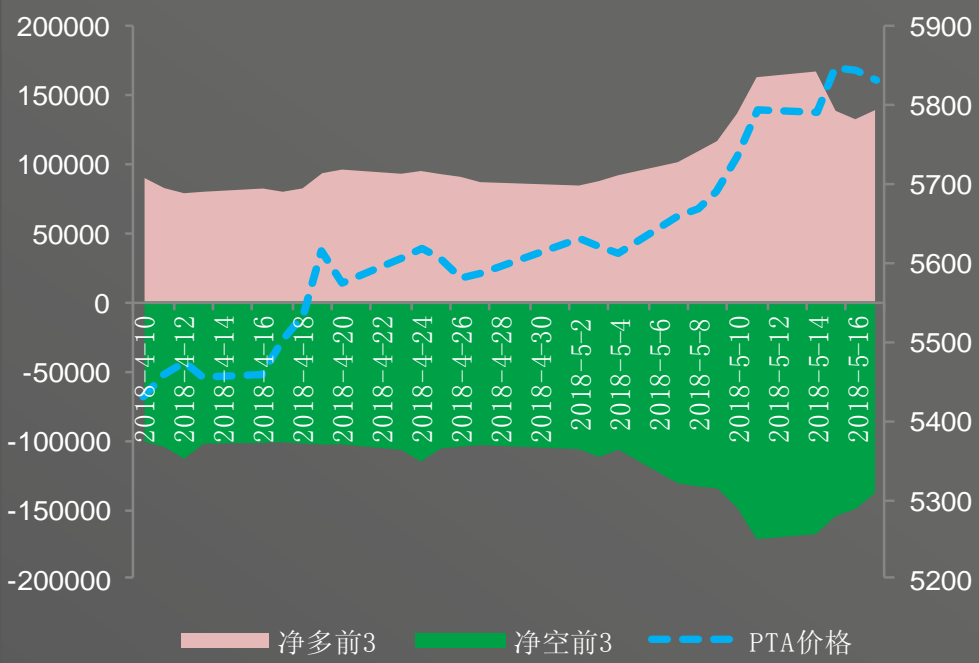
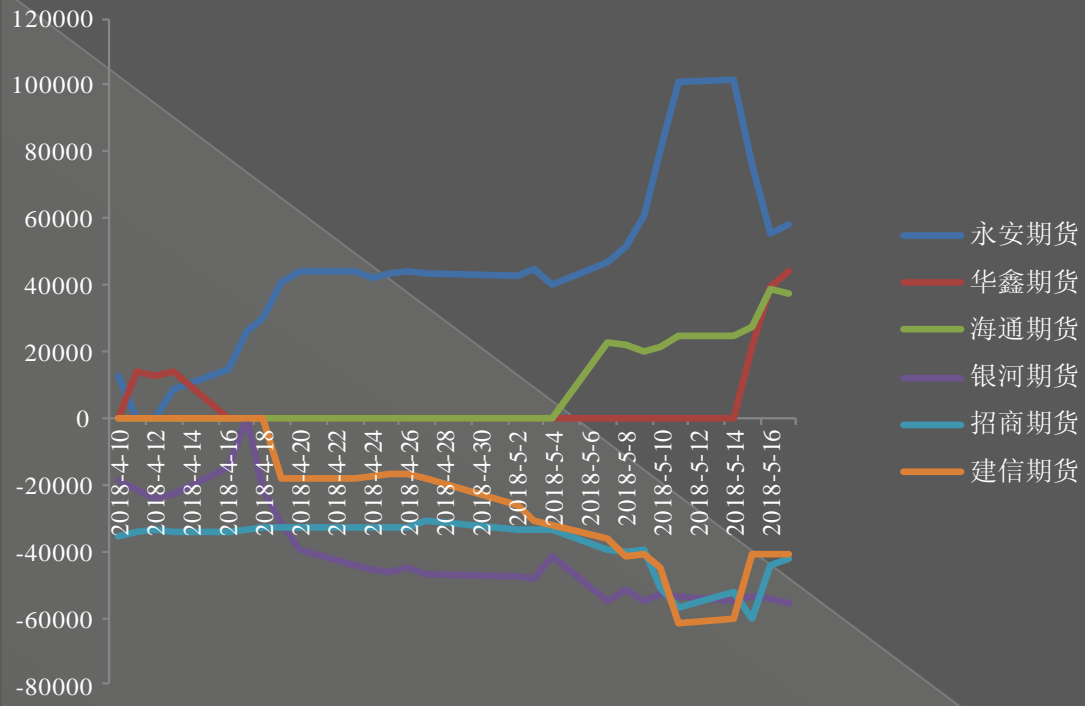
净多前3 净空前3 聚丙烯价格

# 化工：甲醇



变动幅度		当日	最近5日	平均变化	波动率
ma持仓	多头前3	-2.45%	-8.52%	-1.70%	17.35%
	空头前3	15.49%	-20.35%	-4.07%	
ma涨幅		0.04%	2.12%	0.42%	
震荡幅度	1.05%	1.66%(月均值)	投机度	0.64	0.94(月均值)

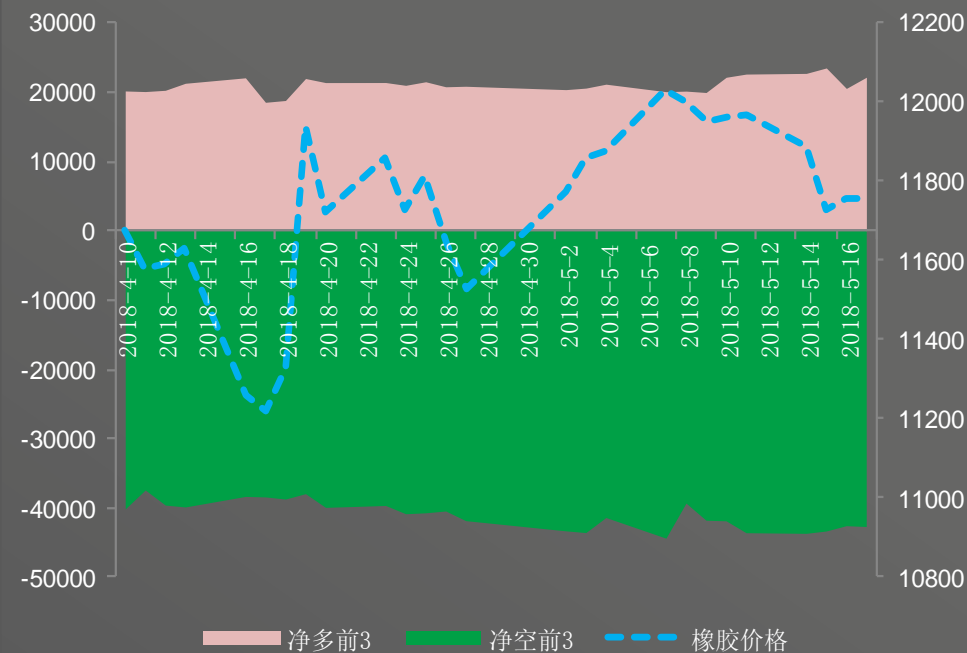
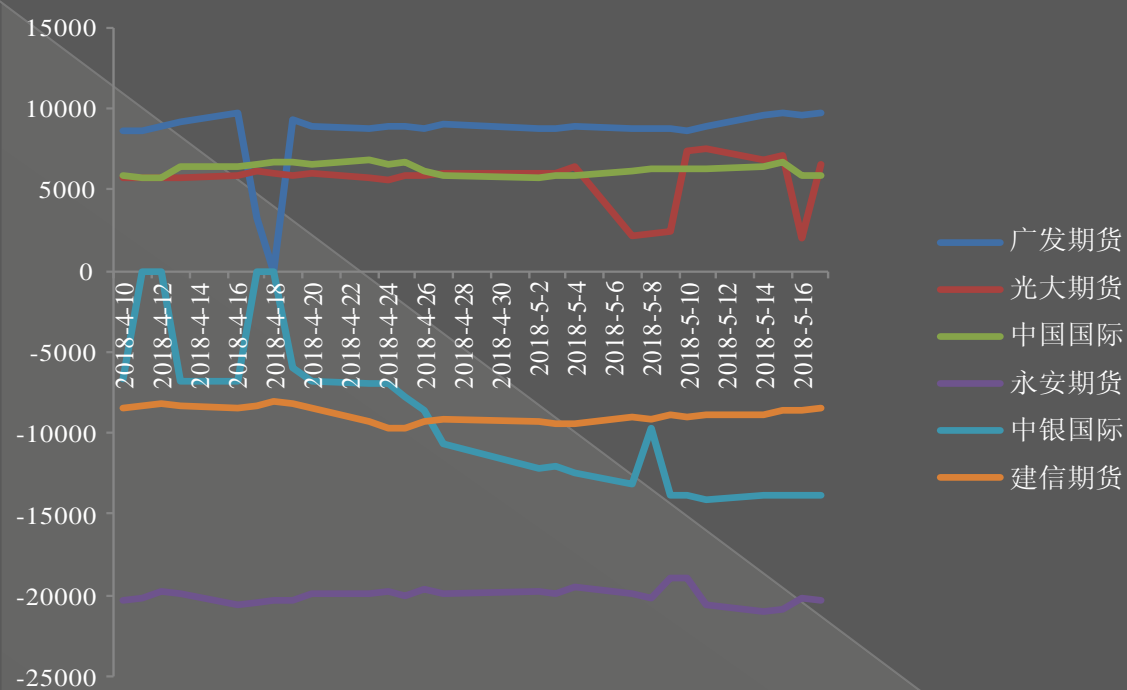
# 化工：PTA



变动幅度		当日	最近5日	平均变化	波动率
pta持仓	多头前3	5.01%	1.99%	0.40%	10.61%
	空头前3	-7.65%	-6.91%	-1.38%	
pta涨幅		-0.22%	1.70%	0.34%	
震荡幅度	0.58%	1.09% (月均值)	投机度	0.35	0.43 (月均值)

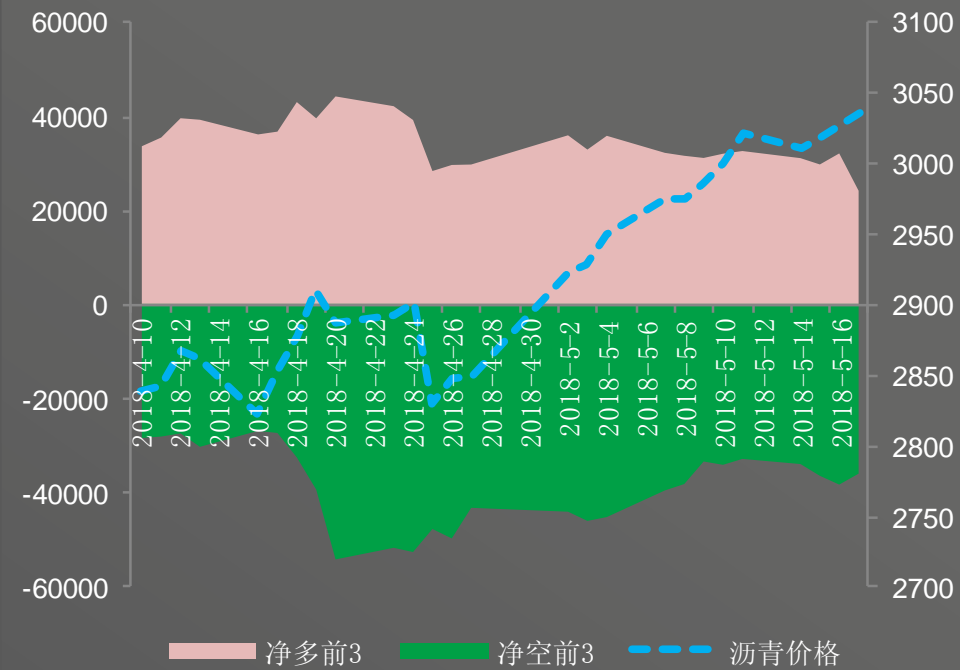
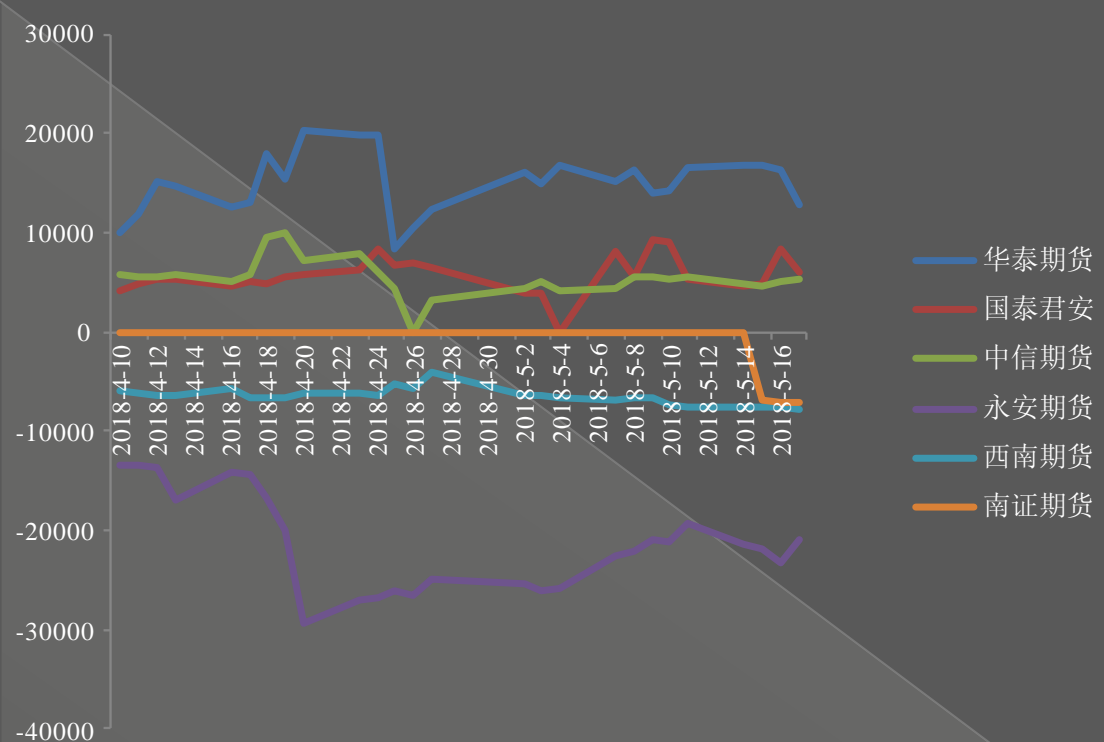


# 化工：橡胶



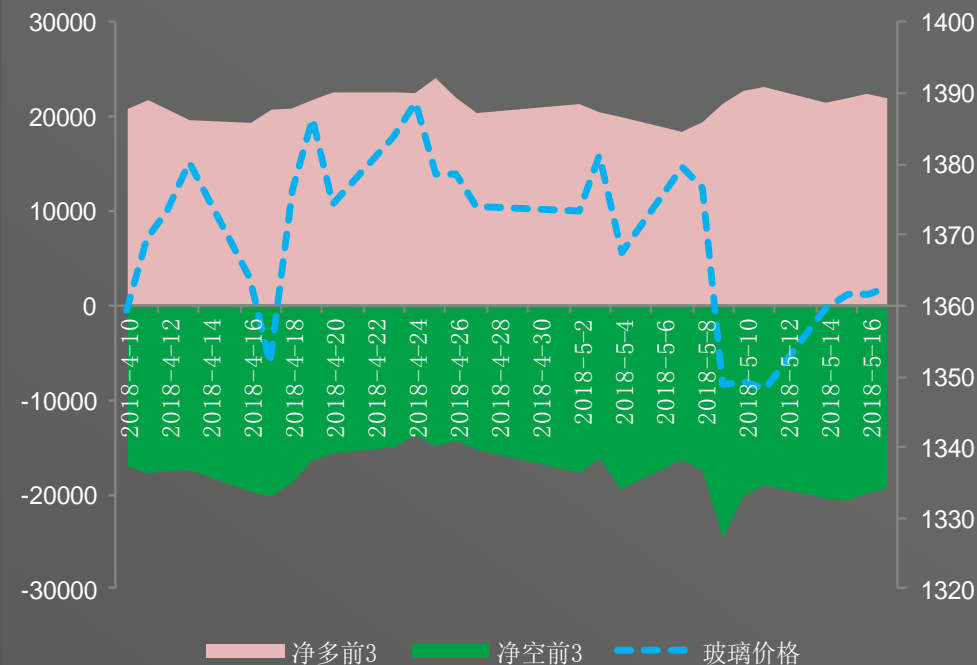
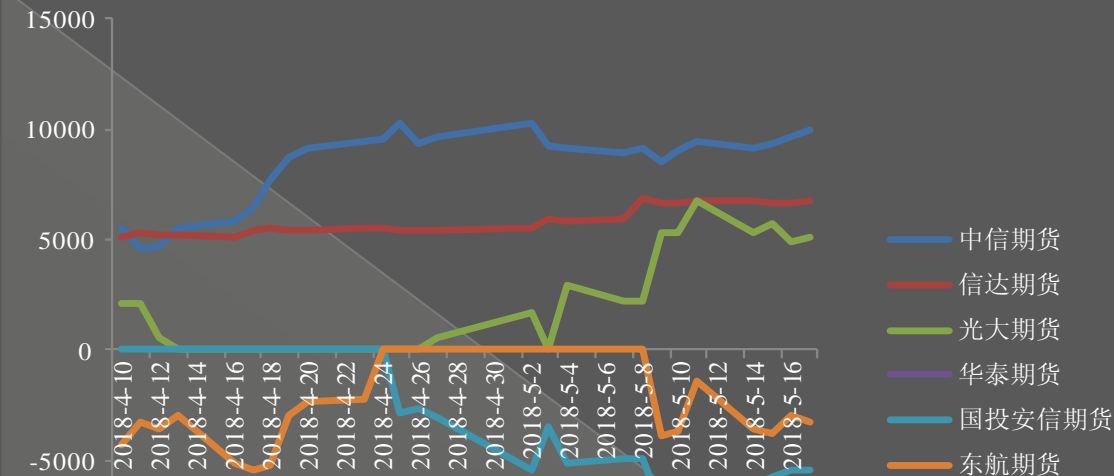
变动幅度		当日	最近5日	平均变化	波动率
ru持仓	多头前3	7.88%	0.05%	0.01%	24.88%
	空头前3	0.27%	1.96%	0.39%	
ru涨幅		0.01%	-1.69%	-0.34%	
震荡幅度	0.97%	1.98%(月均值)	投机度	0.67	0.88(月均值)

# 化工：沥青



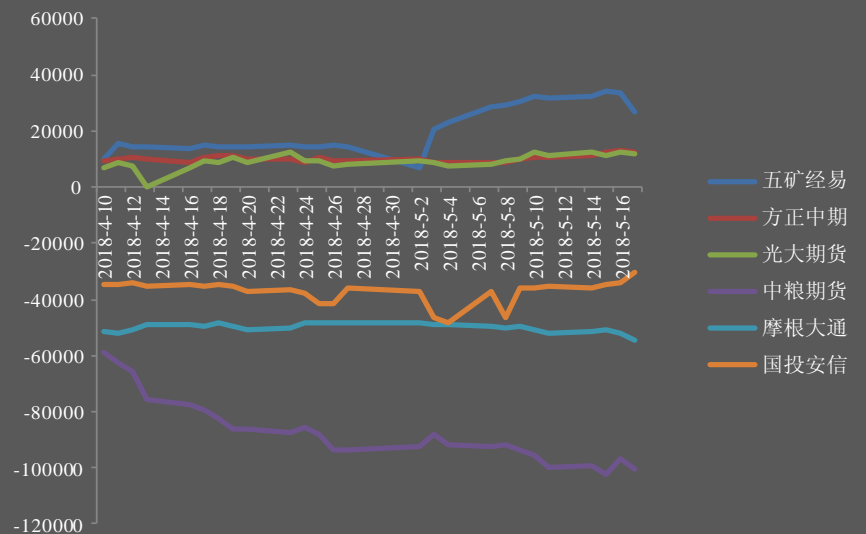
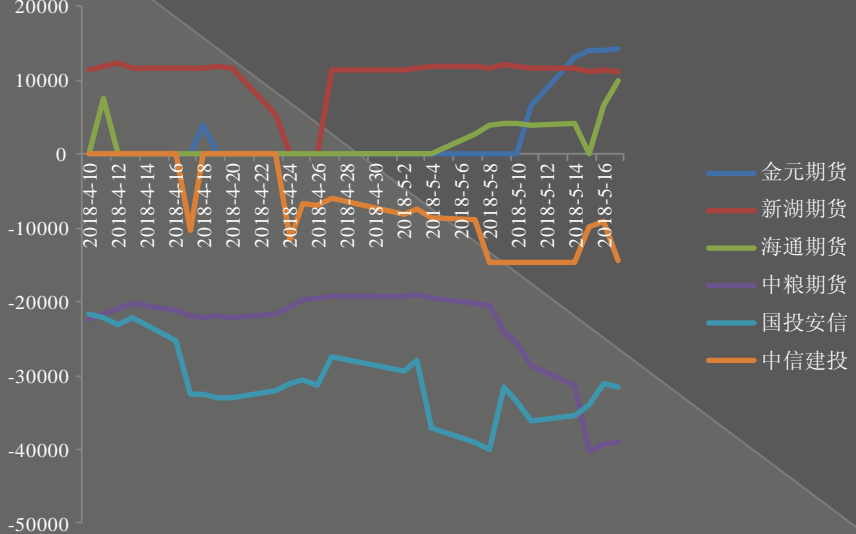
变动幅度		当日	最近5日	平均变化	波动率
bu持仓	多头前3	-24.81%	-24.67%	-4.93%	15.76%
	空头前3	-6.06%	5.49%	1.10%	
bu涨幅		0.34%	1.25%	0.25%	
震荡幅度	1.31%	1.50%(月均值)	投机度	0.70	0.81(月均值)

# 化工：玻璃



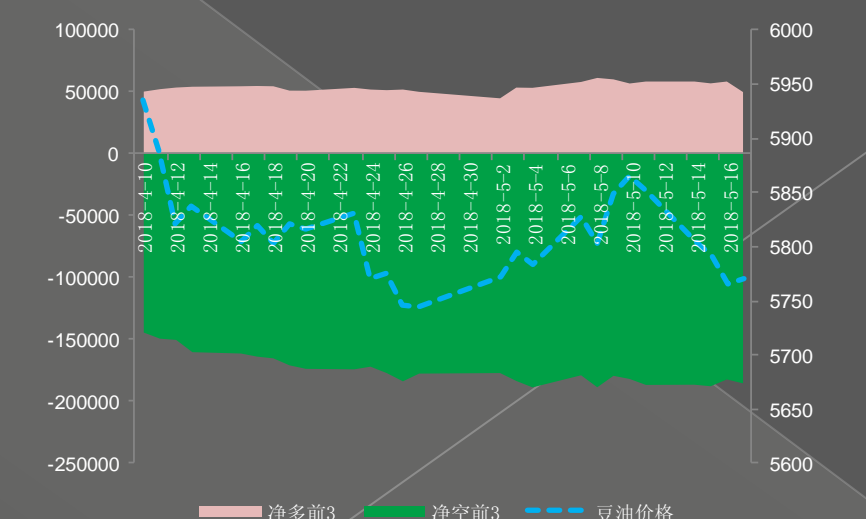
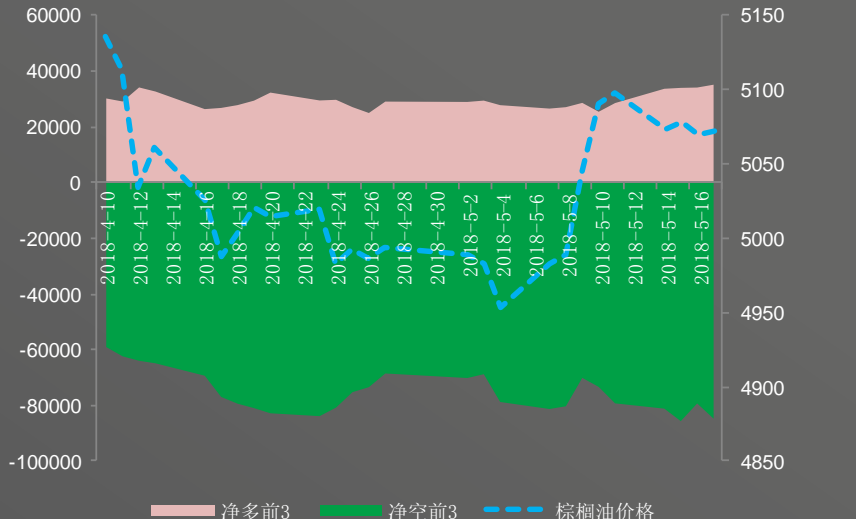
变动幅度		当日	最近5日	平均变化	波动率
fg持仓	多头前3	-2.11%	-3.49%	-0.70%	13.39%
	空头前3	-3.04%	-4.28%	-0.86%	
fg涨幅		0.07%	0.99%	0.20%	
震荡幅度	0.65%	1.29%(月均值)	投机度	0.38	0.56(月均值)

# 农产品：P & Y

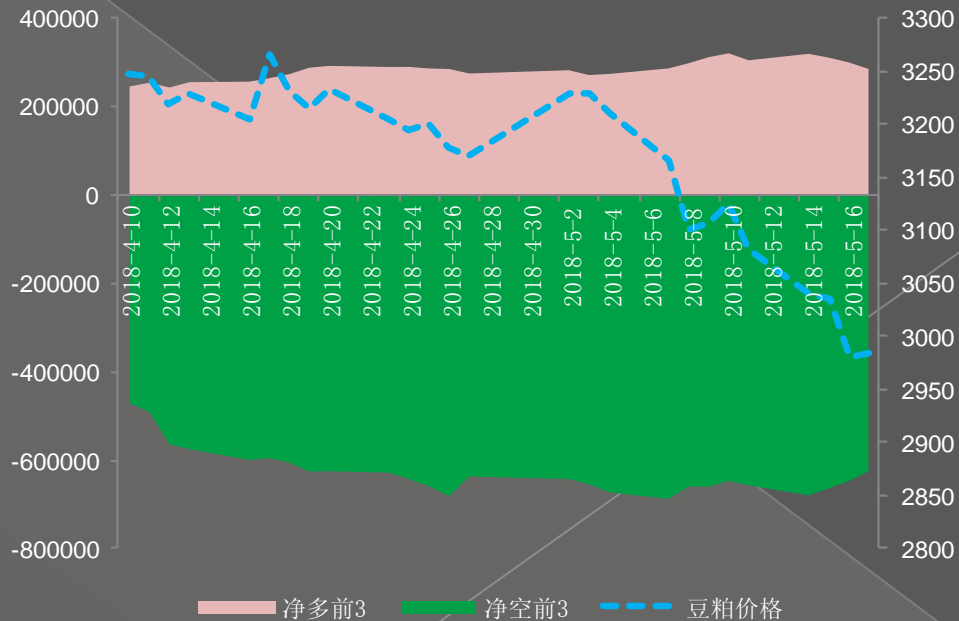
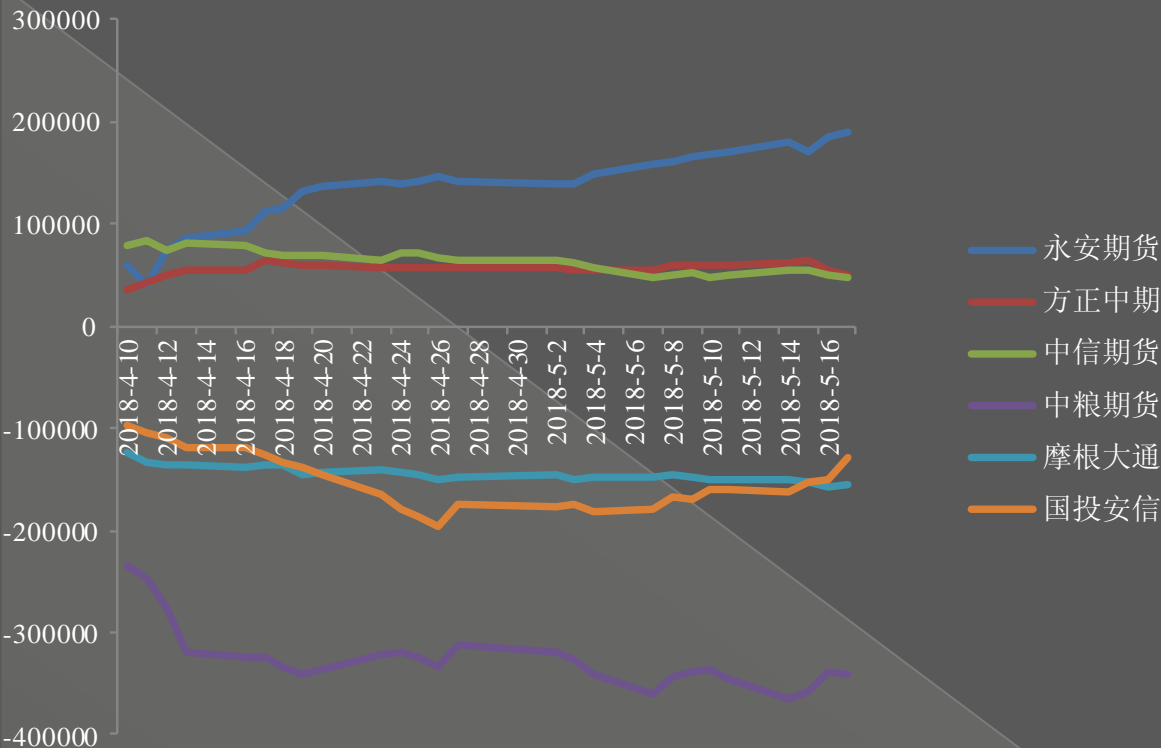


变动幅度		当日	最近5日	平均变化	波动率
p持仓	多头前3	2.95%	38.03%	7.61%	9.21%
	空头前3	6.89%	15.56%	3.11%	
p涨幅		0.04%	-0.36%	-0.07%	
震荡幅度	0.98%	0.82%(月均值)	投机度	0.41	0.47(月均值)

变动幅度		当日	最近5日	平均变化	波动率
y持仓	多头前3	-14.55%	-12.18%	-2.44%	9.02%
	空头前3	1.74%	1.96%	0.39%	
y涨幅		0.10%	-1.60%	-0.32%	
震荡幅度	0.74%	0.92%(月均值)	投机度	0.33	0.34(月均值)



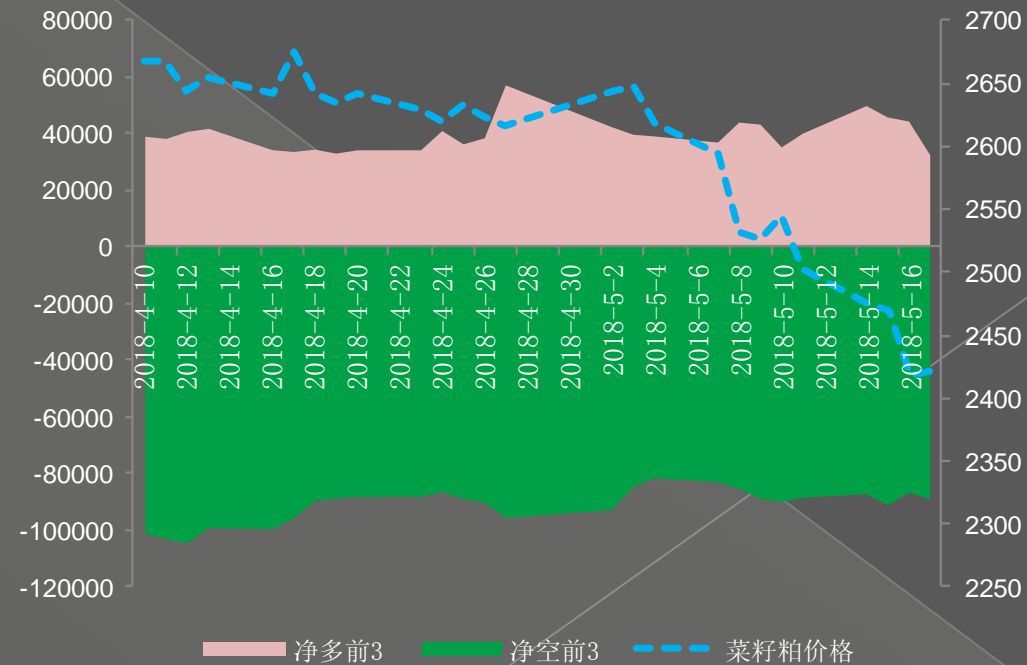
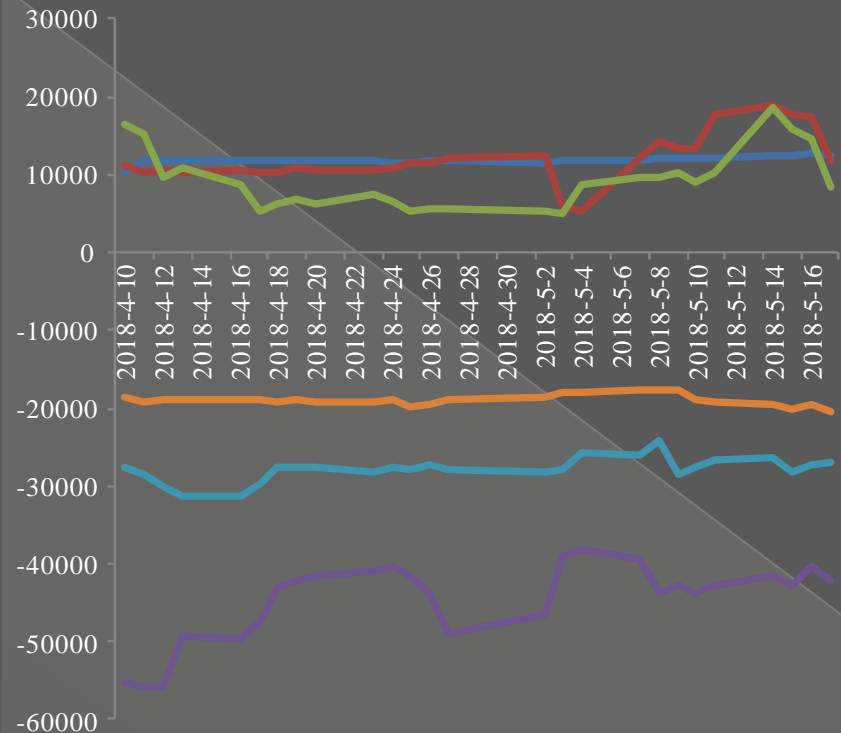
# 农产品：豆粕



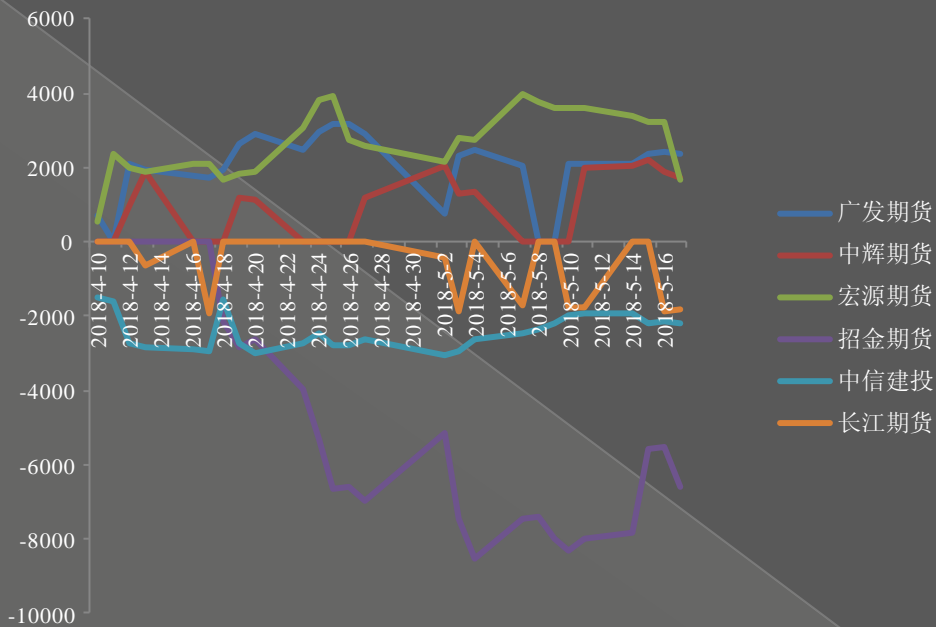
变动幅度		当日	最近5日	平均变化	波动率
m持仓	多头前3	-4.90%	-10.87%	-2.17%	16.46%
	空头前3	-3.42%	-3.30%	-0.66%	
m涨幅		0.14%	-4.49%	-0.90%	
震荡幅度	2.07%	1.74%(月均值)	投机度	0.65	0.54(月均值)

# 农产品：菜粕

- 福能期货
- 国泰君安
- 徽商期货
- 中粮期货
- 国投安信期货
- 中国国际

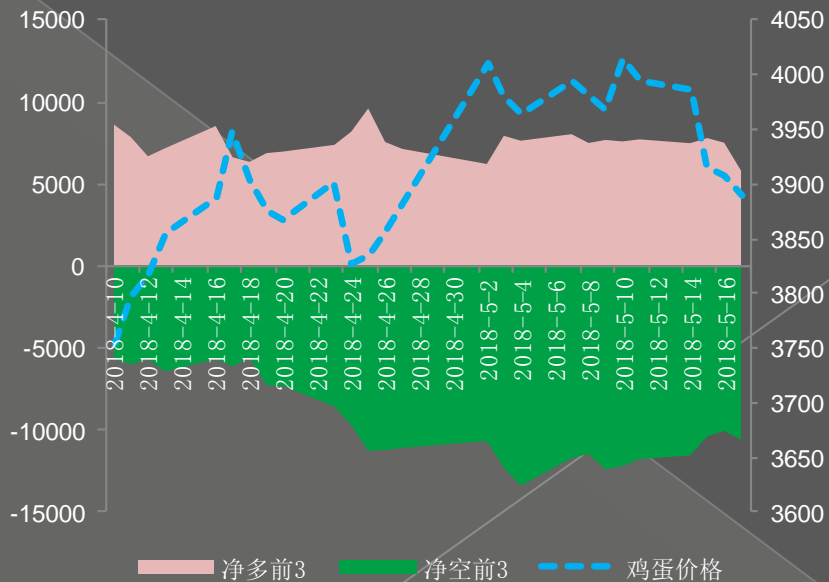


变动幅度		当日	最近5日	平均变化	波动率
rm持仓	多头前3	-26.76%	-7.77%	-1.55%	14.73%
	空头前3	2.72%	-0.97%	-0.19%	
rm涨幅		0.13%	-4.85%	-0.97%	
震荡幅度	1.68%	1.64%(月均值)	投机度	1.06	0.75(月均值)

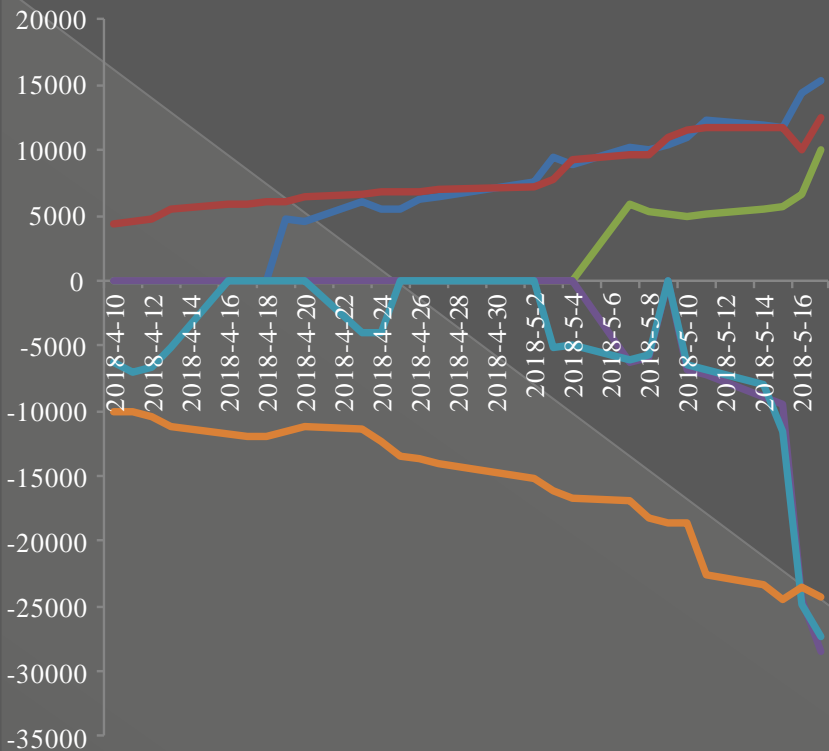


# 农产品：鸡蛋

变动幅度		当日	最近5日	平均变化	波动率
jd持仓	多头前3	-22.92%	-23.68%	-4.74%	19.68%
	空头前3	5.30%	-13.14%	-2.63%	
jd涨幅		-0.47%	-3.13%	-0.63%	
震荡幅度	1.13%	1.64%(月均值)	投机度	0.49	0.72(月均值)

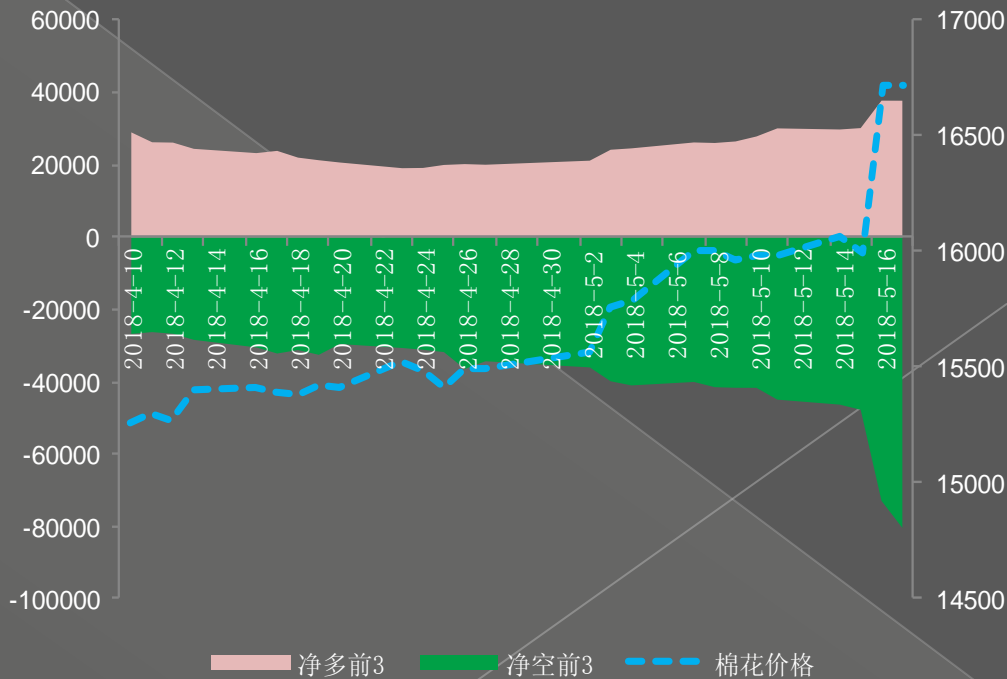


# 农产品：棉花



- 兴证期货
- 招金期货
- 中信建投
- 永安期货
- 华信期货
- 东证期货

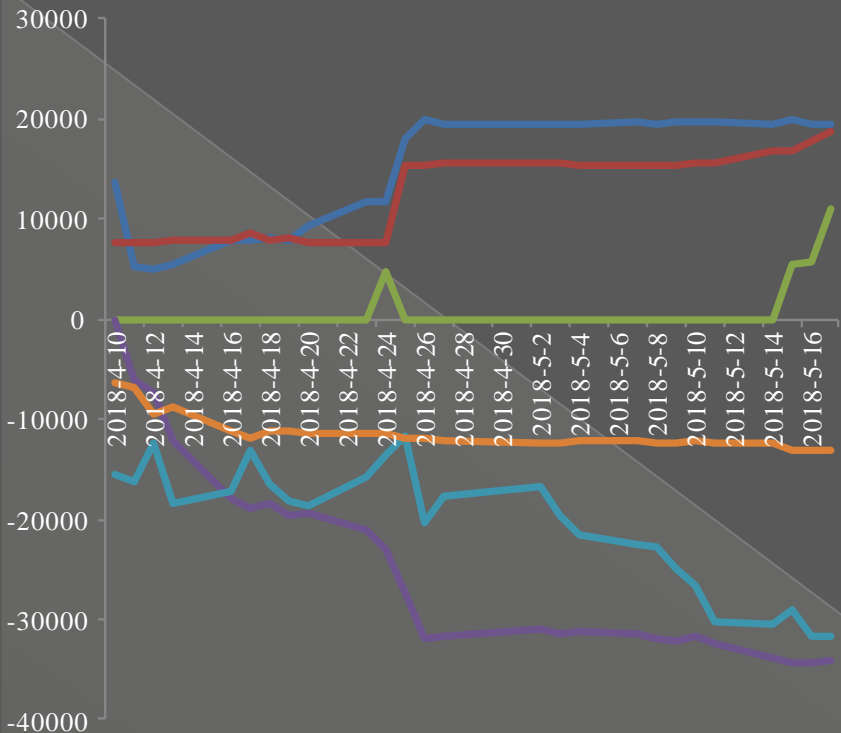
变动幅度		当日	最近5日	平均变化	波动率
cf持仓	多头前3	-0.04%	35.34%	7.07%	15.97%
	空头前3	10.27%	93.21%	18.64%	
cf涨幅		0.01%	4.61%	0.92%	
震荡幅度	3.13%	1.02%(月均值)	投机度	2.14	0.52(月均值)



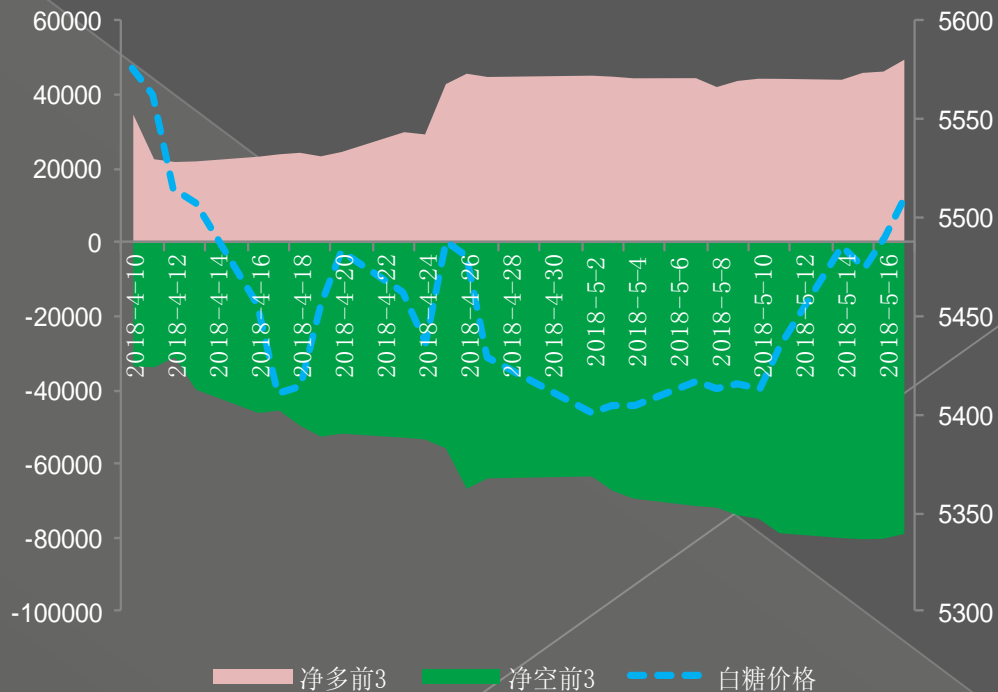
- 净多前3
- 净空前3
- 棉花价格

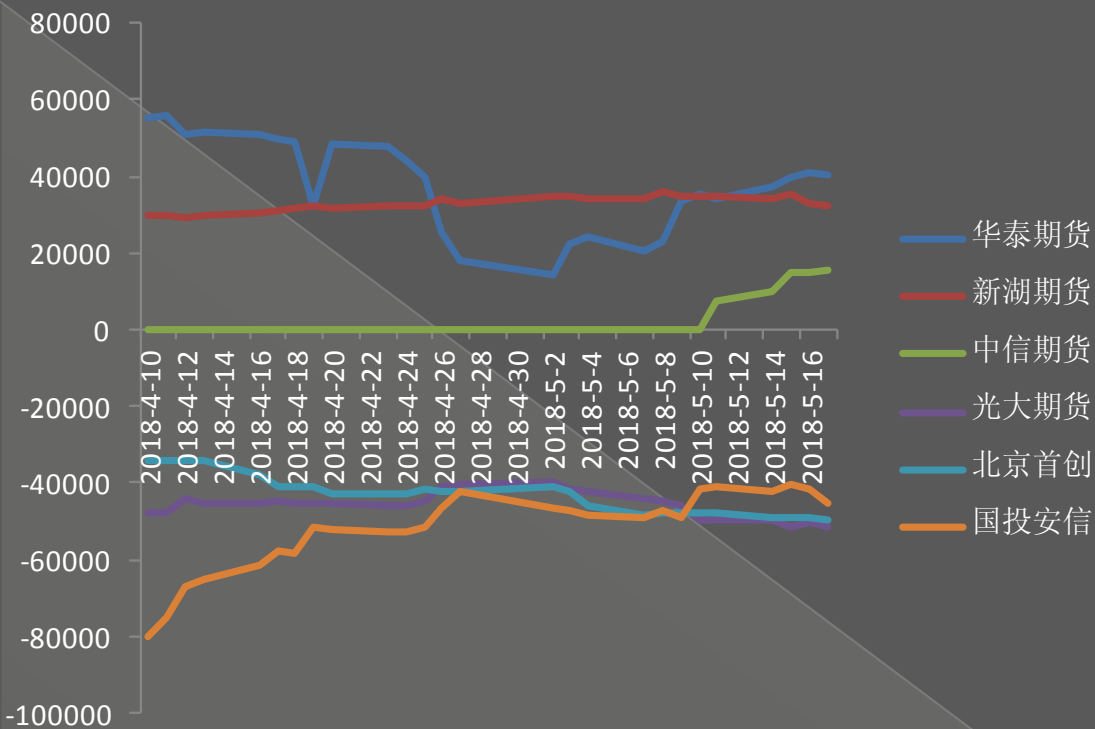


# 农产品：白糖



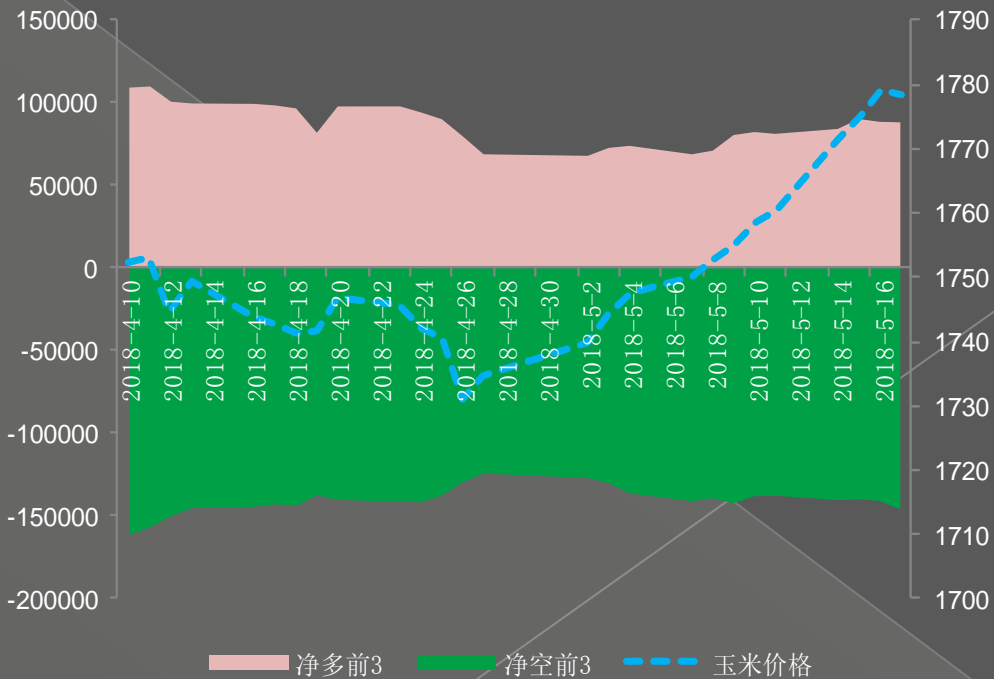
变动幅度		当日	最近5日	平均变化	波动率
sr持仓	多头前3	6.92%	11.61%	2.32%	9.93%
	空头前3	-1.65%	5.52%	1.10%	
sr涨幅		0.38%	1.81%	0.36%	
震荡幅度	0.81%	0.89% (月均值)	投机度	0.58	0.46 (月均值)





# 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	-0.34%	7.14%	1.43%	5.18%
	空头前3	3.68%	5.80%	1.16%	
c涨幅		-0.04%	1.12%	0.22%	
震荡幅度	0.58%	0.56%(月均值)	投机度	0.25	0.29(月均值)



# 部分机构资金变动表

制表日期：2018年5月17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	15174.03	4.99%	102266.75	47.11%
南华期货	-15389.53	-15.32%	-3473.30	-3.92%
混沌天成	0.00	--	0.00	--
海通期货	6859.84	5.76%	-4383.39	-3.36%
上海大陆	-2011.98	-9.21%	854.25	4.50%
中信期货	-12299.40	-6.42%	-17390.21	-8.85%
新湖期货	1487.57	2.60%	-8345.89	-12.43%

中粮期货	7288.20	2.31%	10695.29	3.43%
中信建投	1130.04	2.13%	9382.55	20.89%
申银万国	1454.10	2.75%	1105.65	2.07%
华泰期货	-16621.75	-22.71%	12683.08	28.89%
光大期货	-7086.21	-5.62%	32957.68	38.33%
一德期货	-7320.06	-5.57%	-24583.18	-16.54%
国投期货	-654.20	-0.75%	16329.31	23.39%
金瑞期货	23384.22	20.61%	13435.96	10.89%
鲁证期货	2901.44	4.65%	25372.47	63.59%
中国国际	704.73	1.13%	-4973.90	-7.29%

## 部分机构持仓一览

机构	永安期货					
日期	2018-5-10	2018-5-11	2018-5-14	2018-5-15	2018-5-16	2018-5-17
黄金	2609	2614	2333	2367	2320	2352
白银					-7869	-7402
沪铜		1649	3860	4154	3011	3174
沪铝	2196	2150	1751	2208		
沪镍	13867	13735	18610	20416	22055	24038
沪锌			-5217	-4873	-6502	-5476
沪铅	2307	3193	4508	4466	4067	4328
螺纹钢	33101	21327	27528	37782	25621	43596
铁矿石		1291				
焦煤	-2590	-8850	-10303	-12464	-13365	-14270
焦炭	6604	7827	12114	11582	16512	15313
豆油	12855	15240	14390	10713	1046	2763
棕榈油	3877	8050	7960	7248	5627	5704
菜籽油	4975	7079	6943	8352	10649	9744
豆粕	168230	171243	180232	171109	186273	189729
菜籽粕	-1471	-2104	-3098	-3044	-905	2123
棉花	-6836	-7220	-8887	-9465	-24451	-28542
白糖	-31608	-32426	-33965	-34441	-34283	-34142
玉米	-15878	-19353	-23323	-23859	-24421	-23976
鸡蛋						
PTA	80365	100786	101557	76442	55518	58419
聚乙烯	-3800				-6058	-5586
聚丙烯			7577	6636	4394	9347
甲醇	38011	32869	29448	34117	32859	32332
玻璃	6902	6480	5515	3664	5971	2130
橡胶	-18966	-20627	-21054	-20899	-20179	-20315
沥青	-21254	-19354	-21464	-21803	-23305	-20961
动力煤	25301	28688	28593		21979	24842

# 部分机构持仓一览

机构	南华期货					
日期	2018-5-10	2018-5-11	2018-5-14	2018-5-15	2018-5-16	2018-5-17
黄金					-878	-963
白银		8659			8927	9151
沪铜	5051	4622	4621	4160	4036	4295
沪铝	301	6795	6633	6732	6878	7257
沪镍	-7942	-15113	-7788	-6344	-6602	-5477
沪锌					3563	3994
沪铅						
螺纹钢	-10903	-10195	-9273			
铁矿石	19163	19592	19481			
焦煤						
焦炭					-2569	-2565
豆油	-9550		-10081		-8771	
棕榈油	3730	3633				
菜籽油	-7932		-7690			
豆粕	-42555	-43960	-43716	-43027	-39152	-33471
菜籽粕	-8555	-9987	-9333	-9588	-9727	-8066
棉花						
白糖	6753	6862	6567	6617	6558	6855
玉米					-12027	
鸡蛋	-1781	-1746	-1722			-1665
PTA					-51461	-38047
聚乙烯	9780	9600	9524	9537	9644	8841
聚丙烯	-16218	-16149	-15475	-15330	-17572	-16744
甲醇	8690	9683	8883		8750	
玻璃	-2280					
橡胶	1473	1570	1565	1219	1110	1275
沥青						
动力煤						1449

# 部分机构持仓一览

机构	国泰君安					
日期	2018-5-10	2018-5-11	2018-5-14	2018-5-15	2018-5-16	2018-5-17
黄金	6995	7094	6953	7407	7742	7706
白银	-15534	-16060	-15509	-14770	-15989	-16748
沪铜	5266	8894	8566	8937	9284	8869
沪铝						
沪镍	5130	5567	5596			
沪锌						
沪铅	1399	1593	1567	1570	1746	1242
螺纹钢						
铁矿石	14454	13302	15385	14614	14200	19093
焦煤	1249	1041		2088		3341
焦炭	-1012		-521		-953	-977
豆油	-12126	-12943	-13594	-11105		-13368
棕榈油	6658	7522	8506	8951	3906	4211
菜籽油	31825	32014	32144	32077	24183	24275
豆粕	29968		28579	26678		24306
菜籽粕	13457	17877	18983	17821	17345	11710
棉花						7338
白糖	-9920	-9870	-9328		-8674	
玉米		-11903				
鸡蛋		1390				
PTA	24197	31717	33497	35329	28998	30543
聚乙烯					4336	4789
聚丙烯						
甲醇	11483	10517	10439	10370	9544	8294
玻璃	-2305	-1904	-1492	-2176	-2597	-2470
橡胶						
沥青	8949	5374	4556	4935	8237	6042
动力煤	-3958	-4561				

## 部分机构持仓一览

机构	混沌天成					
日期	2018-5-10	2018-5-11	2018-5-14	2018-5-15	2018-5-16	2018-5-17
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	2018-5-10	2018-5-11	2018-5-14	2018-5-15	2018-5-16	2018-5-17
黄金						2441
白银		7166	6234			
沪铜	-13203	-6027	-6660	-12430	-8981	-9151
沪铝	-7931	-14268	-8175	-7169		
沪镍	7181	6965	11782	10307	9947	9519
沪锌	-3432					-4048
沪铅	6658	6772	6954	7052	6606	6799
螺纹钢	-49475	-47051	-47165	-36343	-36441	-37379
铁矿石	-9906	-6381		-2482	-1473	584
焦煤	1050	1975	2601	1600		958
焦炭	2283	4120	1249	1460	1732	
豆油						
棕榈油	4117	3951	4162		6543	9975
菜籽油	-6551	-5782		-5550		
豆粕	33740	26949	27411		29189	27939
菜籽粕		-1660	-703	-597		-733
棉花	5052	5808	6239	4907	13401	9908
白糖				5573	5861	10969
玉米					7507	7295
鸡蛋	1910		1242			
PTA	21373	24875	24378	27488	38443	37539
聚乙烯	4873					
聚丙烯	10756	11317	5769	10128	15757	14557
甲醇	6029	11184		8763	6719	9116
玻璃	1592	-1548			-2098	-2295
橡胶		-1141				
沥青	4759	4718	5031	4697	4474	4486
动力煤	3352	6366	5305		7246	9229

## 部分机构持仓一览

机构	上海大陆					
日期	2018-5-10	2018-5-11	2018-5-14	2018-5-15	2018-5-16	2018-5-17
黄金						
白银						
沪铜	6001	5979	6261	6579	6429	5966
沪铝						
沪镍						
沪锌						
沪铅						
螺纹钢						
铁矿石						
焦煤						
焦炭						
豆油						
棕榈油	7083	8959	9002	8978	8928	8948
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					-2775	
动力煤						

# 部分机构持仓一览

机构	中粮期货					
日期	2018-5-10	2018-5-11	2018-5-14	2018-5-15	2018-5-16	2018-5-17
黄金						
白银	7385				8872	5490
沪铜	-9343	-9783	-11130	-10512	-8671	-9190
沪铝	-15123	-15610	-15848	-15878	-17338	-17601
沪镍	-10361	-10947	-9075	-8432		
沪锌	11510	11594	12897	9605	6643	6344
沪铅				-1963	-1018	-1604
螺纹钢						
铁矿石						
焦煤	4417	2596				
焦炭					2782	2730
豆油	-95261	-99694	-99418	-102058	-96730	-100189
棕榈油	-25568	-28710	-31331	-40163	-39319	-39098
菜籽油	-19883	-23829	-24058	-25046	-28473	-28359
豆粕	-335271	-346630	-365119	-357943	-338298	-339797
菜籽粕	-43649	-42715	-41461	-42916	-40219	-42045
棉花	-7905	-7302	-7272	-5853	-8112	-10643
白糖	-26553	-30200	-30499	-29025	-31586	-31654
玉米	-26789	-27217	-27511	-28153	-28583	-30212
鸡蛋						
PTA	20882	20573	16186	17561	23274	23128
聚乙烯			-4235	-4196	-4104	-4199
聚丙烯						
甲醇						
玻璃						
橡胶	-7852	-7819	-7850	-7824	-7537	-7501
沥青						
动力煤	-4552	-4816	-5290		-4837	-4898

# 部分机构持仓一览

机构	中信期货					
日期	2018-5-10	2018-5-11	2018-5-14	2018-5-15	2018-5-16	2018-5-17
黄金	13520	13525	13477	13180	12579	10757
白银	-32518	-28691	-26933	-25934	-22367	-23748
沪铜	-14138	-13770	-13331	-13366	-14333	-13868
沪铝	861		-3399			
沪镍	-13570	-14188	-12372	-10956	-11241	-11955
沪锌	14355	13347	13790	14038	9585	9361
沪铅	-1384	-3909	-5229	-5047	-4884	-4033
螺纹钢					-14409	-11326
铁矿石		-5422	-626		-9886	-10963
焦煤	5041	5026	3520	3628	4074	3761
焦炭	-1239	-2138	-1980	-2246	-2062	-1998
豆油		-10641	-10081			
棕榈油	-8967	-2140	-2630		-4845	
菜籽油	-14156	-11769	-10951	-10433	-11106	-10401
豆粕	48748	50021	54304	53971	51064	48602
菜籽粕	7454	5856	6664	5689	4724	3253
棉花			4184	6908		
白糖	-16609	-16084	-15581	-16885	-14356	-12959
玉米		7260	10123	15036	14661	15261
鸡蛋	1376			1536		
PTA	32507	31301	32903	23058	34648	33927
聚乙烯	-5984	-8743	-10197	-9810	-9660	-9001
聚丙烯	8154	7554	6344	6060	5605	5703
甲醇	8510		9165	9262		
玻璃	9088	9501	9156	9403	9672	9994
橡胶		-3881				
沥青	5191	5608	4891	4642	5095	5300
动力煤	1489	2412				1155

## 部分机构持仓一览

机构	中信建投					
日期	2018-5-10	2018-5-11	2018-5-14	2018-5-15	2018-5-16	2018-5-17
黄金					2186	
白银				6459		
沪铜						
沪铝						
沪镍			-4976	-5316	-5372	-5479
沪锌						
沪铅			-799			
螺纹钢						
铁矿石	33541	34006	38608	43010	40604	38576
焦煤						2819
焦炭						
豆油						
棕榈油	-14551	-14596	-14647	-9893	-9111	-14334
菜籽油	4017					
豆粕						
菜籽粕						
棉花	4870	5041	5430	5639	6590	9994
白糖						
玉米	10086	9429				
鸡蛋	-1980	-1924	-1902	-2176	-2150	-2169
PTA					15287	
聚乙烯						
聚丙烯						
甲醇	6642					7018
玻璃						
橡胶	4865	4837	4819			
沥青	-3602	-3692	-3691	-3512	-3432	-3062
动力煤						

## 部分机构持仓一览

机构	新湖期货					
日期	2018-5-10	2018-5-11	2018-5-14	2018-5-15	2018-5-16	2018-5-17
黄金	-839	-834	-827	-899	-874	-906
白银						
沪铜						
沪铝						
沪镍						
沪锌						
沪铅						
螺纹钢	22683	24818	-25520	-21997		
铁矿石						
焦煤						
焦炭						
豆油					2275	
棕榈油	11843	11709	11763	11170	11397	11079
菜籽油		-5205	-5462	-4874	-5734	-5597
豆粕	-97075	-96515	-96000	-94769	-102194	-98216
菜籽粕						
棉花						
白糖						
玉米	34741	34677	34251	35558	33045	32450
鸡蛋	1614	1326	1348		1621	1645
PTA	-16463	-26754				
聚乙烯		4475	3344	3239		3327
聚丙烯						
甲醇						
玻璃						
橡胶	-6076	-6073	-6165	-6585	-6056	-6025
沥青	-5207	-5682	-3989	-3829		-3708
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

