



市场持仓分析

2018/7/27

今天持仓变化

品种	今天变化						今天头寸变化参考	
	净多前3	净多前5	净多前10	净空前3	净空前5	净空前10	净多前3-净空前3	指标参考
甲醇	-3.31%	-1.92%	-6.04%	-13.47%	-13.95%	-18.94%	10.16%	☆☆☆
沪铝	17.75%	14.58%	8.73%	7.82%	5.38%	3.55%	9.93%	☆☆
沥青	2.13%	1.28%	0.86%	-7.67%	-5.80%	-3.84%	9.80%	☆☆
豆油	4.76%	6.26%	9.99%	0.33%	2.52%	1.69%	4.43%	☆
苹果	-5.42%	-4.35%	-3.06%	-7.66%	-6.93%	-6.08%	2.24%	☆
豆粕	-0.22%	4.48%	2.14%	-1.96%	-1.47%	-1.24%	1.74%	☆
沪锌	2.77%	9.37%	4.88%	1.22%	0.14%	-2.40%	1.55%	☆
沪铜	2.19%	0.43%	-0.93%	1.00%	0.50%	0.83%	1.19%	☆
沪金	-6.37%	-3.92%	-4.46%	-6.41%	-7.26%	-4.44%	0.04%	☆
沪镍	-6.46%	-2.35%	5.48%	-6.24%	-5.67%	-4.29%	-0.21%	☆
鸡蛋	-3.70%	-3.05%	2.54%	-2.61%	1.13%	4.96%	-1.09%	☆
棉花	-2.61%	-2.89%	-11.95%	-1.42%	-1.28%	-6.68%	-1.18%	☆
玉米	-3.94%	-2.74%	-1.13%	-2.66%	-3.17%	3.06%	-1.28%	☆
PTA	7.22%	5.97%	3.60%	8.96%	9.29%	5.28%	-1.75%	☆
螺纹钢	0.52%	0.07%	0.06%	2.55%	-1.22%	-12.46%	-2.03%	☆
聚丙烯	-3.92%	-3.05%	-3.17%	-0.31%	-0.18%	-3.88%	-3.62%	☆
聚乙烯	2.09%	-1.98%	-1.17%	5.80%	7.00%	6.09%	-3.71%	☆
棕榈油	-3.39%	0.53%	1.24%	1.47%	1.40%	-4.10%	-4.86%	☆
橡胶	-0.51%	-2.32%	-2.87%	5.12%	4.00%	0.25%	-5.63%	☆☆
焦炭	2.06%	4.39%	2.51%	8.87%	18.59%	10.78%	-6.81%	☆☆
沪银	-7.89%	-5.59%	-5.45%	1.18%	-0.34%	3.58%	-9.06%	☆☆
白糖	-3.06%	-3.91%	-4.34%	7.53%	9.69%	4.04%	-10.59%	☆☆☆
菜籽粕	-12.74%	-7.73%	-9.52%	2.25%	2.36%	-3.55%	-15.00%	☆☆☆
玻璃	-2.77%	-6.83%	-7.64%	13.26%	10.28%	-7.92%	-16.03%	☆☆☆
焦煤	6.44%	11.88%	12.07%	23.22%	37.23%	30.64%	-16.78%	☆☆☆
动力煤	-4.61%	-3.02%	0.54%	14.68%	9.24%	1.29%	-19.29%	☆☆☆

近5日持仓变化

品种	五日变化						近五日头寸变化参考	
	多头前3	多头前5	多头前10	空头前3	空头前5	空头前10	多头前3-空头前3	指标参考
苹果	-5.46%	-5.02%	-6.83%	-68.83%	-64.62%	-60.86%	63.37%	☆☆☆☆
橡胶	22.48%	9.80%	0.99%	3.12%	4.73%	-3.53%	19.36%	☆☆
螺纹钢	-4.00%	-4.13%	-5.40%	-19.91%	-14.21%	-21.06%	15.91%	☆☆
沪铜	-0.75%	-1.69%	-11.67%	-16.15%	-16.80%	-15.24%	15.40%	☆☆
焦炭	12.67%	9.45%	17.17%	-1.43%	2.62%	12.99%	14.10%	☆☆
PTA	38.71%	29.86%	17.97%	28.50%	26.00%	18.86%	10.21%	☆☆
沪镍	-0.78%	-0.62%	37.43%	-10.50%	-8.07%	1.78%	9.73%	☆
鸡蛋	13.84%	14.68%	13.94%	5.51%	6.39%	1.78%	8.33%	☆
豆粕	-6.82%	-2.31%	-3.88%	-10.07%	-4.56%	-1.28%	3.25%	☆
豆油	2.40%	3.53%	7.67%	-0.65%	2.92%	8.71%	3.06%	☆
棉花	-0.77%	0.89%	-5.92%	-3.81%	-2.06%	-6.46%	3.04%	☆
玉米	-24.08%	-24.52%	-25.02%	-24.88%	-25.22%	-24.15%	0.79%	☆
沪铝	5.48%	5.24%	-4.50%	5.26%	5.04%	5.61%	0.21%	☆
聚乙烯	12.68%	4.26%	3.42%	12.61%	13.26%	11.79%	0.07%	☆
白糖	-8.24%	-9.39%	-5.06%	-7.53%	-5.75%	-4.66%	-0.71%	☆
沪银	-8.97%	-7.85%	-5.15%	-6.77%	-7.52%	-5.39%	-2.20%	☆
沥青	-3.80%	2.37%	-1.53%	-1.10%	1.27%	4.61%	-2.70%	☆
沪锌	5.53%	7.71%	10.18%	13.88%	14.81%	7.95%	-8.35%	☆
玻璃	-9.38%	-18.85%	-22.21%	1.38%	0.30%	-15.95%	-10.76%	☆☆
棕榈油	-10.54%	-9.35%	-8.89%	0.79%	-4.21%	-7.88%	-11.34%	☆☆
菜籽粕	-7.56%	-6.80%	-2.94%	4.22%	4.66%	5.10%	-11.78%	☆☆
聚丙烯	4.01%	3.44%	2.23%	24.14%	16.80%	10.83%	-20.13%	☆☆
沪金	-29.04%	-19.41%	-11.96%	-6.75%	-4.79%	67.26%	-22.28%	☆☆
甲醇	-22.47%	-18.67%	-17.63%	3.83%	1.31%	-1.59%	-26.30%	☆☆
铁矿石	26.17%	17.39%	22.41%	53.80%	46.34%	24.33%	-27.62%	☆☆
动力煤	5.07%	2.45%	6.93%	38.26%	30.16%	23.33%	-33.19%	☆☆☆

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 绝对值 $<$ 50%	10% \leq 绝对值 $<$ 20%	5% \leq 绝对值 $<$ 10%	绝对值 $<$ 5%
☆☆☆☆☆	☆☆☆☆	☆☆☆	☆☆	☆

2018年7月27日机构持仓异动表

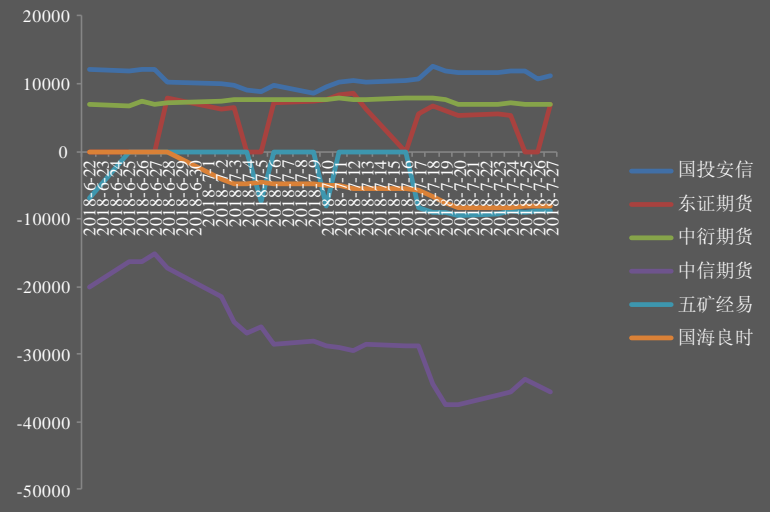
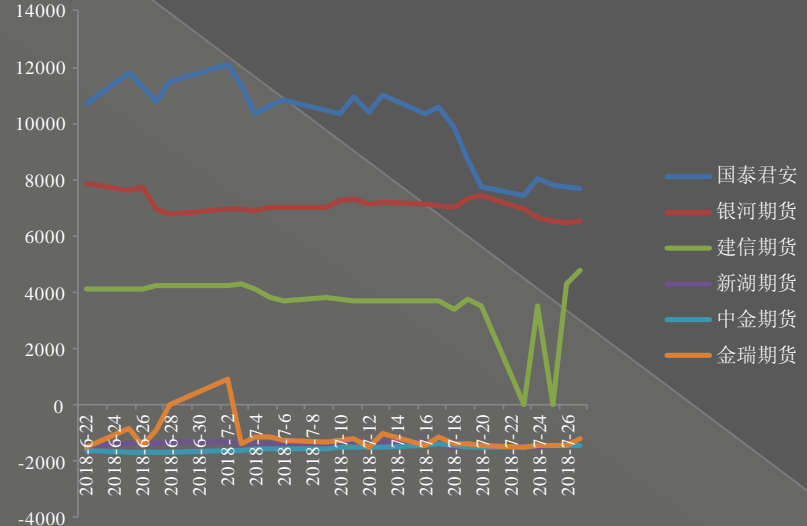
金属

中信期货	黄金净多单变动幅度为：-2832手
南华期货	白银净多单变动幅度为：-8299手
银河期货	白银净多单变动幅度为：-8272手
东证期货	白银净多单变动幅度为：7010手
银河期货	沪铝净多单变动幅度为：2584手
新湖期货	沪镍净多单变动幅度为：-3666手
兴证期货	沪镍净多单变动幅度为：4625手
国泰君安	沪铅净空单变动幅度为：760手

黑色

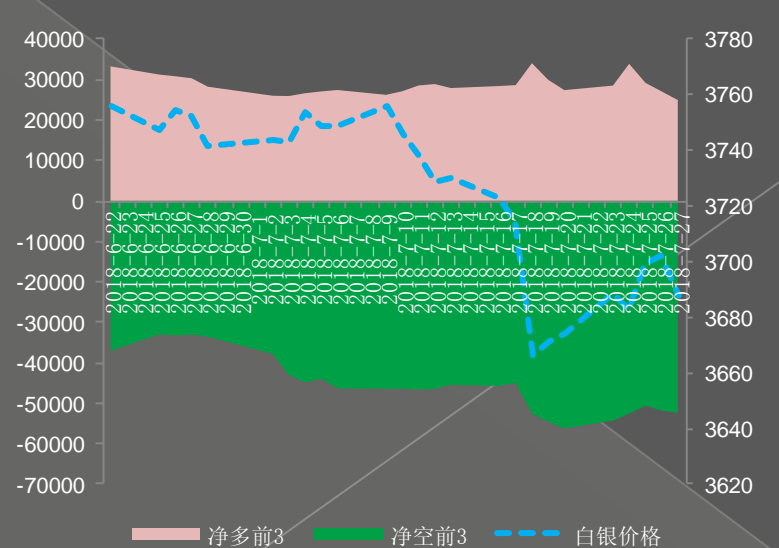
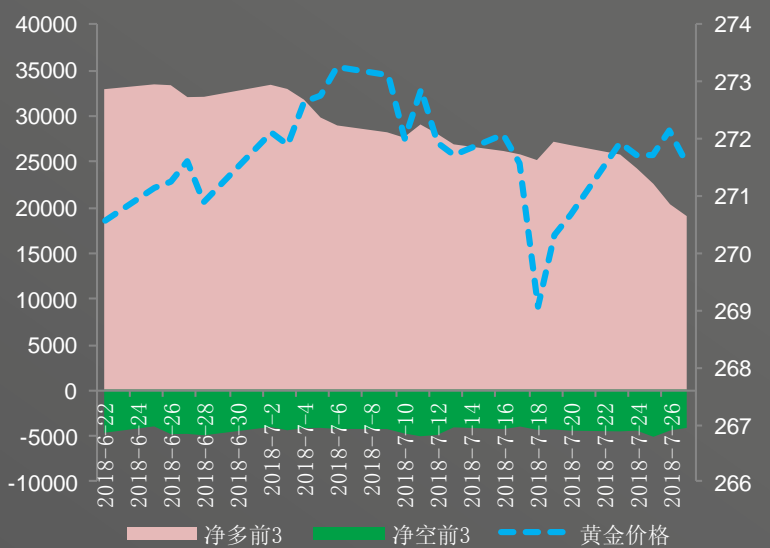
广发期货	铁矿石净多单变动幅度为：-4694手
申银万国	铁矿石净多单变动幅度为：-12056手
国投安信	铁矿石净空单变动幅度为：-13739手
光大期货	铁矿石净多单变动幅度为：13237手
海通期货	铁矿石净多单变动幅度为：11482手
道通期货	铁矿石净空单变动幅度为：24782手
兴证期货	焦煤净多单变动幅度为：-1890手
中信期货	焦煤净多单变动幅度为：1265手
国贸期货	焦煤净多单变动幅度为：704手
永安期货	焦煤净空单变动幅度为：4649手
华泰期货	焦炭净空单变动幅度为：1388手

金属板块：AU & AG



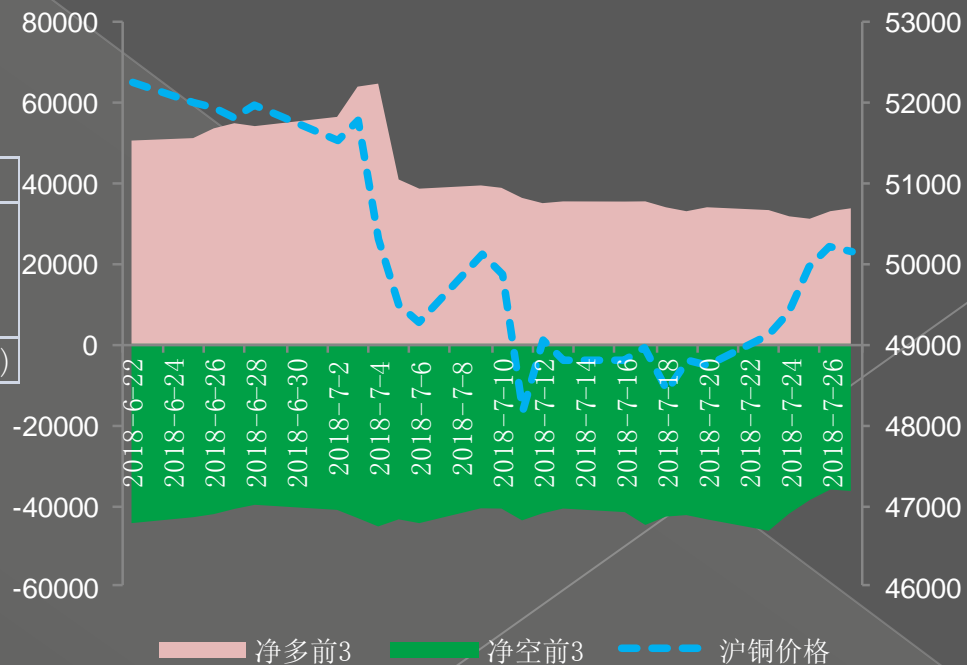
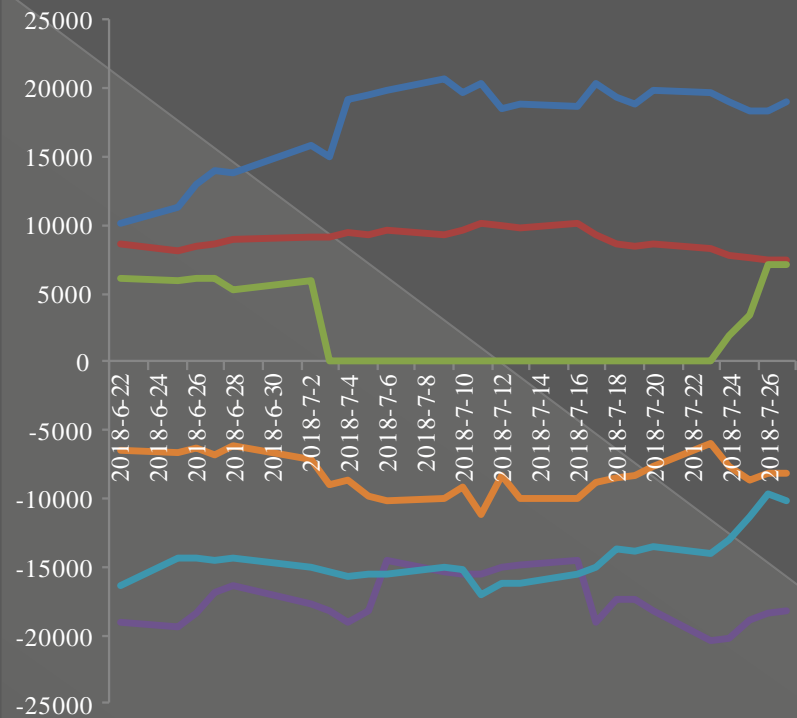
变动幅度		当日	最近5日	平均变化	波动率
au持仓	多头前3	-6.37%	-29.04%	-5.81%	5.38%
	空头前3	-6.41%	-6.75%	-1.35%	
au涨幅		-0.22%	0.32%	0.06%	
震荡幅度	0.29%	0.44%(月均值)	投机度	0.27	0.30(月均值)

变动幅度		当日	最近5日	平均变化	波动率
ag持仓	多头前3	-7.89%	-8.97%	-1.79%	5.73%
	空头前3	1.18%	-6.77%	-1.35%	
ag涨幅		-0.40%	0.36%	0.07%	
震荡幅度	0.62%	0.62%(月均值)	投机度	0.28	0.39(月均值)



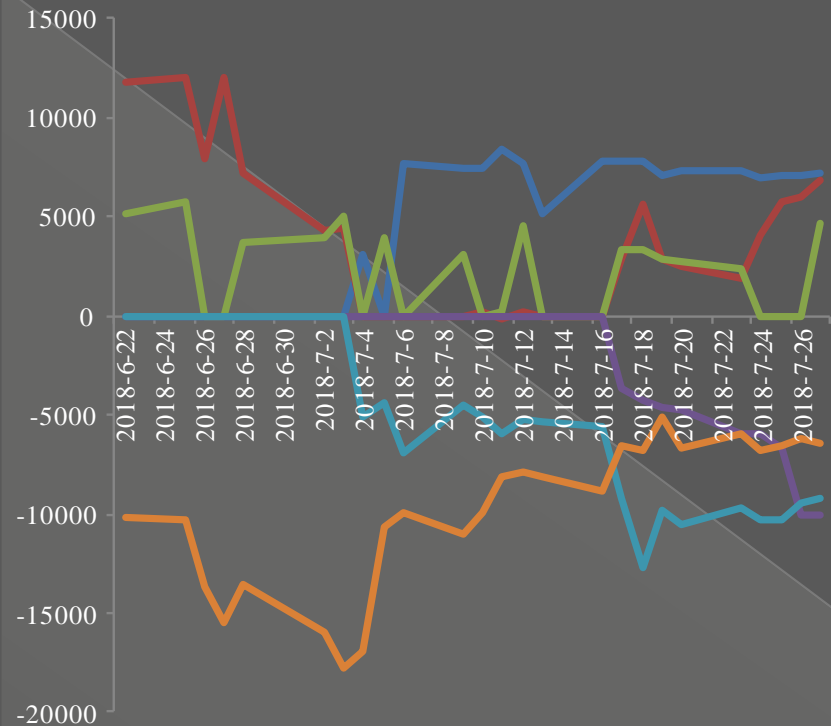
金属板块：Cu

- 金瑞期货
- 弘业期货
- 广发期货
- 五矿经易
- 中信期货
- 中粮期货

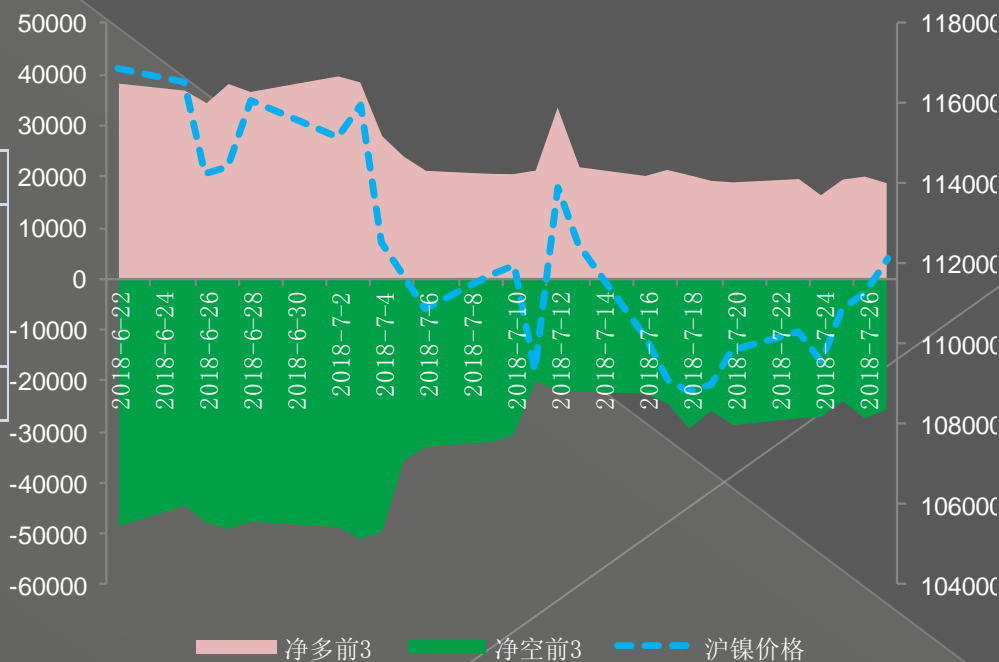


变动幅度		当日	最近5日	平均变化	波动率
cu持仓	多头前3	2.19%	-0.75%	-0.15%	27.88%
	空头前3	1.00%	-16.15%	-3.23%	
cu涨幅		-0.08%	2.94%	0.59%	
震荡幅度	0.78%	1.58%(月均值)	投机度	0.64	0.83(月均值)

金属板块：Ni

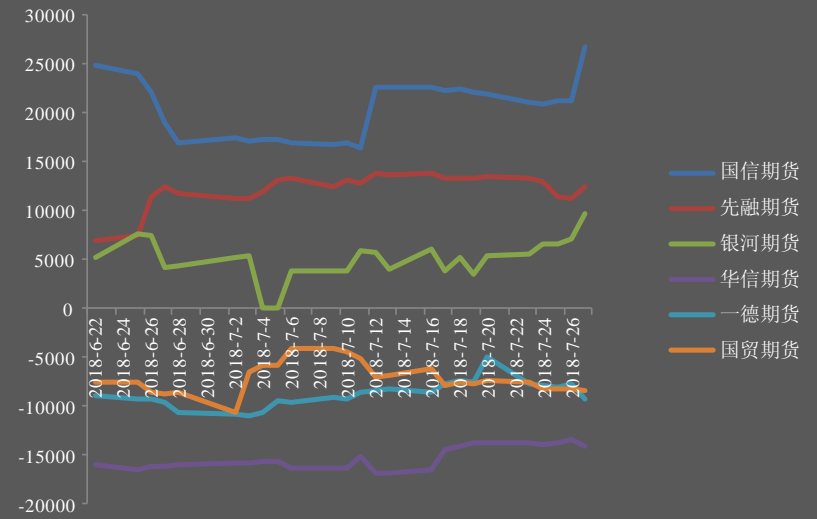
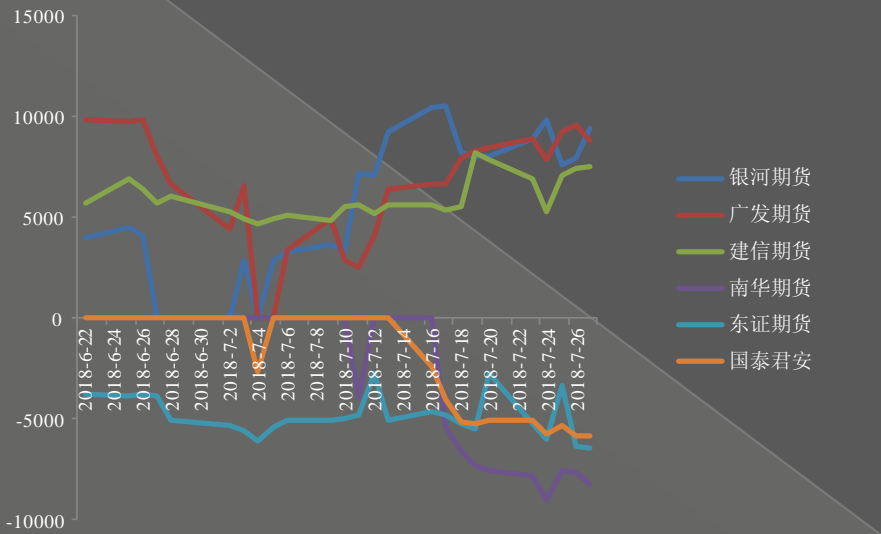


- 国投安信
- 华泰期货
- 兴证期货
- 格林大华
- 广发期货
- 中信期货



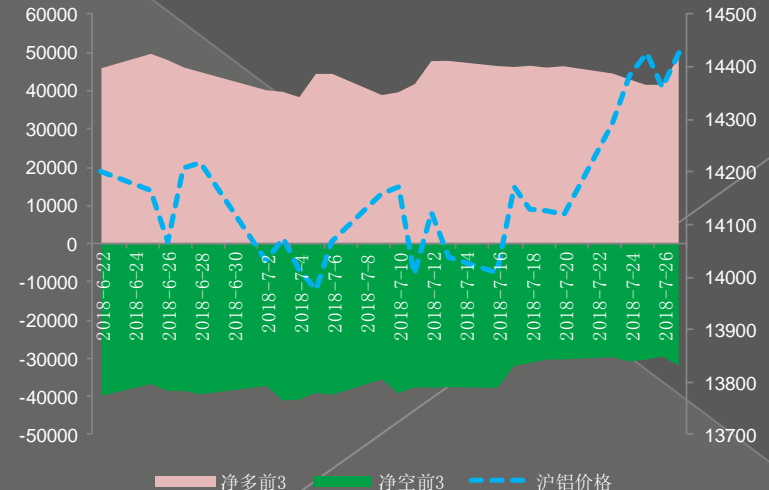
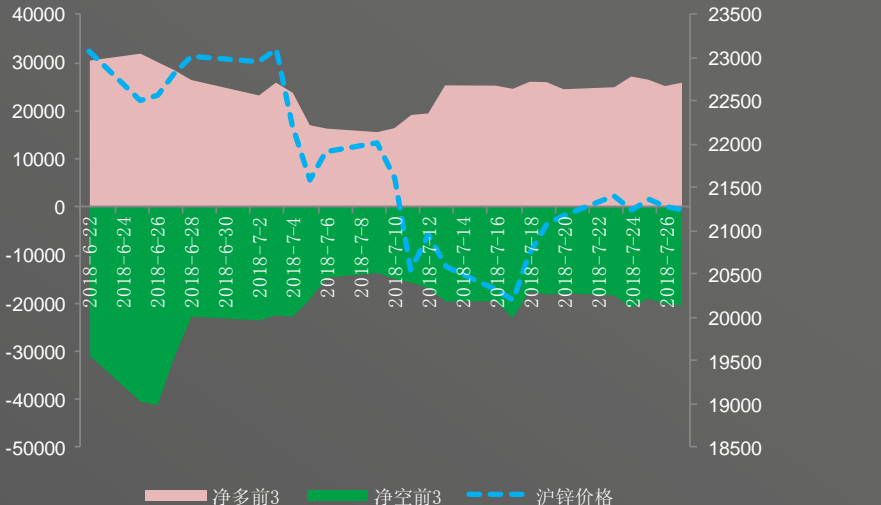
变动幅度		当日	最近5日	平均变化	波动率
ni持仓	多头前3	-6.46%	-0.78%	-0.16%	24.99%
	空头前3	-6.24%	-10.50%	-2.10%	
ni涨幅		0.76%	2.04%	0.41%	
震荡幅度	1.98%	2.18%(月均值)	投机度	1.92	1.90(月均值)

金属板块：Zn & Al

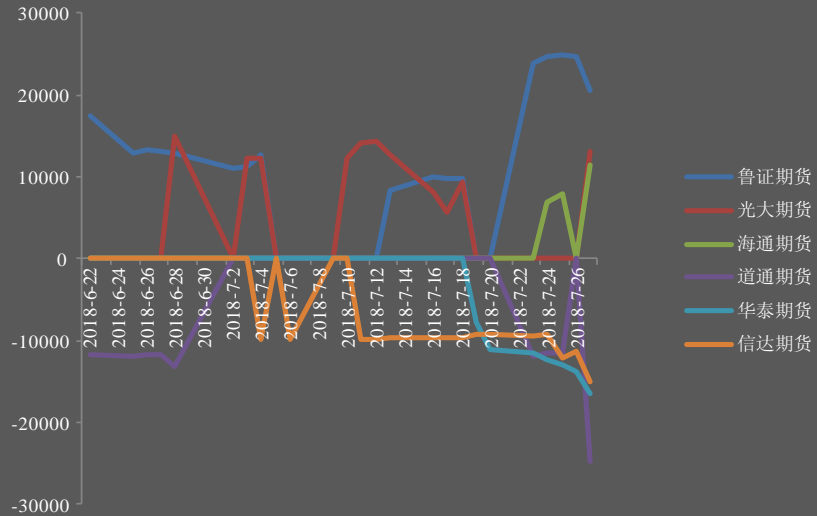
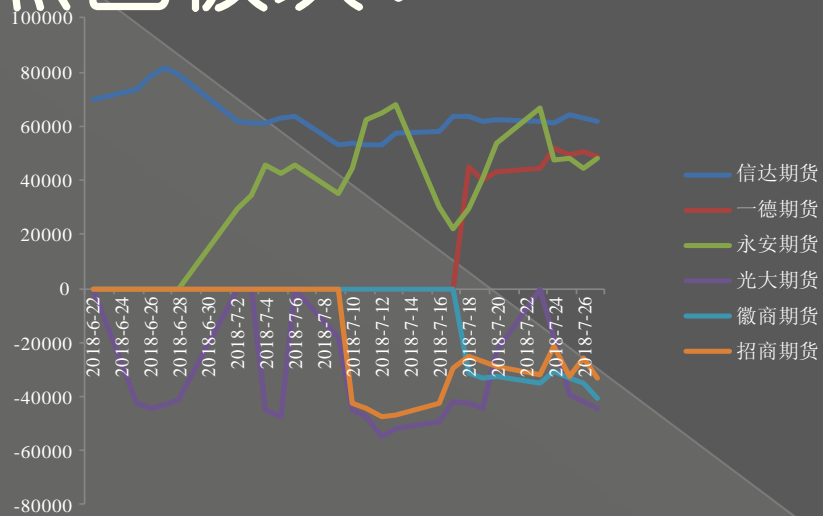


变动幅度		当日	最近5日	平均变化	波动率
zn持仓	多头前3	2.77%	5.53%	1.11%	50.16%
	空头前3	1.22%	13.88%	2.78%	
zn涨幅		-0.24%	0.25%	0.05%	
震荡幅度	1.02%	2.37% (月均值)	投机度	1.26	2.01 (月均值)

变动幅度		当日	最近5日	平均变化	波动率
al持仓	多头前3	17.75%	5.48%	1.10%	19.76%
	空头前3	7.82%	5.26%	1.05%	
al涨幅		0.48%	2.20%	0.44%	
震荡幅度	0.81%	1.05% (月均值)	投机度	0.51	0.47 (月均值)

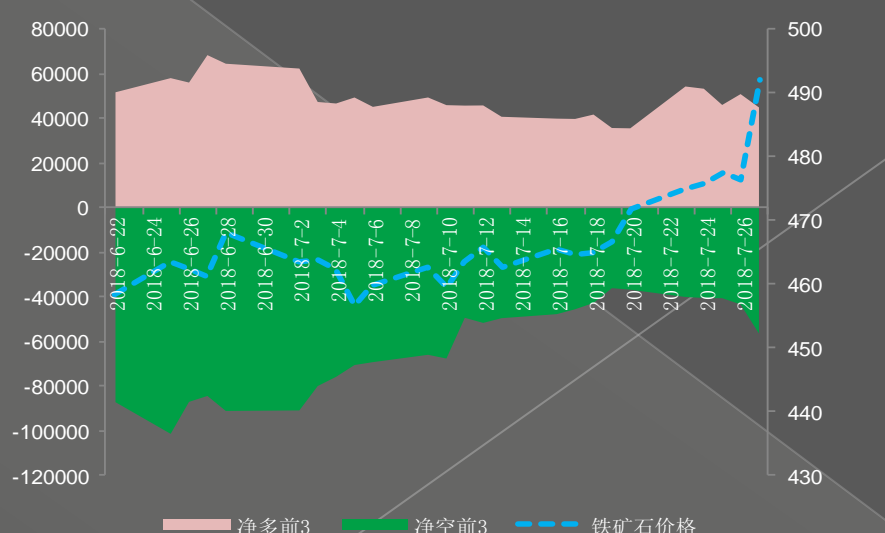
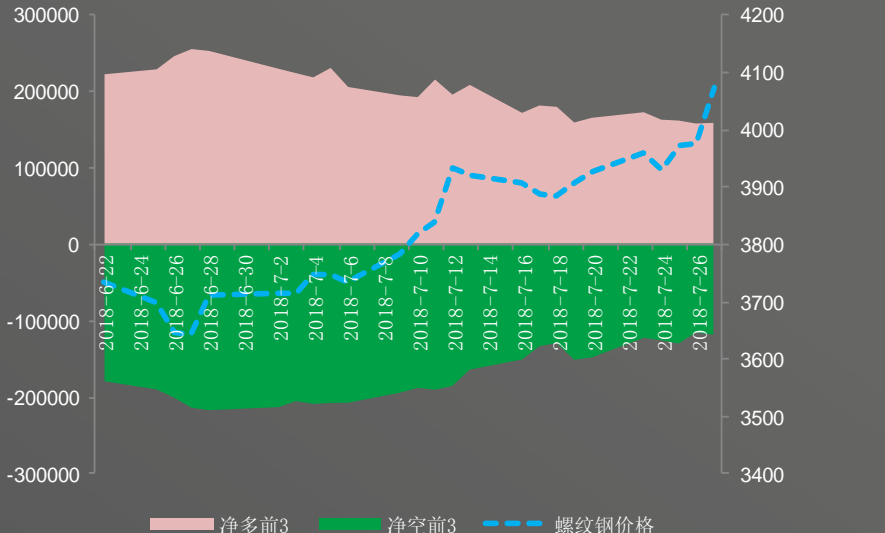


黑色板块：Rb & I

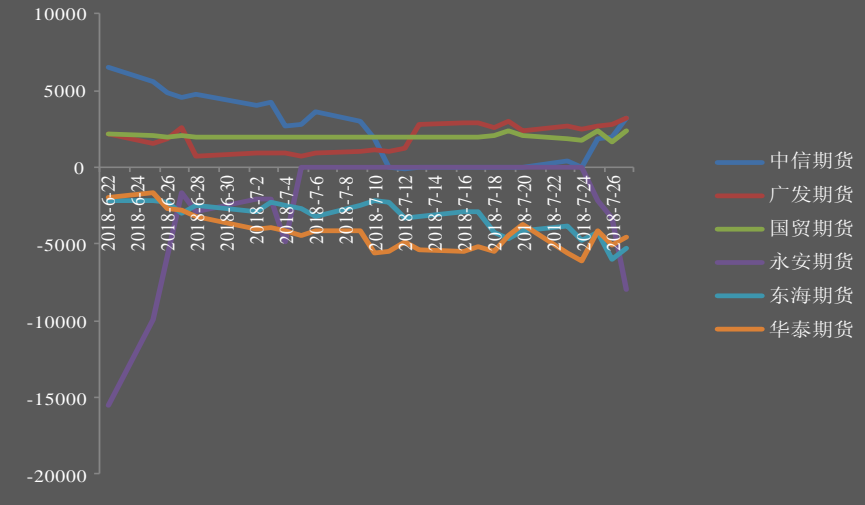
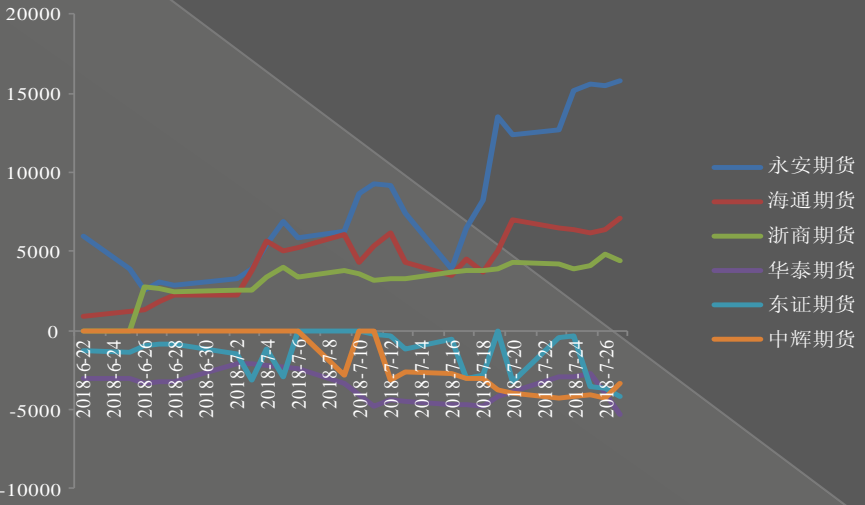


变动幅度		当日	最近5日	平均变化	波动率
rb持仓	多头前3	0.52%	-4.00%	-0.80%	34.20%
	空头前3	2.55%	-19.91%	-3.98%	
rb涨幅		2.45%	3.68%	0.74%	
震荡幅度	2.62%	1.67%(月均值)	投机度	1.03	1.03(月均值)

变动幅度		当日	最近5日	平均变化	波动率
I持仓	多头前3	-11.70%	26.17%	5.23%	17.68%
	空头前3	30.26%	53.80%	10.76%	
I涨幅		3.30%	4.30%	0.86%	
震荡幅度	3.69%	1.72%(月均值)	投机度	1.32	0.95(月均值)

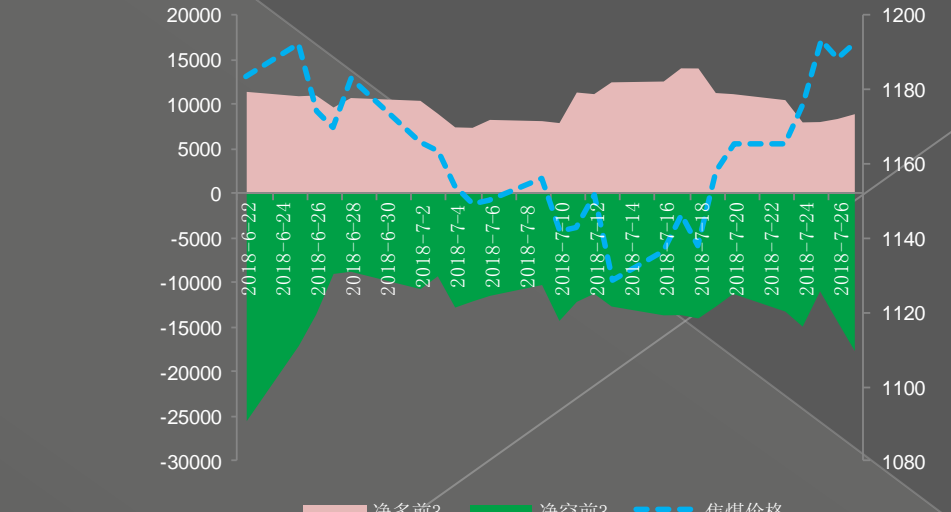
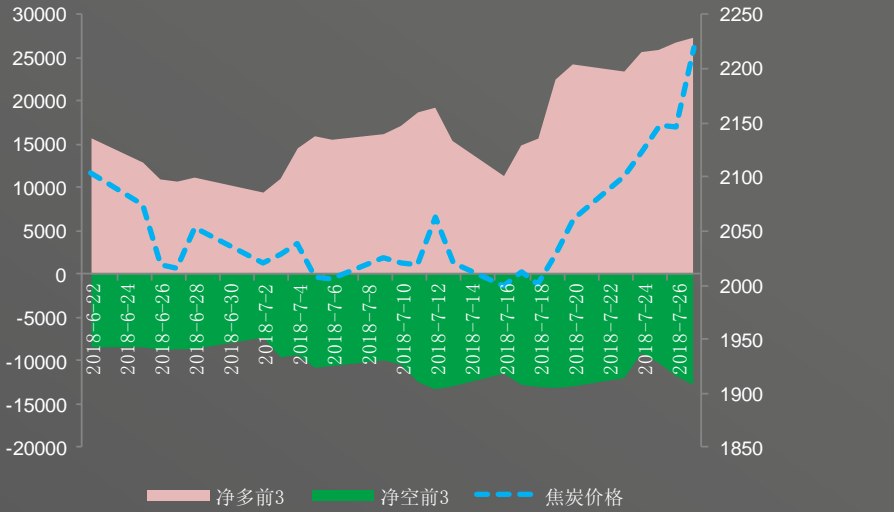


黑色板块：J & JM

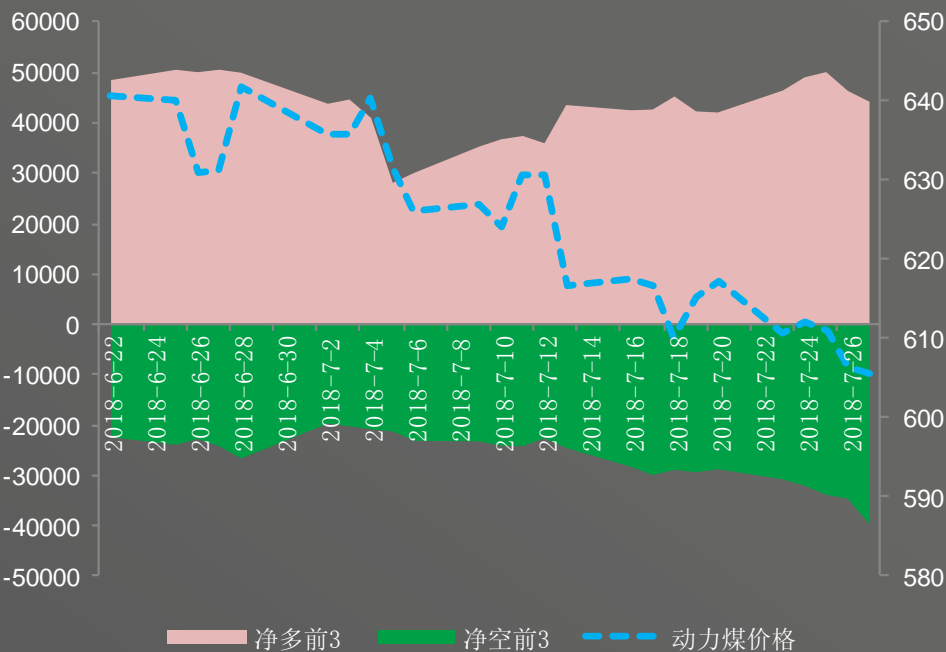
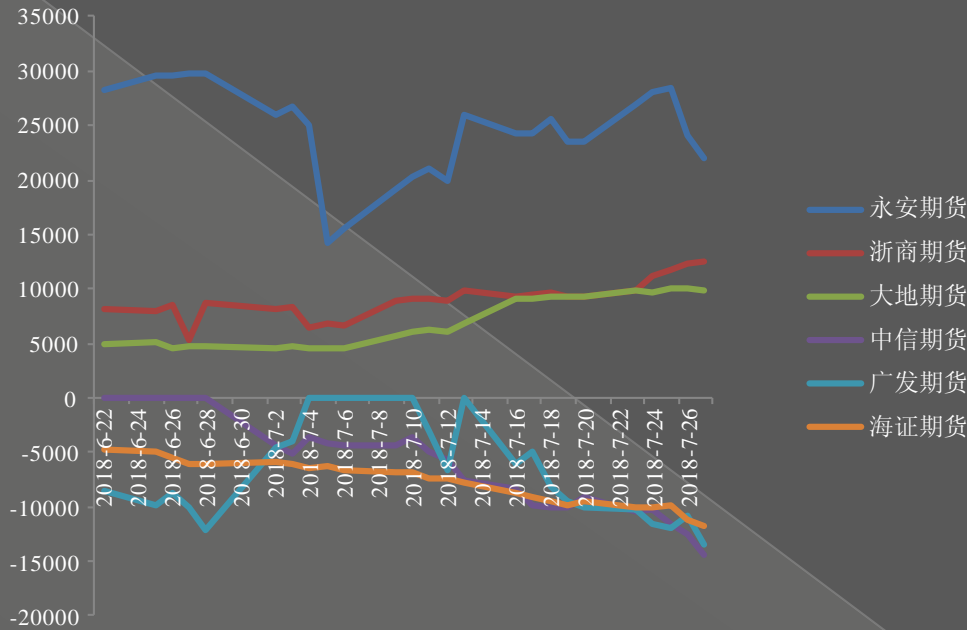


变动幅度		当日	最近5日	平均变化	波动率
j持仓	多头前3	2.06%	12.67%	2.53%	27.25%
	空头前3	8.87%	-1.43%	-0.29%	
j涨幅		3.41%	7.65%	1.53%	
震荡幅度	3.66%	2.51%(月均值)	投机度	1.17	1.35(月均值)

变动幅度		当日	最近5日	平均变化	波动率
jm持仓	多头前3	6.44%	-20.10%	-4.02%	25.86%
	空头前3	23.22%	57.12%	11.42%	
jm涨幅		0.38%	2.35%	0.47%	
震荡幅度	2.55%	2.09%(月均值)	投机度	1.27	1.12(月均值)

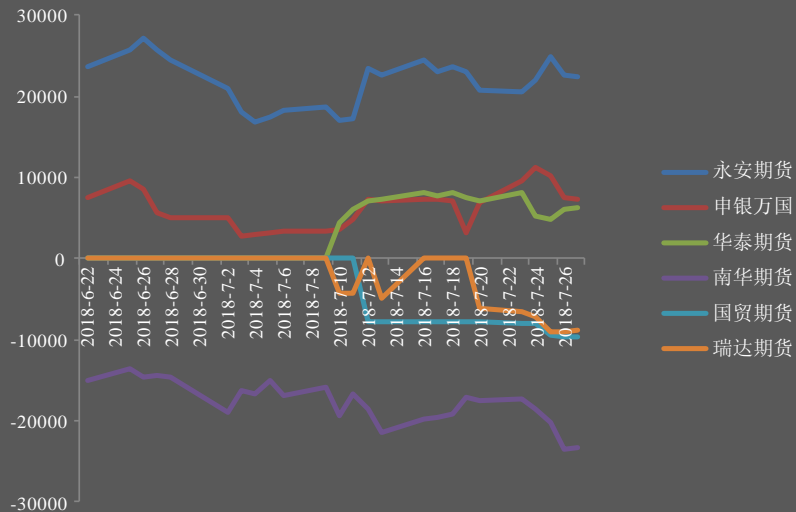
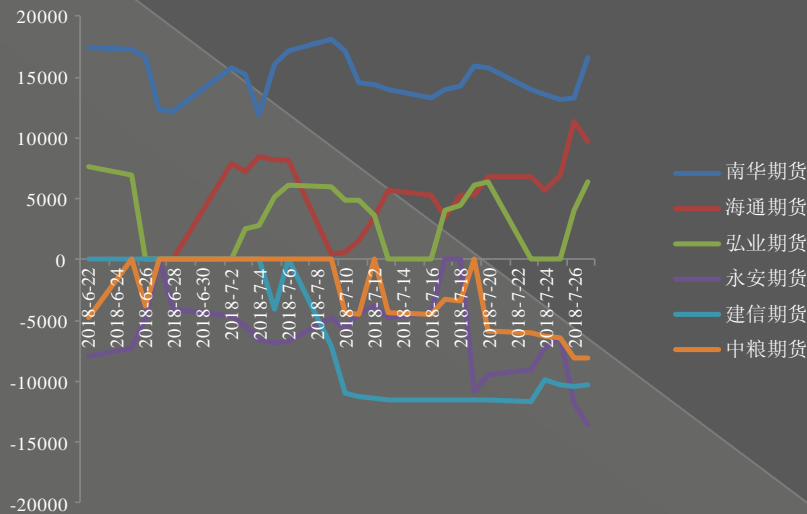


黑色：动力煤



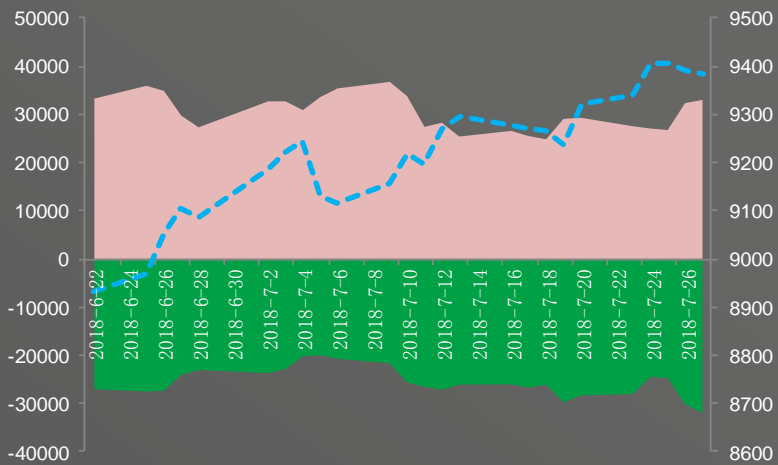
变动幅度		当日	最近5日	平均变化	波动率
zc持仓	多头前3	-4.61%	5.07%	1.01%	14.66%
	空头前3	14.68%	38.26%	7.65%	
zc涨幅		-0.13%	-1.88%	-0.38%	
震荡幅度	1.24%	1.31% (月均值)	投机度	0.78	0.93 (月均值)

化工：塑料 & PP

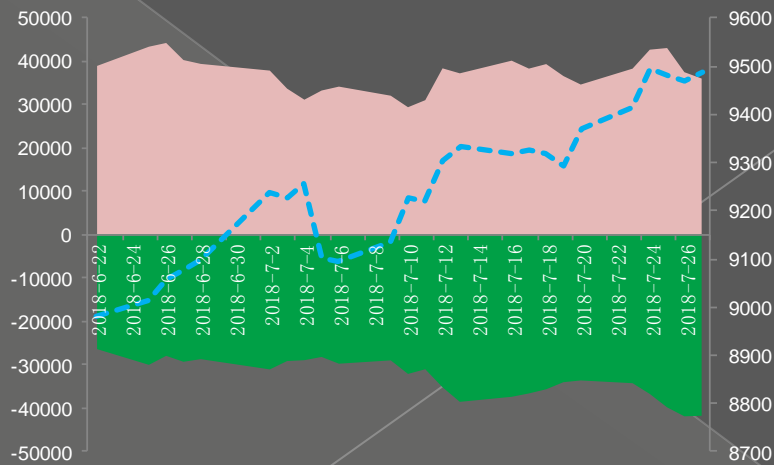


变动幅度		当日	最近5日	平均变化	波动率
I持仓	多头前3	2.09%	12.68%	2.54%	9.18%
	空头前3	5.80%	12.61%	2.52%	
I涨幅		-0.08%	0.69%	0.14%	
震荡幅度	0.79%	0.94% (月均值)	投机度	0.39	0.41 (月均值)

变动幅度		当日	最近5日	平均变化	波动率
pp持仓	多头前3	-3.92%	4.01%	0.80%	10.92%
	空头前3	-0.31%	24.14%	4.83%	
pp涨幅		0.22%	1.25%	0.25%	
震荡幅度	0.92%	1.02% (月均值)	投机度	0.43	0.51 (月均值)

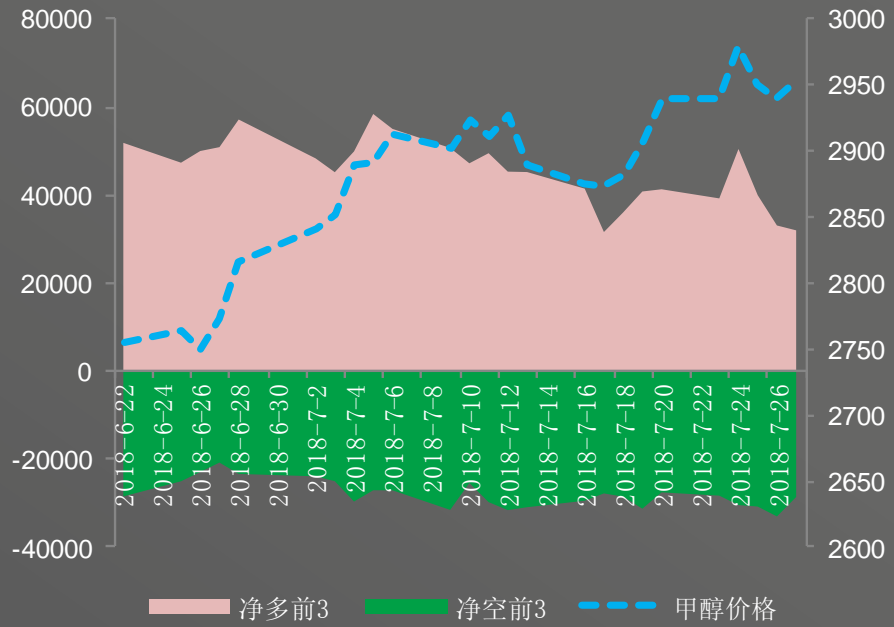
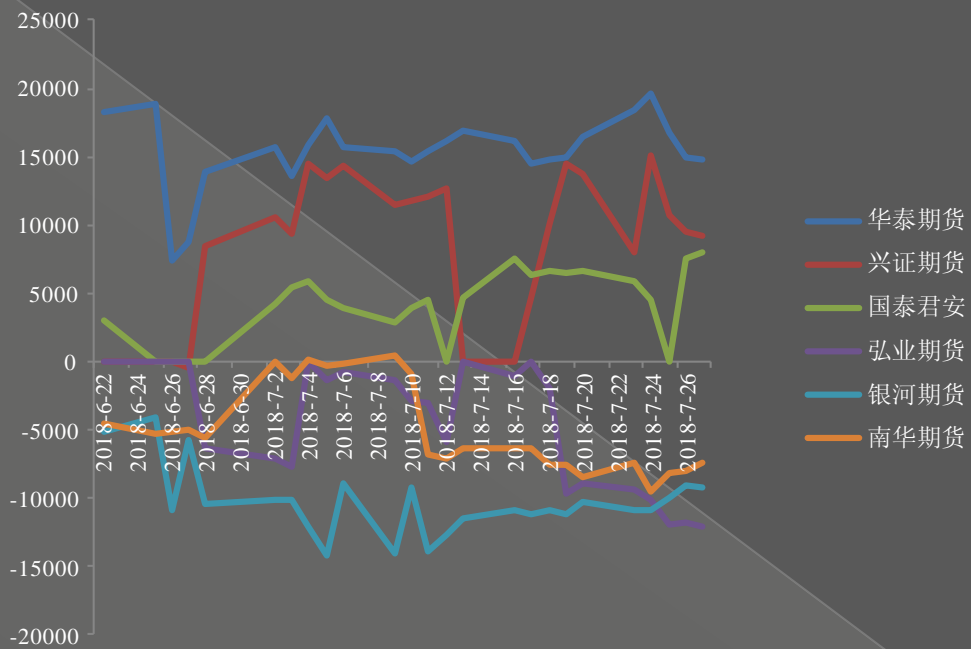


净多前3 净空前3 聚乙烯价格



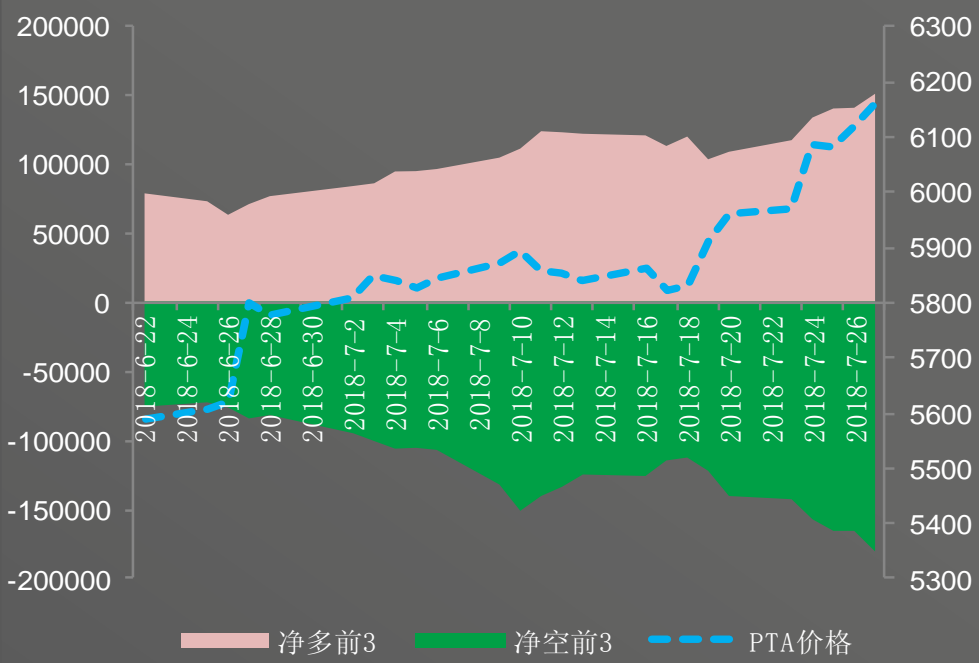
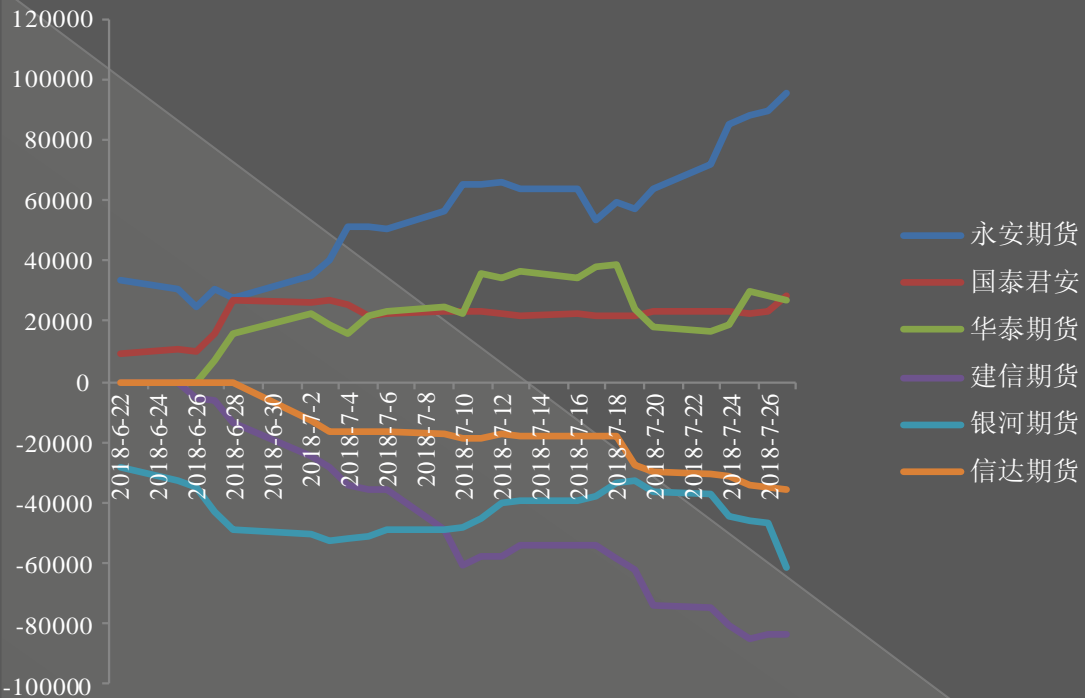
净多前3 净空前3 聚丙烯价格

化工：甲醇



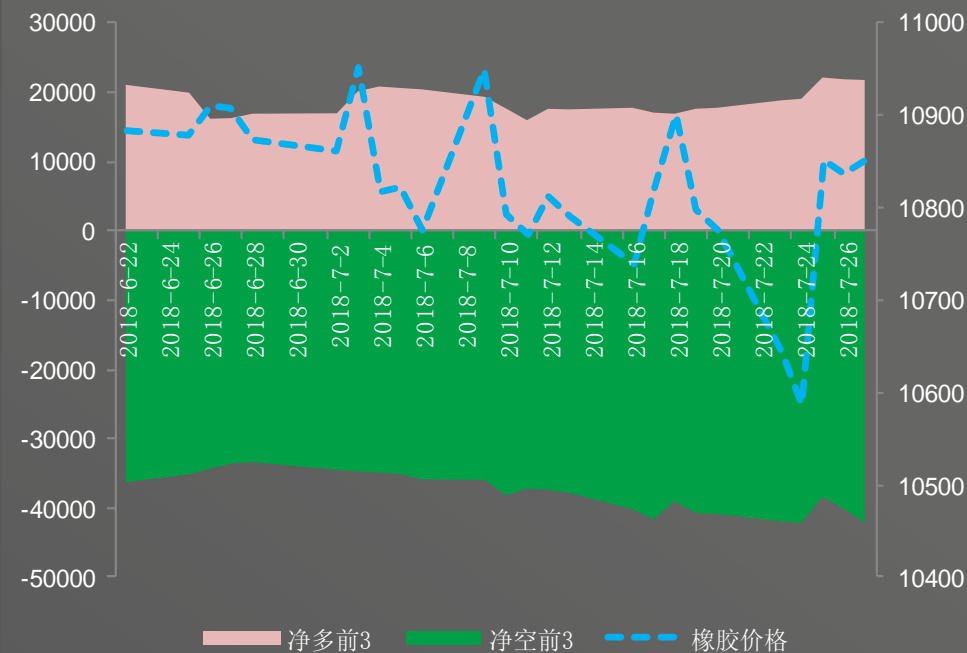
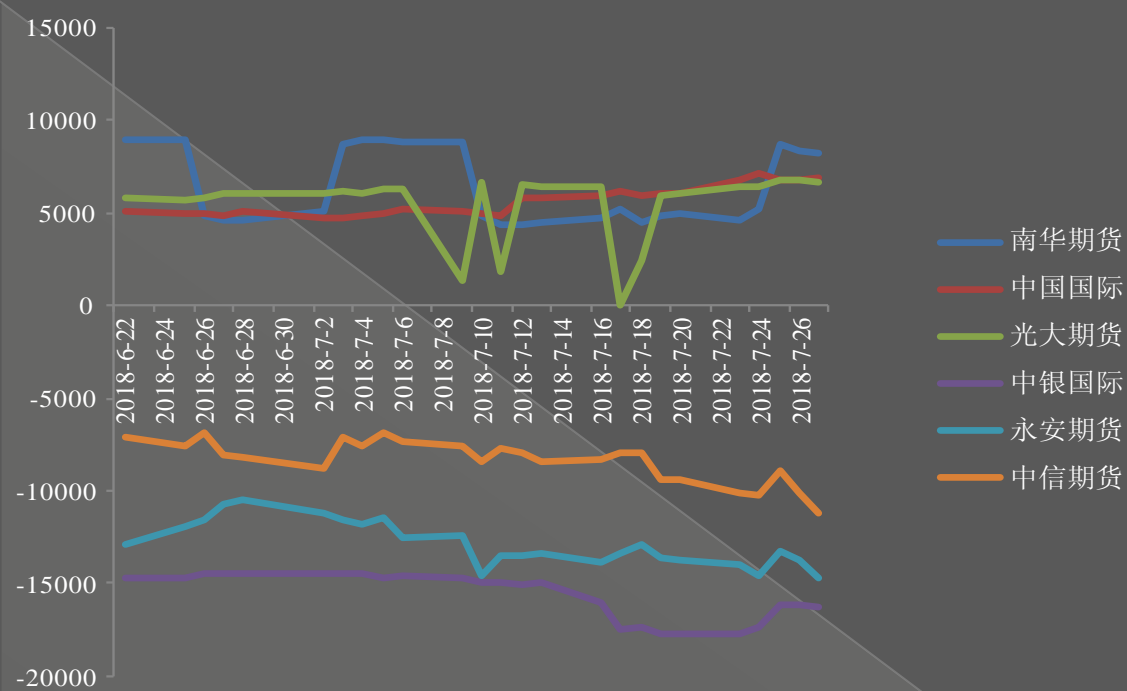
变动幅度		当日	最近5日	平均变化	波动率
ma持仓	多头前3	-3.31%	-22.47%	-4.49%	18.20%
	空头前3	-13.47%	3.83%	0.77%	
ma涨幅		0.51%	0.46%	0.09%	
震荡幅度	1.02%	1.49%(月均值)	投机度	0.89	0.92(月均值)

化工：PTA



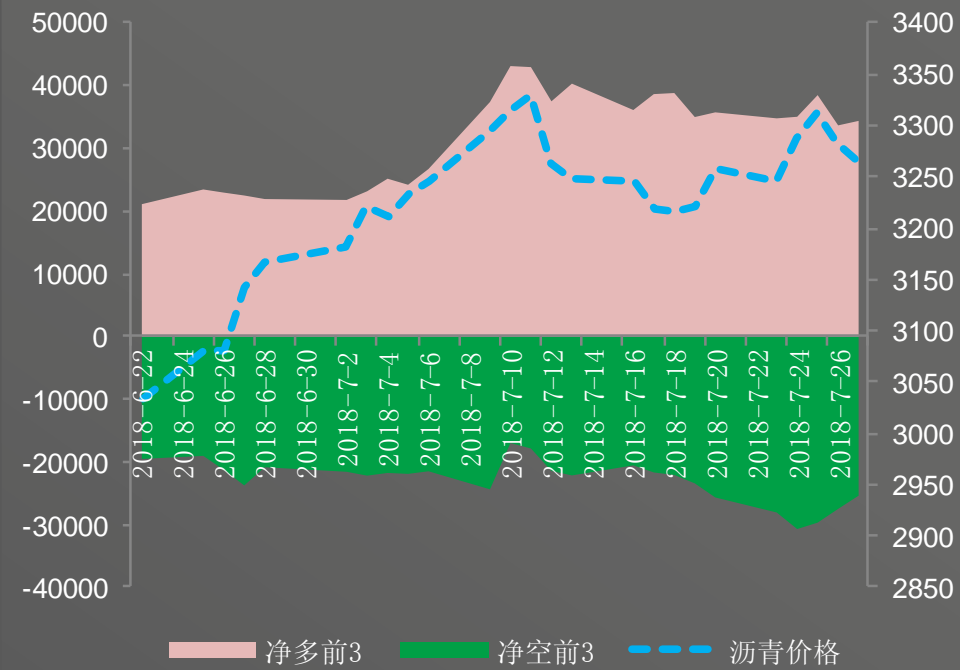
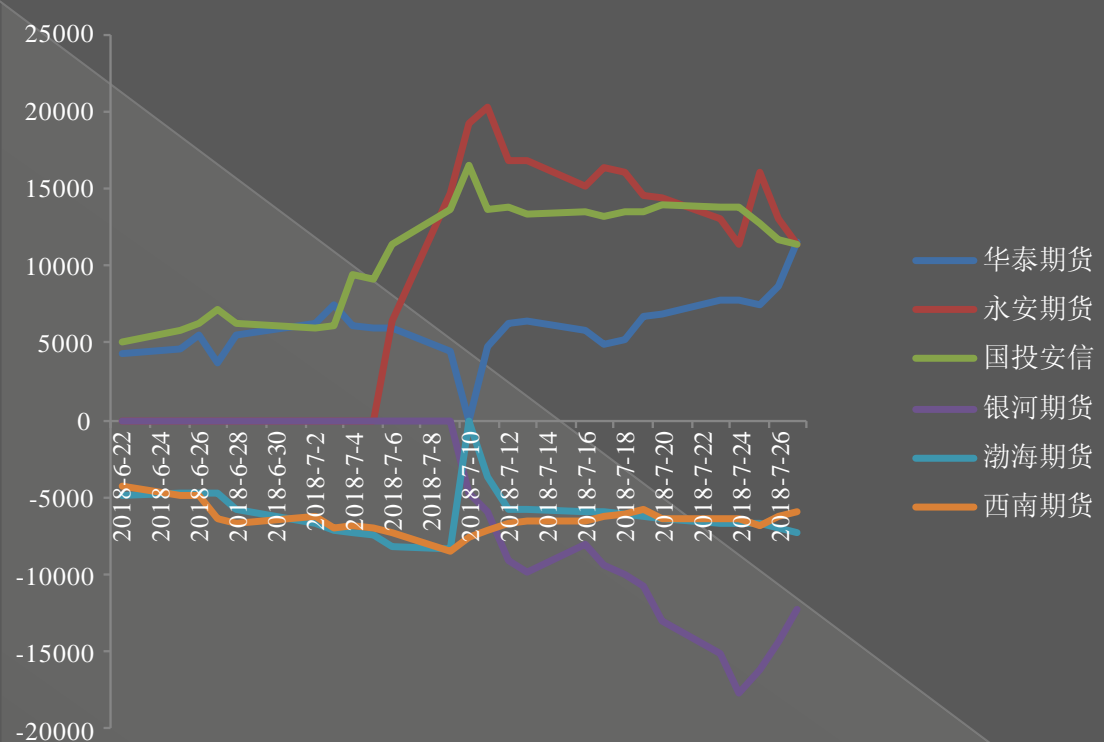
变动幅度		当日	最近5日	平均变化	波动率
pta持仓	多头前3	7.22%	38.71%	7.74%	10.97%
	空头前3	8.96%	28.50%	5.70%	
pta涨幅		0.67%	3.32%	0.66%	
震荡幅度	1.24%	1.28%(月均值)	投机度	0.85	0.65(月均值)

化工：橡胶



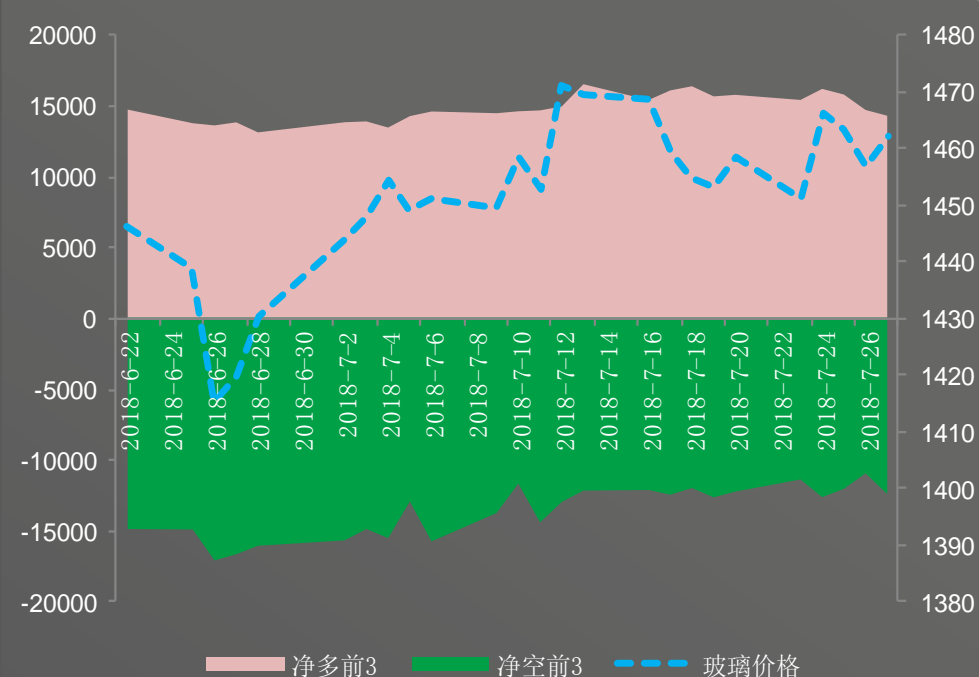
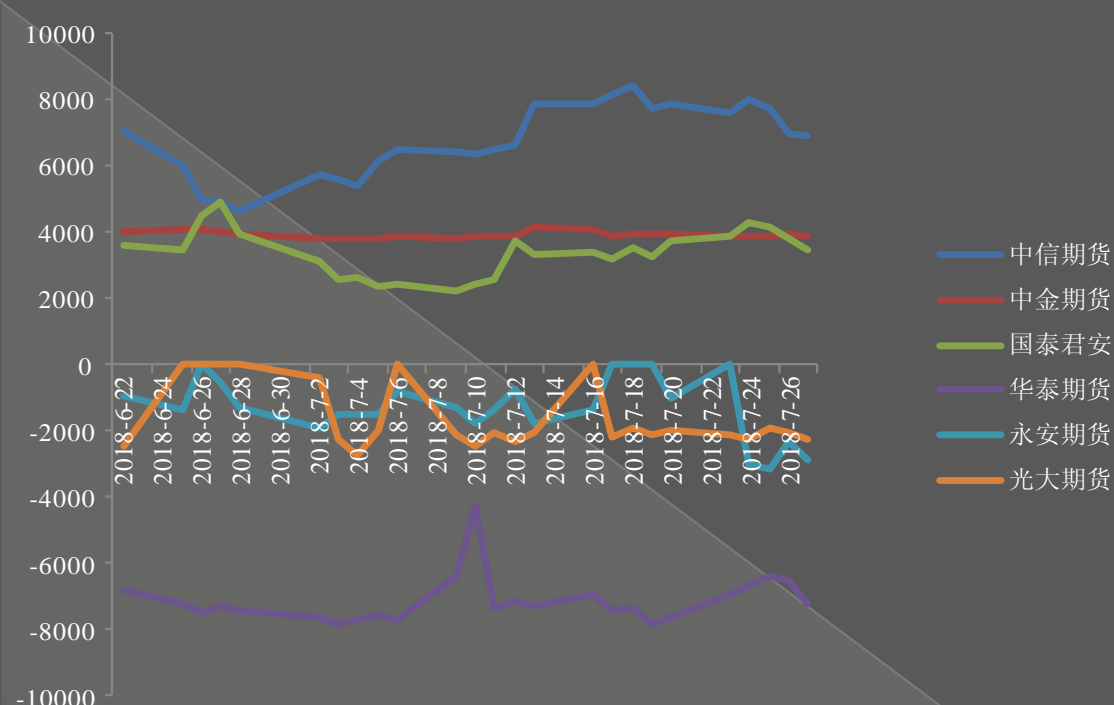
变动幅度		当日	最近5日	平均变化	波动率
ru持仓	多头前3	-0.51%	22.48%	4.50%	54.72%
	空头前3	5.12%	3.12%	0.62%	
ru涨幅		0.13%	0.70%	0.14%	
震荡幅度	1.57%	1.92%(月均值)	投机度	0.75	0.75(月均值)

化工：沥青



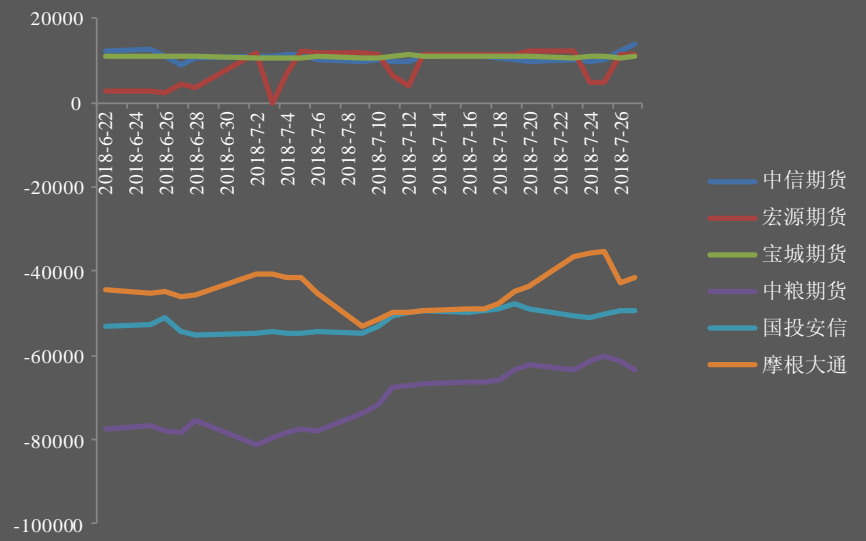
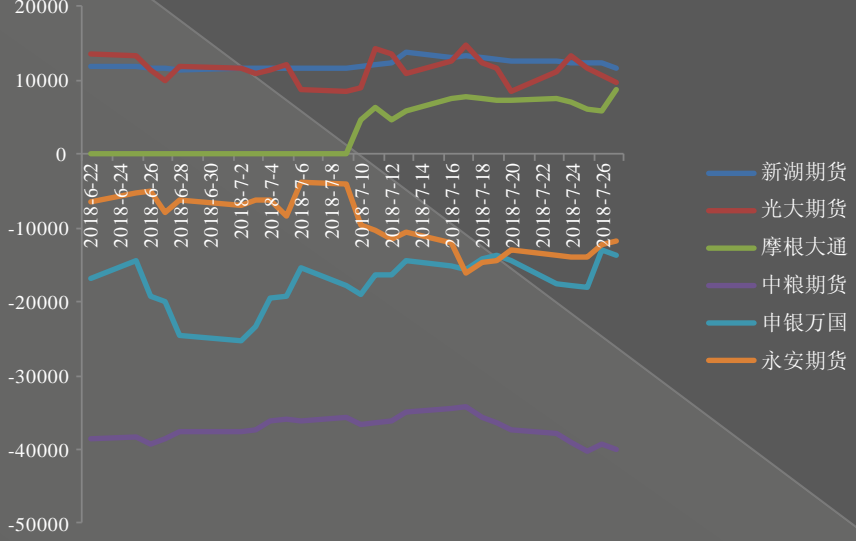
变动幅度		当日	最近5日	平均变化	波动率
bu持仓	多头前3	2.13%	-3.80%	-0.76%	13.58%
	空头前3	-7.67%	-1.10%	-0.22%	
bu涨幅		-0.57%	0.17%	0.03%	
震荡幅度	1.91%	1.70%(月均值)	投机度	0.94	0.96(月均值)

化工：玻璃



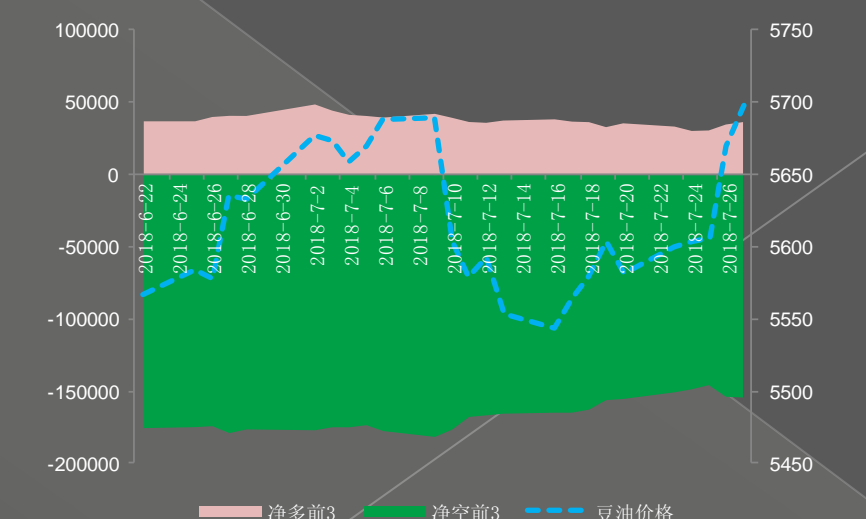
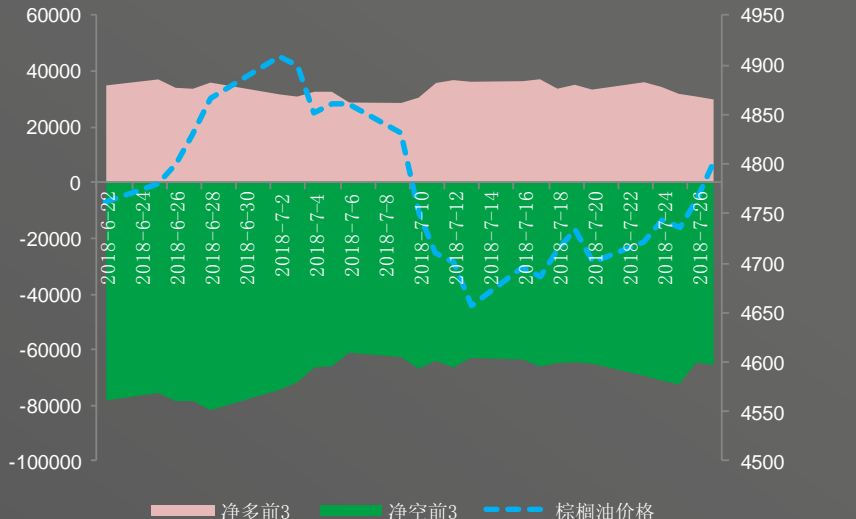
变动幅度		当日	最近5日	平均变化	波动率
fg持仓	多头前3	-2.77%	-9.38%	-1.88%	21.15%
	空头前3	13.26%	1.38%	0.28%	
fg涨幅		0.37%	0.26%	0.05%	
震荡幅度	1.03%	1.10%(月均值)	投机度	0.62	0.55(月均值)

农产品：P & Y

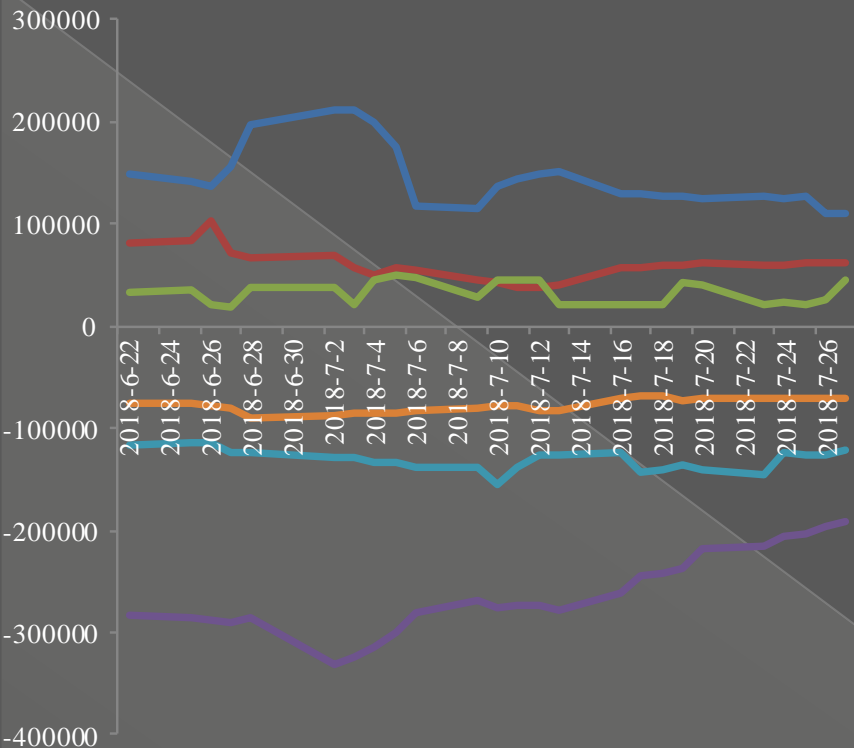


变动幅度		当日	最近5日	平均变化	波动率
p持仓	多头前3	-3.39%	-10.54%	-2.11%	31.98%
	空头前3	1.47%	0.79%	0.16%	
p涨幅		0.83%	2.19%	0.44%	
震荡幅度	1.15%	1.21%(月均值)	投机度	0.52	0.49(月均值)

变动幅度		当日	最近5日	平均变化	波动率
y持仓	多头前3	4.76%	2.40%	0.48%	16.78%
	空头前3	0.33%	-0.65%	-0.13%	
y涨幅		0.50%	2.08%	0.42%	
震荡幅度	0.98%	1.02%(月均值)	投机度	0.32	0.30(月均值)

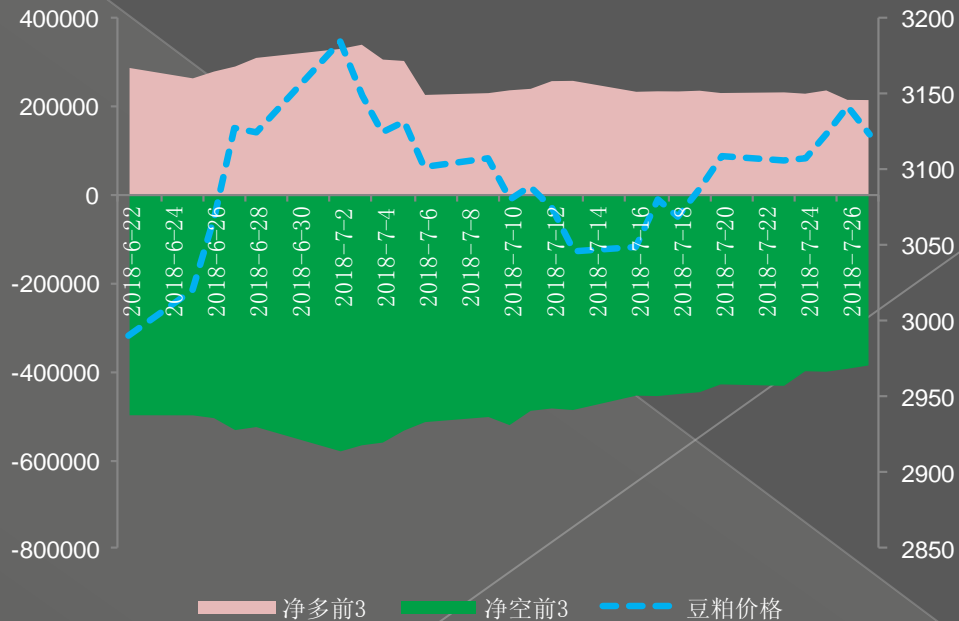


农产品：豆粕



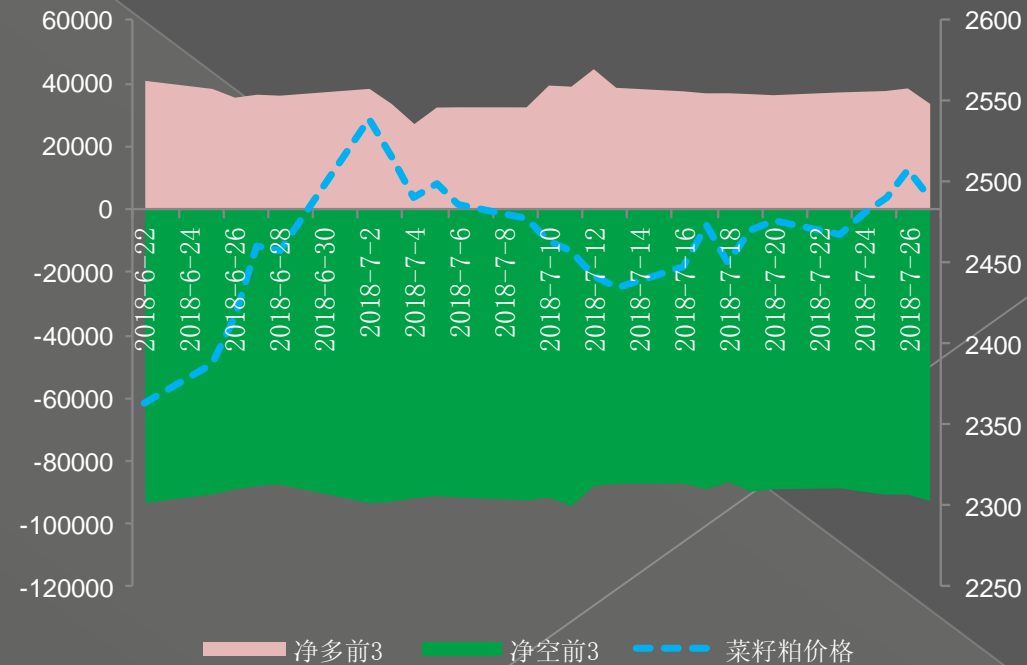
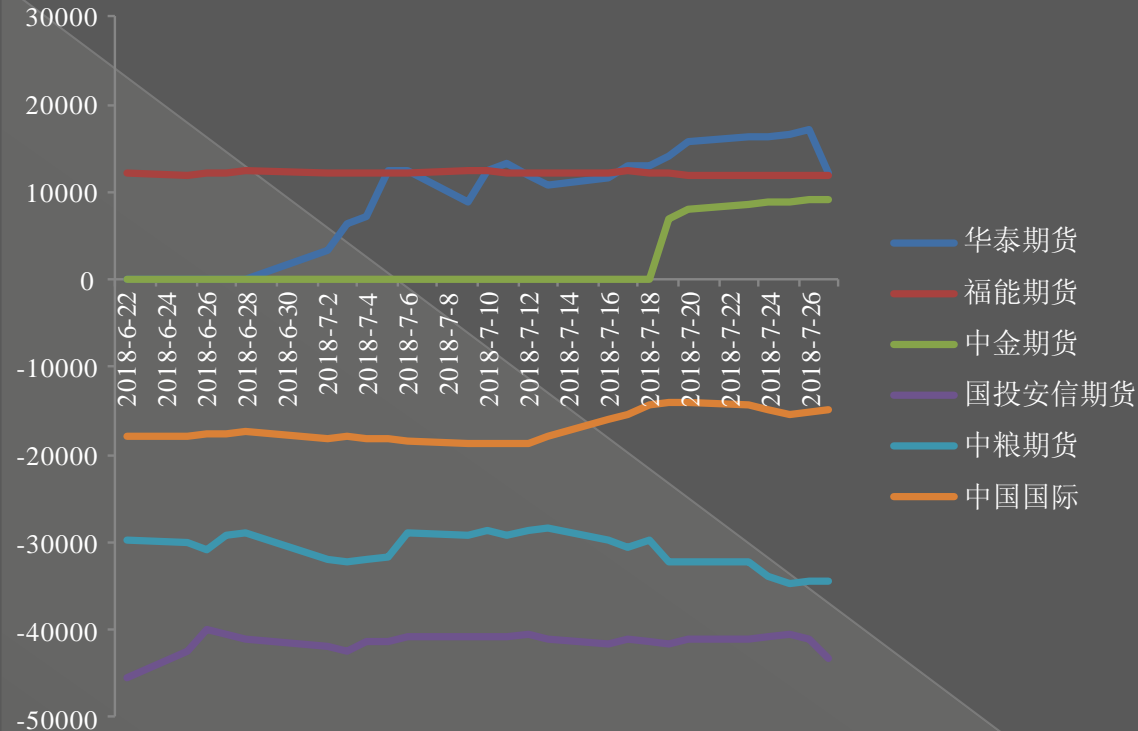
- 永安期货
- 五矿经易
- 华泰期货
- 中粮期货
- 摩根大通
- 银河期货

变动幅度		当日	最近5日	平均变化	波动率
m持仓	多头前3	-0.22%	-6.82%	-1.36%	19.27%
	空头前3	-1.96%	-10.07%	-2.01%	
m涨幅		-0.60%	0.42%	0.08%	
震荡幅度	1.18%	1.59%(月均值)	投机度	0.38	0.56(月均值)

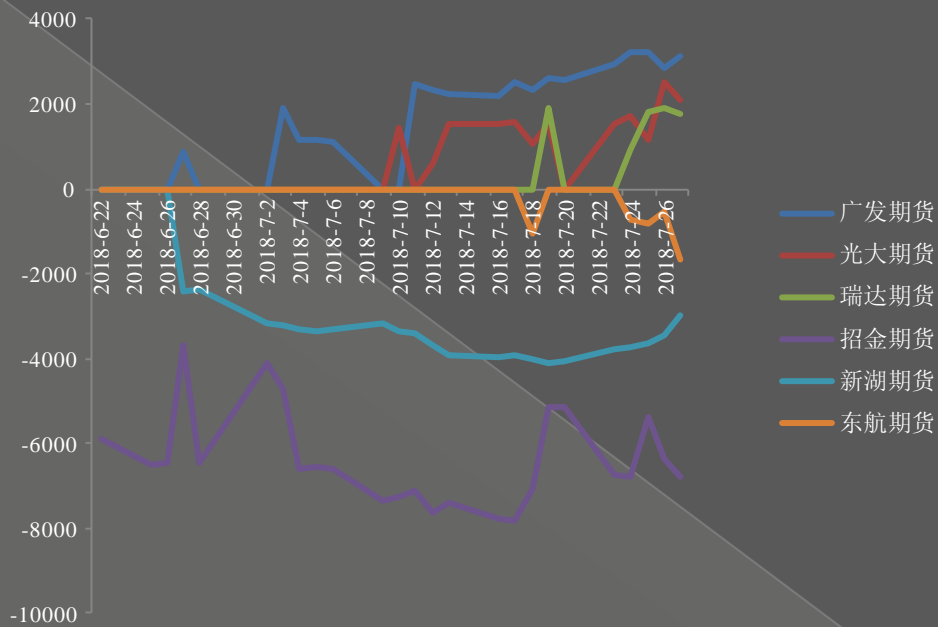


- 净多前3
- 净空前3
- 豆粕价格

农产品：菜粕

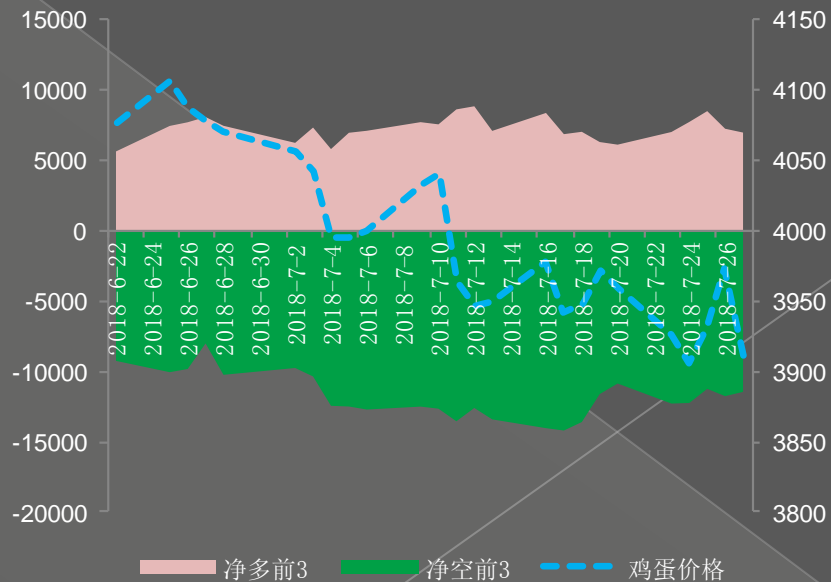


变动幅度		当日	最近5日	平均变化	波动率
rm持仓	多头前3	-12.74%	-7.56%	-1.51%	14.81%
	空头前3	2.25%	4.22%	0.84%	
rm涨幅		-0.75%	0.52%	0.10%	
震荡幅度	1.43%	1.54%(月均值)	投机度	0.77	1.16(月均值)

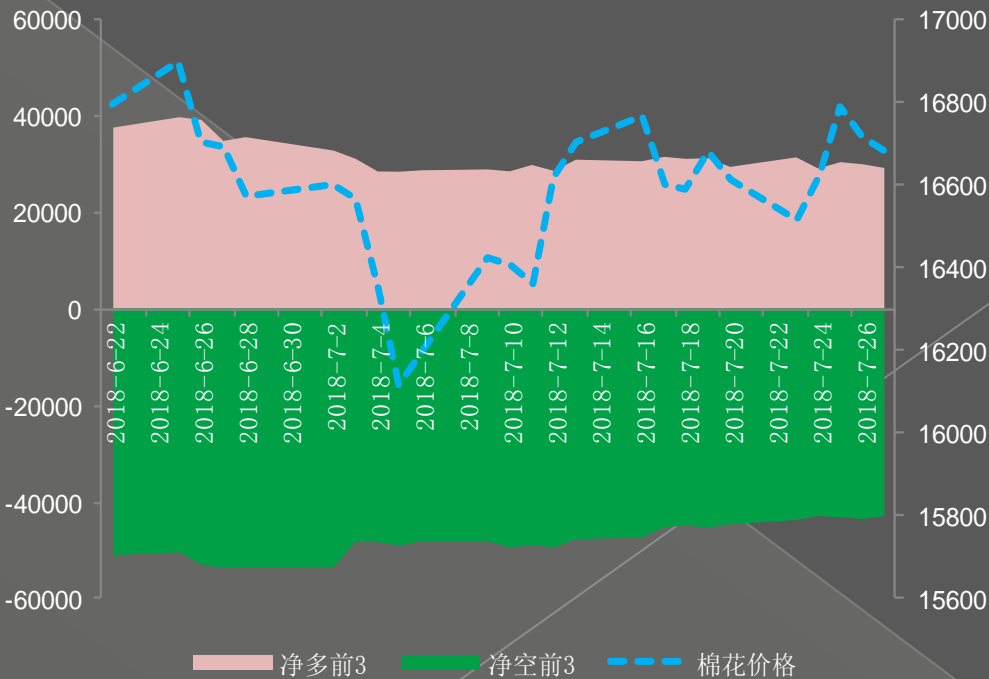
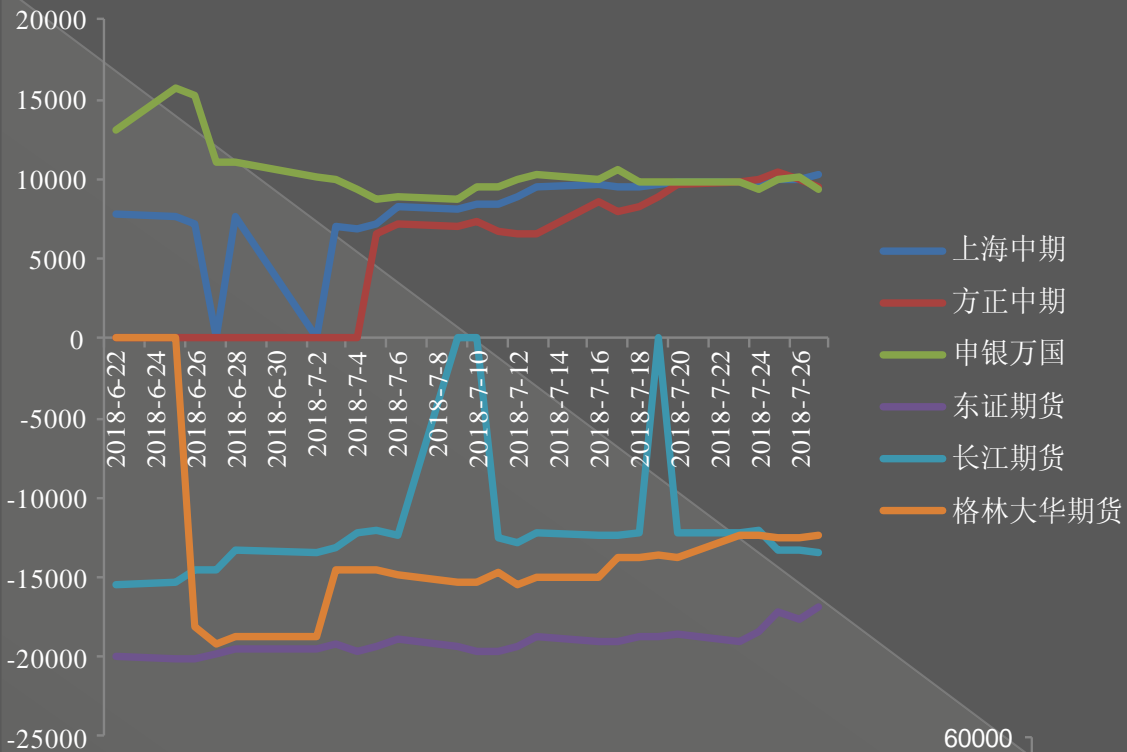


农产品：鸡蛋

变动幅度		当日	最近5日	平均变化	波动率
jd持仓	多头前3	-3.70%	13.84%	2.77%	15.79%
	空头前3	-2.61%	5.51%	1.10%	
jd涨幅		-1.62%	-1.25%	-0.25%	
震荡幅度	1.94%	1.34%(月均值)	投机度	0.75	0.66(月均值)

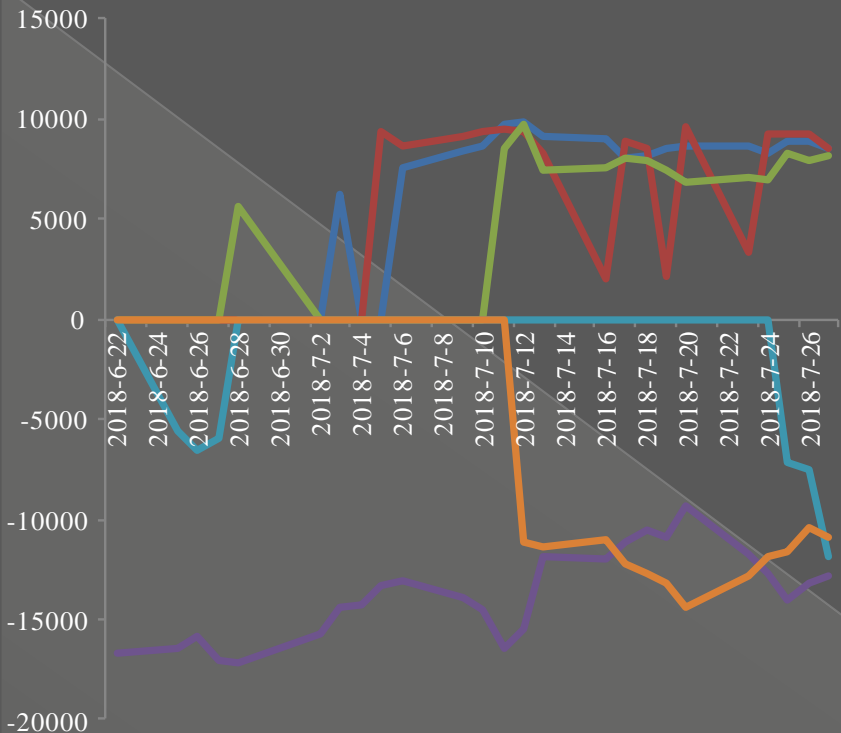


农产品：棉花



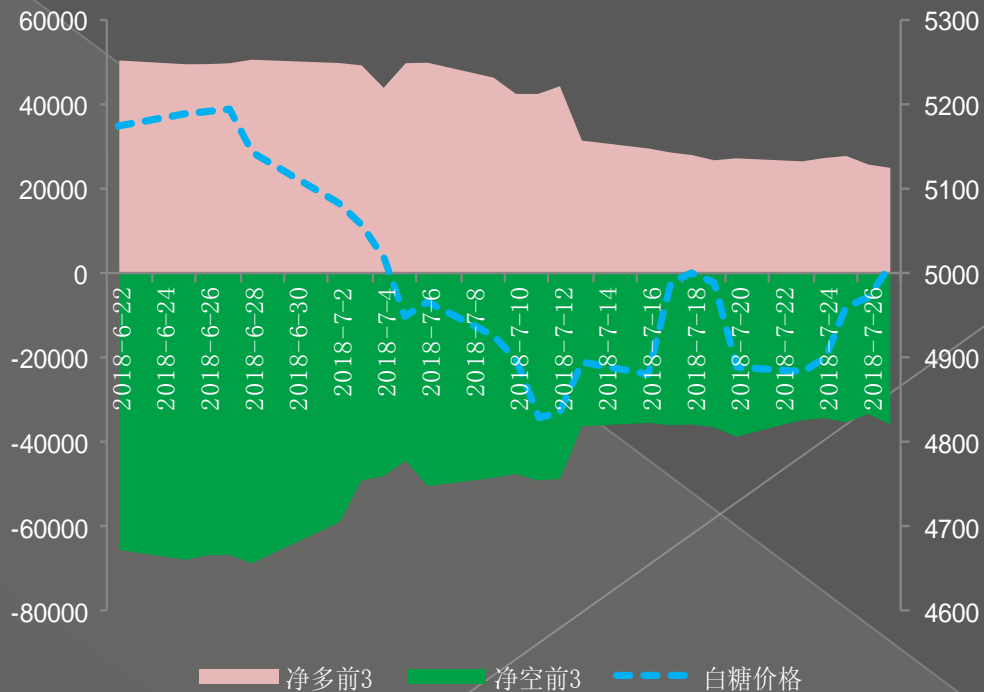
变动幅度		当日	最近5日	平均变化	波动率
cf持仓	多头前3	-2.61%	-0.77%	-0.15%	25.77%
	空头前3	-1.42%	-3.81%	-0.76%	
cf涨幅		-0.23%	0.41%	0.08%	
震荡幅度	1.18%	1.57%(月均值)	投机度	0.39	0.55(月均值)

农产品：白糖

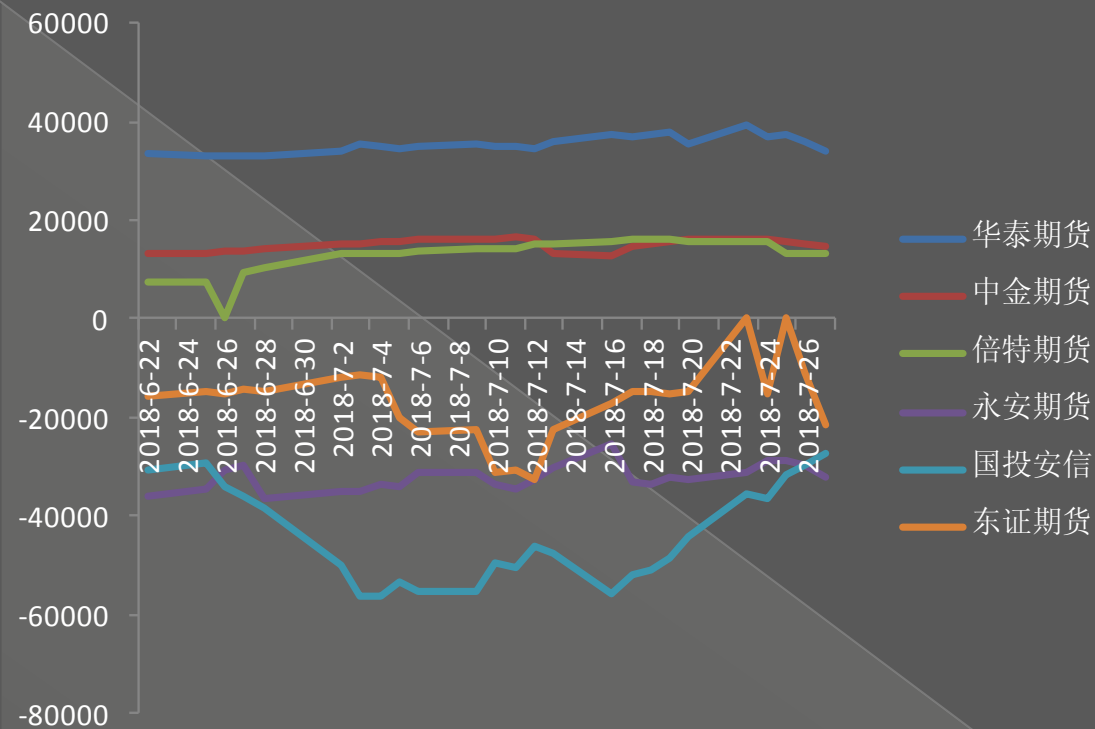


- 徽商期货
- 广发期货
- 方正中期
- 中信期货
- 华泰期货
- 华信期货

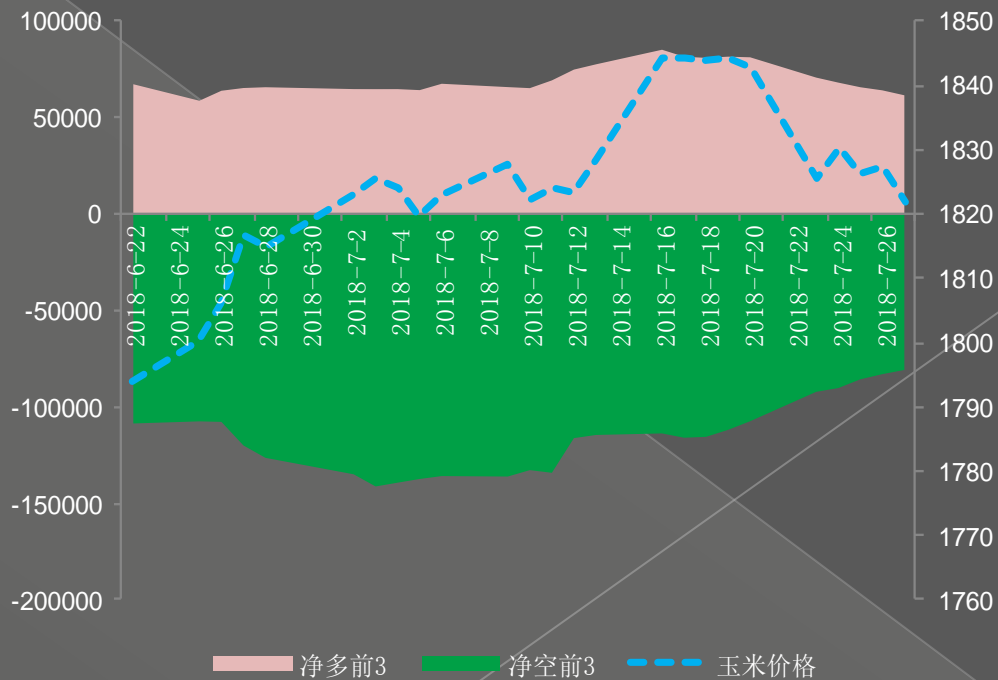
变动幅度		当日	最近5日	平均变化	波动率
sr持仓	多头前3	-3.06%	-8.24%	-1.65%	43.22%
	空头前3	7.53%	-7.53%	-1.51%	
sr涨幅		0.82%	2.50%	0.50%	
震荡幅度	1.78%	1.28% (月均值)	投机度	1.10	0.83 (月均值)



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	-3.94%	-24.08%	-4.82%	10.31%
	空头前3	-2.66%	-24.88%	-4.98%	
c涨幅		-0.31%	-1.14%	-0.23%	
震荡幅度	0.42%	0.61%(月均值)	投机度	0.23	0.29(月均值)



部分机构资金变动表

制表日期：2018年7月27日

单位：万

	当日保证金流入 (流出)	当日保证金增幅	5日保证金流入 (流出)	5日保证金增幅
永安期货	8808.64	3.83%	27593.95	13.08%
南华期货	104.78	0.10%	-8052.51	-7.19%
混沌天成	0.00	--	0.00	--
海通期货	-6847.02	-8.41%	-22926.30	-23.51%
上海大陆	-379.36	-3.31%	-2410.81	-17.87%
中信期货	-3952.38	-2.60%	-37386.85	-20.18%
新湖期货	-3338.09	-4.41%	2727.28	3.91%

中粮期货	1248.03	0.54%	-7844.97	-3.25%
中信建投	6677.49	22.65%	3189.83	9.68%
申银万国	-2938.12	-6.02%	-1465.85	-3.09%
华泰期货	20069.29	18.96%	23279.61	22.69%
光大期货	6455.78	12.73%	-3995.27	-6.53%
一德期货	-15627.57	-15.24%	-7008.86	-7.46%
国投期货	-83.75	-0.10%	-11690.99	-12.56%
金瑞期货	3352.58	4.32%	7585.48	10.34%
鲁证期货	-22361.07	-37.09%	-21649.36	-36.34%
中国国际	-3284.60	-5.53%	-3522.26	-5.91%

部分机构持仓一览

机构	永安期货					
日期	2018-7-20	2018-7-23	2018-7-24	2018-7-25	2018-7-26	2018-7-27
黄金						
白银	-6749	-5662	-7341	-5989	-4640	-7236
沪铜					1610	1793
沪铝	-6583	-6420	-7844	-6597	-6709	-7680
沪镍	-11563	-11809	-10190	-7137	-8109	-4718
沪锌	3300	4375		3996		
沪铅	2523	2354	2346	3323	4763	4611
螺纹钢	53915	66620	47569	48114	44451	48431
铁矿石	-3819	-4921		-2201		5724
焦煤	6102	5302	3265	-2107	-3282	-7931
焦炭	12433	12758	15169	15633	15532	15776
豆油	-9695					
棕榈油	-13015	-13680	-13967	-14033	-12148	-11811
菜籽油	22684	23610	23114	23667	23620	27700
豆粕	124381	127141	124050	128469	110595	110399
菜籽粕	8224	7614	7671	7184	3268	3388
棉花			-8412	-9570	-9349	-7234
白糖		554	717	1110	933	67
玉米	-32572	-31216	-28569	-28929	-29725	-32015
鸡蛋	1509	1786	1656	1761	1906	1426
PTA	63570	71469	85099	88120	89368	95248
聚乙烯	-9433	-8966	-7187	-6368	-11779	-13548
聚丙烯	20767	20636	22065	24964	22662	22412
甲醇	-1995		5686	-6989	-12098	-3516
玻璃	-1019		-2992	-3106	-2321	-2883
橡胶	-13734	-13987	-14541	-13317	-13732	-14688
沥青	14339	13104	11424	15991	13007	11420
动力煤	23547	26860	28089	28501	24127	22085

部分机构持仓一览

机构	南华期货					
日期	2018-7-20	2018-7-23	2018-7-24	2018-7-25	2018-7-26	2018-7-27
黄金		-427		-592	-723	-585
白银	8462	8544	13678	8489	8299	
沪铜	5432	5260	4862	4470	3833	3278
沪铝						
沪镍		-568				
沪锌	-7533	-7815	-9014	-7510	-7635	-8198
沪铅	-1901	-2255	-2205	-3106	-3026	-2999
螺纹钢	-52551	-24692	-47976	-46237	-17991	-11273
铁矿石						
焦煤						
焦炭						
豆油	7689	6666	6540	5932		7965
棕榈油	-9986	-9180	-9214	-9510	-8951	-8985
菜籽油	-10130	-9819	-10693	-10586	-9619	-11235
豆粕		-19604		-18569	-19061	-20114
菜籽粕	-11074	-11088	-11739	-10842	-10970	-11671
棉花	8156	7895	7913	9501	8815	8629
白糖						
玉米						
鸡蛋	1192	-452				
PTA						
聚乙烯	15743	13965	13610	13157	13279	16621
聚丙烯	-17437	-17256	-18488	-20172	-23438	-23365
甲醇	-8402	-7406	-9434	-8167	-8067	-7382
玻璃	2761	2384	2053	1858	-1811	1613
橡胶	4967	4597	5223	8756	8349	8242
沥青						
动力煤						

部分机构持仓一览

机构	国泰君安					
日期	2018-7-20	2018-7-23	2018-7-24	2018-7-25	2018-7-26	2018-7-27
黄金	7762	7442	8026	7779	7722	7674
白银				-4883	-4918	-5323
沪铜	3206	2617	3407	2807	2433	1388
沪铝						
沪镍			-3489	-4202	-4248	-5384
沪锌	-5030	-5032	-5696	-5281	-5795	-5842
沪铅	-1704	-1660	-1548	-1758	-2086	-2846
螺纹钢				-7956		
铁矿石	14222	15779	15307	7277	8396	8071
焦煤			-500			
焦炭	-835	-596				
豆油	-18556	-16769	-18653	-17347	-18550	-17023
棕榈油					2893	
菜籽油	15269	15456	15437	15596	16244	15527
豆粕	-22394		-17869	-21799	-20798	-22126
菜籽粕	8326	8266	7902	8263	8677	9076
棉花	7963	8774	8095	8320	8233	8639
白糖	6245	6692	6593	6420	6528	6398
玉米						
鸡蛋	-1136					-1584
PTA	23112	23125	23390	22519	23113	28641
聚乙烯		4451				4046
聚丙烯					4202	5676
甲醇	6722	5957	4526		7535	8065
玻璃	3792	3895	4316	4143	3811	3486
橡胶						
沥青						4251
动力煤	-5953	-6421	-6360	-10191	-8686	

部分机构持仓一览

机构	混沌天成					
日期	2018-7-20	2018-7-23	2018-7-24	2018-7-25	2018-7-26	2018-7-27
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	2018-7-20	2018-7-23	2018-7-24	2018-7-25	2018-7-26	2018-7-27
黄金	3220	3688	3562	3818	3636	
白银				6279	6481	
沪铜	-11803	-11958	-7792	-7161	-6664	-6250
沪铝			-8751			-5298
沪镍	3593	5409	3001	2388	2955	3215
沪锌	-3769	-2717	-3809	-4683		
沪铅	-1528	-1515	-1427	-1412	-1421	-1330
螺纹钢	-23008		-13229			
铁矿石			6852	7998		11482
焦煤	-2367	-2152		-1874	-2050	
焦炭	7066	6492	6388	6145	6375	7088
豆油						
棕榈油			4936	4588	5246	6707
菜籽油	-5424	-4414	-5058	-4579	-4922	-5041
豆粕	23682	27935	27745	29551	32199	31040
菜籽粕	2585		3168	1802	4378	
棉花						
白糖	-39		36			
玉米	19619	11775	13428	12937	8466	8645
鸡蛋					1099	
PTA						
聚乙烯	6778	6803	5658	6934	11318	9780
聚丙烯						
甲醇	5738					
玻璃	1250		2004	2117	1600	1543
橡胶						
沥青	6087	4804	4912		4542	4578
动力煤			4895			

部分机构持仓一览

机构	上海大陆					
日期	2018-7-20	2018-7-23	2018-7-24	2018-7-25	2018-7-26	2018-7-27
黄金						
白银						
沪铜	4072	3182	3014	3029	3048	3041
沪铝						
沪镍						
沪锌						
沪铅						
螺纹钢						
铁矿石						
焦煤						
焦炭						
豆油						
棕榈油	7584	7253	7246	7294	7987	7180
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	中粮期货					
日期	2018-7-20	2018-7-23	2018-7-24	2018-7-25	2018-7-26	2018-7-27
黄金						
白银	7523	5401		5601		
沪铜	-7691	-5988	-7705	-8577	-8123	-8130
沪铝	-5892	-6583	-6344	-6696	-6103	-6230
沪镍	-6064	-5447	-5297	-5720	-4848	-5192
沪锌	3727	3727	4012	3908	4110	4116
沪铅		-781	-782	847	795	701
螺纹钢						
铁矿石	11865	12028	11015	11044	11061	8754
焦煤		-1989	-2239	-2051	-2010	
焦炭						
豆油	-62255	-63294	-61469	-59991	-61368	-63508
棕榈油	-37365	-37930	-39059	-40180	-39349	-39894
菜籽油	-38126	-38459	-38210	-38501	-38343	-38067
豆粕	-218088	-216489	-204821	-203608	-195820	-192027
菜籽粕	-32233	-32335	-33742	-34715	-34359	-34419
棉花	-11493	-11383	-10764	-11539	-10748	-10237
白糖	-6638	-6543	-5873			-9150
玉米		11550	12142	12201	10895	11142
鸡蛋						
PTA	19045	18032	19733	14800	14968	12688
聚乙烯	-5879	-5957	-6316	-6411	-8035	-8077
聚丙烯	3699		3770	3743		
甲醇	-6386		-5788			
玻璃			-2891	-2476	-943	-206
橡胶	-8157	-8531	-8387	-8601	-8947	-9198
沥青						
动力煤						

部分机构持仓一览

机构	中信期货					
日期	2018-7-20	2018-7-23	2018-7-24	2018-7-25	2018-7-26	2018-7-27
黄金	11627	11394	9603	8253	6130	3298
白银	-37501	-35950	-35548	-33600	-34501	-35617
沪铜	-13511	-13976	-13033	-11360	-9566	-10151
沪铝	-7898	-5920		-5708	-5935	-5119
沪镍	-6709	-5902	-6780	-6551	-6197	-6437
沪锌	-4376			-3838		
沪铅	2936	2428	2380	1209	1298	929
螺纹钢	-26284	-26573	-29229	-15460	-17990	-17619
铁矿石	-10250	-12240	-11442	-14391	-15658	-6904
焦煤		458		1833	2007	3272
焦炭	3600	2844	2859	2939	2602	2414
豆油	9868	10090	9866	10185	12284	14003
棕榈油	-6532	-7159	-7284	-6899	-5968	-6009
菜籽油	-10974	-10163	-10746	-10747	-9787	-11070
豆粕						
菜籽粕		-1047	-700	-1091		-2782
棉花	3991	5053	5841	7482	7893	8172
白糖	-9304	-11711	-12690	-13984	-13201	-12778
玉米	26237	15900	11162	8601		
鸡蛋	1249	1815	1687	1542	1512	1689
PTA	22061	22573	25102	21603	21158	21768
聚乙烯						
聚丙烯	-4146	-3906				
甲醇	11138	12387	15760	12490	6698	7865
玻璃	7865	7649	8040	7770	6992	6937
橡胶	-9417	-10180	-10244	-8860	-10143	-11156
沥青	-3078			-3300		-3455
动力煤	-9137	-10472	-10219	-11576	-12500	-14416

部分机构持仓一览

机构	中信建投					
日期	2018-7-20	2018-7-23	2018-7-24	2018-7-25	2018-7-26	2018-7-27
黄金	3506	4154		3636	3630	3826
白银						5496
沪铜	-3587	-3368	-3367			
沪铝			4134			
沪镍						
沪锌						
沪铅						
螺纹钢	-21280	-22765	-21457	-22241	-25074	-27730
铁矿石						
焦煤					1707	
焦炭						
豆油						
棕榈油	11994	12452	8771	7886	7924	7905
菜籽油					4663	4624
豆粕						
菜籽粕						
棉花						
白糖						
玉米						
鸡蛋	1869	2095	2242	2236		
PTA						
聚乙烯						
聚丙烯						
甲醇					5558	5532
玻璃						
橡胶				2836		2783
沥青						
动力煤						

部分机构持仓一览

机构	新湖期货					
日期	2018-7-20	2018-7-23	2018-7-24	2018-7-25	2018-7-26	2018-7-27
黄金	-1461	-1453	-1470	-1434	-1450	-1446
白银	-4082		-4578			
沪铜						
沪铝						
沪镍	6772	6750	2721	4401	6755	3089
沪锌						
沪铅	1877	1944	1880	1841	1663	1548
螺纹钢	34267			28182	27850	27367
铁矿石						
焦煤						
焦炭						
豆油	-10243	-10382	-9738	-9902	-19724	-19621
棕榈油	12716	12603	12453	12481	12369	11696
菜籽油	-5415	-5399	-5196	-4864	-4234	-4020
豆粕	-28180	-25283	-23964	-24007	-50244	-49933
菜籽粕						
棉花						
白糖						
玉米						
鸡蛋	-4056	-3792	-3709	-3611	-3430	-2974
PTA	-26444	-26992	-28088	-26783	-24038	-29103
聚乙烯						
聚丙烯						
甲醇						
玻璃						
橡胶	-6016	-6093	-5751	-5059	-5033	-5059
沥青	-3000	-3067	-2877		-5758	-5584
动力煤			-7317	-7203	-5715	-6312

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

