大陆期货

市场持仓分析

2018/1/5

大陆期货

大陆期货研究所

今天持仓变化

品种	今天变化						今天头寸变化参考	
	多头前3	多头前5	多头前20	空头前3	空头前5	空头前20	多头前3-空头前3	指标参考
焦炭	41.60%	31.25%	18.68%	-16.76%	-14.53%	-17.39%	58.36%	☆☆☆☆☆
甲醇	17.35%	13.67%	7.31%	-1.10%	-2.90%	-3.21%	18.45%	☆☆☆
焦煤	-9.69%	-6.78%	-2.44%	-10.59%	-4.78%	-1.28%	0.89%	☆
动力煤	12.23%	7.62%	5.75%	-2.62%	-3.22%	-2.52%	14.85%	☆☆☆
铁矿石	-10.29%	-5.12%	1.44%	-1.58%	-2.22%	-3.00%	-8.71%	☆☆
玻璃	9.14%	8.54%	1.81%	-6.90%	-4.98%	3.02%	16.04%	☆☆☆
豆粕	2.97%	3.21%	0.01%	-0.35%	-0.49%	0.46%	3.32%	☆
玉米	4.26%	4.77%	1.37%	-1.64%	-0.88%	0.03%	5.90%	☆☆
棕榈油	-7.52%	-7.64%	2.12%	0.77%	2.35%	0.25%	-8.29%	☆☆
鸡蛋	1.20%	-0.54%	-1.10%	0.69%	2.92%	2.07%	0.51%	☆
沪镍	1.35%	1.35%	-0.55%	3.11%	1.40%	0.37%	-1.76%	☆
菜籽粕	3.17%	0.32%	2.33%	0.34%	-0.43%	-2.71%	2.83%	☆
橡胶	4.06%	5.33%	3.29%	-2.78%	-3.71%	-4.23%	6.84%	☆☆
豆油	-1.88%	-2.91%	-3.54%	1.40%	3.07%	2.08%	-3.29%	☆
沪铜	-0.71%	-0.85%	0.44%	-2.90%	-1.76%	-1.26%	2.19%	☆
棉花	0.88%	0.99%	1.31%	-0.69%	-0.40%	-0.44%	1.57%	☆
白糖	-17.92%	-13.55%	-5.58%	-3.23%	-2.48%	-0.74%	-14.69%	☆☆☆
沪锌	1.42%	1.12%	3.38%	-5.94%	-4.75%	-2.73%	7.36%	☆☆
聚乙烯	-7.49%	-3.07%	-3.30%	-0.31%	-0.47%	0.27%	-7.18%	☆☆
聚丙烯	3.35%	2.90%	-0.27%	0.67%	-0.52%	-1.54%	2.68%	☆
沥青	-5.68%	-3.63%	4.12%	-7.60%	-3.52%	-1.84%	1.92%	☆
沪银	0.03%	-0.17%	3.32%	3.67%	6.31%	5.84%	-3.64%	☆
PTA	19.59%	22.39%	16.24%	-16.42%	-16.83%	-16.11%	36.00%	☆☆☆☆
沪金	-9.69%	-6.77%	-0.67%	1.90%	4.76%	2.18%	-11.59%	☆☆☆
沪铝	-0.11%	-0.40%	-1.27%	0.51%	0.02%	-0.32%	-0.62%	☆
螺纹钢	0.28%	2.39%	5.98%	-0.97%	-2.56%	-3.36%	1.25%	☆

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20	空头前3	空头前5	空头前20	多头前3-空头前3	指标参考
甲醇	0.39%	-3.13%	-8.53%	15.67%	15.67%	14.35%	-15.28%	☆☆
玉米	-3.20%	-3.06%	-2.12%	8.32%	7.05%	3.94%	-11.52%	☆☆
棕榈油	-31.52%	-22.71%	-12.36%	11.27%	14.03%	9.19%	-42.79%	☆☆☆
动力煤	-34.79%	-35.41%	-25.18%	20.46%	21.15%	28.49%	-55.26%	☆☆☆☆
聚丙烯	1.00%	6.55%	11.37%	9.11%	-0.44%	-12.29%	-8.10%	☆
橡胶	0.15%	2.47%	6.40%	-1.63%	-2.71%	-4.87%	1.78%	☆
棉花	6.84%	5.49%	-0.02%	-6.81%	-4.62%	-1.81%	13.64%	☆☆
鸡蛋	-2.04%	-4.61%	-4.35%	2.81%	5.09%	4.59%	-4.85%	☆
菜籽粕	18.13%	14.17%	5.36%	-5.27%	-7.87%	-9.14%	23.40%	☆☆
铁矿石	6.82%	13.68%	9.05%	-2.68%	-8.12%	-3.11%	9.49%	☆
豆油	-10.96%	-8.90%	-10.17%	2.85%	6.74%	8.57%	-13.80%	☆☆
沪镍	-2.96%	2.47%	0.18%	5.39%	5.45%	4.54%	-8.35%	☆
焦炭	42.26%	32.12%	12.24%	-7.07%	-4.62%	-3.05%	49.33%	☆☆☆
沥青	16.03%	24.20%	24.81%	-19.31%	-15.93%	-16.42%	35.33%	☆☆☆
沪银	1.53%	-1.55%	-1.67%	12.89%	11.44%	14.31%	-11.36%	☆☆
沪铝	-1.94%	-5.89%	-4.27%	3.39%	3.06%	2.25%	-5.33%	☆
沪金	-3.27%	1.58%	6.76%	3.74%	4.28%	3.23%	-7.02%	☆
焦煤	-2.20%	2.08%	0.75%	-12.26%	-8.40%	-0.03%	10.06%	☆☆
沪锌	14.98%	16.77%	19.47%	-29.87%	-26.23%	-25.44%	44.85%	☆☆☆
聚乙烯	1.45%	13.89%	16.12%	-37.87%	-21.43%	-16.26%	39.31%	☆☆☆
沪铜	-4.63%	-2.62%	-0.13%	-1.53%	-7.06%	-1.19%	-3.10%	☆
豆粕	2.78%	-0.19%	1.05%	2.70%	1.85%	0.49%	0.08%	☆
螺纹钢	6.75%	0.17%	0.36%	1.49%	2.87%	8.40%	5.26%	☆
PTA	33.33%	35.63%	21.91%	-39.82%	-36.79%	-27.76%	73.15%	☆☆☆☆
白糖	-15.10%	-14.88%	-10.01%	-4.93%	-0.71%	3.98%	-10.17%	☆☆
玻璃	-19.52%	-17.12%	-14.83%	12.08%	12.21%	15.05%	-31.59%	☆☆☆

2018年1月5日机构持仓异动表

金属	
中信期货	黄金净多单变动幅度为：-3858手
东证期货	白银净多单变动幅度为：3119手
金瑞期货	沪锌净多单变动幅度为：2280手

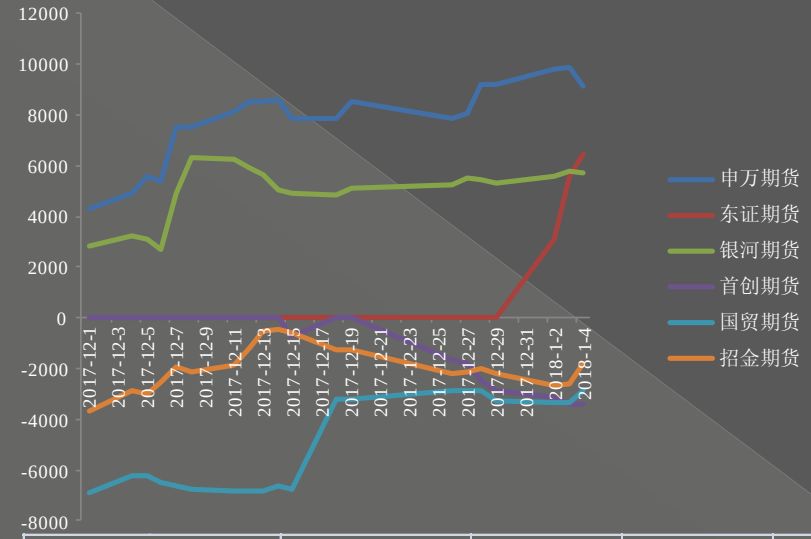
黑色	
永安期货	铁矿石净多单变动幅度为：-30307手
华泰期货	铁矿石净多单变动幅度为：19851手
长江期货	铁矿石净多单变动幅度为：15902手
永安期货	焦煤净多单变动幅度为：-6231手
中粮期货	焦煤净多单变动幅度为：-6174手
华信期货	焦煤净多单变动幅度为：2765手
东证期货	焦炭净多单变动幅度为：-3282手
弘业期货	焦炭净空单变动幅度为：-2383手
永安期货	焦炭净多单变动幅度为：8363手
海通期货	焦炭净多单变动幅度为：1585手
中粮期货	焦炭净多单变动幅度为：2724手

2018年1月5日机构持仓异动表

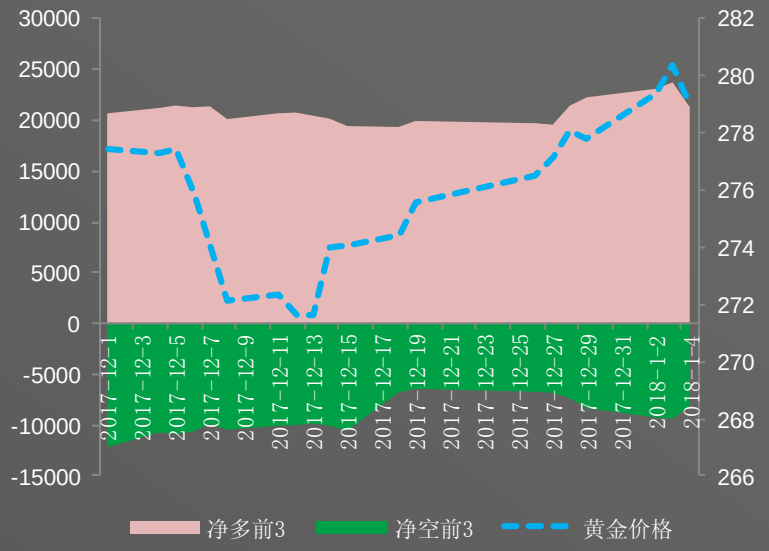
农产品	
摩根大通	棕榈油净多单变动幅度为：3642手
华泰期货	菜籽粕净多单变动幅度为：-5303手
华泰期货	菜籽粕净多单变动幅度为：-5303手
华信期货	白糖净多单变动幅度为：-13535手
国海良时	白糖净多单变动幅度为：-5465手
国海良时	白糖净多单变动幅度为：-5465手

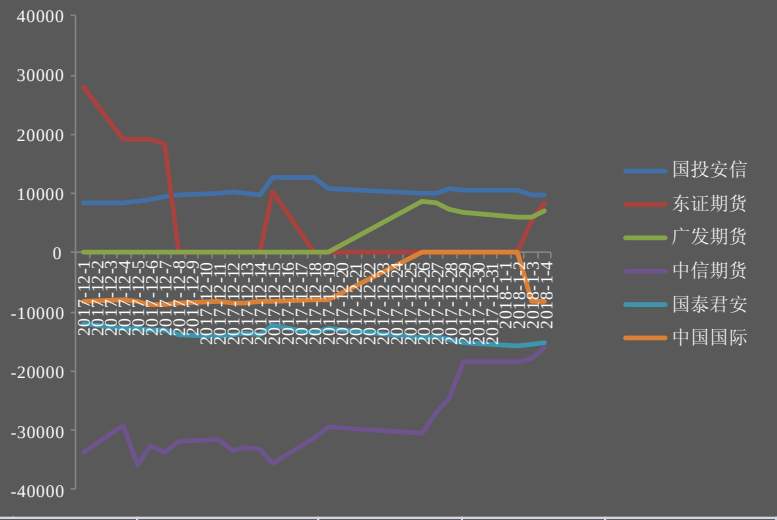
化工	
华泰期货	PTA净多单变动幅度为：-17062手
海通期货	PTA净多单变动幅度为：7989手
国泰君安	PTA净多单变动幅度为：25974手
海通期货	聚乙烯净多单变动幅度为：6253手
永安期货	聚乙烯净空单变动幅度为：9202手
国投安信期货	甲醇净多单变动幅度为：-6678手
华信期货	玻璃净多单变动幅度为：5513手
鲁证期货	沥青净多单变动幅度为：4334手
方正中期	橡胶净多单变动幅度为：-4437手
方正中期	橡胶净多单变动幅度为：-4437手

金属板块：AU & AG

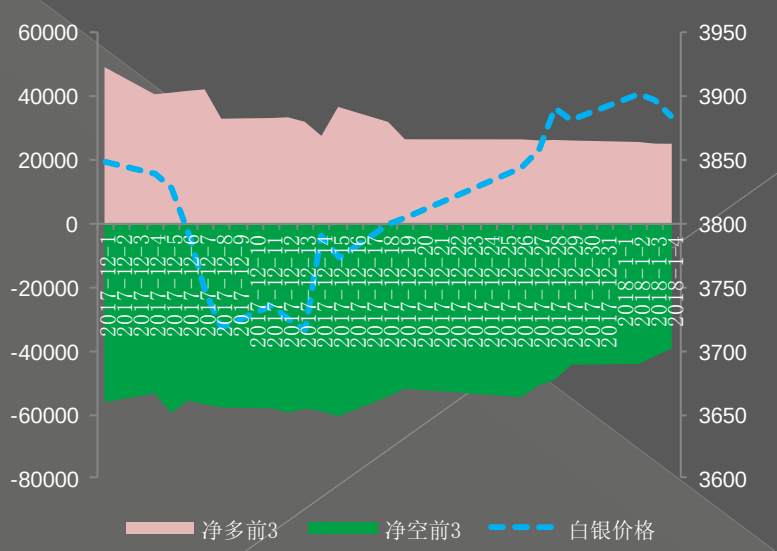


变动幅度		当日	最近5日	平均变化	波动率
au持仓	多头前3	-10.19%	8.84%	1.77%	7.17%
	空头前3	-14.20%	18.46%	3.69%	
au涨幅		-0.47%	0.69%	0.14%	
震荡幅度	0.76%	0.66%(月均值)	投机度	0.48	0.41(月均值)

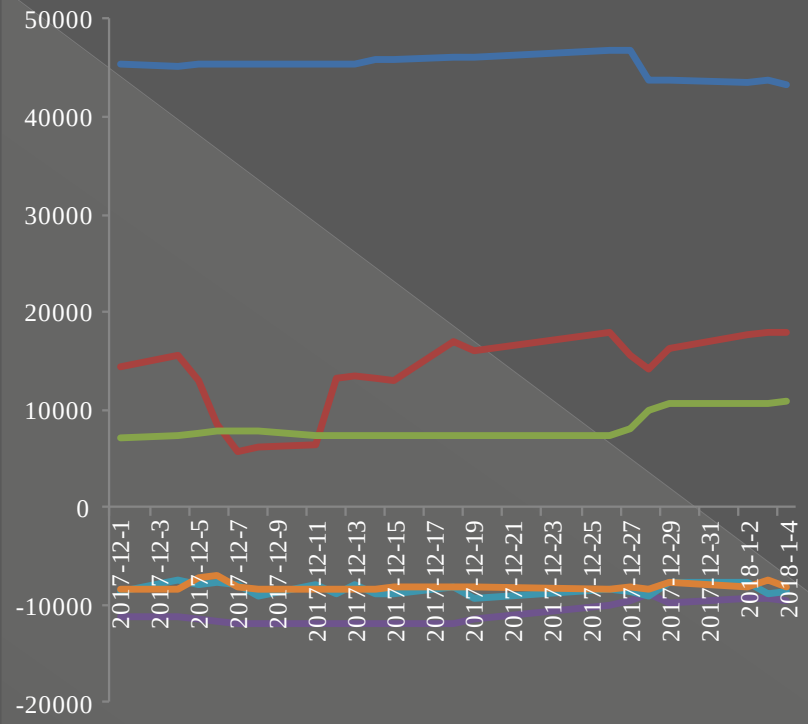




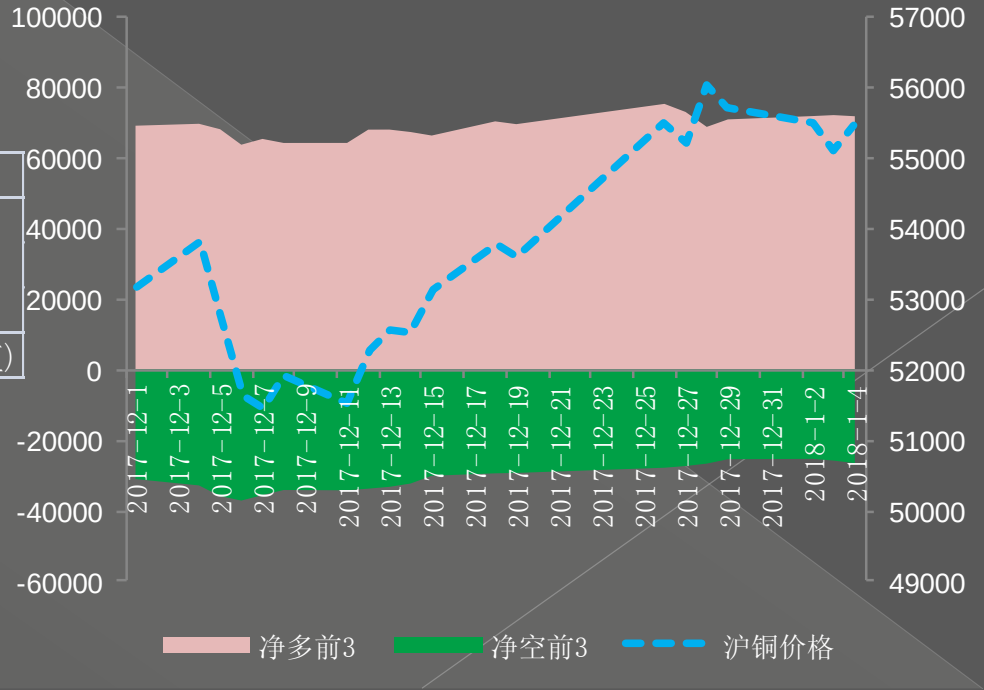
变动幅度		当日	最近5日	平均变化	波动率
ag持仓	多头前3	-0.14%	-3.93%	-0.79%	12.53%
	空头前3	-5.65%	-23.01%	-4.60%	
ag涨幅		-0.31%	0.71%	0.14%	
震荡幅度	0.90%	1.03%(月均值)	投机度	0.56	0.55(月均值)



金属板块：Cu

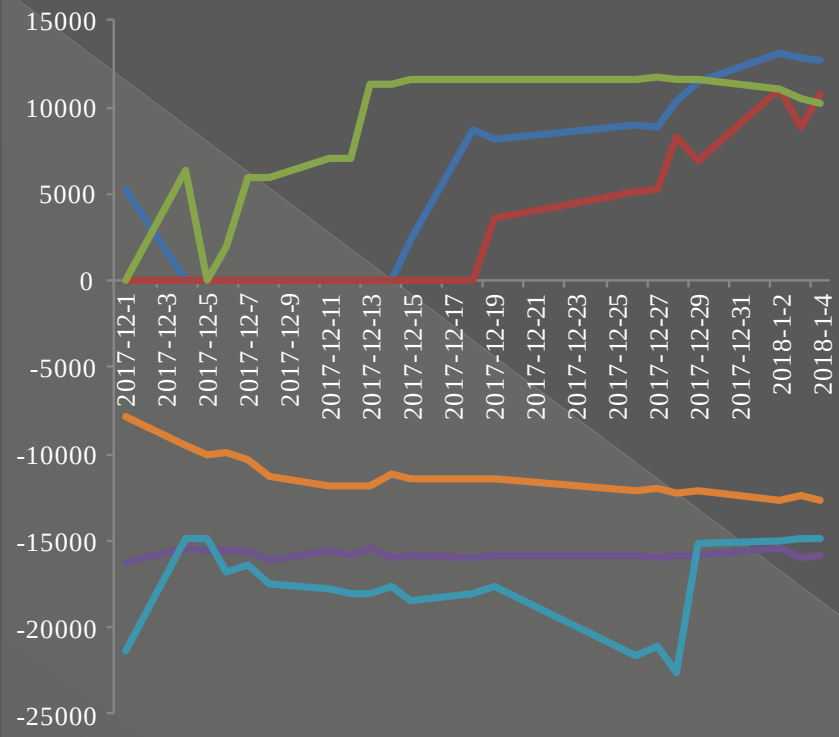


变动幅度		当日	最近5日	平均变化	波动率
cu持仓	多头前3	-0.45%	-1.66%	-0.33%	19.94%
	空头前3	2.84%	-2.94%	-0.59%	
cu涨幅		0.65%	0.44%	0.09%	
震荡幅度	1.20%	1.31%(月均值)	投机度	0.42	0.54(月均值)

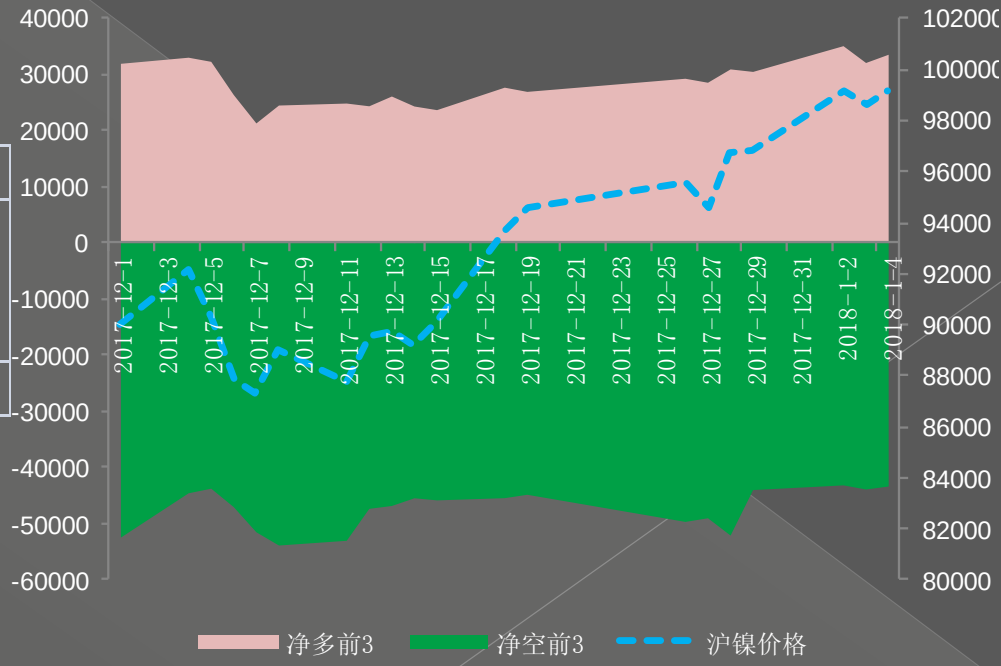


大陆期货

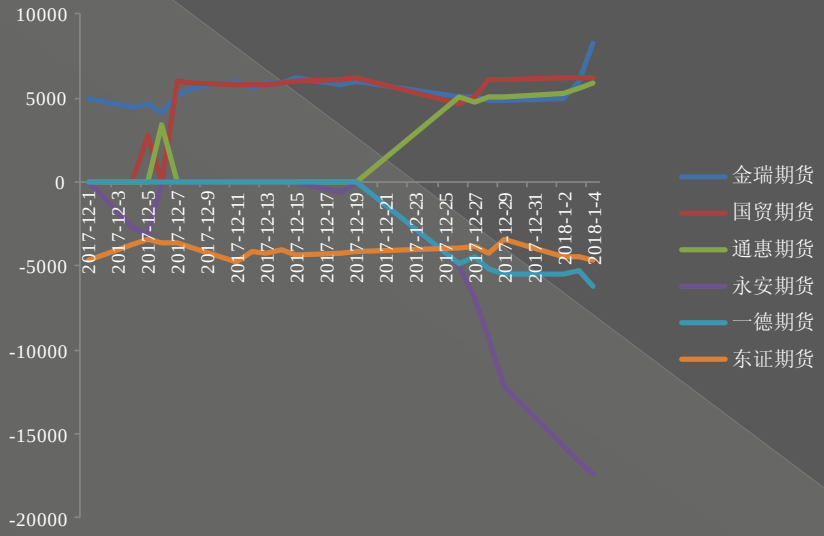
金属板块：Ni

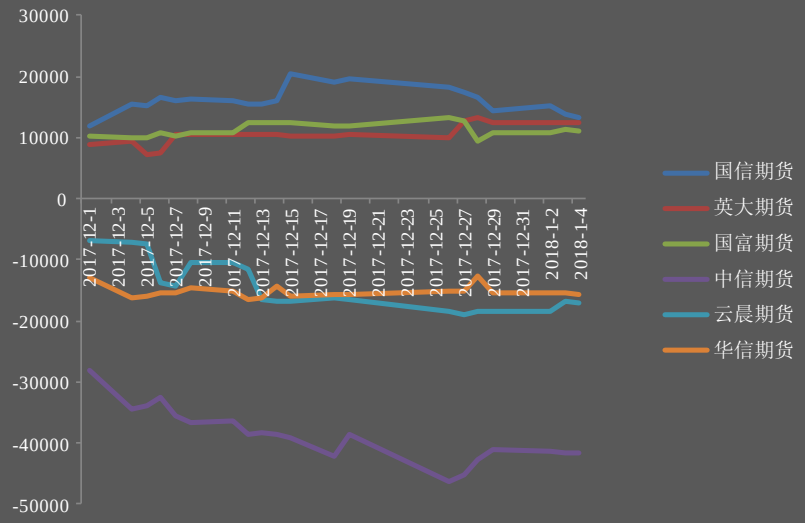


变动幅度		当日	最近5日	平均变化	波动率
ni持仓	多头前3	4.59%	17.46%	3.49%	26.31%
	空头前3	-1.22%	-11.55%	-2.31%	
ni涨幅		0.57%	4.89%	0.98%	
震荡幅度	1.79%	2.38%(月均值)	投机度	1.19	1.27(月均值)



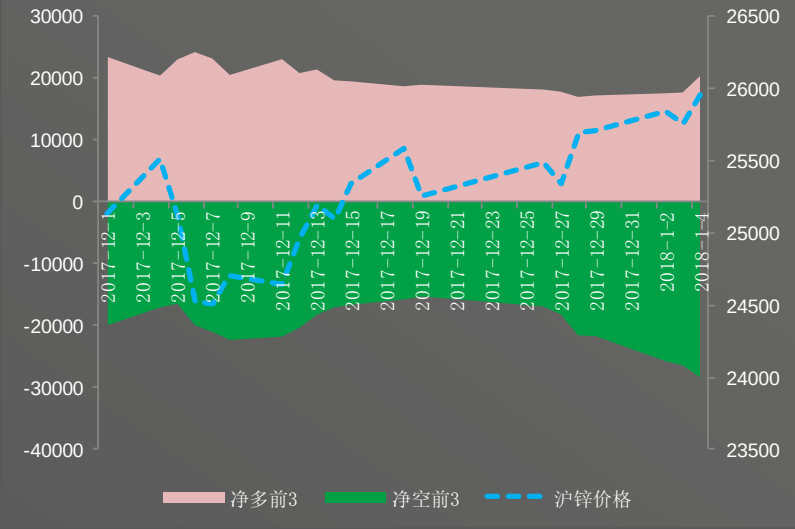
金属板块：Zn & Al

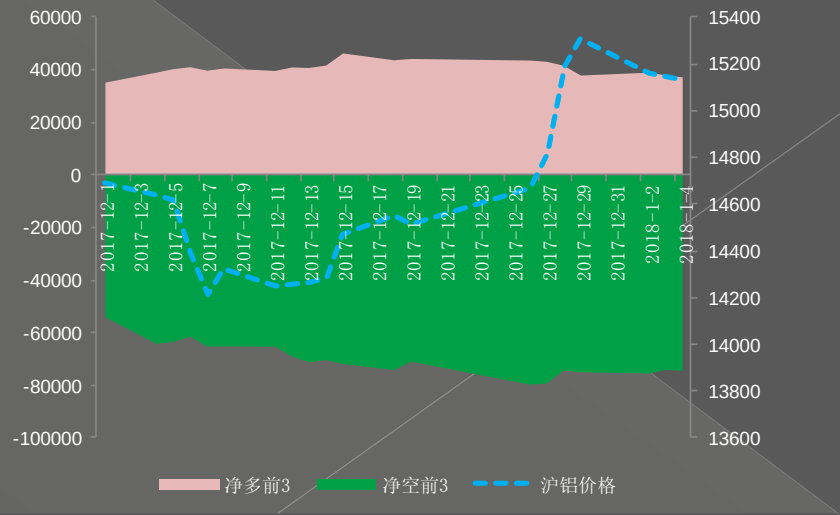




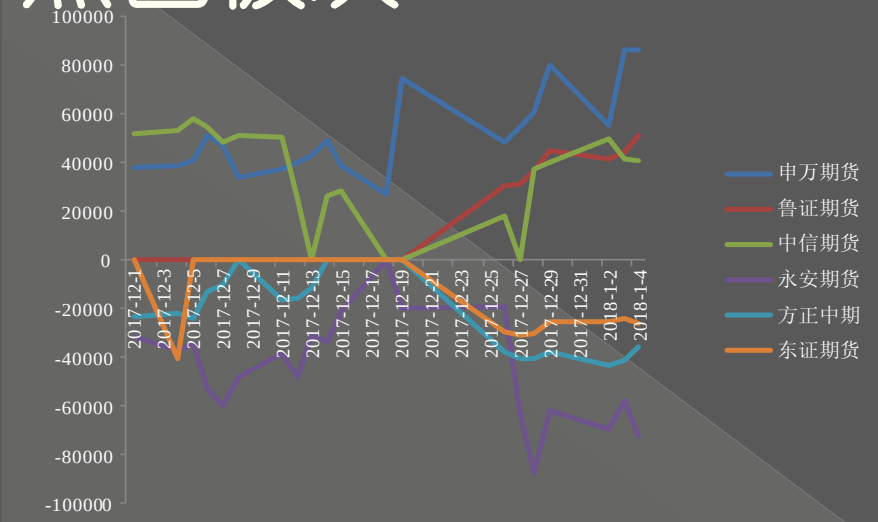
变动幅度		当日	最近5日	平均变化	波动率
zn持仓	多头前3	14.93%	14.08%	2.82%	16.10%
	空头前3	7.21%	55.98%	11.20%	
zn涨幅		0.84%	2.45%	0.49%	
震荡幅度	1.02%	1.61%(月均值)	投机度	0.96	1.42(月均值)

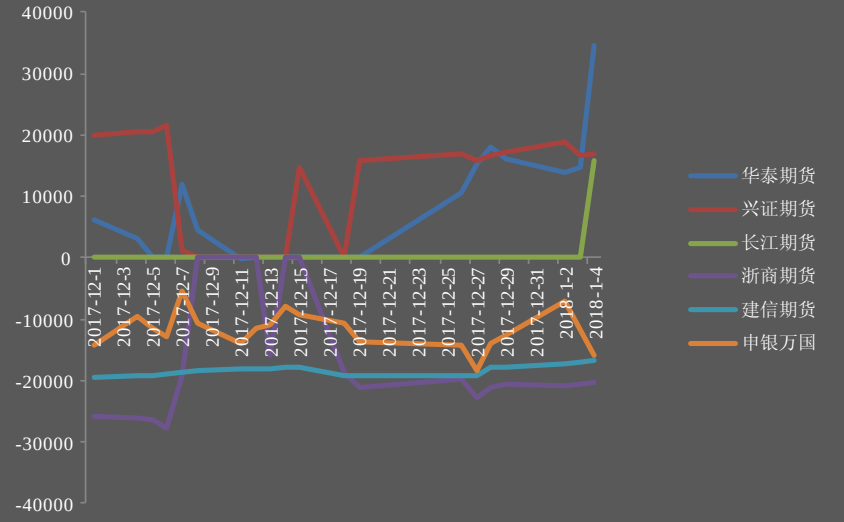
变动幅度		当日	最近5日	平均变化	波动率
al持仓	多头前3	-2.04%	-13.79%	-2.76%	14.32%
	空头前3	0.54%	-6.04%	-1.21%	
al涨幅		-0.11%	2.12%	0.42%	
震荡幅度	0.88%	1.65%(月均值)	投机度	0.45	0.59(月均值)





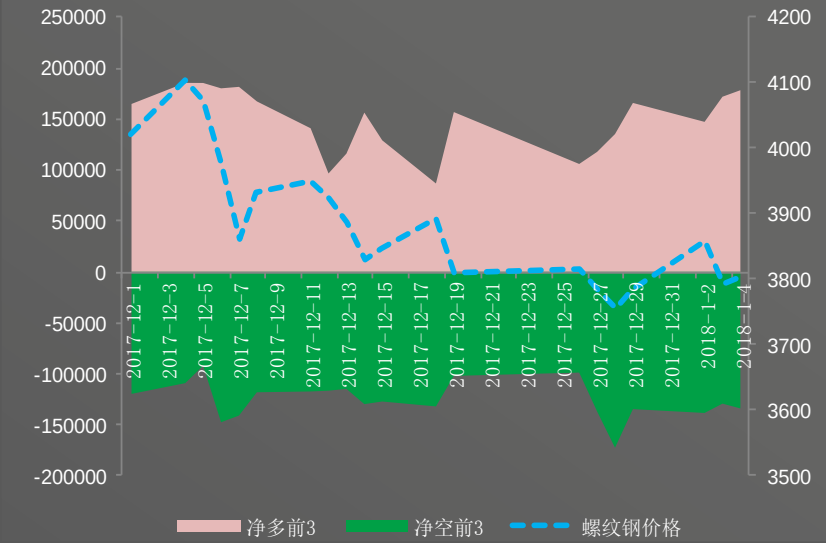
黑色板块：Rb & I

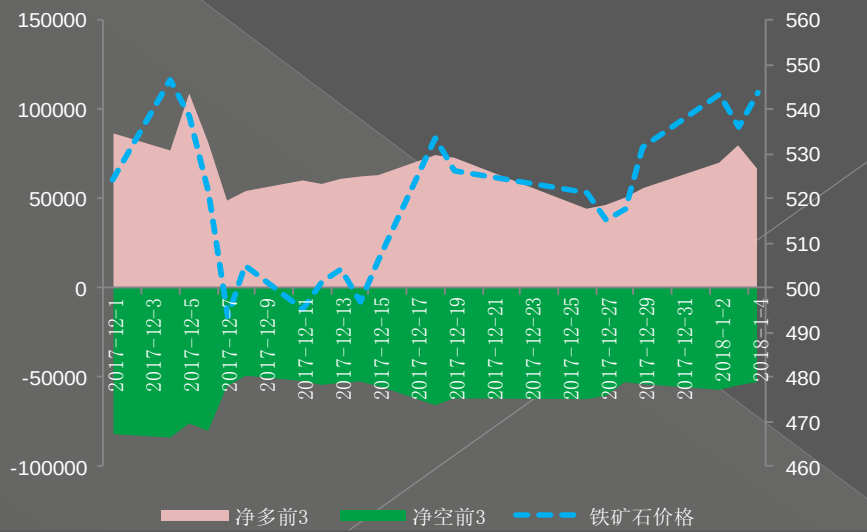




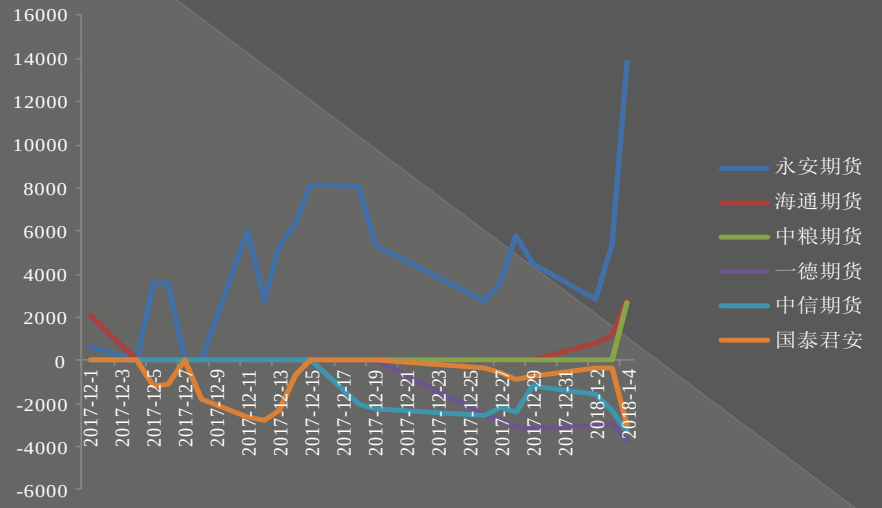
变动幅度		当日	最近5日	平均变化	波动率
rb持仓	多头前3	3.74%	51.41%	10.28%	21.75%
	空头前3	3.61%	-2.17%	-0.43%	
rb涨幅		0.30%	0.55%	0.11%	
震荡幅度	1.71%	2.34%(月均值)	投机度	1.30	1.43(月均值)

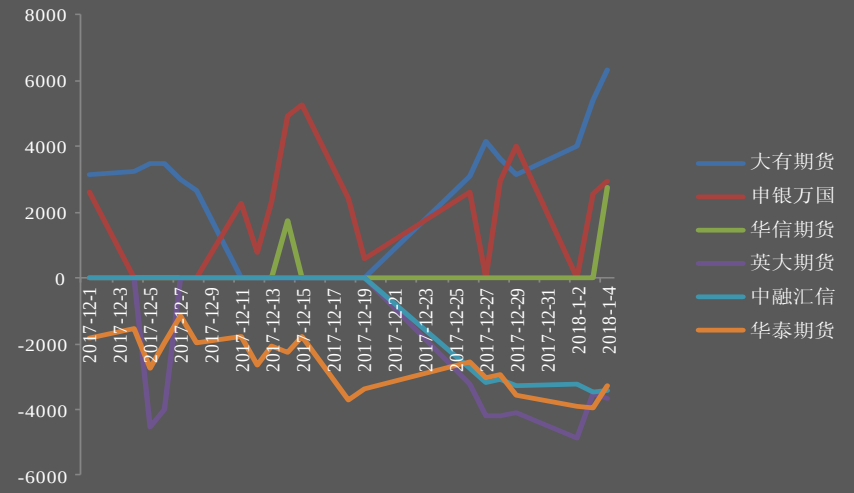
变动幅度		当日	最近5日	平均变化	波动率
I持仓	多头前3	-16.18%	43.90%	8.78%	39.33%
	空头前3	-3.52%	-12.92%	-2.58%	
I涨幅		1.44%	5.49%	1.10%	
震荡幅度	4.17%	3.49%(月均值)	投机度	1.58	1.50(月均值)



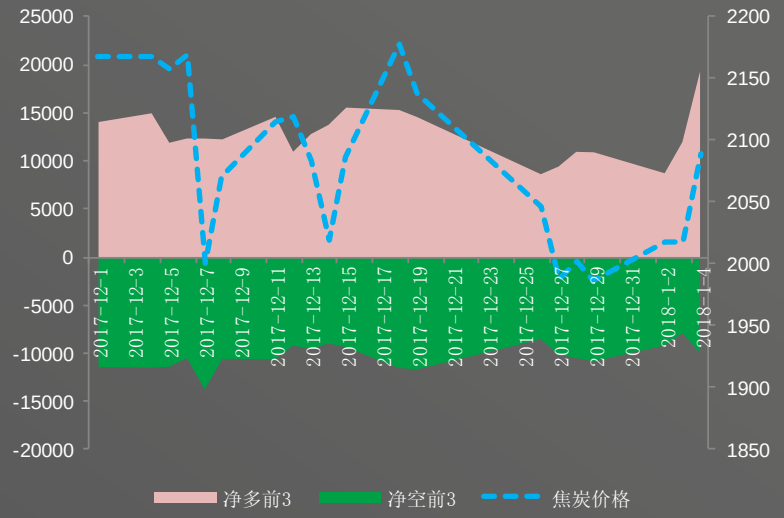


黑色板块：J & JM

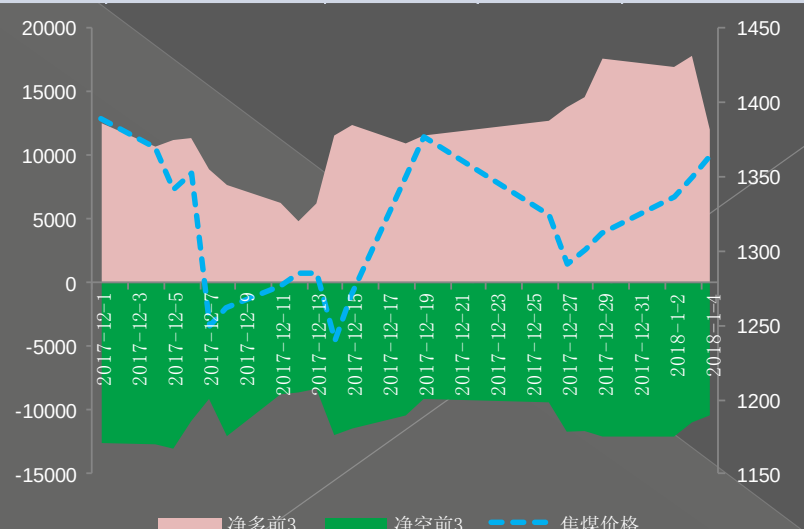




变动幅度		当日	最近5日	平均变化	波动率
j持仓	多头前3	61.32%	105.06%	21.01%	47.74%
	空头前3	25.73%	-1.92%	-0.38%	
j涨幅		3.58%	5.11%	1.02%	
震荡幅度	2.78%	3.77%(月均值)	投机度	1.54	1.73(月均值)

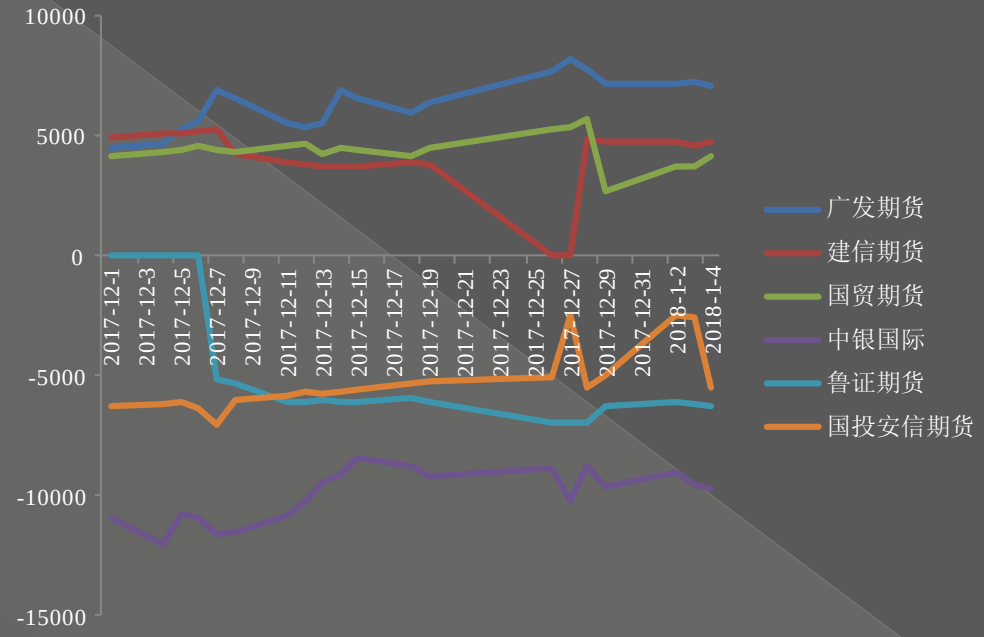


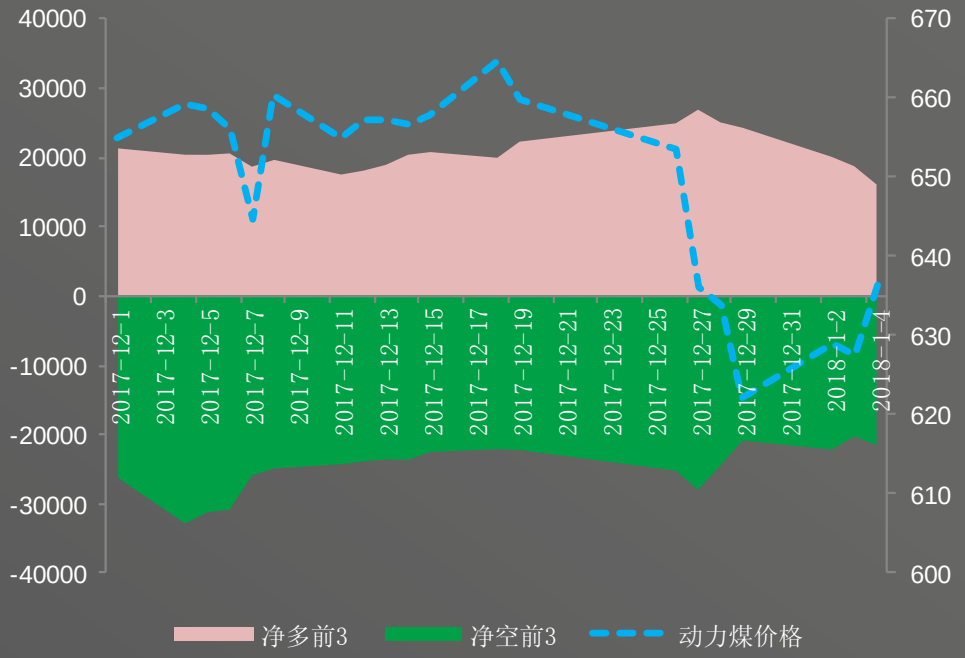
变动幅度		当日	最近5日	平均变化	波动率
jm持仓	多头前3	-32.44%	-12.67%	-2.53%	45.20%
	空头前3	-5.08%	-11.00%	-2.20%	
jm涨幅		1.10%	5.69%	1.14%	
震荡幅度	3.13%	3.82%(月均值)	投机度	1.45	1.82(月均值)



大陆期货

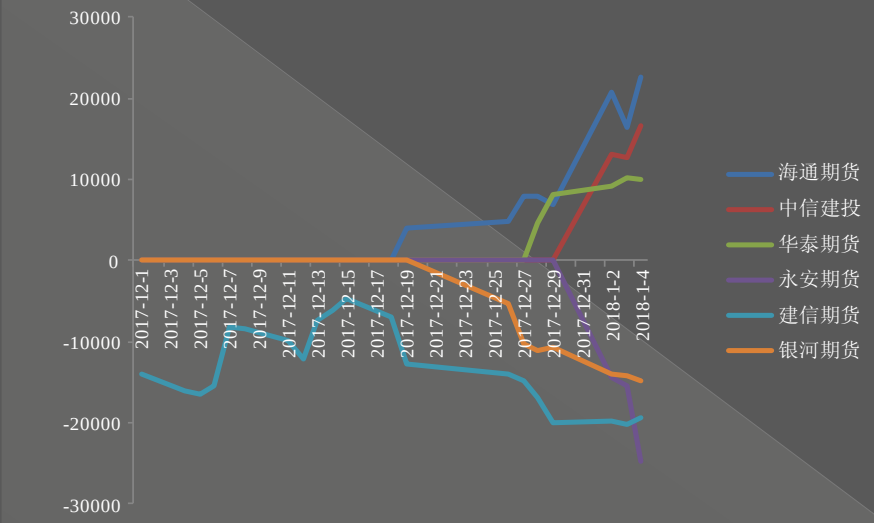
黑色：动力煤

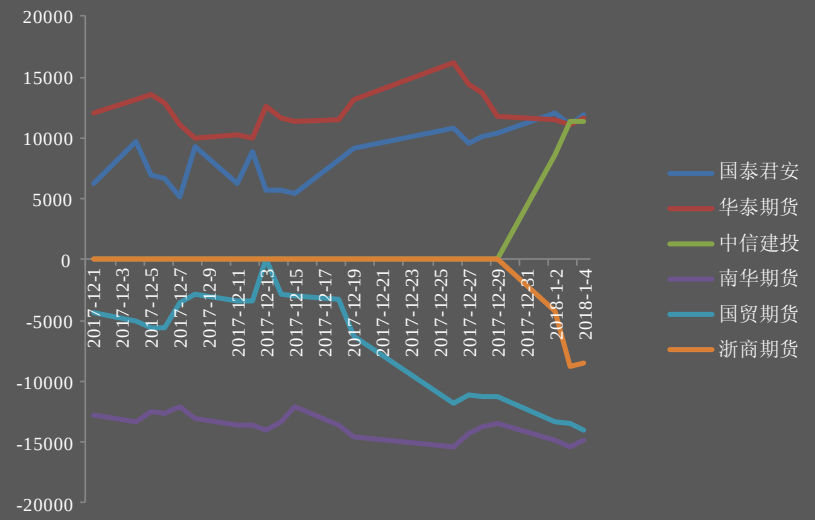




变动幅度		当日	最近5日	平均变化	波动率
zc持仓	多头前3	-14.13%	-40.30%	-8.06%	18.58%
	空头前3	6.12%	-22.98%	-4.60%	
zc涨幅		1.42%	0.06%	0.01%	
震荡幅度	1.30%	1.79%(月均值)	投机度	0.68	0.58(月均值)

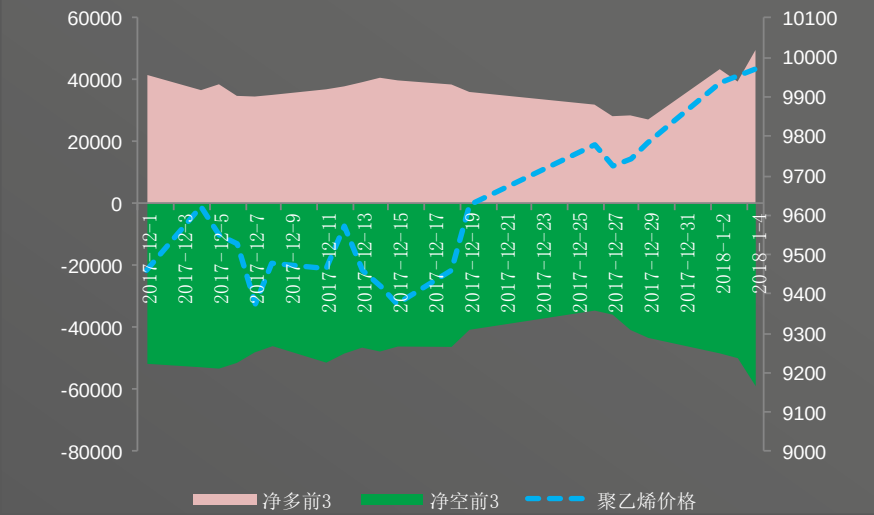
化工：塑料 & PP

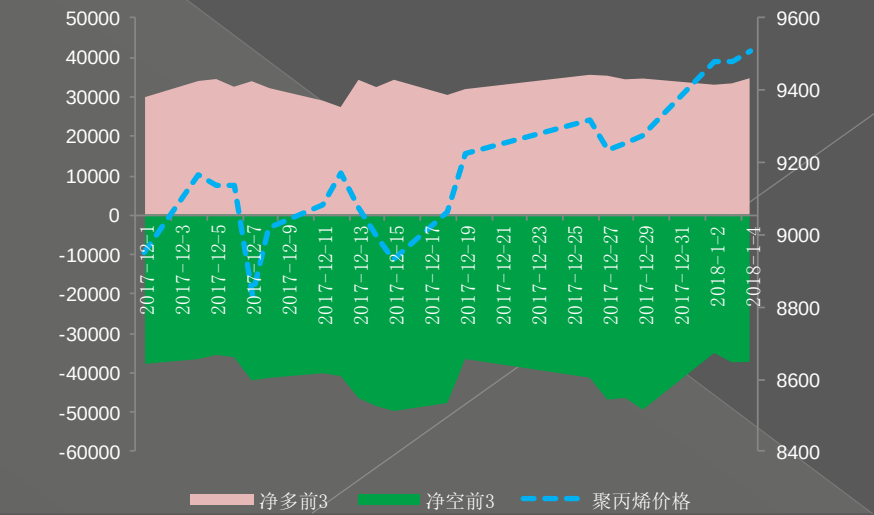




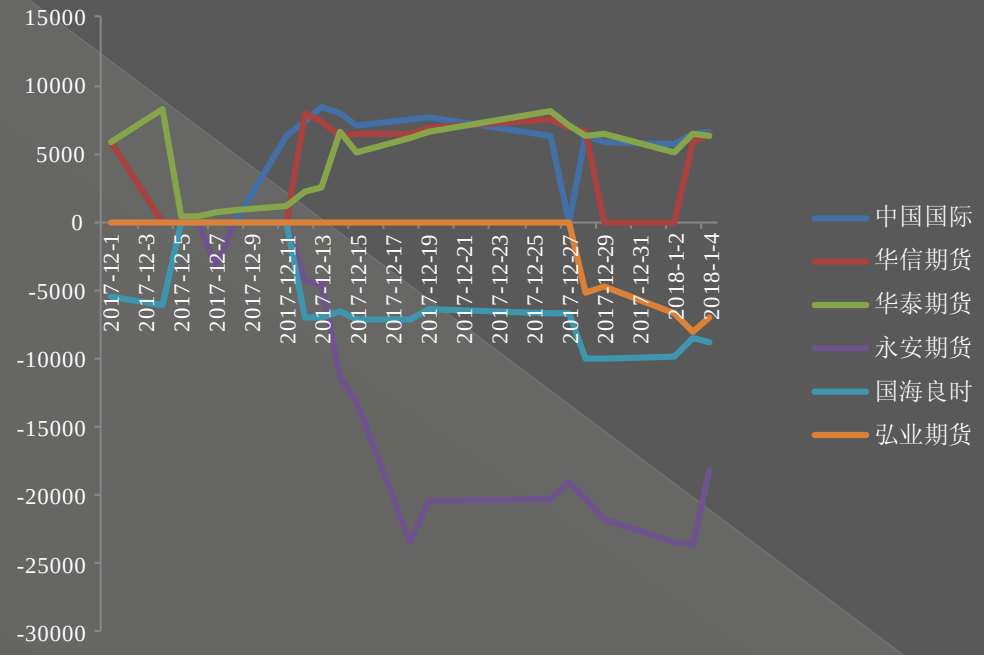
变动幅度		当日	最近5日	平均变化	波动率
l持仓	多头前3	25.73%	75.34%	15.07%	15.57%
	空头前3	18.20%	64.70%	12.94%	
l涨幅		0.16%	2.53%	0.51%	
震荡幅度	1.64%	1.66%(月均值)	投机度	0.76	0.89(月均值)

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%	-1.81%	-0.36%	21.34%
	空头前3	-0.27%	-20.40%	-4.08%	
pp涨幅		0.35%	3.00%	0.60%	
震荡幅度	1.18%	1.83%(月均值)	投机度	0.71	1.05(月均值)

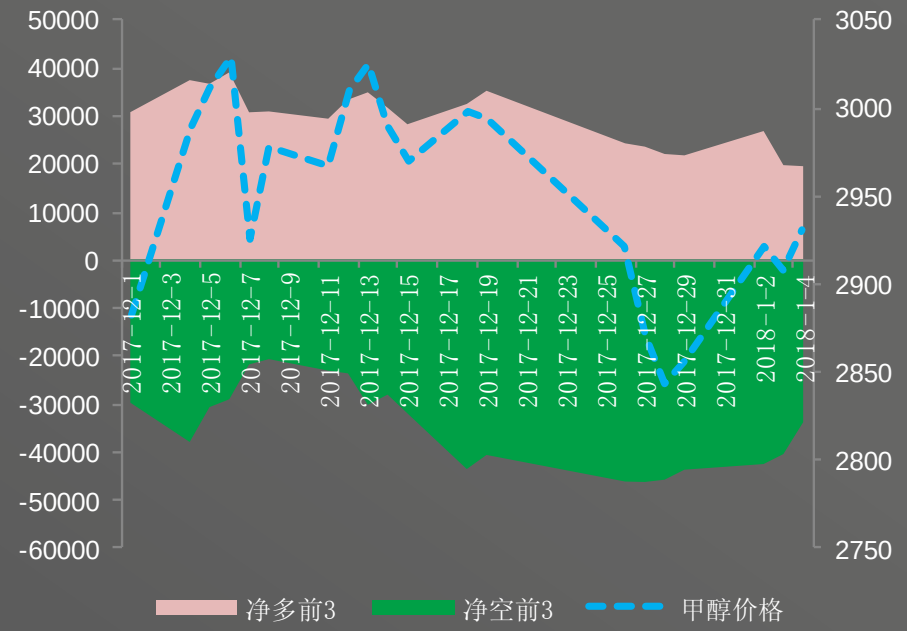




大陆期货



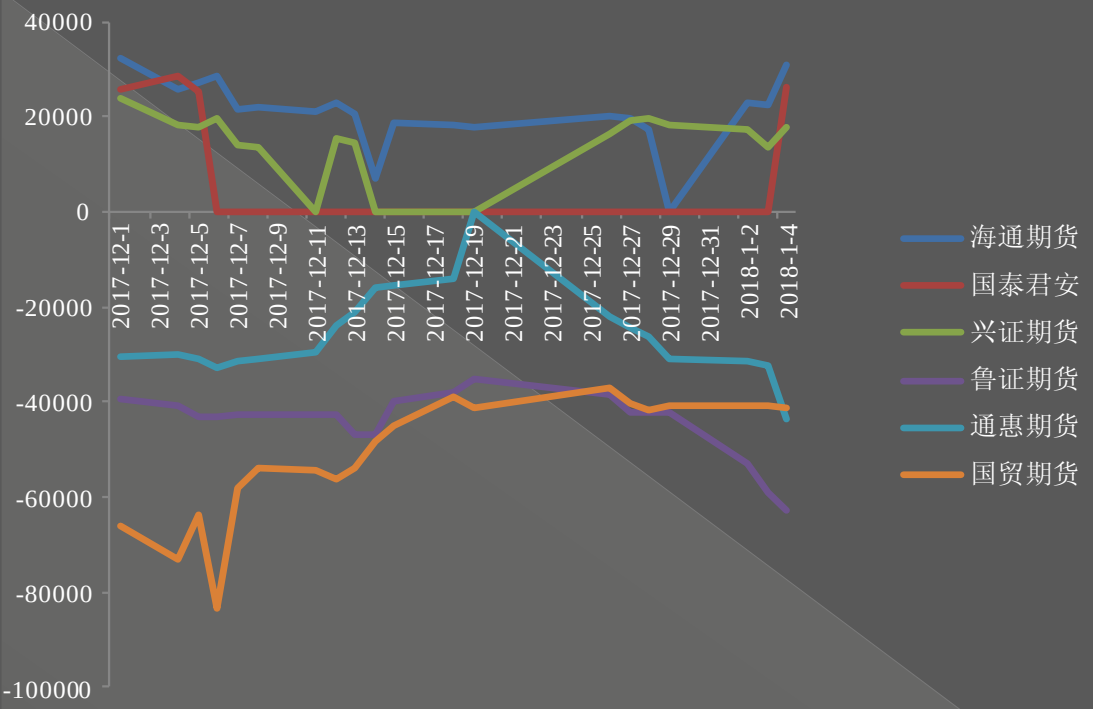
化工：甲醇

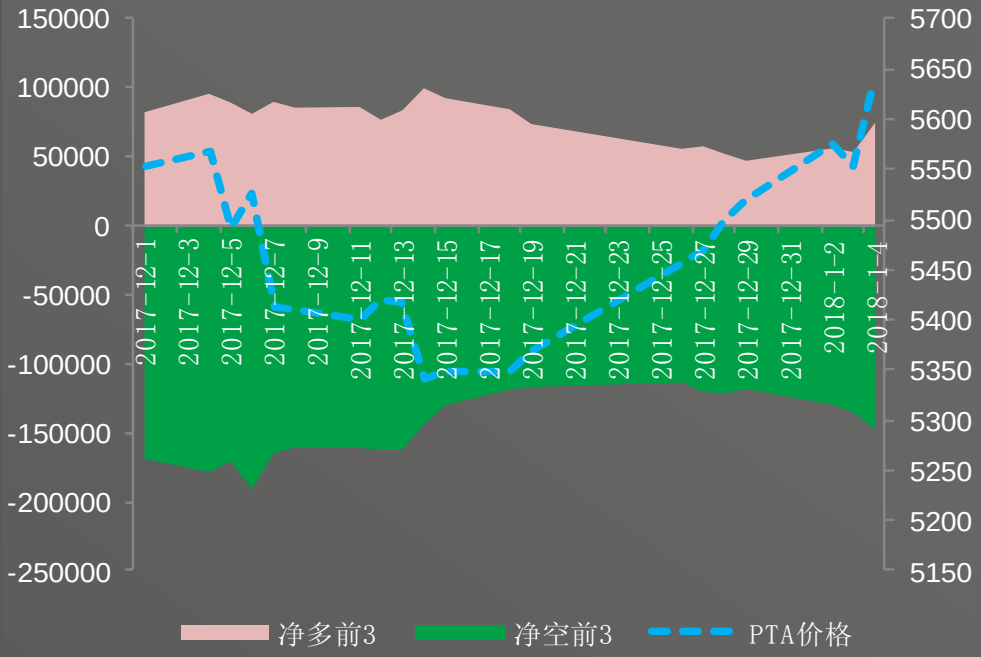


变动幅度		当日	最近5日	平均变化	波动率
ma持仓	多头前3	-1.10%	-17.32%	-3.46%	25.95%
	空头前3	-16.35%	-26.84%	-5.37%	
ma涨幅		0.78%	2.06%	0.41%	
震荡幅度	1.75%	2.67%(月均值)	投机度	1.39	1.74(月均值)

大陆期货

化工：PTA

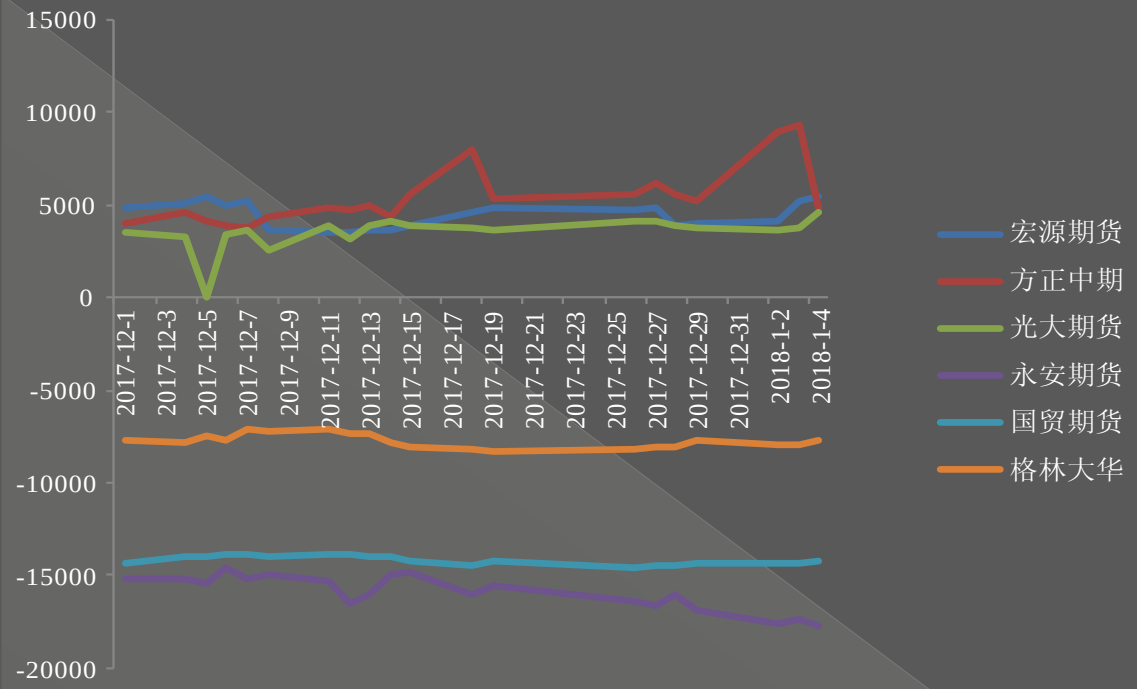


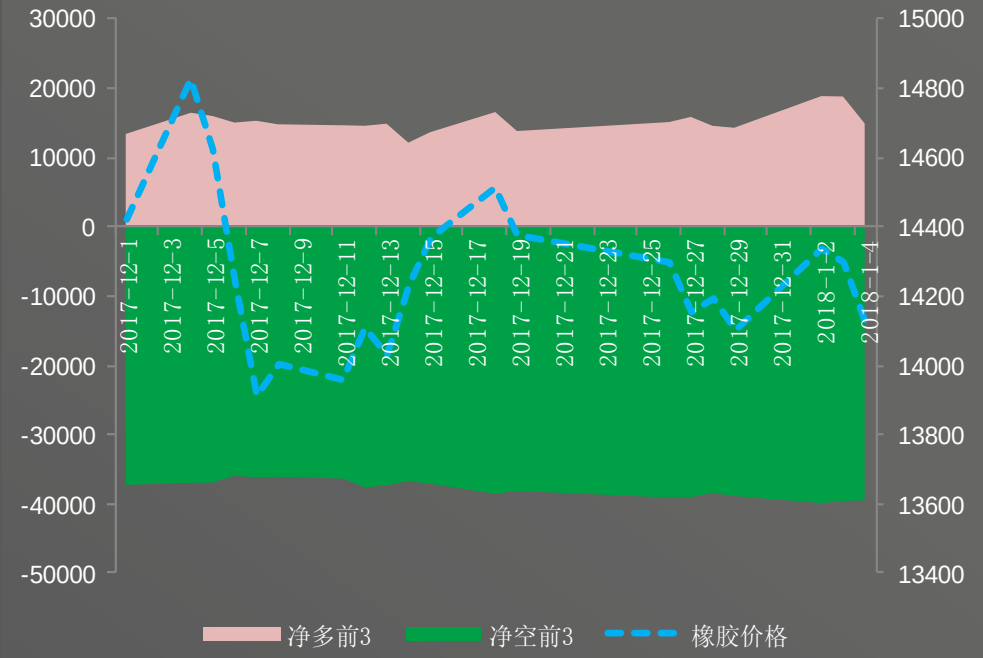


变动幅度		当日	最近5日	平均变化	波动率
pta持仓	多头前3	39.28%	29.44%	5.89%	17.72%
	空头前3	8.68%	22.40%	4.48%	
pta涨幅		1.48%	3.04%	0.61%	
震荡幅度	0.72%	1.41%(月均值)	投机度	0.43	0.58(月均值)

大陆期货

化工：橡胶

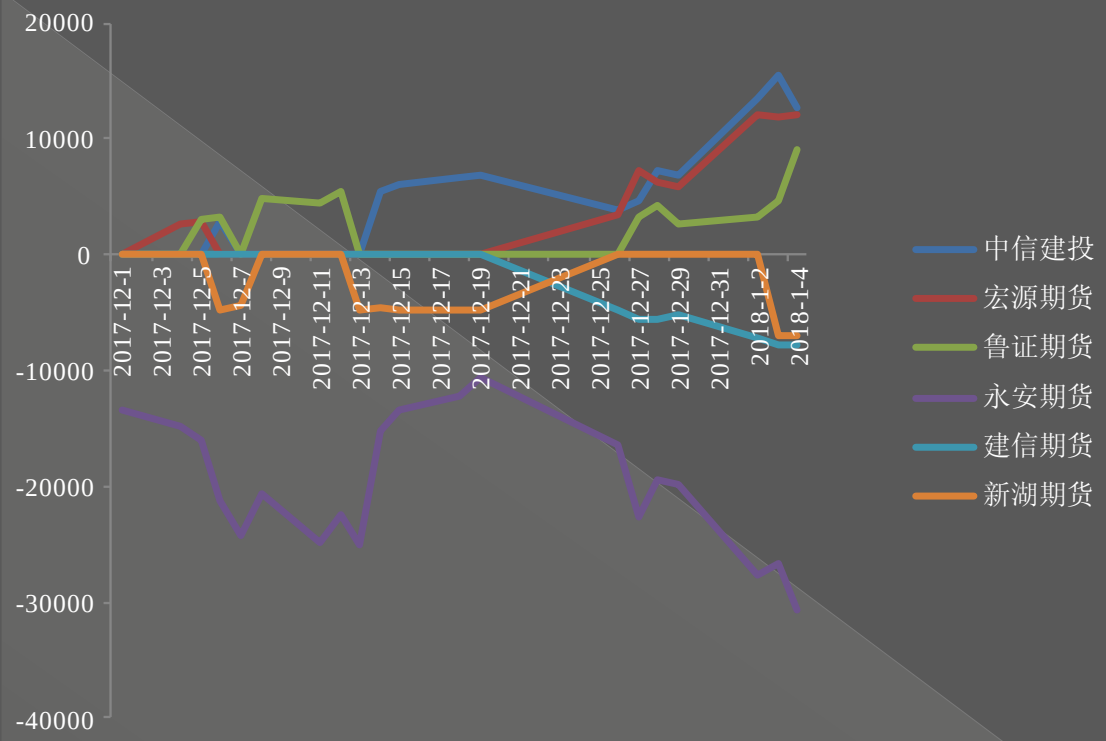


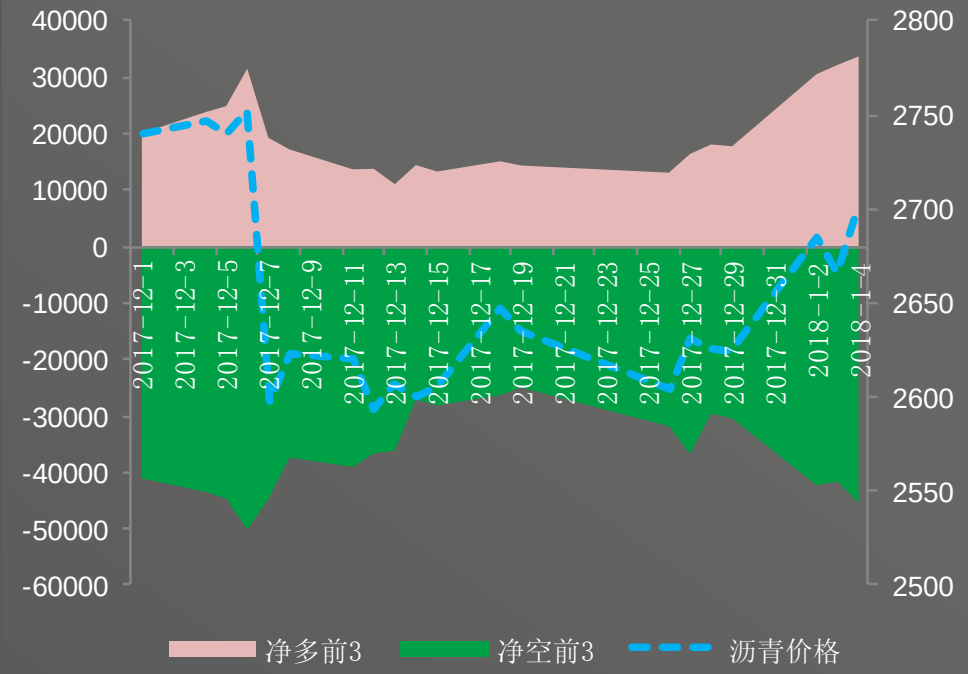


变动幅度		当日	最近5日	平均变化	波动率
ru持仓	多头前3	-20.66%	-5.97%	-1.19%	26.11%
	空头前3	-0.26%	1.14%	0.23%	
ru涨幅		-1.22%	-0.25%	-0.05%	
震荡幅度	1.67%	2.72%(月均值)	投机度	1.02	1.40(月均值)

大陆期货

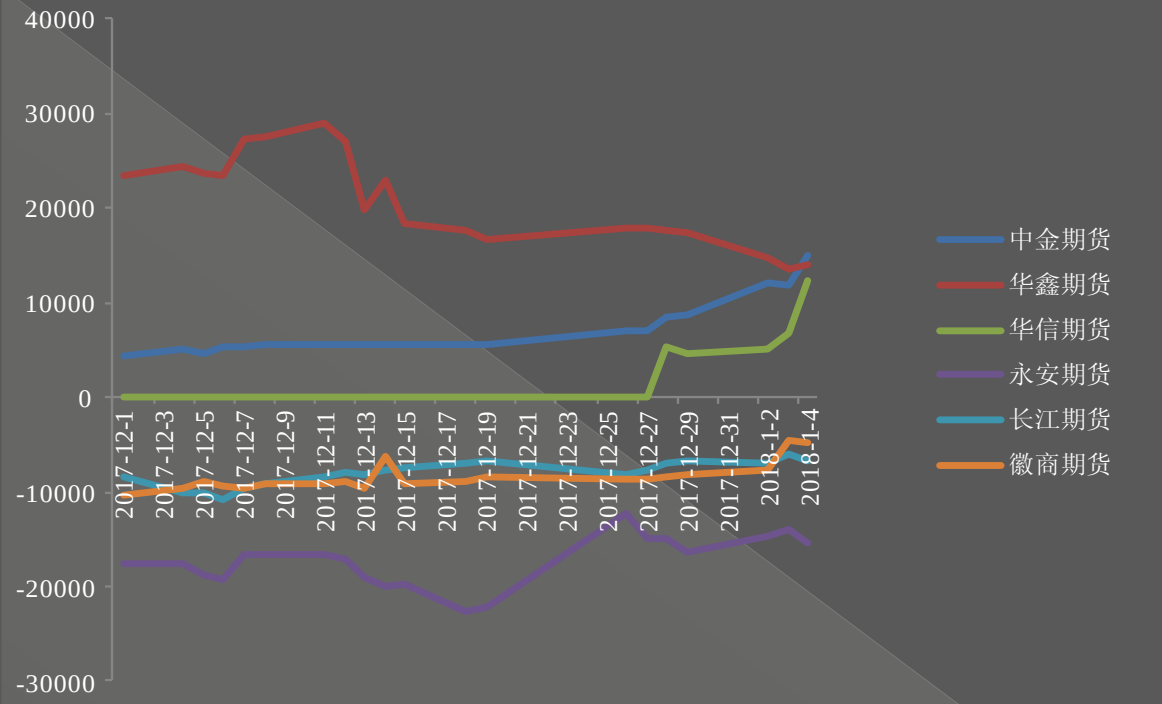
化工：沥青

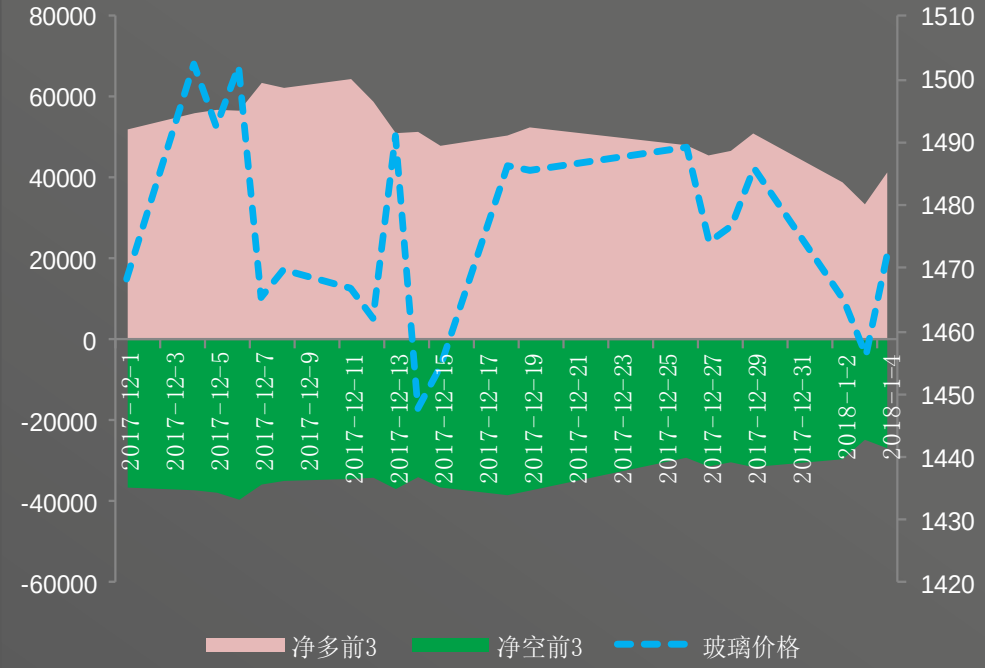




变动幅度		当日	最近5日	平均变化	波动率
bu持仓	多头前3	4.64%	105.69%	21.14%	25.07%
	空头前3	9.06%	23.54%	4.71%	
bu涨幅		1.28%	2.63%	0.53%	
震荡幅度	1.91%	2.09%(月均值)	投机度	1.02	1.02(月均值)

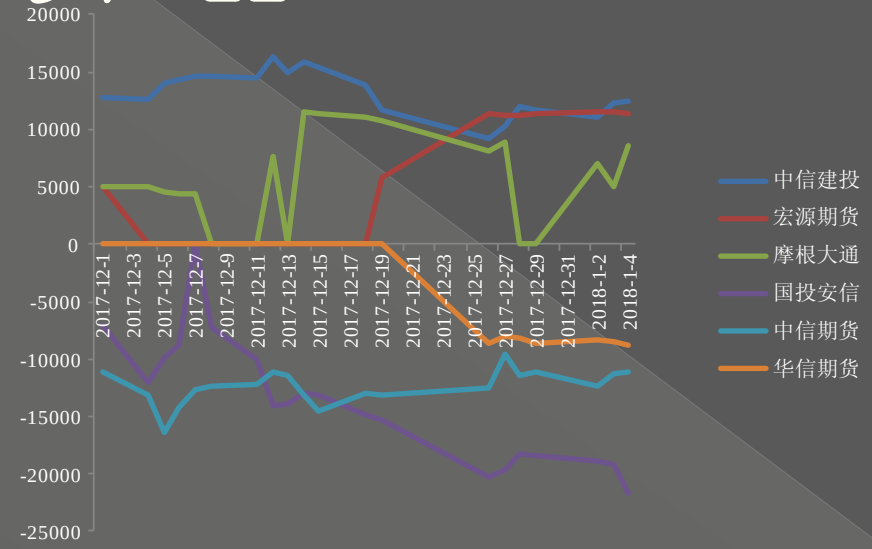
化工：玻璃

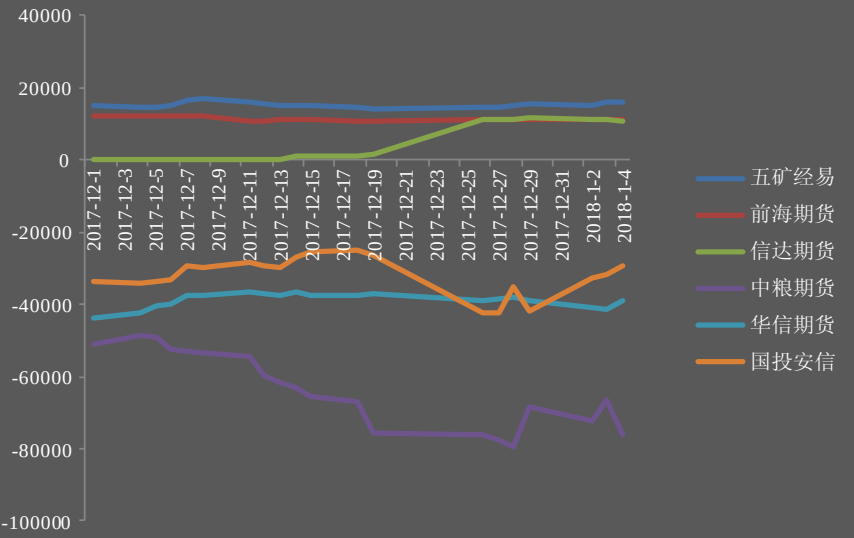




变动幅度		当日	最近5日	平均变化	波动率
fg持仓	多头前3	23.47%	-9.18%	-1.84%	21.10%
	空头前3	8.51%	-14.40%	-2.88%	
fg涨幅		1.16%	-0.07%	-0.01%	
震荡幅度	1.33%	2.07%(月均值)	投机度	0.44	0.63(月均值)

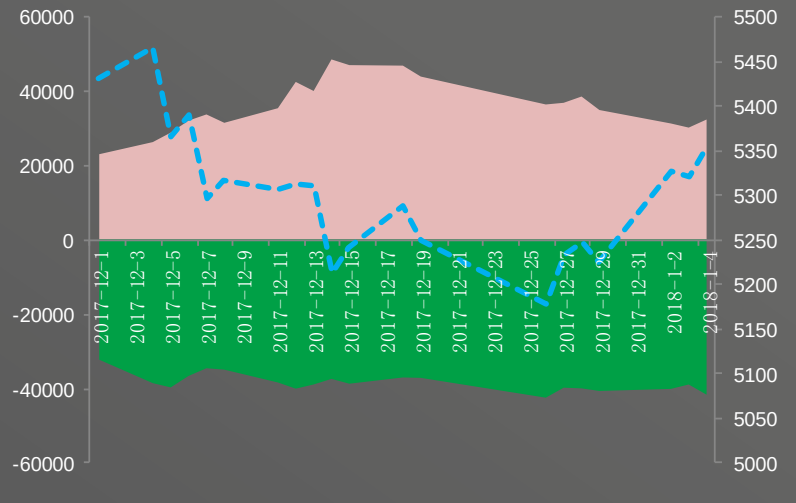
农产品：P & Y

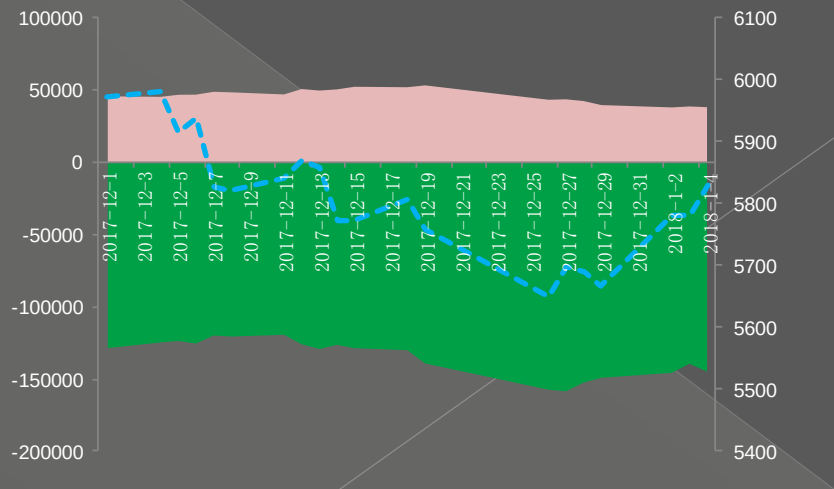




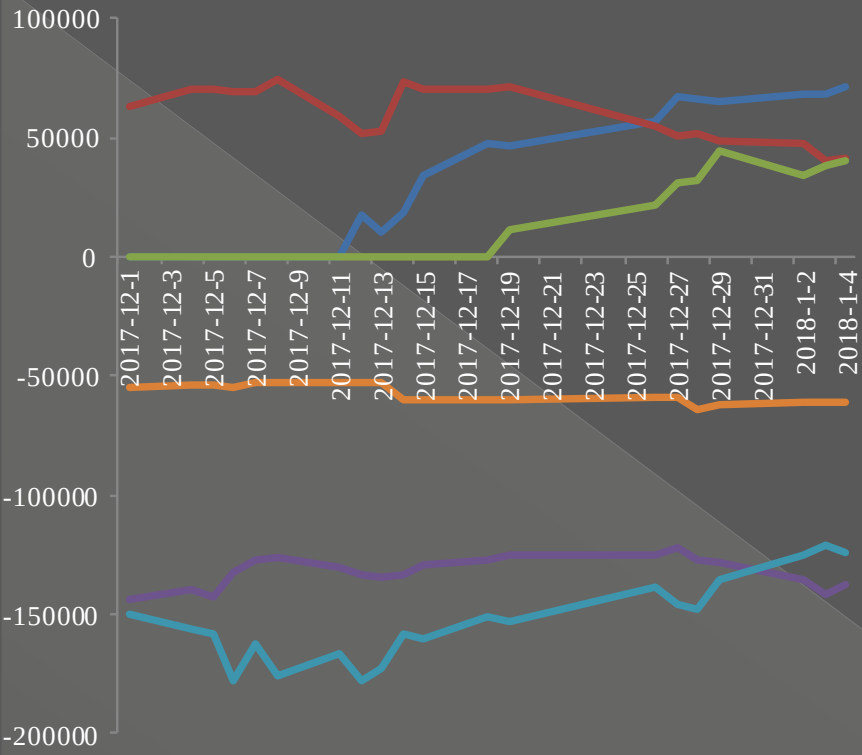
变动幅度		当日	最近5日	平均变化	波动率
p持仓	多头前3	7.24%	-12.22%	-2.44%	15.60%
	空头前3	7.04%	4.74%	0.95%	
p涨幅		0.65%	2.37%	0.47%	
震荡幅度	1.03%	1.15%(月均值)	投机度	0.46	0.54(月均值)

变动幅度		当日	最近5日	平均变化	波动率
y持仓	多头前3	-1.35%	-12.35%	-2.47%	14.58%
	空头前3	3.89%	-8.62%	-1.72%	
y涨幅		0.82%	2.29%	0.46%	
震荡幅度	1.06%	1.13%(月均值)	投机度	0.33	0.34(月均值)



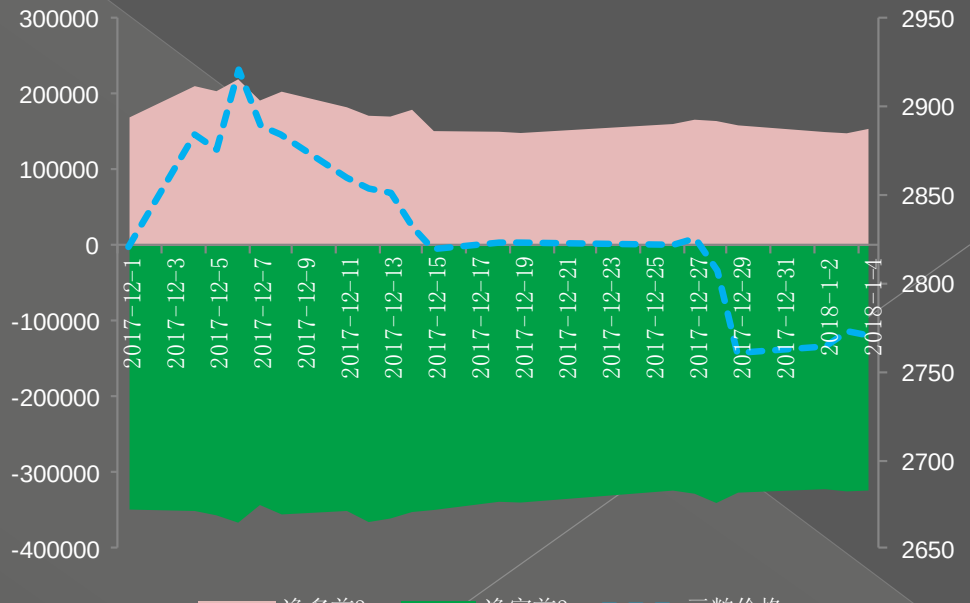


大陆期货

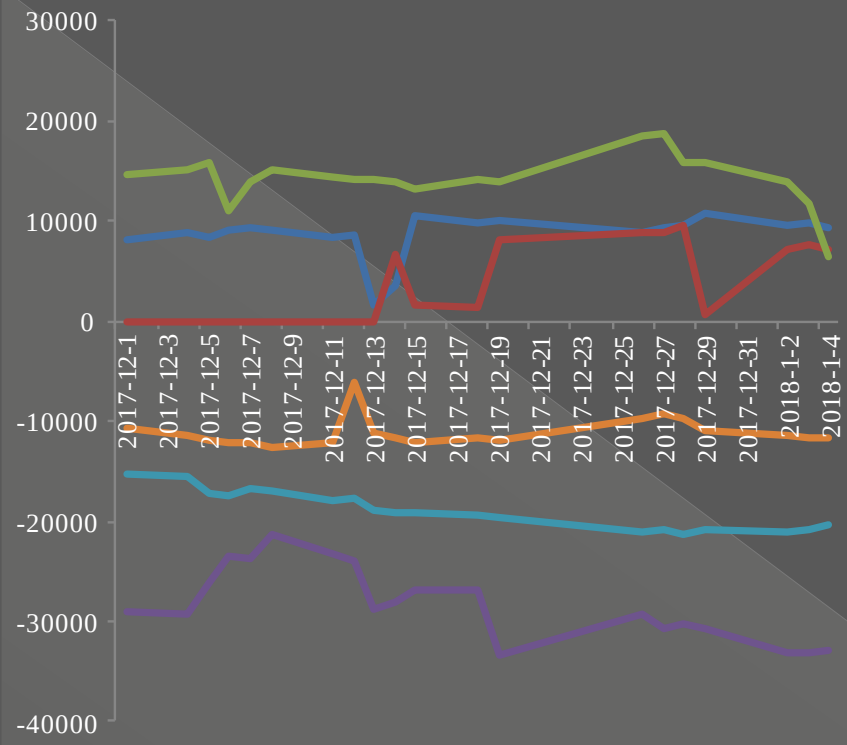


农产品：豆粕

变动幅度		当日	最近5日	平均变化	波动率
m持仓	多头前3	3.90%	-7.29%	-1.46%	12.71%
	空头前3	-0.36%	-1.30%	-0.26%	
m涨幅		-0.09%	-1.98%	-0.40%	
震荡幅度	1.04%	1.00%(月均值)	投机度	0.38	0.38(月均值)

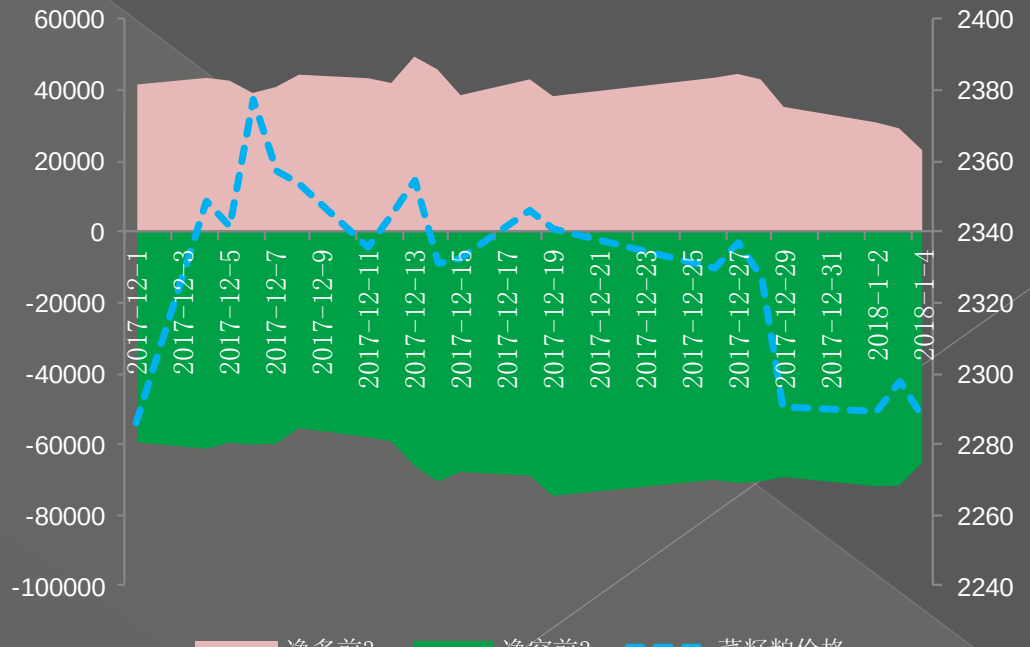


大陆期货



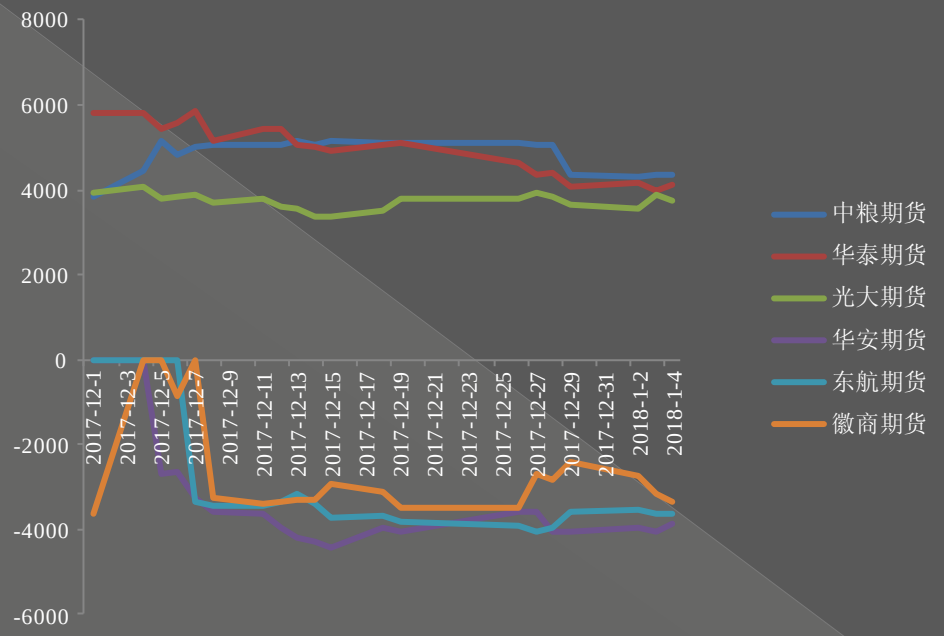
农产品：菜粕

变动幅度		当日	最近5日	平均变化	波动率
rm持仓	多头前3	-20.97%	-48.14%	-9.63%	14.32%
	空头前3	-9.18%	-8.16%	-1.63%	
rm涨幅		-0.46%	-2.13%	-0.43%	
震荡幅度	1.29%	1.28%(月均值)	投机度	0.59	0.56(月均值)

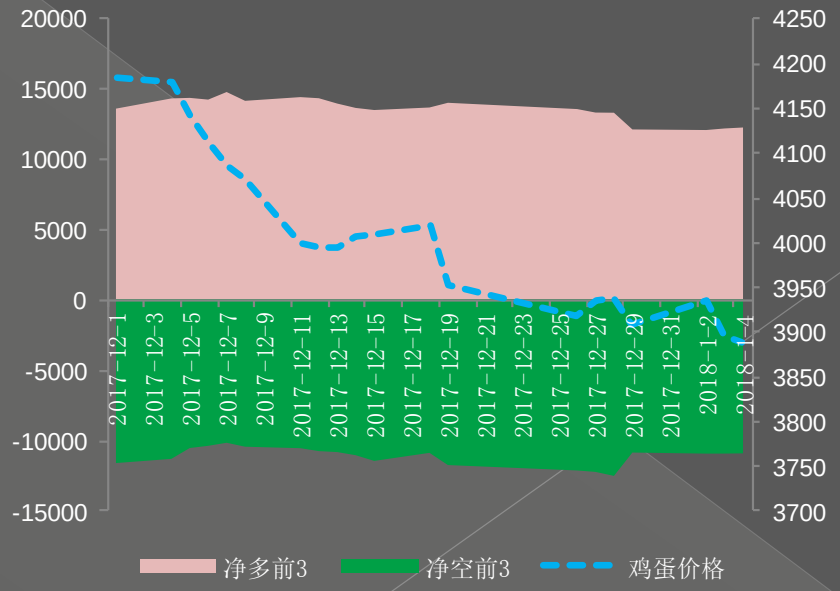


大陆期货

农产品：鸡蛋

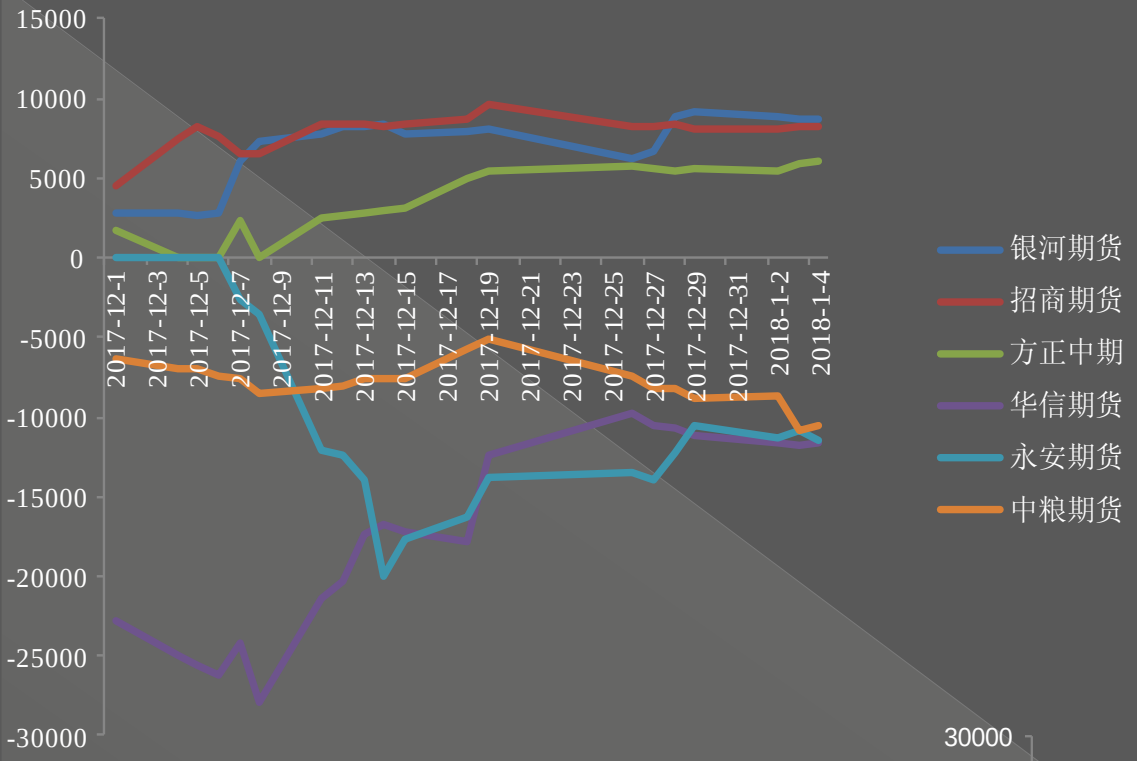


变动幅度		当日	最近5日	平均变化	波动率
jd持仓	多头前3	0.56%	-8.01%	-1.60%	11.12%
	空头前3	-0.14%	-10.74%	-2.15%	
jd涨幅		-0.18%	-1.23%	-0.25%	
震荡幅度	0.69%	1.41%(月均值)	投机度	0.27	0.47(月均值)

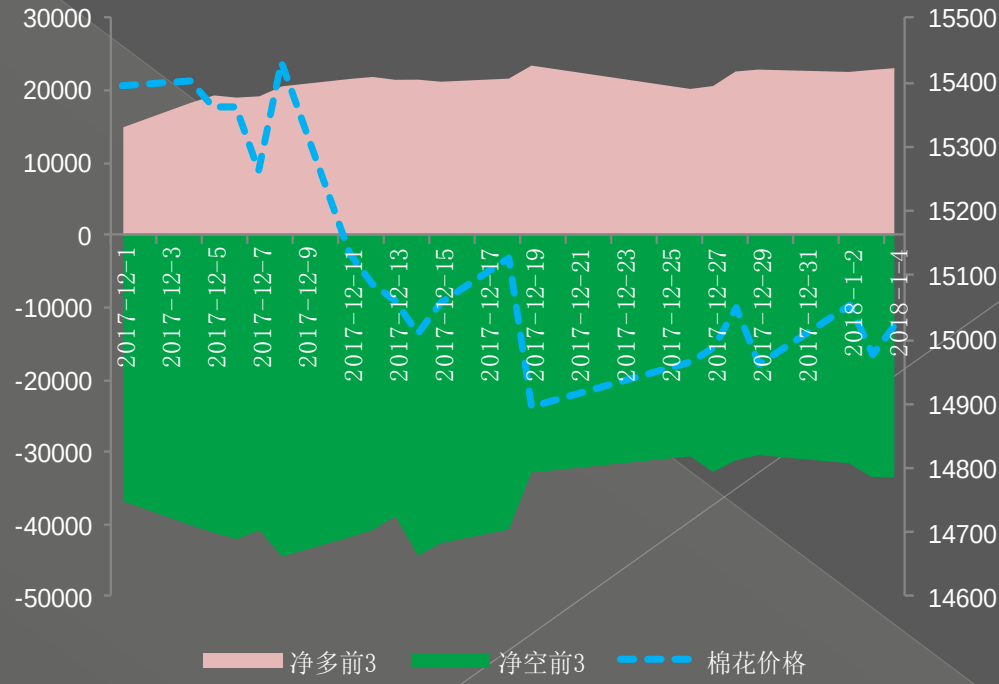


大陆期货

农产品：棉花

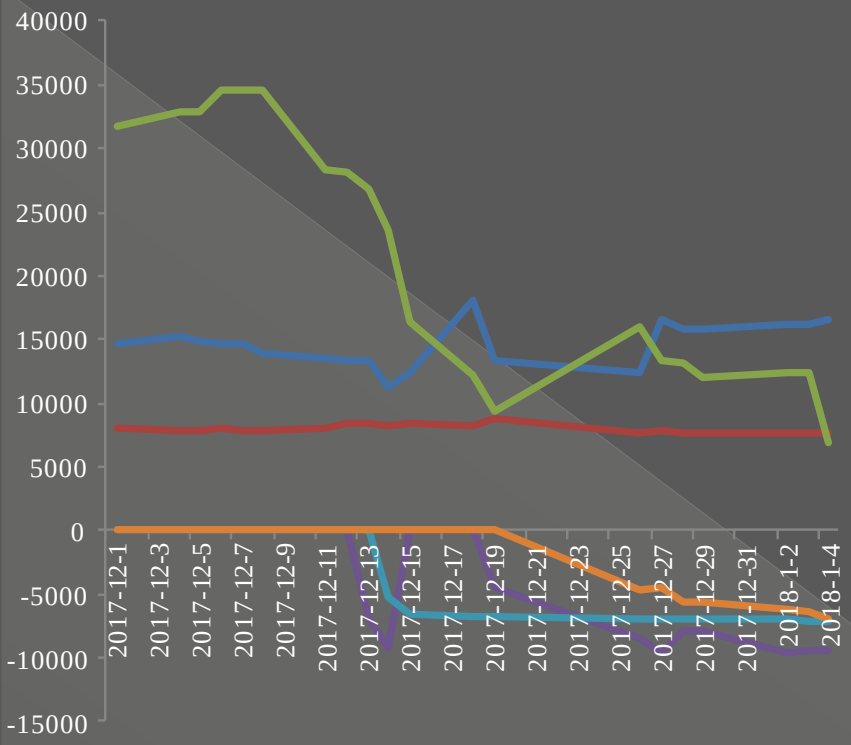


变动幅度		当日	最近5日	平均变化	波动率
cf持仓	多头前3	1.09%	11.96%	2.39%	12.37%
	空头前3	0.26%	2.37%	0.47%	
cf涨幅		0.32%	0.24%	0.05%	
震荡幅度	1.10%	1.03%(月均值)	投机度	0.54	0.53(月均值)

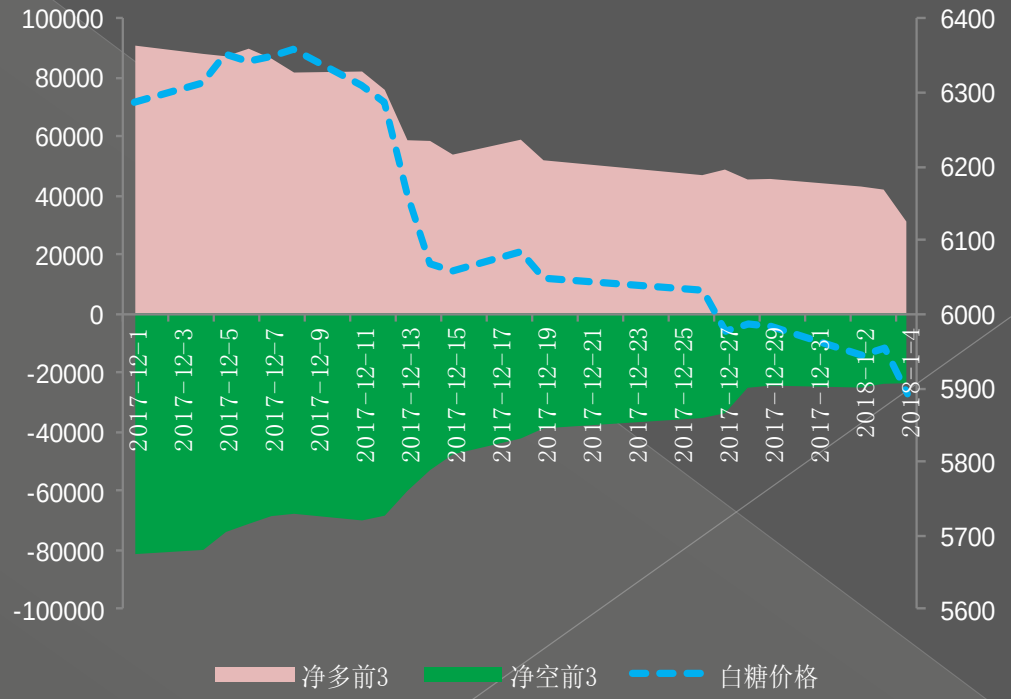


大陆期货

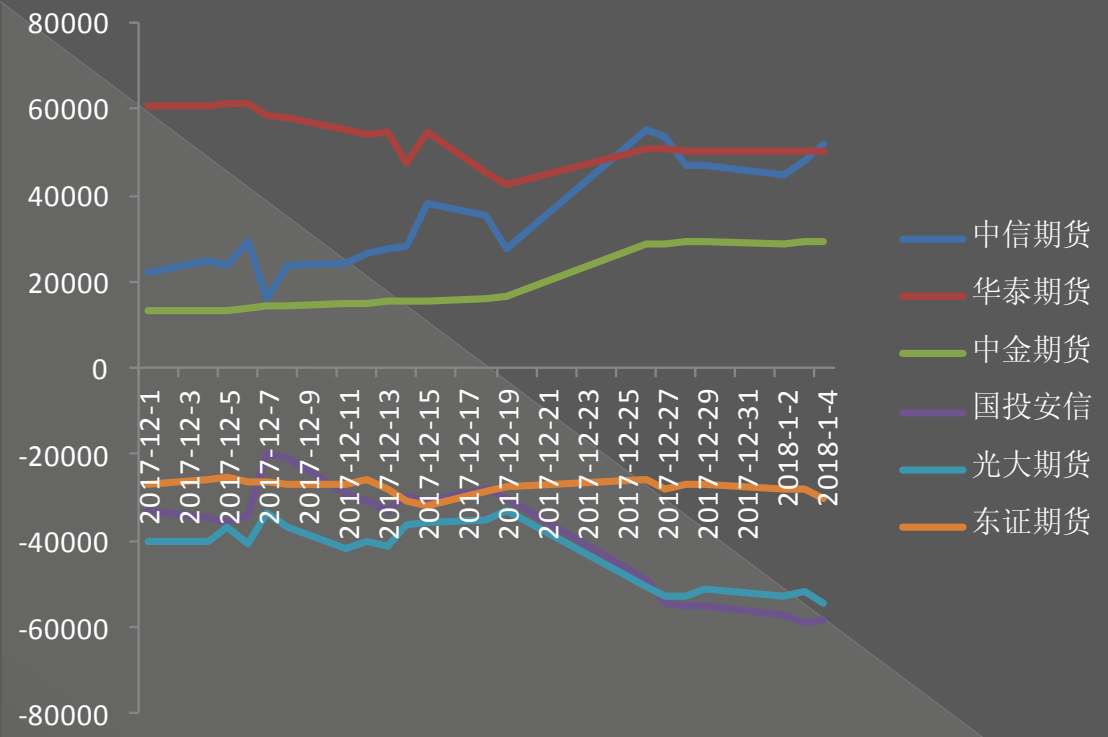
农产品：白糖



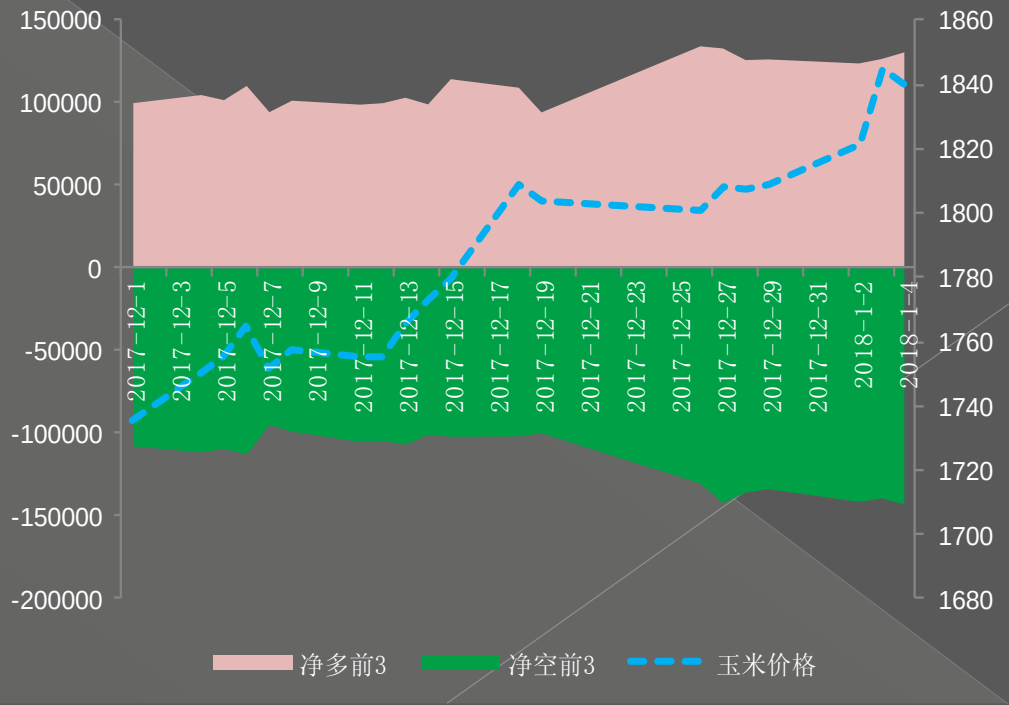
变动幅度		当日	最近5日	平均变化	波动率
sr持仓	多头前3	-25.85%	-36.21%	-7.24%	10.59%
	空头前3	-0.87%	-30.02%	-6.00%	
sr涨幅		-1.02%	-1.40%	-0.28%	
震荡幅度	0.81%	1.09%(月均值)	投机度	0.53	0.48(月均值)



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	3.19%	-1.78%	-0.36%	8.54%
	空头前3	2.59%	0.52%	0.10%	
c涨幅		-0.24%	1.77%	0.35%	
震荡幅度	0.67%	0.79%(月均值)	投机度	0.30	0.40(月均值)



部分机构资金变动表

制表日期：2018年1月5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	0.00	0.00%	68666.68	30.38%
南华期货	0.00	0.00%	-16804.77	-34.69%
混沌天成	0.00	0.00%	1433.31	5.73%
海通期货	0.00	0.00%	9445.18	7.94%
上海大陆	0.00	0.00%	9603.71	--
中信期货	0.00	0.00%	-6244.44	-4.12%
新湖期货	0.00	0.00%	7951.89	18.36%

大陆期货

中粮期货	0.00	0.00%	-10213.50	-5.81%
中信建投	0.00	0.00%	-416.10	-0.84%
申银万国	0.00	0.00%	14026.42	48.18%
华泰期货	0.00	0.00%	5226.81	5.31%
光大期货	0.00	0.00%	-7849.88	-15.84%
一德期货	0.00	0.00%	2418.54	2.32%
国投期货	0.00	0.00%	15889.76	28.58%
金瑞期货	0.00	0.00%	1146.85	1.93%
鲁证期货	0.00	0.00%	12413.74	19.09%
中国国际	0.00	0.00%	-1338.18	-2.64%

部分机构持仓一览

机构	永安期货					
日期	2017-12-28	2017-12-29	2018-1-2	2018-1-3	2018-1-4	
黄金	3823	3480	3504	3565	3745	
白银						
沪铜	14111	16249	17679	17852	17935	
沪铝		6905	6827	7130	7525	
沪镍	8276	6988	11029	8920	10839	
沪锌	-9270	-12202	-15711	-16618	-17368	
沪铅						
螺纹钢	-86974	-61453	-69645	-57286	-72357	
铁矿石	-4034	16990	35890	45640	15333	
焦煤	7060	7693	6745	6231		
焦炭	5814	4530	2852	5443	13806	
豆油			-6990	-7559		
棕榈油	-10420	-11170	-6742		-6435	
菜籽油	21065	21226	22912	22226	21741	
豆粕	66140	65240	68116	68548	71776	
菜籽粕	-2430	-81	-139	-1559		
棉花	-12292	-10537	-11358	-10819	-11484	
白糖				-4100		
玉米	-23892	-18430	-15057	-28519	-21087	
鸡蛋				-1265		
PTA			-6863	-7738		
聚乙烯			-14470	-15506	-24708	
聚丙烯	10886	12643	9621	8747	8756	
甲醇	-20305	-21728	-23403	-23538	-18117	
玻璃	-14878	-16354	-14780	-14067	-15295	
橡胶	-15998	-16844	-17581	-17364	-17705	
沥青	-19508	-19754	-27602	-26751	-30724	
动力煤	-8610	-4985				

部分机构持仓一览

机构	南华期货					
日期	2017-12-28	2017-12-29	2018-1-2	2018-1-3	2018-1-4	
黄金						
白银	6851	6378	6173	6513	6592	
沪铜						
沪铝						
沪镍				-5235	-5840	
沪锌	-2121					
沪铅			-579			
螺纹钢						
铁矿石						
焦煤		-1786				
焦炭	2362		1961			
豆油						
棕榈油						
菜籽油						
豆粕						
菜籽粕	-9629	-10828	-11446	-11719	-11756	
棉花						
白糖	6474	4198	4862	5065	1886	
玉米						
鸡蛋	3269	2716	2660	2853	2820	
PTA	11079	11568				
聚乙烯	11267	10059	9294	8681	8674	
聚丙烯	-13693	-13474	-14817	-15336	-14872	
甲醇	-4668	-4480		-4054	-4733	
玻璃						
橡胶	4877	5175	5254	1635		
沥青	-3738	-3440	-3143	-3133		
动力煤		-3145	-2832	-2881		

部分机构持仓一览

机构	国泰君安					
日期	2017-12-28	2017-12-29	2018-1-2	2018-1-3	2018-1-4	
黄金	-1214	-1119	-1135			
白银	-14559	-15143	-15683	-15528	-15088	
沪铜		-4616	-5971	-5665	-5967	
沪铝	-823	-4538	-4089			
沪镍	-13628	-12995	-12682	-12986	-10848	
沪锌	2992					
沪铅	660	676	687	1102	956	
螺纹钢					25692	
铁矿石	3073				5183	
焦煤						
焦炭	-849	-755	-386	-359	-3017	
豆油			4027	4409	3725	
棕榈油	-9029	-8703	-8355	-7845	-7436	
菜籽油	22632	23115	23423	23519	23380	
豆粕						
菜籽粕	9504	10923	9632	9803	9462	
棉花						
白糖				-4144	-4157	
玉米	16452	16396	15322	15721	17604	
鸡蛋						
PTA					25974	
聚乙烯					5111	
聚丙烯	10100	10409	12107	11123	11968	
甲醇	-4671	-4348	13299	4181	2753	
玻璃	7930	6907	7780	8123	7491	
橡胶	-4098			-4353	-4707	
沥青	-4538	-4229	-7546	-7212	-6582	
动力煤	-2191					

部分机构持仓一览

机构	混沌天成					
日期	2017-12-28	2017-12-29	2018-1-2	2018-1-3	2018-1-4	
黄金						
白银						
沪铜	-8924	-9767	-9371	-9410	-9535	
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	2017-12-28	2017-12-29	2018-1-2	2018-1-3	2018-1-4	
黄金	4693	4454	5211	5375	4503	
白银						
沪铜	-4672	-4975	-5067	-6320	-6054	
沪铝	4344	4343	4513	5290	11161	
沪镍	3822			4621	5820	
沪锌	-71	-589	-662	-3135	441	
沪铅	2614	2258	2523	2551	2551	
螺纹钢	-44797	-32558	-16921	-30340	-22635	
铁矿石	16098	22021	15679	18067	14457	
焦煤	1468	596	2272	1984	1471	
焦炭		-2158	773	1193	2778	
豆油	-8475	-8727	-7804	-8368		
棕榈油						
菜籽油	-10027	-9418	-8837	-8802	-8785	
豆粕	21232	12234	24399	23964	24050	
菜籽粕						
棉花		-3513				
白糖	-4887	-5452	-7445	-7112	-6586	
玉米	22846	22655	23039	24995	24480	
鸡蛋		779	1300	1050	1252	
PTA	17181		22910	22673	30662	
聚乙烯	8057	6945	20840	16352	22605	
聚丙烯	-21551	-24700	-6126	-6475	-7487	
甲醇	-15402	-11996	-9244	-8321	-629	
玻璃	15390	21755	12144		6762	
橡胶						
沥青	-4209	-4324		-3153		
动力煤						

部分机构持仓一览

机构	上海大陆					
日期	2017-12-28	2017-12-29	2018-1-2	2018-1-3	2018-1-4	
黄金						
白银						
沪铜			2846	3456	3463	
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	中粮期货					
日期	2017-12-28	2017-12-29	2018-1-2	2018-1-3	2018-1-4	
黄金						
白银	5183	5256	5298	5305	5135	
沪铜			-5389	-5264	-5375	
沪铝	3874					
沪镍	11565	11588	11060	10481	10199	
沪锌		-1406		2592	2554	
沪铅				-628	-946	
螺纹钢						
铁矿石						
焦煤	2065	5908	6208	6174		
焦炭	-4065	-4532	-3584		2724	
豆油	-79426	-68168	-72463	-66325	-76309	
棕榈油	-7412	-7459	-7716	-7068		
菜籽油	-12335	-12380	-12302	-12640	-12502	
豆粕	-148102	-135681	-124969	-121103	-124358	
菜籽粕	-30190	-30748	-33224	-33052	-32821	
棉花	-8259	-8751	-8629	-10850	-10475	
白糖	-4211	-5370	-4894	-5725		
玉米	-16980	-19356	-22704	-16512	-18072	
鸡蛋	5084	4370	4310	4352	4369	
PTA		8944				
聚乙烯	-12892	-12696	3317			
聚丙烯			5601	5622	5482	
甲醇	-4599	-4145				
玻璃						
橡胶	-6513	-6274	-6334	-6366	-6676	
沥青						
动力煤				3279	3938	

部分机构持仓一览

机构	中信期货					
日期	2017-12-28	2017-12-29	2018-1-2	2018-1-3	2018-1-4	
黄金	6787	7723	7683	8060	4202	
白银	-24501	-18354	-18278	-17962	-15883	
沪铜						
沪铝	-42825	-40984	-41436	-41607	-41694	
沪镍	-4700	-5976	-5195	-6495	-6038	
沪锌				-640	-3229	
沪铅	-1566	-1431	-2290	-1458	-1356	
螺纹钢	37540	40421	50152	41524	41141	
铁矿石	-4276	-6735	-5903	-11500	-5462	
焦煤	671	1014	1061	723	1249	
焦炭	-2381	-1152	-1527	-2312	-3297	
豆油						
棕榈油	-11347	-11103	-12402	-11302	-11130	
菜籽油	-12335	-11434	-11167	-11087	-11166	
豆粕	52221	49205	47429	40912	41343	
菜籽粕	8904	8464	6696	6248	6098	
棉花	3239	4849	4283	4070	3966	
白糖						
玉米	46929	47234	44935	47866	51744	
鸡蛋		-2177	-1899	-1870	-1820	
PTA			9170	9139	17018	
聚乙烯	-5380	-6933				
聚丙烯	5493	5158	5649	5890	4959	
甲醇	5654	5434	7402	4319	4713	
玻璃	11999	11647	11523	7566	7438	
橡胶						
沥青	4698	5042	5163	4896	5942	
动力煤						

部分机构持仓一览

机构	中信建投					
日期	2017-12-28	2017-12-29	2018-1-2	2018-1-3	2018-1-4	
黄金	2323	2388				
白银						
沪铜	2756	2832	2795	2725	2395	
沪铝						
沪镍	-5473	-5020	-5357			
沪锌						
沪铅						
螺纹钢				18524		
铁矿石	4172	2607	4458	6201	5144	
焦煤			1330		-2464	
焦炭		2225	1933			
豆油						
棕榈油	11955	11695	11068	12382	12468	
菜籽油						
豆粕	45964					
菜籽粕	17752	8142				
棉花						
白糖						
玉米						
鸡蛋	-3635	-3153	-3376			
PTA						
聚乙烯			13153	12633	16750	
聚丙烯			8676	11368	11320	
甲醇						
玻璃	-4098	-3993	-3844	-3702		
橡胶				3428	3828	
沥青	7220	6851	13450	15537	12734	
动力煤						

部分机构持仓一览

机构	新湖期货					
日期	2017-12-28	2017-12-29	2018-1-2	2018-1-3	2018-1-4	
黄金						
白银						
沪铜						
沪铝						
沪镍					-5811	
沪锌						
沪铅			402	329	360	
螺纹钢						
铁矿石						
焦煤						
焦炭						
豆油						
棕榈油	6407	6347	6402	6365	6184	
菜籽油	-4279					
豆粕	-64014	-61543	-60464	-60999	-60637	
菜籽粕						
棉花	2742	2555	2410	2464	2735	
白糖						
玉米						
鸡蛋	-2837	-2796	-2733	-2874	-2881	
PTA					-12904	
聚乙烯	-5253	-5357	-5340	-5371	-5158	
聚丙烯	-3447	-3428	-3964	-3852	-3717	
甲醇						
玻璃		3605				
橡胶	-5117	-4977	-5045	-4992	-5218	
沥青				-7026	-7021	
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