大陆期货

市场持仓分析

2018/3/13

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
焦煤	3.14%	4.24%	1.91%	-4.78%	-7.91%	-4.45%	7.93%	☆☆
PTA	1.16%	2.44%	1.24%	-4.63%	-3.94%	-1.77%	5.79%	☆☆
动力煤	4.43%	2.49%	0.82%	-1.29%	-1.19%	-1.09%	5.72%	☆☆
棕榈油	5.34%	5.04%	5.56%	0.38%	-0.34%	0.93%	4.96%	☆
沪铝	5.70%	4.55%	4.85%	1.84%	3.16%	-0.34%	3.85%	☆
鸡蛋	2.16%	1.96%	-0.65%	-1.45%	0.18%	0.51%	3.61%	☆
菜籽粕	1.17%	-1.43%	-0.76%	-2.22%	-0.45%	1.07%	3.39%	☆
豆油	-0.83%	0.33%	3.35%	-3.54%	-1.91%	-1.73%	2.71%	☆
螺纹钢	0.28%	0.86%	3.17%	-2.23%	-2.06%	0.86%	2.52%	☆
橡胶	-0.79%	-0.17%	-0.12%	-0.99%	-0.94%	0.90%	0.21%	☆
沪金	-1.97%	-2.69%	2.14%	-2.12%	-3.61%	-2.38%	0.15%	☆
玻璃	2.29%	-1.26%	-3.47%	2.22%	0.29%	1.51%	0.07%	☆
豆粕	-1.64%	-2.79%	-1.32%	-1.48%	-0.73%	0.79%	-0.16%	☆
沪锌	3.73%	1.55%	-1.78%	4.24%	2.37%	1.97%	-0.51%	☆
沥青	7.20%	3.69%	8.15%	7.83%	1.95%	-5.78%	-0.63%	☆
沪银	-1.90%	-1.64%	-0.16%	-0.35%	-1.25%	0.24%	-1.55%	☆
沪铜	-0.22%	-0.32%	0.23%	1.52%	4.18%	0.47%	-1.74%	☆
白糖	0.25%	0.62%	-0.67%	2.20%	1.84%	1.38%	-1.95%	☆
玉米	-0.73%	-1.36%	-0.88%	1.35%	1.53%	0.04%	-2.08%	☆
焦炭	-3.18%	-4.89%	-4.54%	-0.29%	3.02%	4.08%	-2.88%	☆
铁矿石	-3.80%	-2.32%	-3.57%	-0.54%	1.11%	1.50%	-3.27%	☆
聚乙烯	-0.43%	-1.97%	-2.92%	3.44%	3.49%	4.17%	-3.88%	☆
沪镍	-4.99%	-0.82%	-2.79%	0.63%	3.40%	6.12%	-5.63%	☆☆
聚丙烯	-6.45%	-5.33%	-5.48%	1.74%	1.06%	6.92%	-8.19%	☆☆
甲醇	-0.28%	-0.35%	-3.67%	8.23%	5.92%	4.26%	-8.50%	☆☆
棉花	-5.89%	-7.12%	-4.15%	6.98%	5.13%	3.47%	-12.87%	☆☆☆

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
PTA	24.36%	20.75%	12.04%	-33.18%	-23.53%	-6.39%	57.54%	☆☆☆☆
棕榈油	40.05%	28.37%	15.45%	8.67%	4.33%	1.43%	31.38%	☆☆☆
沪铝	23.77%	18.92%	12.40%	-6.58%	-5.25%	-6.55%	30.35%	☆☆☆
动力煤	21.00%	16.28%	8.69%	-5.24%	-3.81%	-12.98%	26.23%	☆☆
焦炭	-1.68%	-0.80%	-7.70%	-26.34%	-18.96%	0.72%	24.66%	☆☆
焦煤	0.43%	-1.74%	-1.33%	-21.44%	-22.70%	-13.51%	21.87%	☆☆
菜籽粕	14.30%	1.47%	-2.05%	-3.96%	-3.04%	2.62%	18.26%	☆☆
铁矿石	5.99%	5.16%	12.19%	-9.46%	-12.68%	-12.70%	15.45%	☆☆
沪镍	4.11%	6.51%	2.95%	-5.63%	-0.05%	5.42%	9.73%	☆
鸡蛋	4.31%	2.28%	1.10%	-3.34%	-3.17%	-3.64%	7.65%	☆
橡胶	1.46%	2.26%	6.00%	-3.82%	-3.31%	-3.01%	5.28%	☆
螺纹钢	2.71%	6.78%	12.14%	-2.43%	-7.66%	-13.30%	5.14%	☆
白糖	-2.56%	-2.32%	-0.60%	-5.83%	-4.04%	-1.80%	3.27%	☆
棉花	9.41%	-1.57%	-7.71%	9.59%	8.44%	7.88%	-0.18%	☆
豆粕	-19.59%	-13.73%	-1.84%	-15.15%	-9.75%	-2.86%	-4.45%	☆
豆油	0.16%	-3.63%	-3.04%	5.80%	3.94%	1.15%	-5.64%	☆
玉米	2.23%	-2.04%	-5.12%	8.64%	7.94%	5.33%	-6.41%	☆
沪锌	-2.97%	0.95%	1.30%	7.46%	2.69%	-0.60%	-10.43%	☆☆
沪银	-7.78%	-12.54%	-3.92%	2.98%	3.61%	2.50%	-10.76%	☆☆
沪金	-1.02%	-0.74%	0.94%	15.73%	16.68%	15.18%	-16.75%	☆☆
聚乙烯	-16.82%	-12.08%	-8.60%	4.96%	6.22%	4.21%	-21.78%	☆☆
沪铜	-17.77%	-13.69%	-7.41%	4.35%	6.35%	3.72%	-22.12%	☆☆
玻璃	-2.78%	-6.24%	-2.47%	24.92%	17.61%	5.17%	-27.70%	☆☆
沥青	-14.47%	-11.42%	-2.69%	13.51%	6.23%	-0.66%	-27.98%	☆☆
聚丙烯	-23.15%	-15.65%	-4.45%	8.47%	6.97%	2.32%	-31.63%	☆☆☆
甲醇	-21.05%	-17.16%	-6.83%	13.96%	11.18%	9.02%	-35.01%	☆☆☆

2018年3月13日机构持仓异动表

金属	
国贸期货	沪镍净多单变动幅度为：-4401手
银河期货	沪锌净空单变动幅度为：-5687手

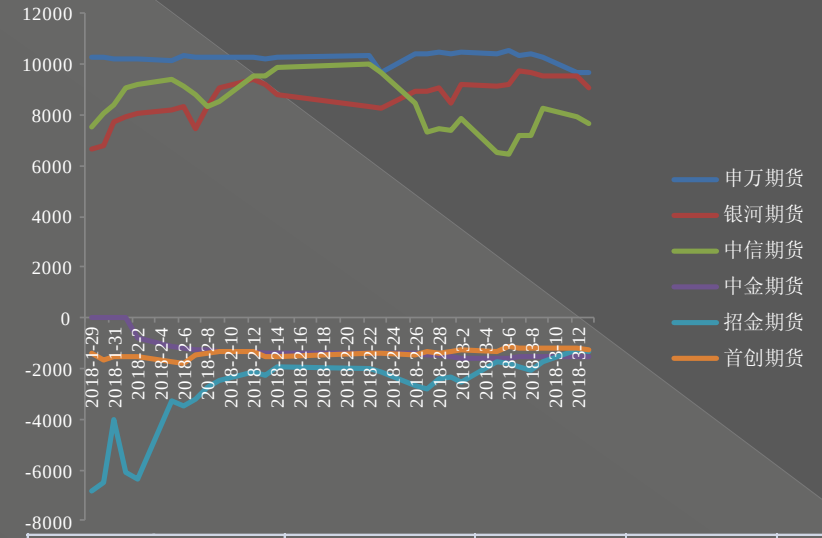
黑色	
国泰君安	铁矿石净多单变动幅度为：15513手
五矿经易	铁矿石净空单变动幅度为：24363手
中辉期货	焦煤净多单变动幅度为：1755手
东航期货	焦煤净空单变动幅度为：2794手
华安期货	焦煤净空单变动幅度为：5111手
兴业期货	焦炭净多单变动幅度为：-1968手
南华期货	焦炭净空单变动幅度为：-2234手
鲁证期货	焦炭净多单变动幅度为：2096手
永安期货	焦炭净空单变动幅度为：2395手
招商期货	焦炭净空单变动幅度为：1565手

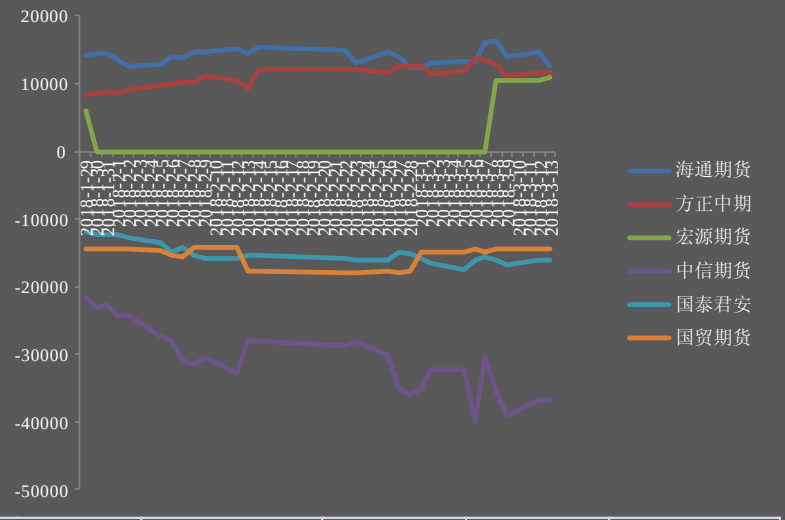
2018年3月13日机构持仓异动表

农产品	
海通期货	棕榈油净多单变动幅度为：-7137手
申银万国	棕榈油净多单变动幅度为：2779手
广发期货	鸡蛋净多单变动幅度为：-2772手

化工	
东证期货	甲醇净多单变动幅度为：-6184手
永安期货	甲醇净多单变动幅度为：3109手
东航期货	甲醇净空单变动幅度为：3793手
鲁证期货	沥青净多单变动幅度为：-8787手
银河期货	沥青净多单变动幅度为：2237手
兴证期货	沥青净空单变动幅度为：8086手
永安期货	沥青净空单变动幅度为：-6016手

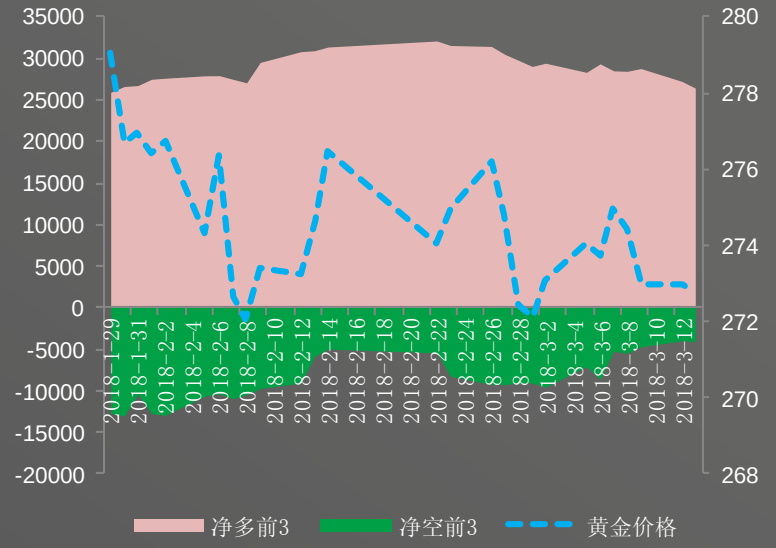
金属板块：AU & AG

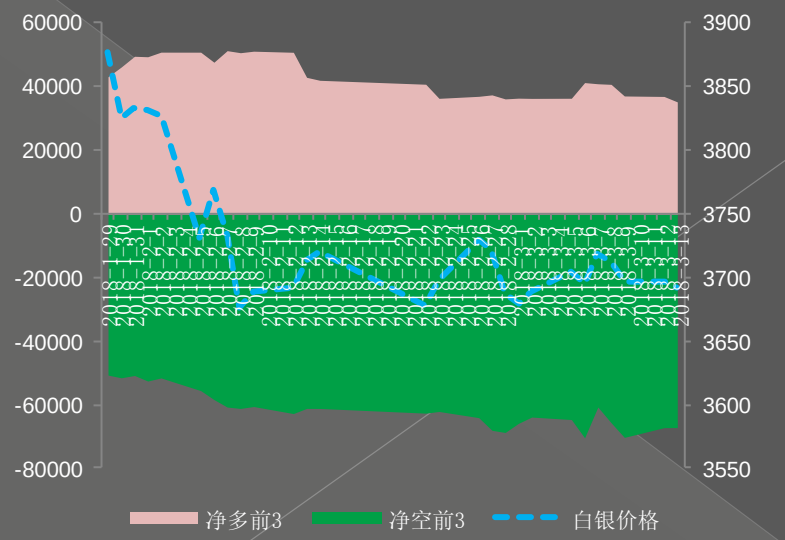




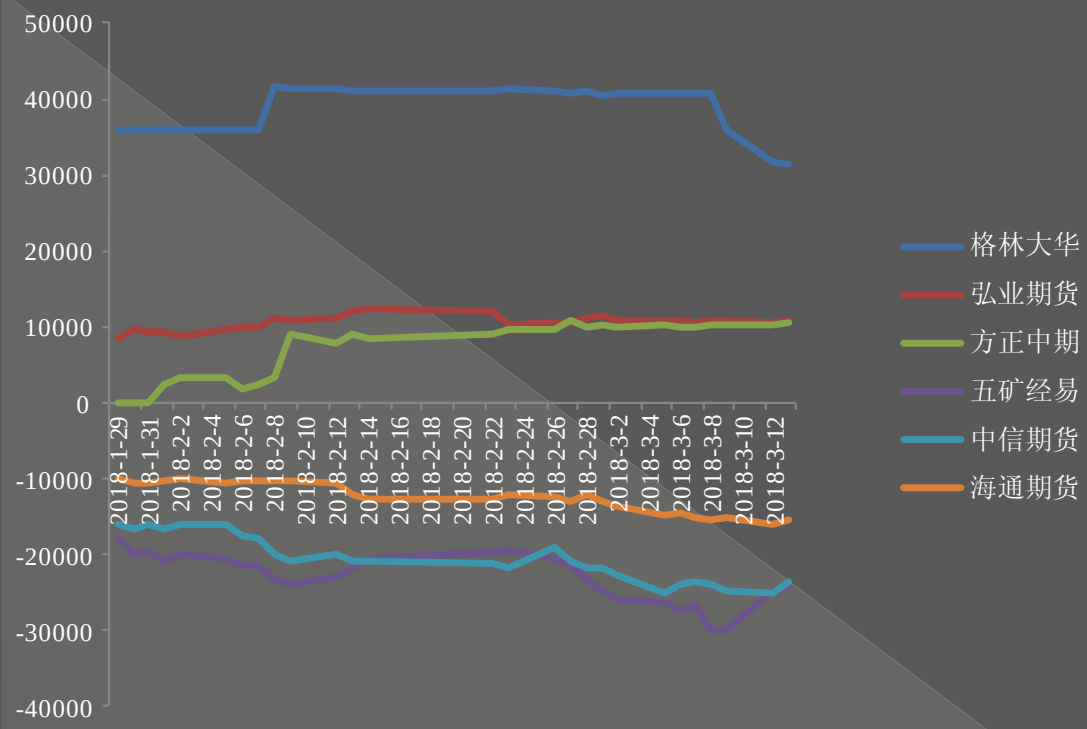
变动幅度		当日	最近5日	平均变化	波动率
au持仓	多头前3	-3.01%	-9.95%	-1.99%	9.07%
	空头前3	2.49%	-52.42%	-10.48%	
au涨幅		-0.08%	-0.35%	-0.07%	
震荡幅度	0.45%	0.70%(月均值)	投机度	0.25	0.38(月均值)

变动幅度		当日	最近5日	平均变化	波动率
ag持仓	多头前3	-4.62%	-14.65%	-2.93%	13.28%
	空头前3	-0.05%	-4.58%	-0.92%	
ag涨幅		-0.15%	-0.11%	-0.02%	
震荡幅度	0.40%	1.07%(月均值)	投机度	0.29	0.50(月均值)

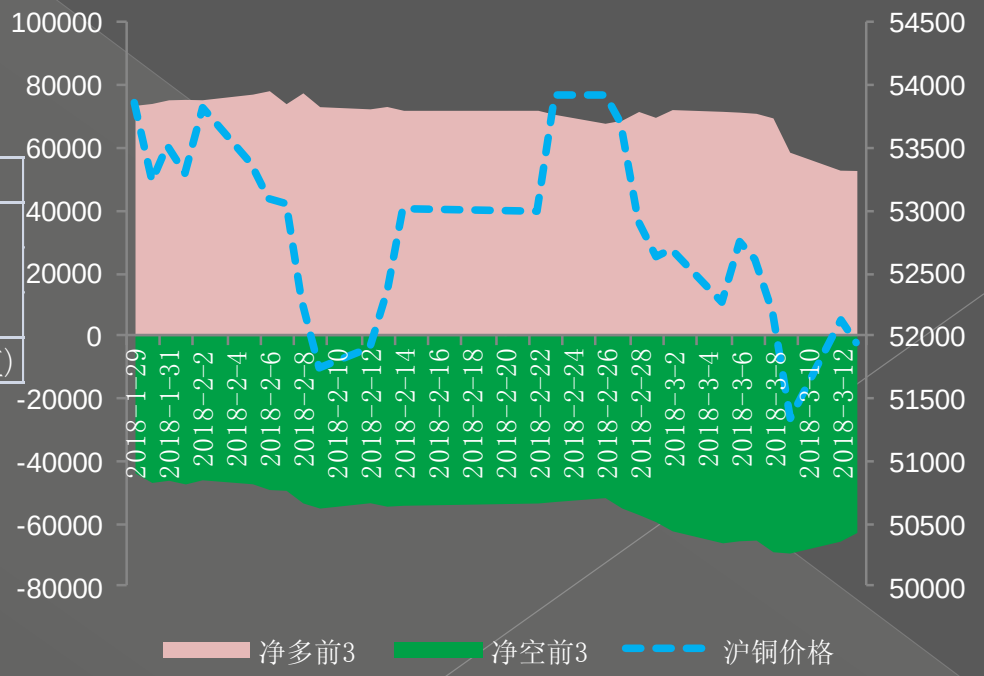




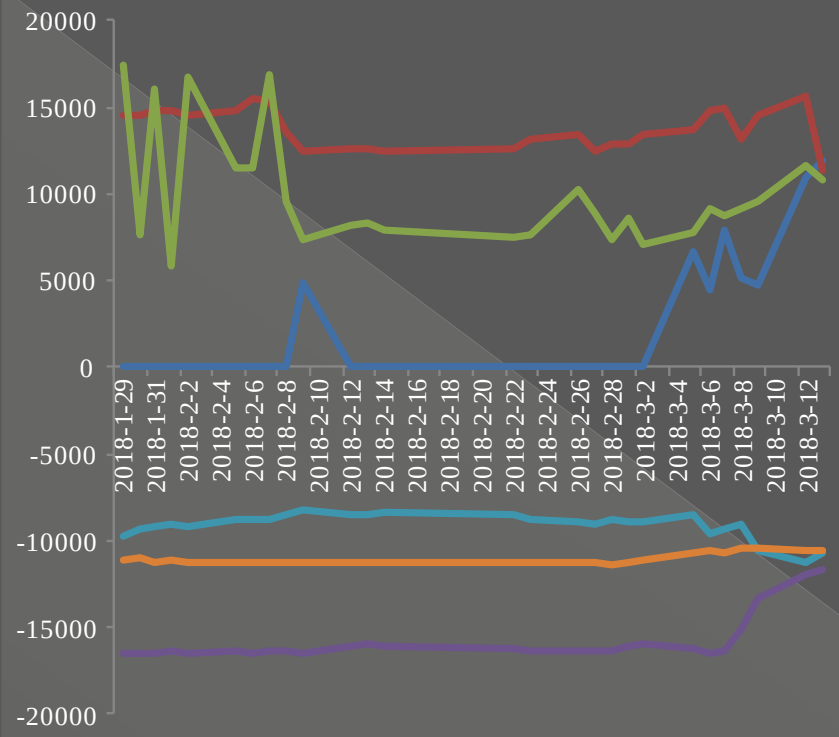
金属板块：Cu



变动幅度		当日	最近5日	平均变化	波动率
cu持仓	多头前3	-0.20%	-26.09%	-5.22%	15.04%
	空头前3	-4.25%	-4.05%	-0.81%	
cu涨幅		-0.36%	-1.56%	-0.31%	
震荡幅度	0.90%	1.35%(月均值)	投机度	0.42	0.53(月均值)

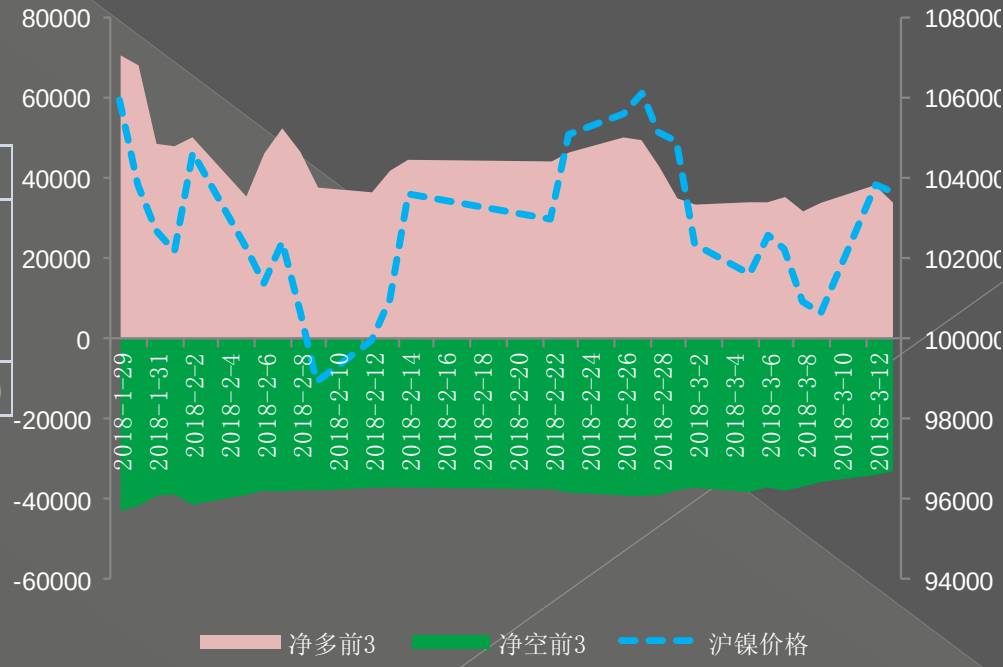


大陆期货

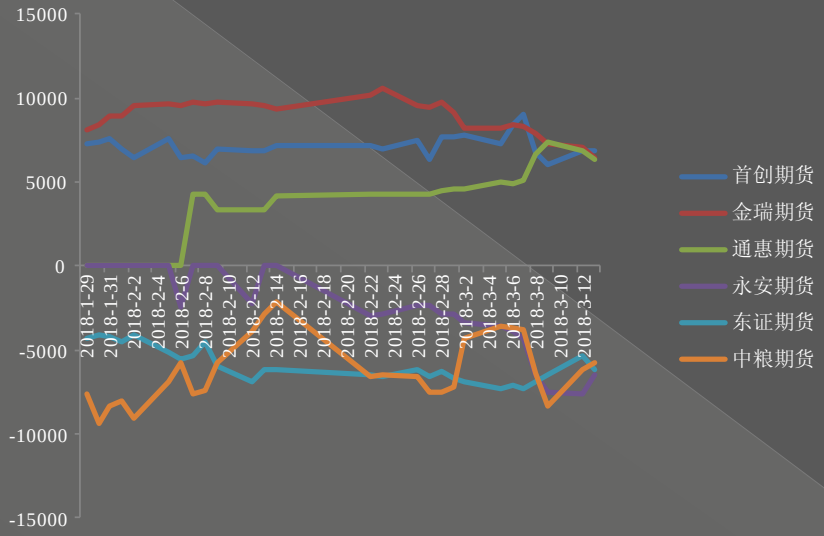


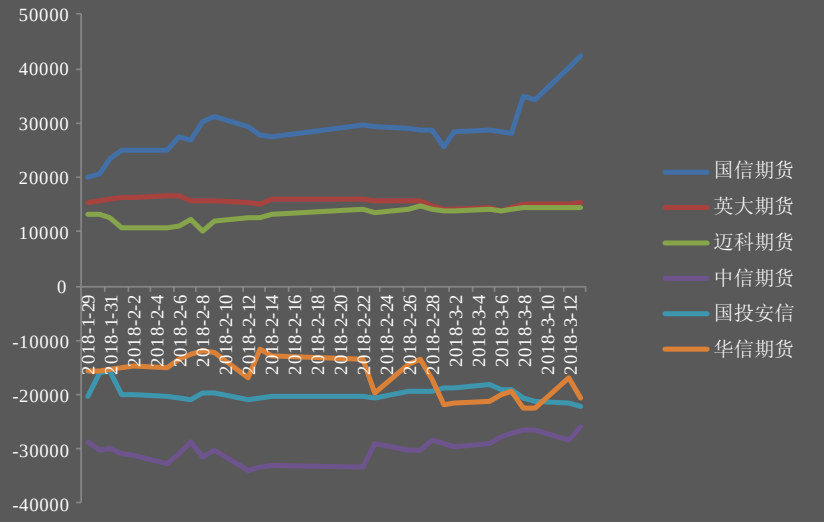
金属板块：Ni

变动幅度		当日	最近5日	平均变化	波动率
ni持仓	多头前3	-11.28%	-0.19%	-0.04%	23.62%
	空头前3	-2.62%	-10.69%	-2.14%	
ni涨幅		-0.18%	1.07%	0.21%	
震荡幅度	1.40%	2.31%(月均值)	投机度	1.58	1.55(月均值)



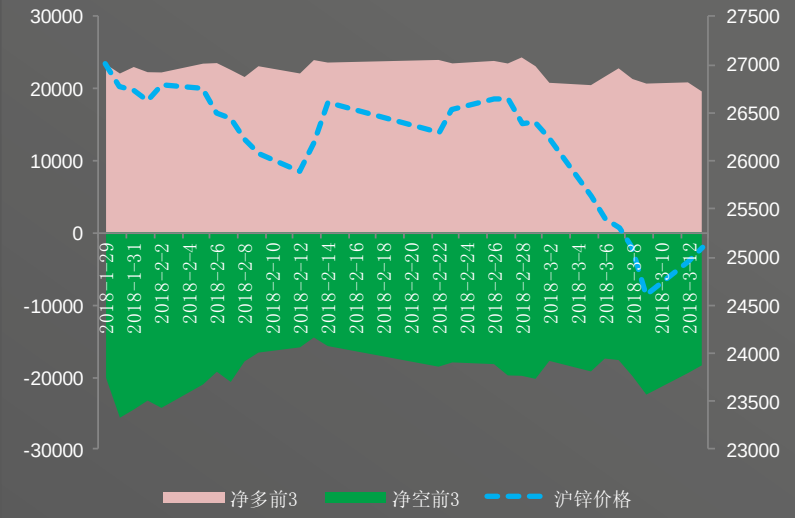
金属板块：Zn & Al

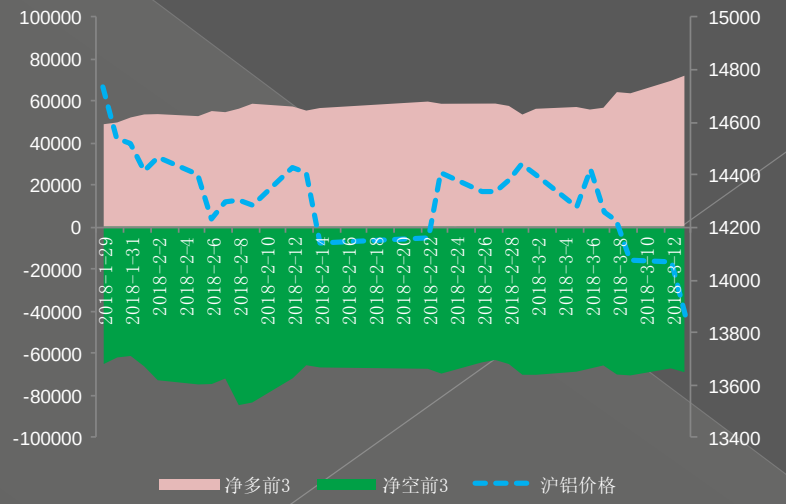




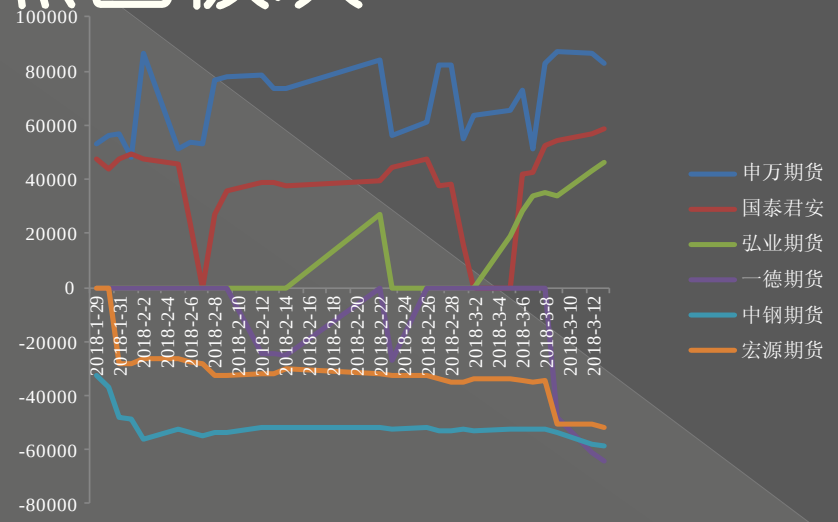
变动幅度		当日	最近5日	平均变化	波动率
zn持仓	多头前3	-6.07%	-9.48%	-1.90%	15.91%
	空头前3	-5.49%	5.40%	1.08%	
zn涨幅		0.57%	-1.12%	-0.22%	
震荡幅度	1.38%	1.55%(月均值)	投机度	1.32	1.22(月均值)

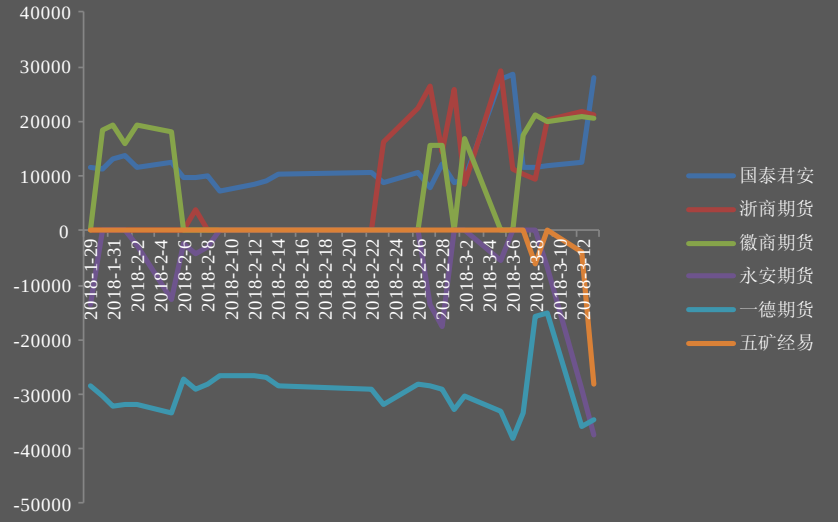
变动幅度		当日	最近5日	平均变化	波动率
al持仓	多头前3	3.48%	28.85%	5.77%	13.68%
	空头前3	2.68%	2.54%	0.51%	
al涨幅		-1.44%	-3.86%	-0.77%	
震荡幅度	2.06%	1.58%(月均值)	投机度	0.71	0.61(月均值)





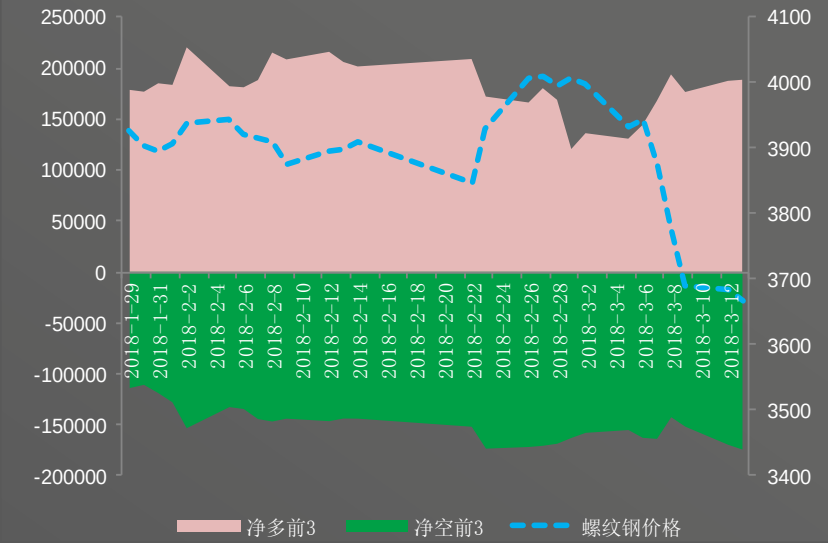
黑色板块：Rb & I

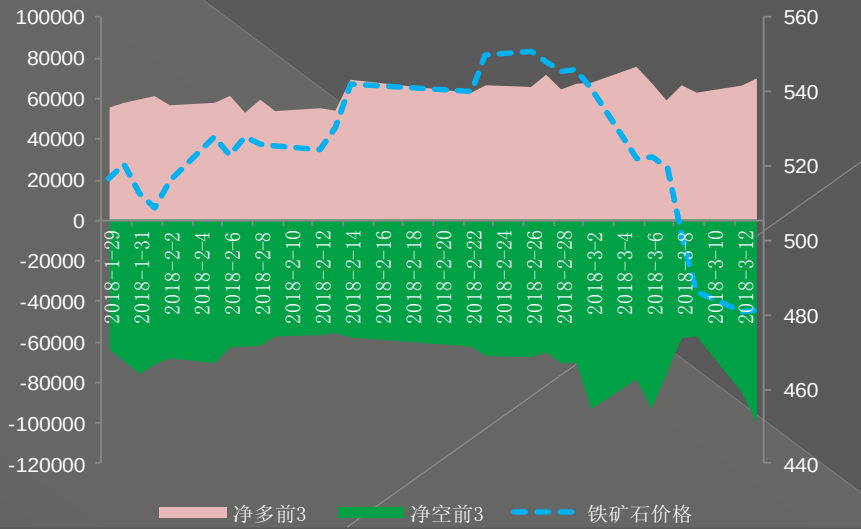




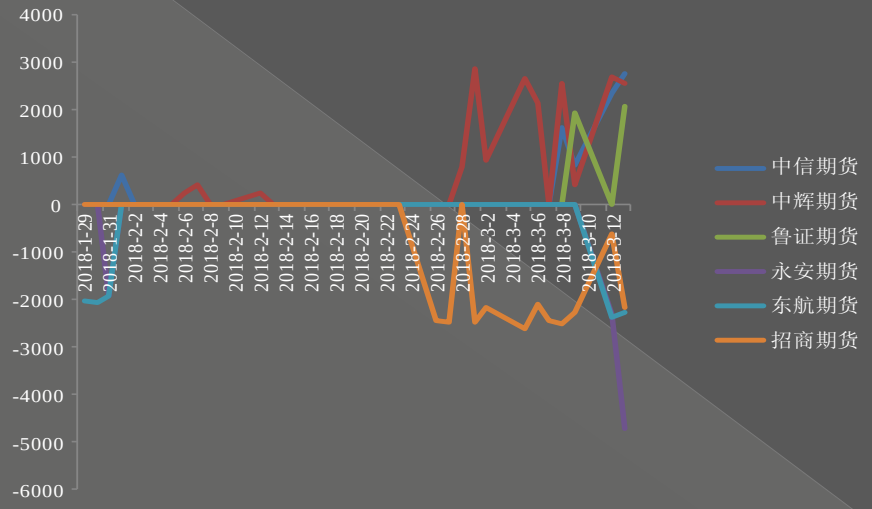
变动幅度		当日	最近5日	平均变化	波动率
rb持仓	多头前3	0.57%	30.86%	6.17%	18.41%
	空头前3	2.75%	7.08%	1.42%	
rb涨幅		-0.46%	-7.07%	-1.41%	
震荡幅度	1.41%	1.68%(月均值)	投机度	0.93	0.94(月均值)

变动幅度		当日	最近5日	平均变化	波动率
I持仓	多头前3	5.31%	3.22%	0.64%	25.03%
	空头前3	18.02%	7.78%	1.56%	
I涨幅		0.04%	-7.88%	-1.58%	
震荡幅度	1.59%	2.25%(月均值)	投机度	0.89	0.98(月均值)



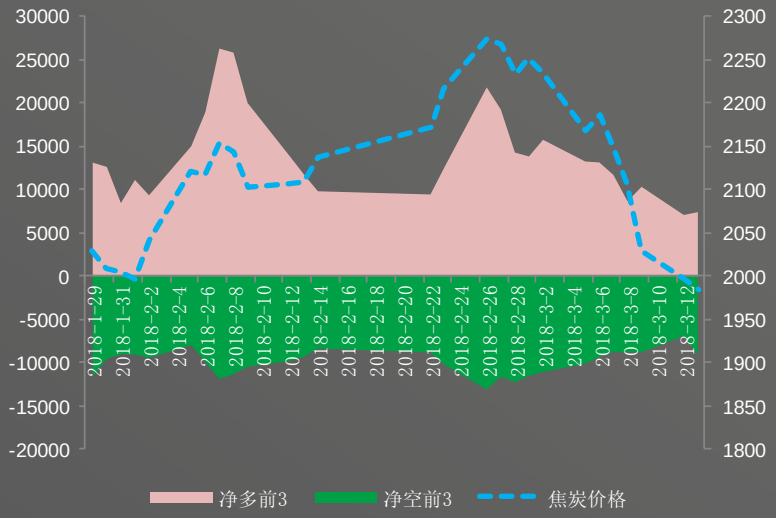


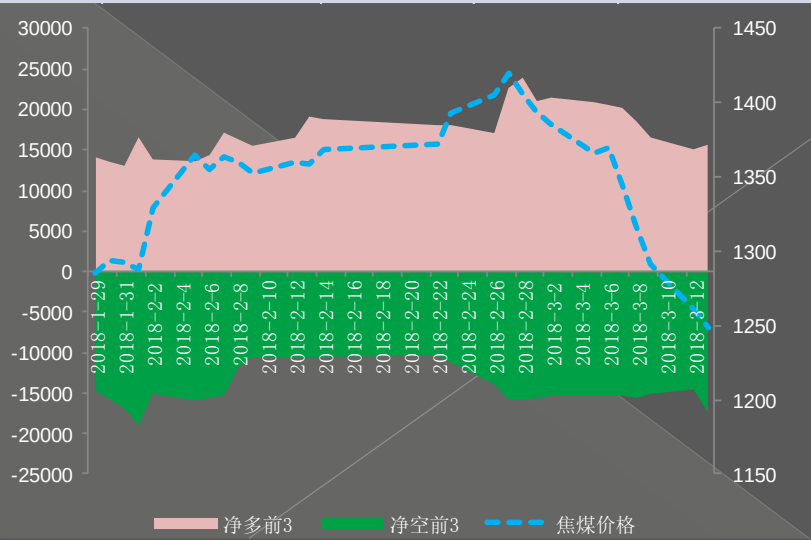
黑色板块：J & JM



变动幅度		当日	最近5日	平均变化	波动率
j持仓	多头前3	4.60%	-43.62%	-8.72%	29.41%
	空头前3	31.65%	-2.57%	-0.51%	
j涨幅		-0.64%	-9.24%	-1.85%	
震荡幅度	1.63%	2.65%(月均值)	投机度	1.29	1.09(月均值)

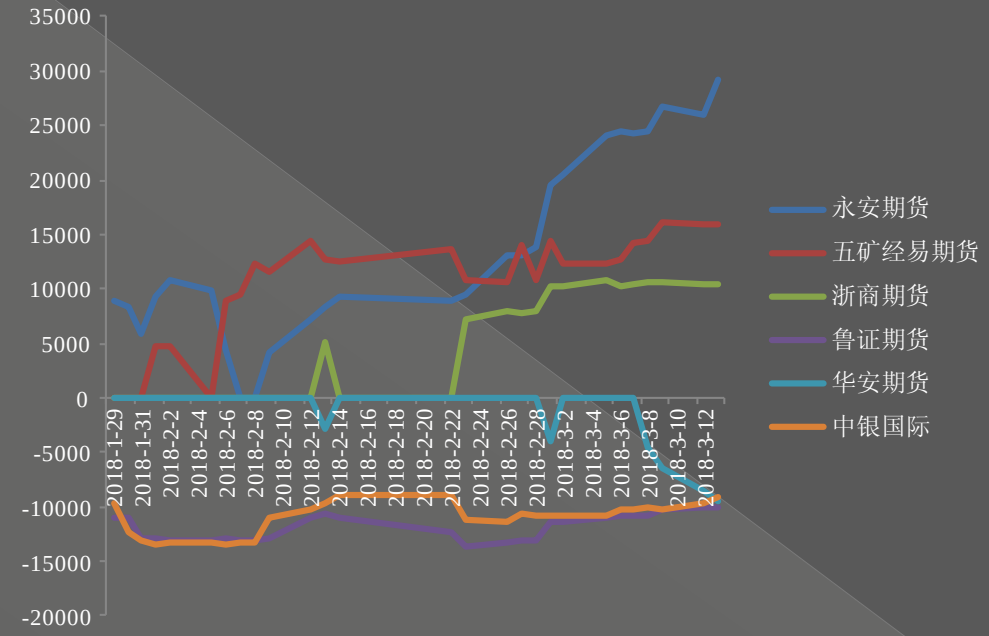
变动幅度		当日	最近5日	平均变化	波动率
jm持仓	多头前3	3.69%	-23.83%	-4.77%	20.20%
	空头前3	19.86%	13.43%	2.69%	
jm涨幅		-1.05%	-8.91%	-1.78%	
震荡幅度	1.59%	2.32%(月均值)	投机度	1.09	0.98(月均值)

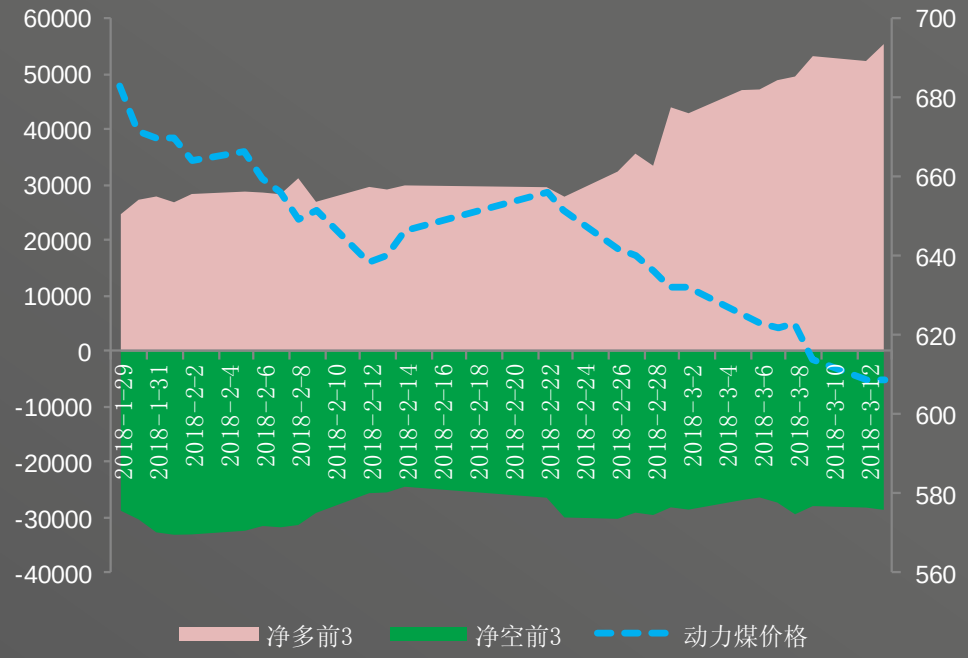




大陆期货

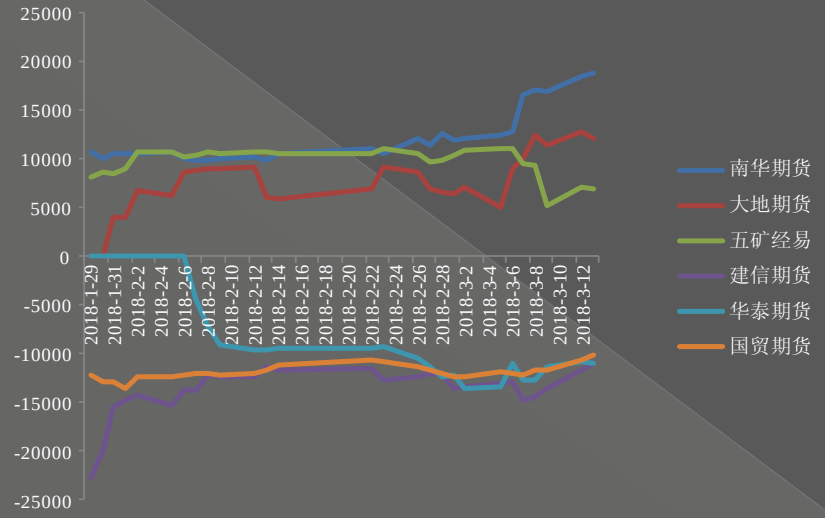
黑色：动力煤

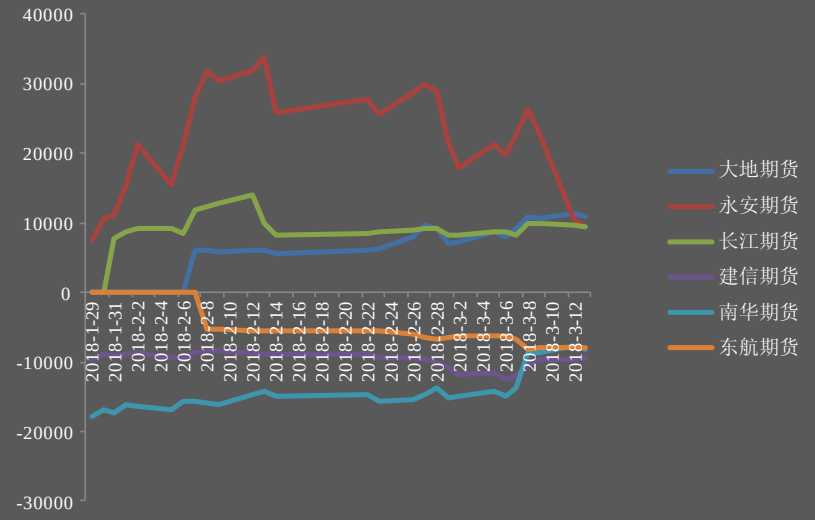




变动幅度		当日	最近5日	平均变化	波动率
zc持仓	多头前3	5.82%	17.29%	3.46%	12.98%
	空头前3	1.47%	8.53%	1.71%	
zc涨幅		-0.03%	-2.29%	-0.46%	
震荡幅度	0.79%	1.40%(月均值)	投机度	0.39	0.68(月均值)

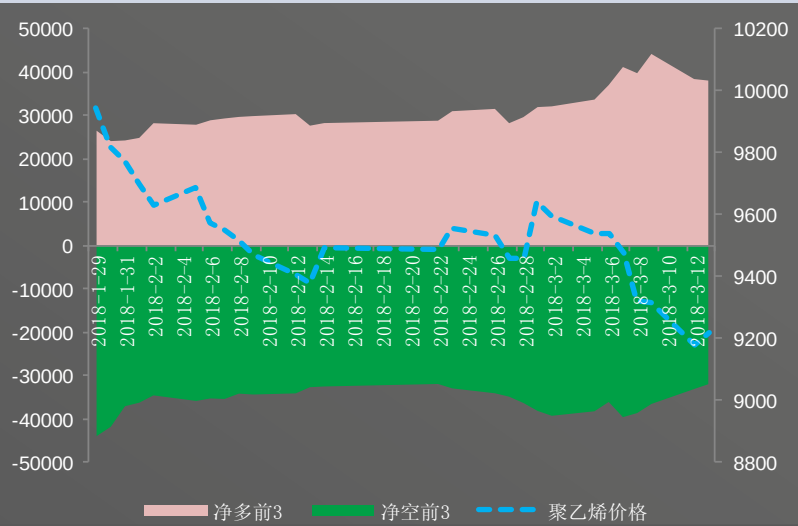
化工：塑料 & PP

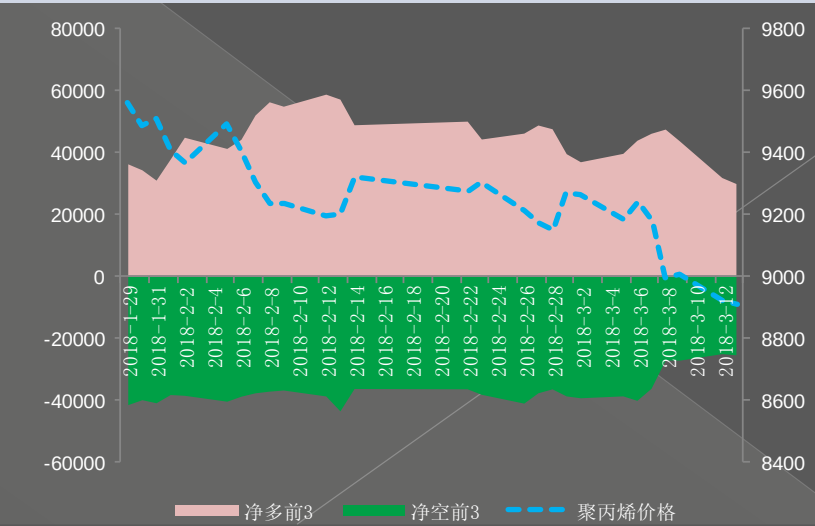




变动幅度		当日	最近5日	平均变化	波动率
l持仓	多头前3	-0.93%	2.81%	0.56%	13.11%
	空头前3	-3.36%	-11.32%	-2.26%	
l涨幅		0.40%	-3.39%	-0.68%	
震荡幅度	0.85%	1.25%(月均值)	投机度	0.41	0.56(月均值)

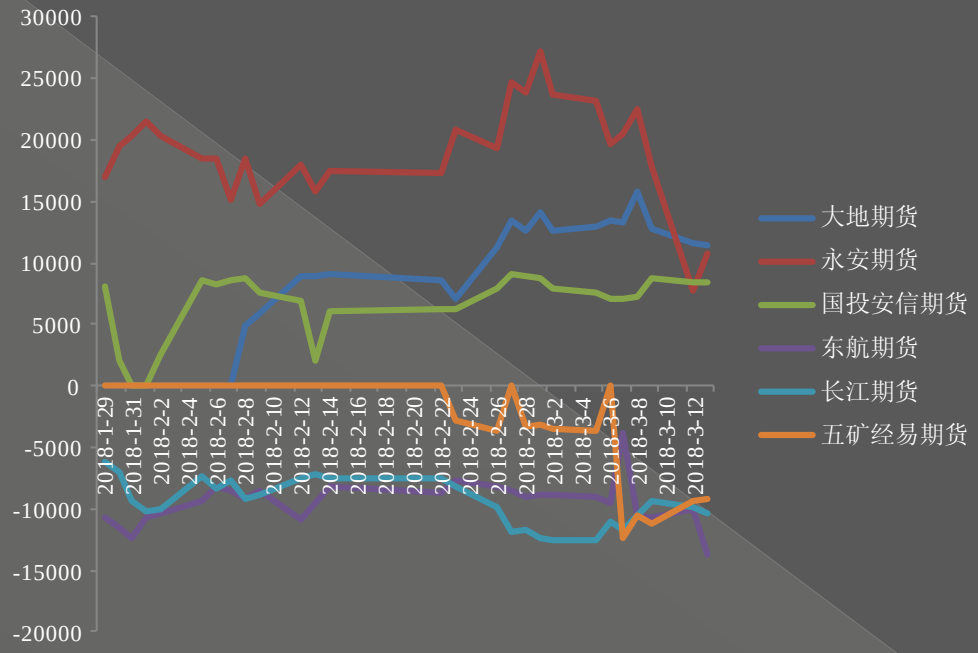
变动幅度		当日	最近5日	平均变化	波动率
pp持仓	多头前3	-6.07%	-31.78%	-6.36%	13.18%
	空头前3	1.51%	-36.74%	-7.35%	
pp涨幅		-0.08%	-3.56%	-0.71%	
震荡幅度	0.62%	1.29%(月均值)	投机度	0.39	0.60(月均值)

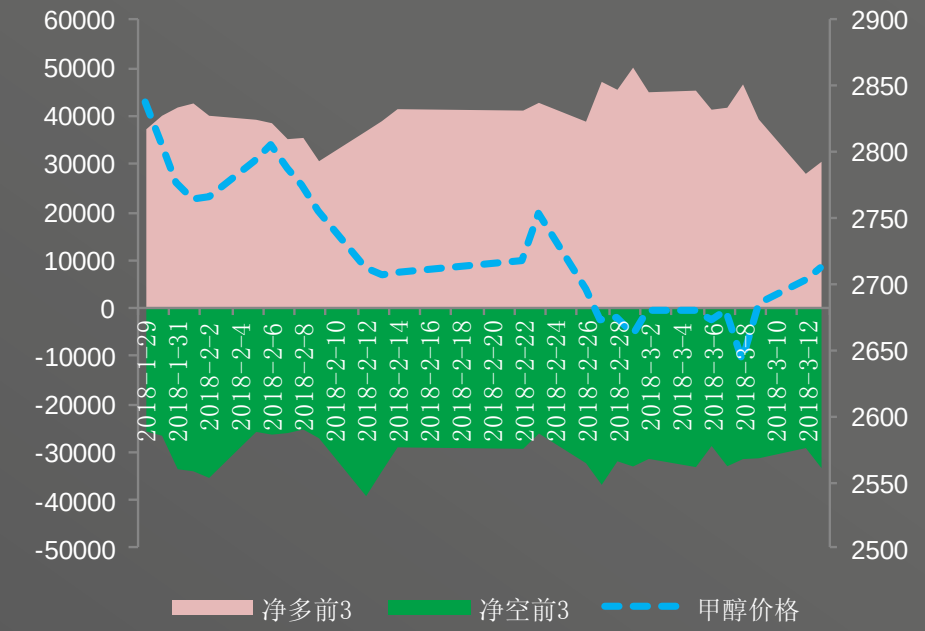




大陆期货

化工：甲醇

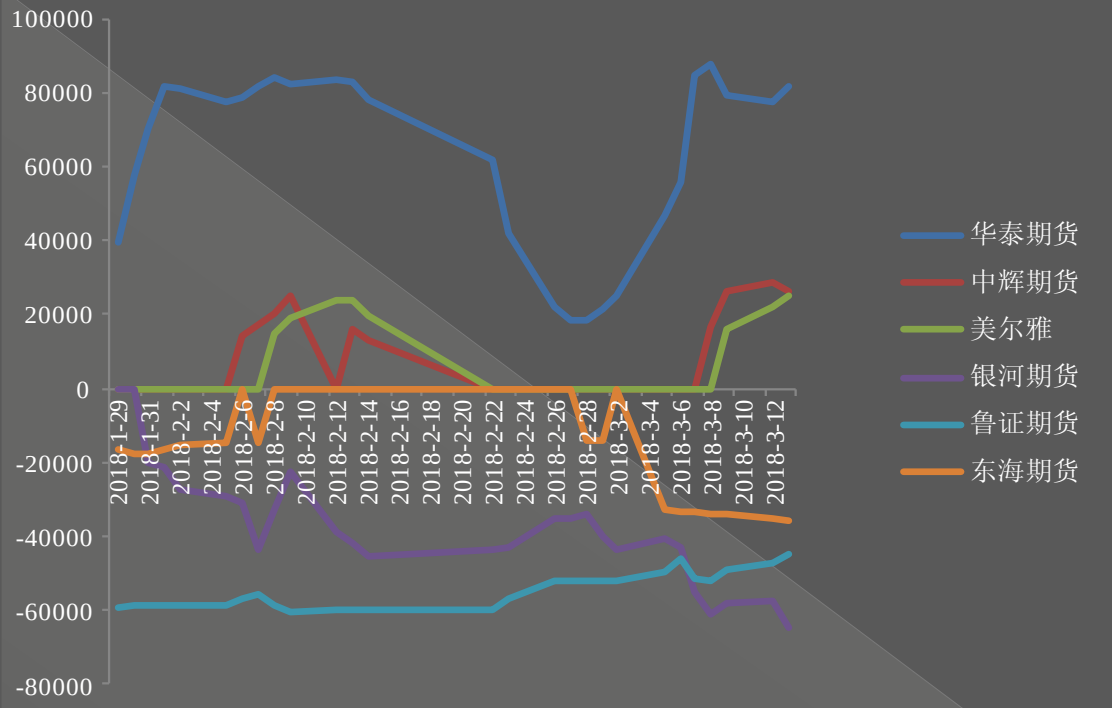


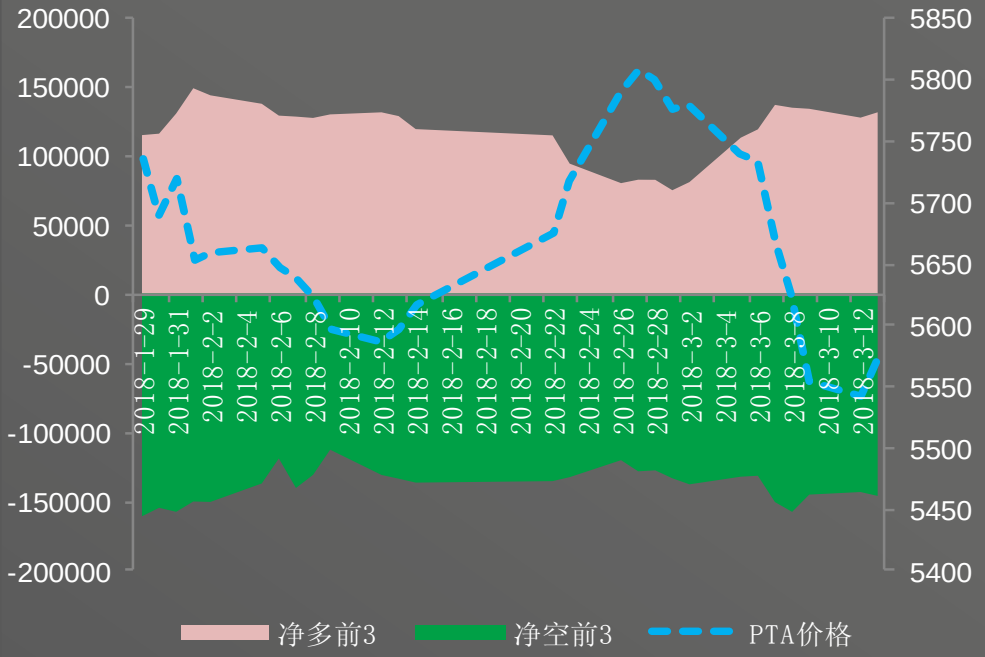


变动幅度		当日	最近5日	平均变化	波动率
ma持仓	多头前3	8.90%	-26.11%	-5.22%	14.60%
	空头前3	14.46%	16.21%	3.24%	
ma涨幅		0.33%	1.51%	0.30%	
震荡幅度	0.93%	1.63%(月均值)	投机度	1.06	1.13(月均值)

大陆期货

化工：PTA

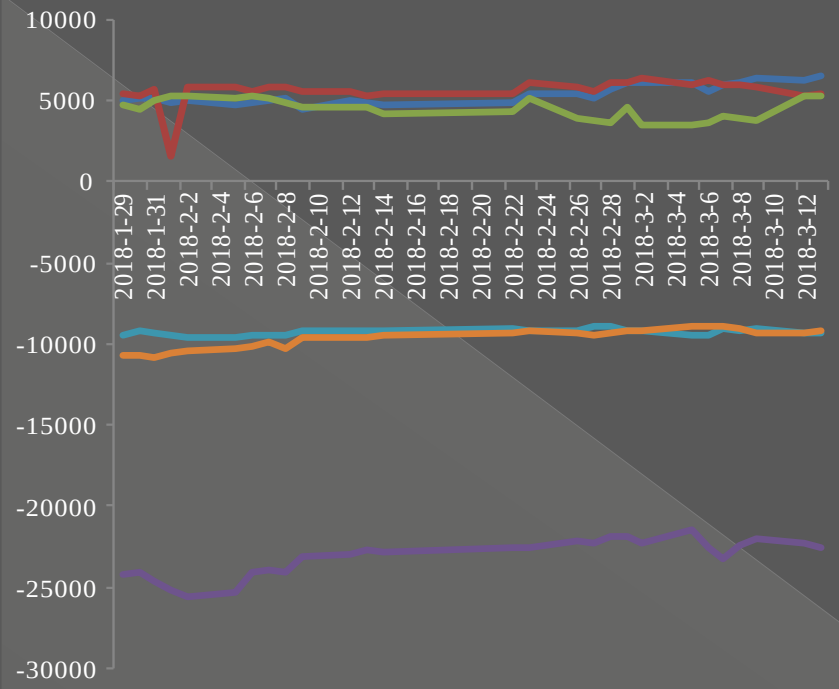


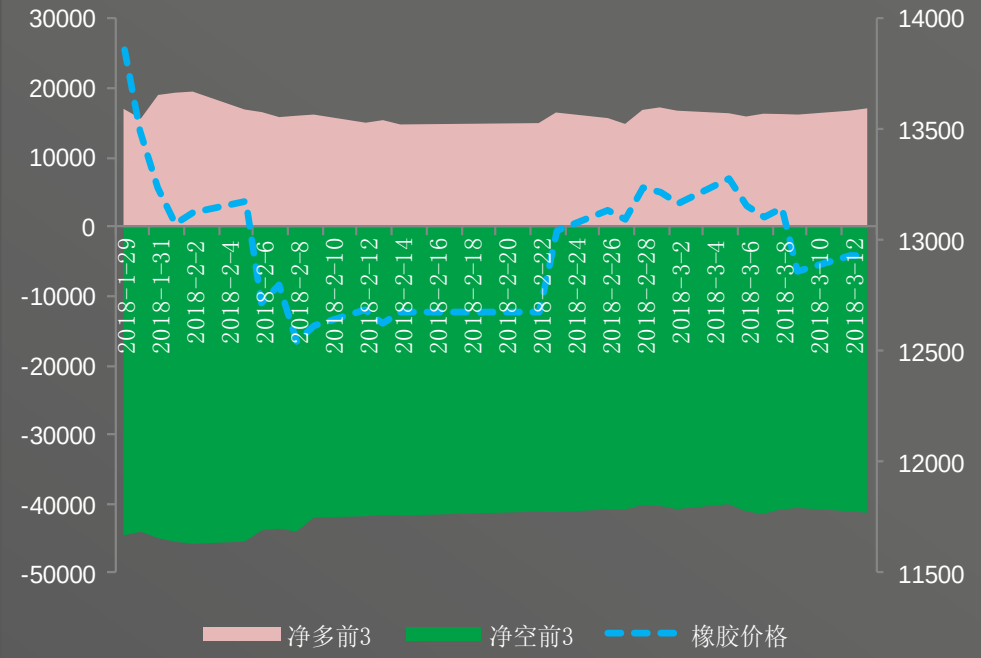


变动幅度		当日	最近5日	平均变化	波动率
pta持仓	多头前3	3.03%	10.38%	2.08%	9.93%
	空头前3	1.96%	11.07%	2.21%	
pta涨幅		0.51%	-2.84%	-0.57%	
震荡幅度	0.96%	1.28%(月均值)	投机度	0.34	0.46(月均值)

大陆期货

化工：橡胶

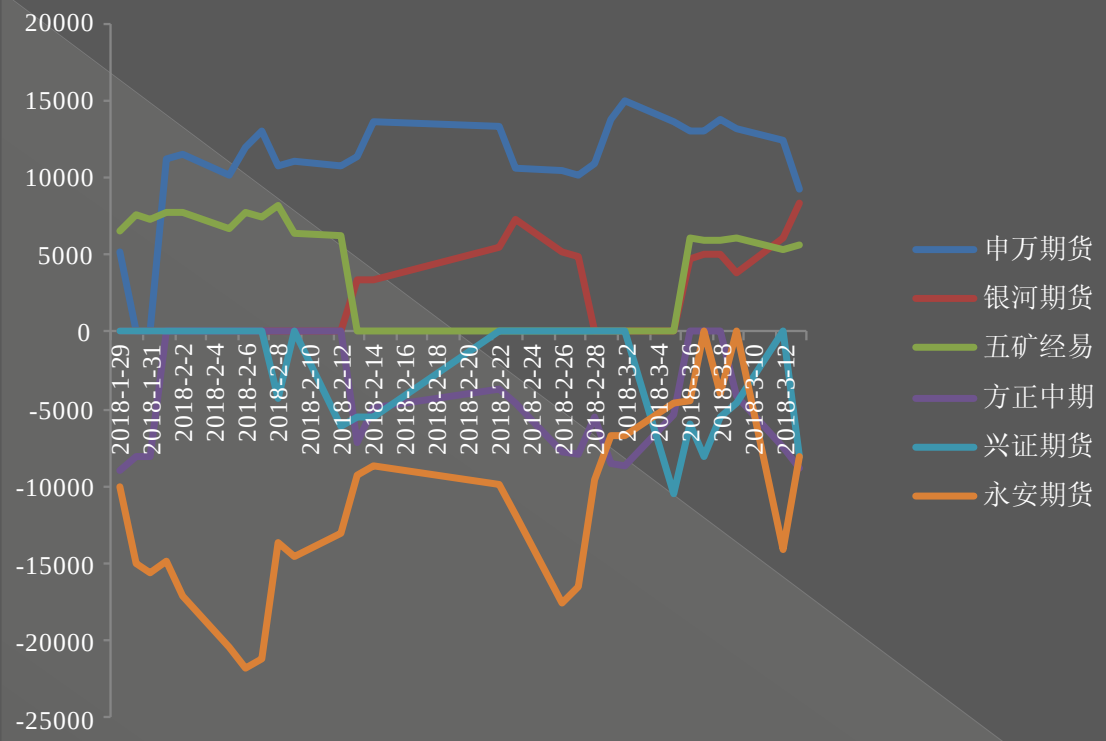


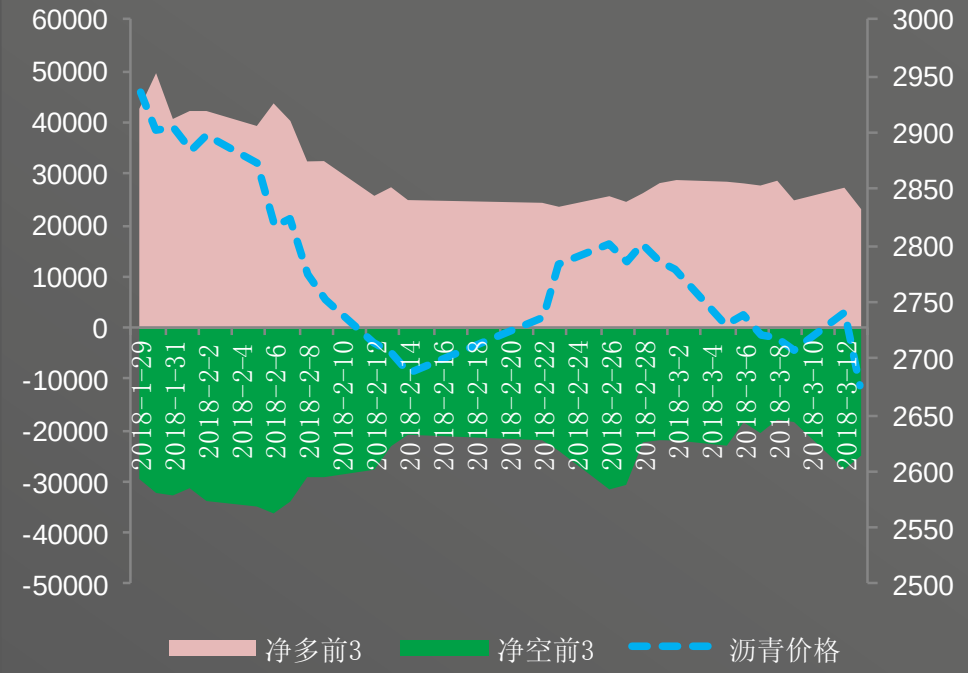


变动幅度		当日	最近5日	平均变化	波动率
ru持仓	多头前3	2.01%	7.38%	1.48%	20.47%
	空头前3	0.50%	0.50%	0.10%	
ru涨幅		0.01%	-1.69%	-0.34%	
震荡幅度	1.08%	2.12%(月均值)	投机度	0.55	0.72(月均值)

大陆期货

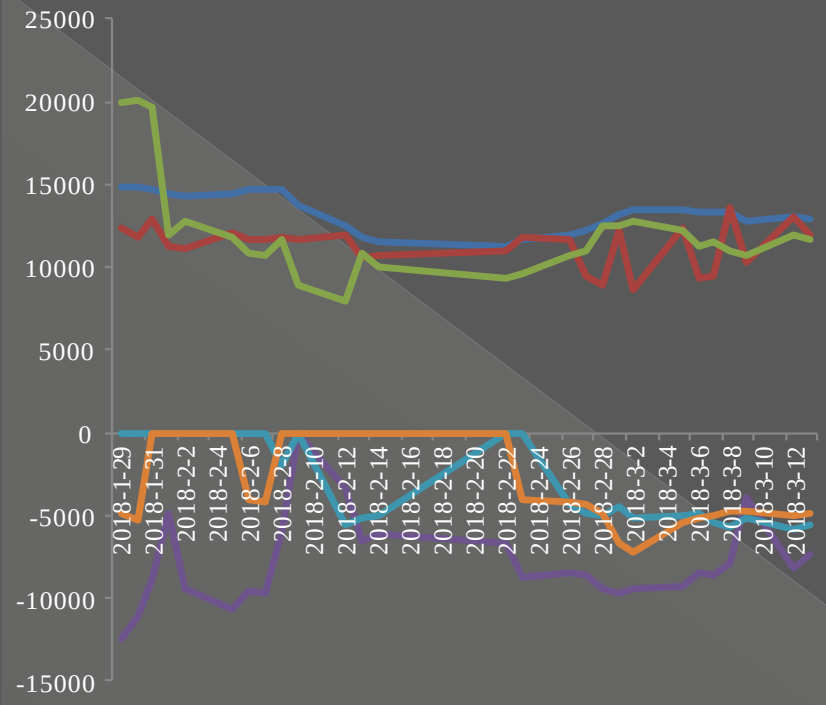
化工：沥青

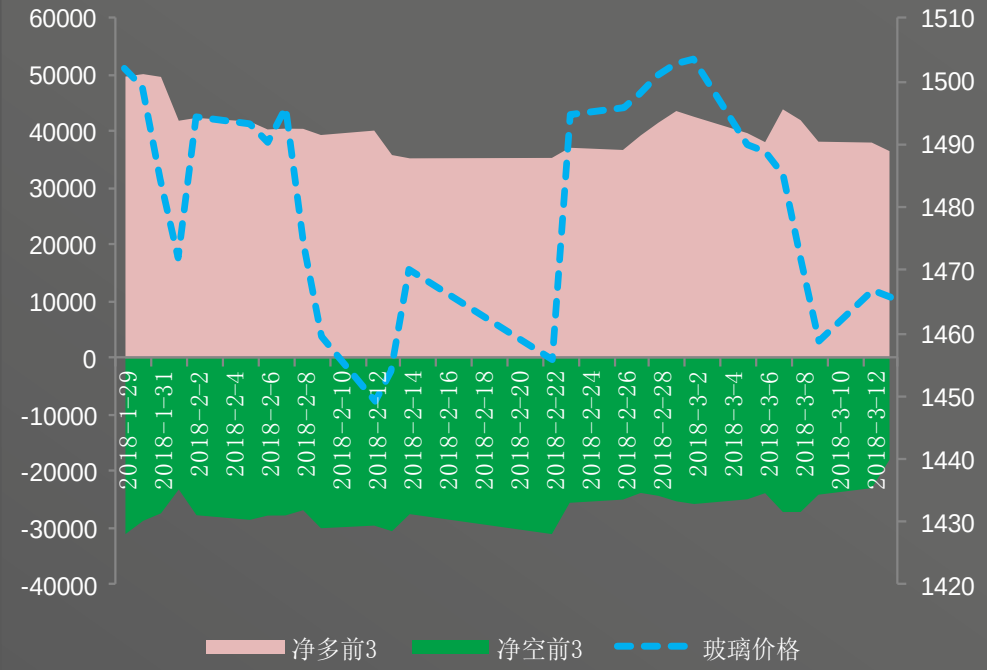




变动幅度		当日	最近5日	平均变化	波动率
bu持仓	多头前3	-15.22%	-17.75%	-3.55%	17.78%
	空头前3	-9.72%	35.70%	7.14%	
bu涨幅		-2.36%	-2.28%	-0.46%	
震荡幅度	2.53%	1.85%(月均值)	投机度	1.12	0.80(月均值)

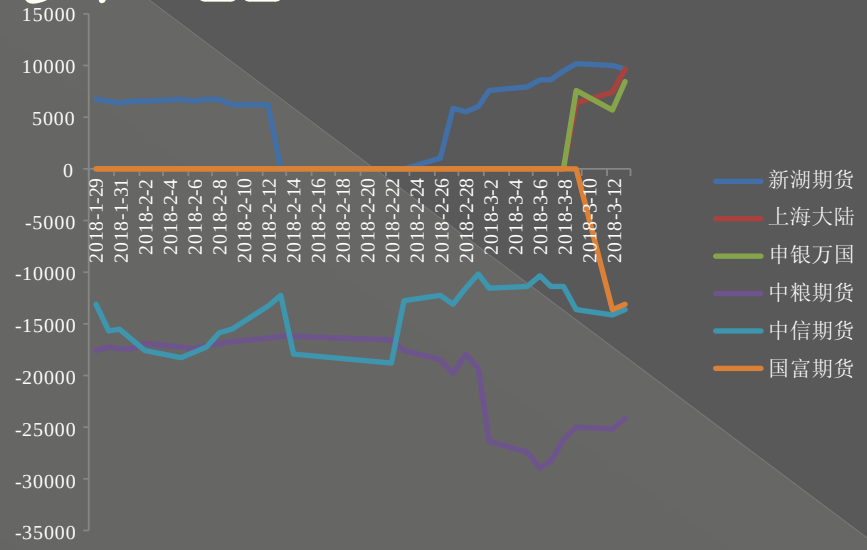
化工：玻璃

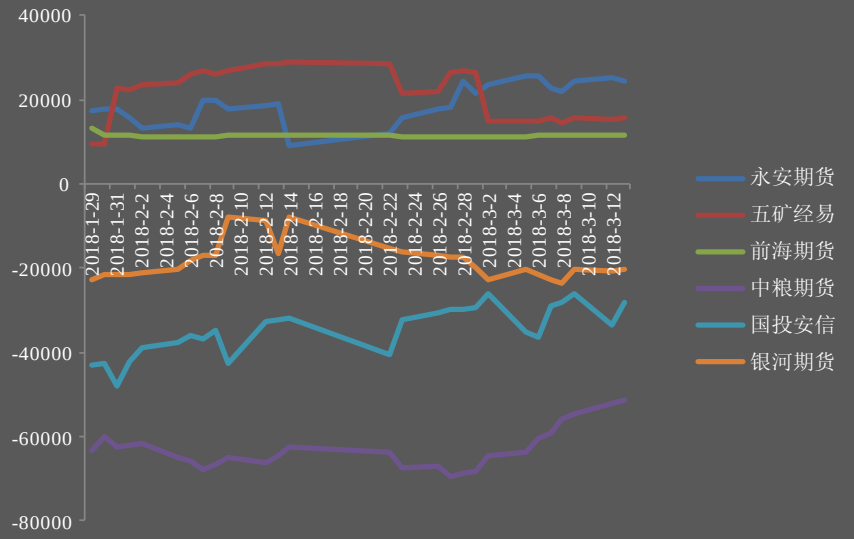




变动幅度		当日	最近5日	平均变化	波动率
fg持仓	多头前3	-3.96%	-4.15%	-0.83%	13.72%
	空头前3	-21.86%	-24.78%	-4.96%	
fg涨幅		-0.06%	-1.55%	-0.31%	
震荡幅度	1.08%	1.51%(月均值)	投机度	0.54	0.54(月均值)

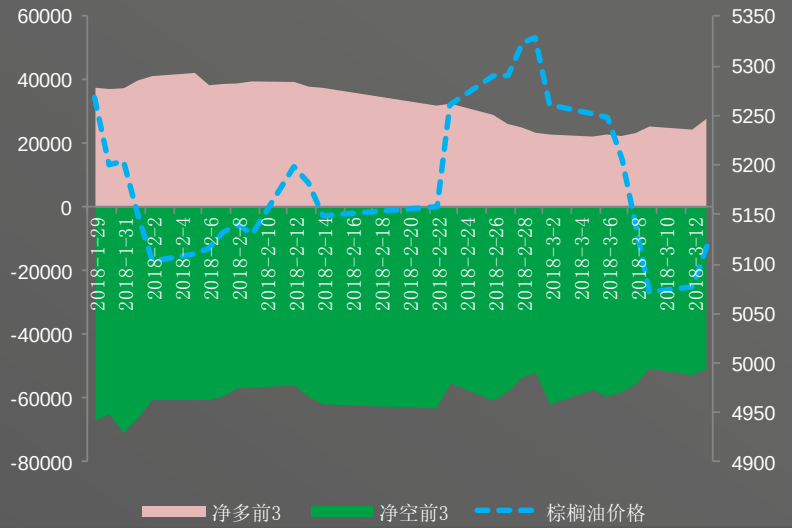
农产品：P & Y

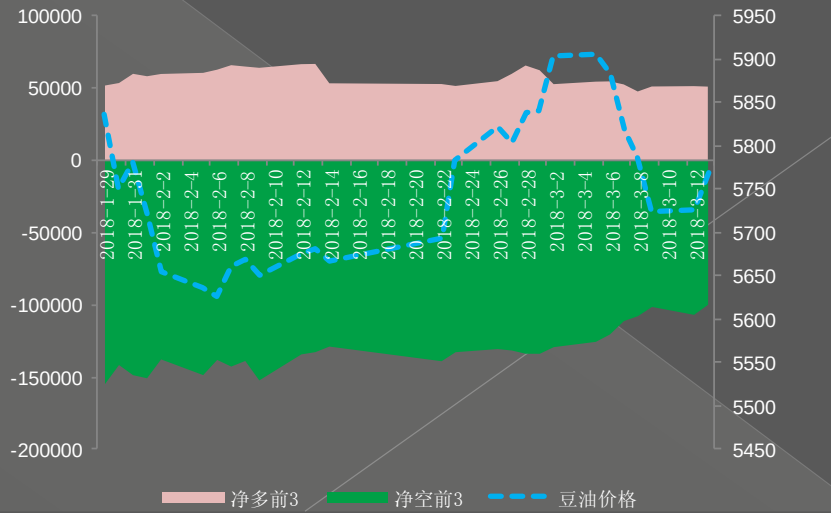




变动幅度		当日	最近5日	平均变化	波动率
p持仓	多头前3	13.82%	21.37%	4.27%	12.65%
	空头前3	-3.80%	-14.66%	-2.93%	
p涨幅		0.81%	-2.46%	-0.49%	
震荡幅度	1.80%	1.30%(月均值)	投机度	0.80	0.60(月均值)

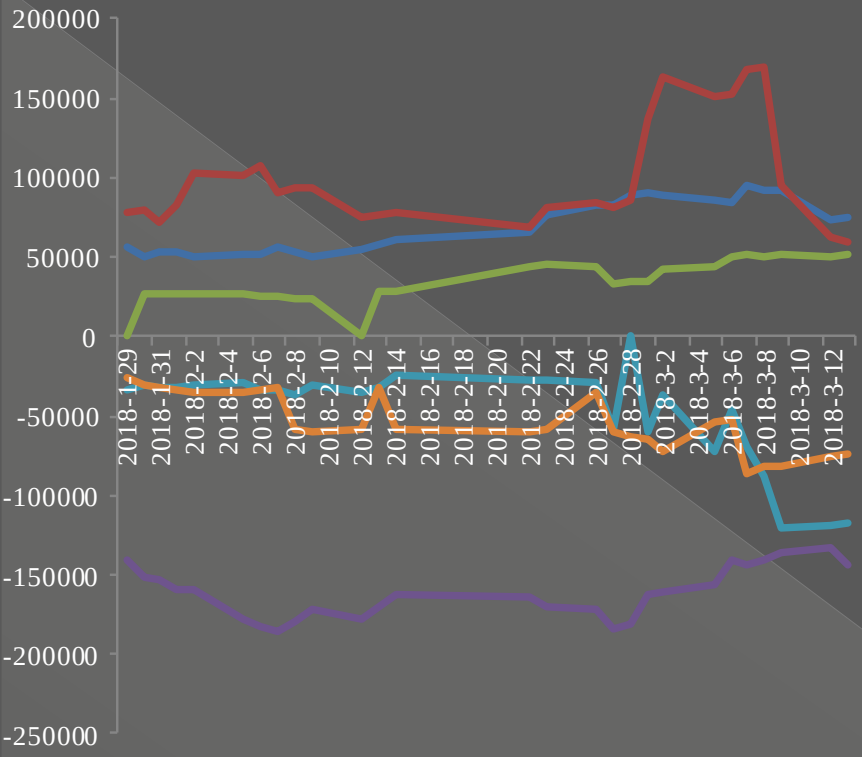
变动幅度		当日	最近5日	平均变化	波动率
y持仓	多头前3	-0.64%	-6.56%	-1.31%	10.25%
	空头前3	-6.57%	-17.15%	-3.43%	
y涨幅		0.74%	-1.95%	-0.39%	
震荡幅度	1.42%	1.24%(月均值)	投机度	0.49	0.39(月均值)

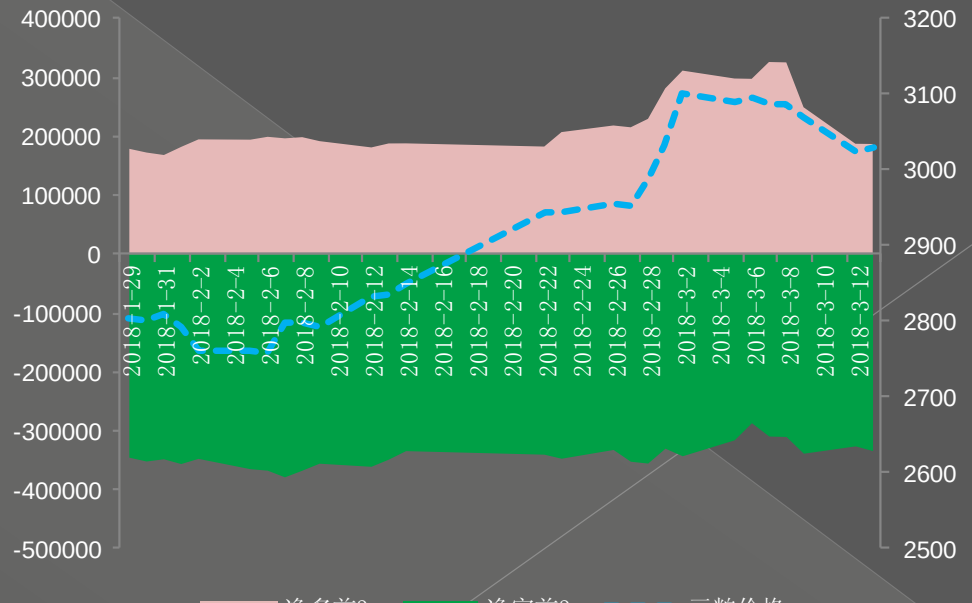




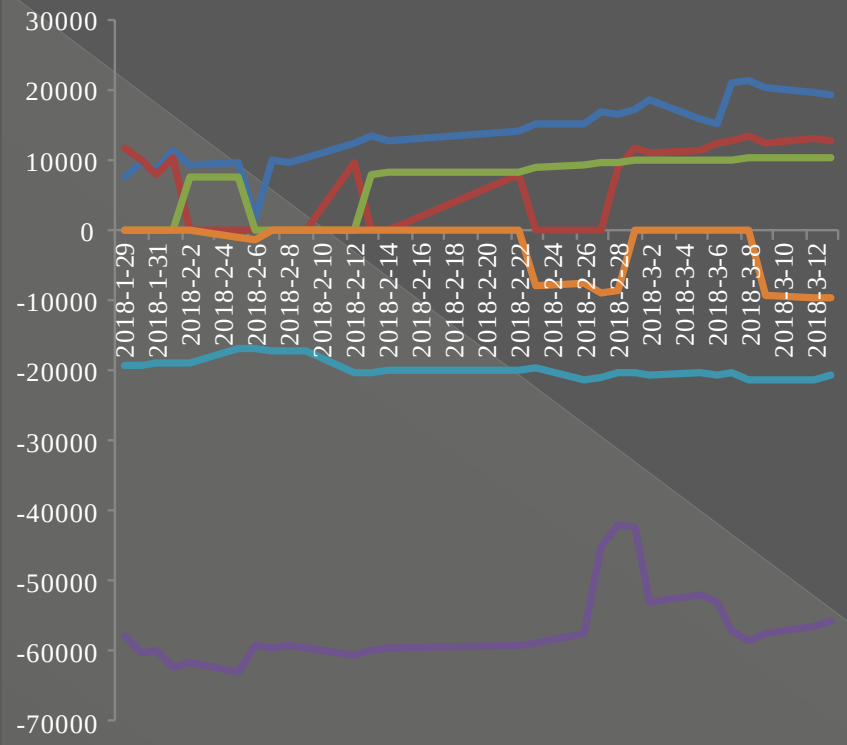
大陆期货

农产品：豆粕



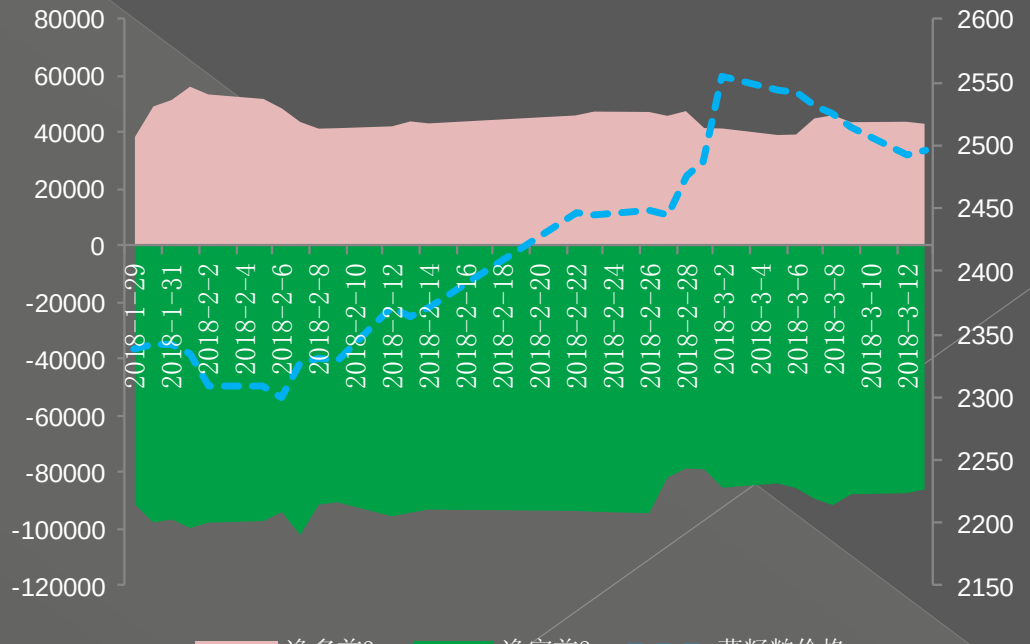


变动幅度		当日	最近5日	平均变化	波动率
m持仓	多头前3	-0.22%	-37.09%	-7.42%	16.61%
	空头前3	2.46%	16.52%	3.30%	
m涨幅		0.24%	-2.05%	-0.41%	
震荡幅度	1.14%	1.32%(月均值)	投机度	0.51	0.51(月均值)



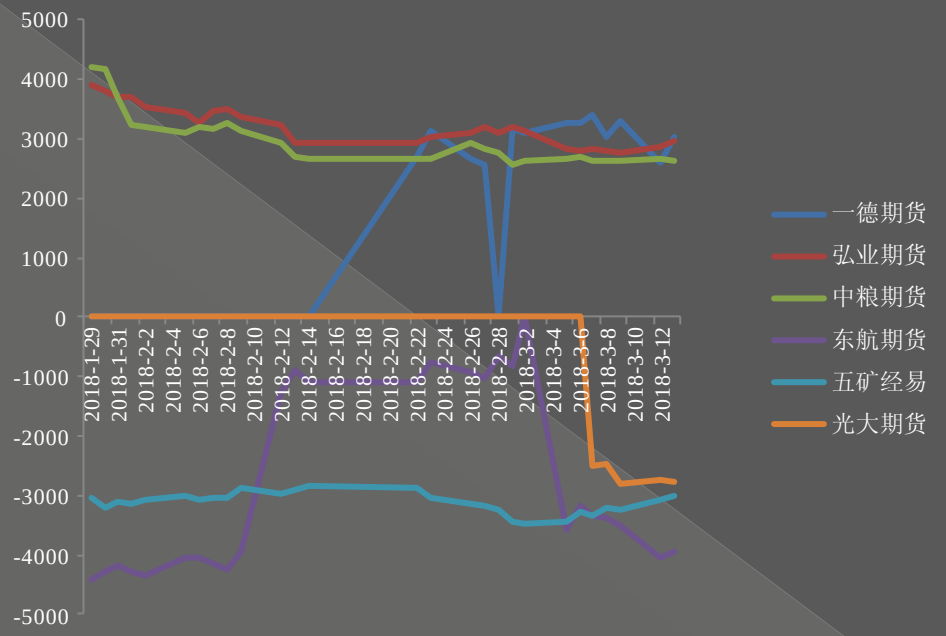
农产品：菜粕

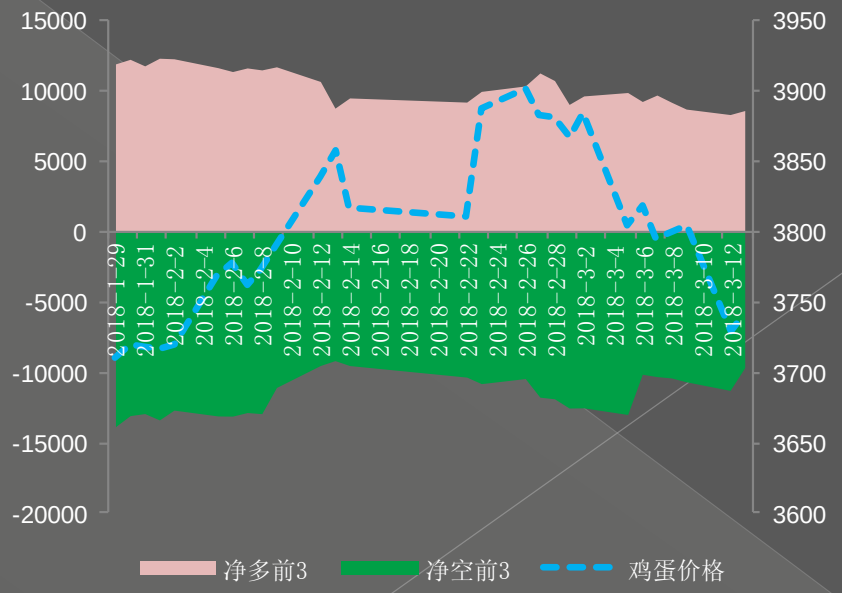
变动幅度		当日	最近5日	平均变化	波动率
rm持仓	多头前3	-1.62%	9.67%	1.93%	16.41%
	空头前3	-1.51%	0.56%	0.11%	
rm涨幅		0.11%	-1.85%	-0.37%	
震荡幅度	1.21%	1.24%(月均值)	投机度	0.63	0.60(月均值)



大陆期货

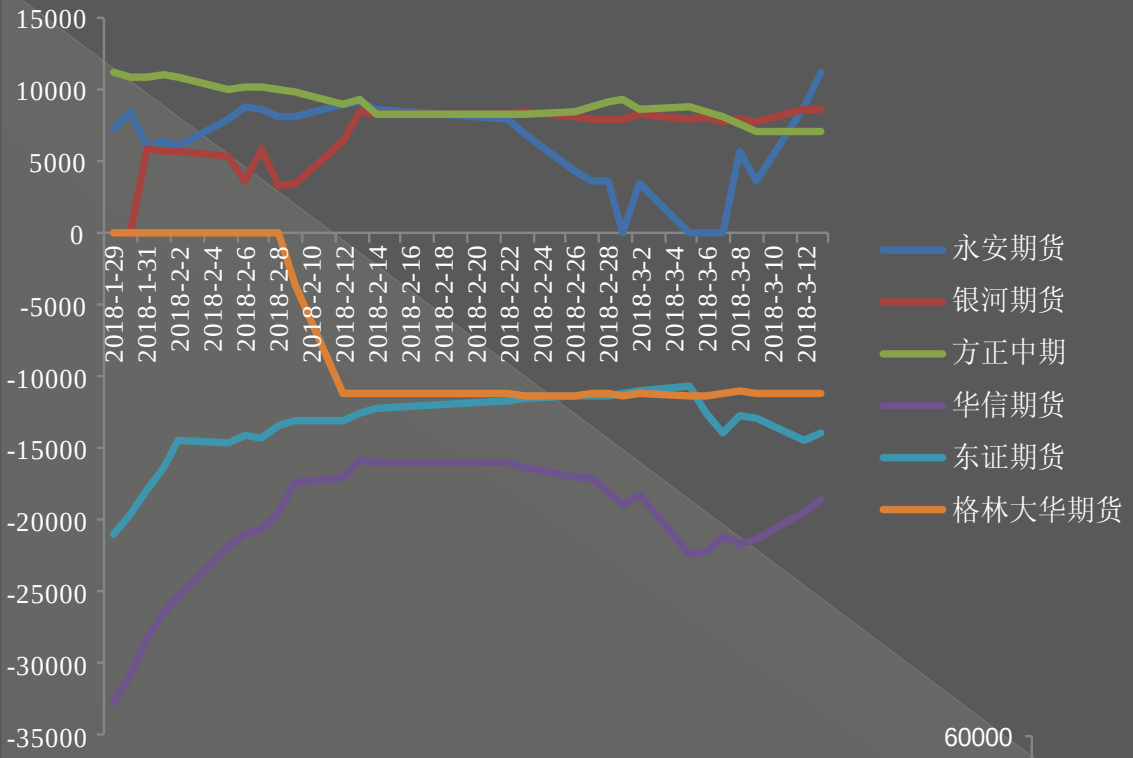
农产品：鸡蛋



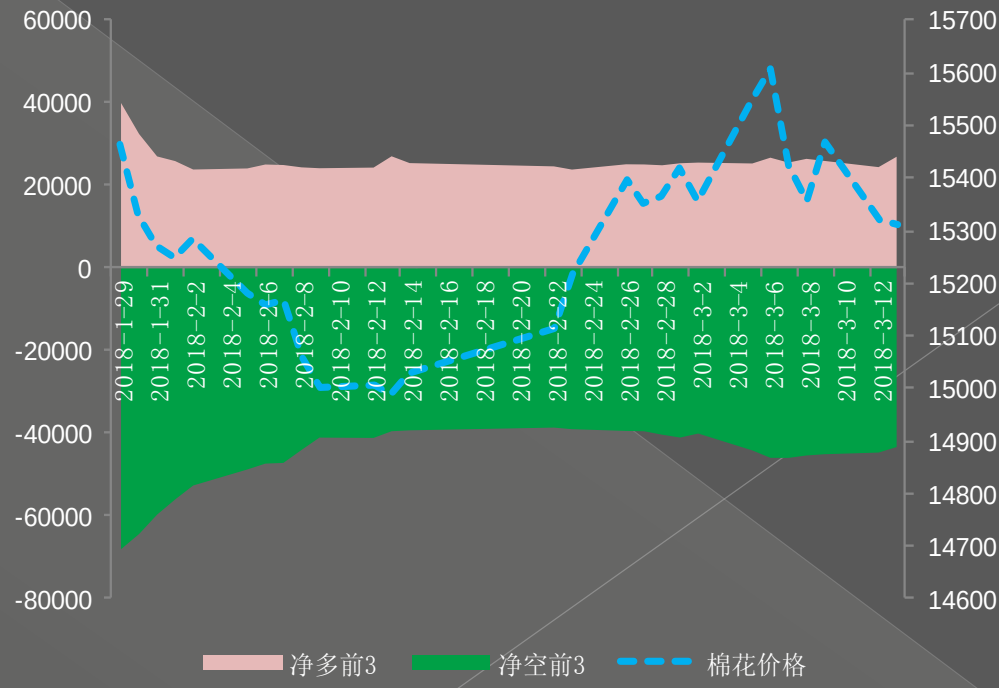


变动幅度		当日	最近5日	平均变化	波动率
jd持仓	多头前3	3.41%	-6.91%	-1.38%	14.95%
	空头前3	-14.47%	-4.73%	-0.95%	
jd涨幅		0.31%	-2.02%	-0.40%	
震荡幅度	0.63%	1.31%(月均值)	投机度	0.27	0.44(月均值)

农产品：棉花

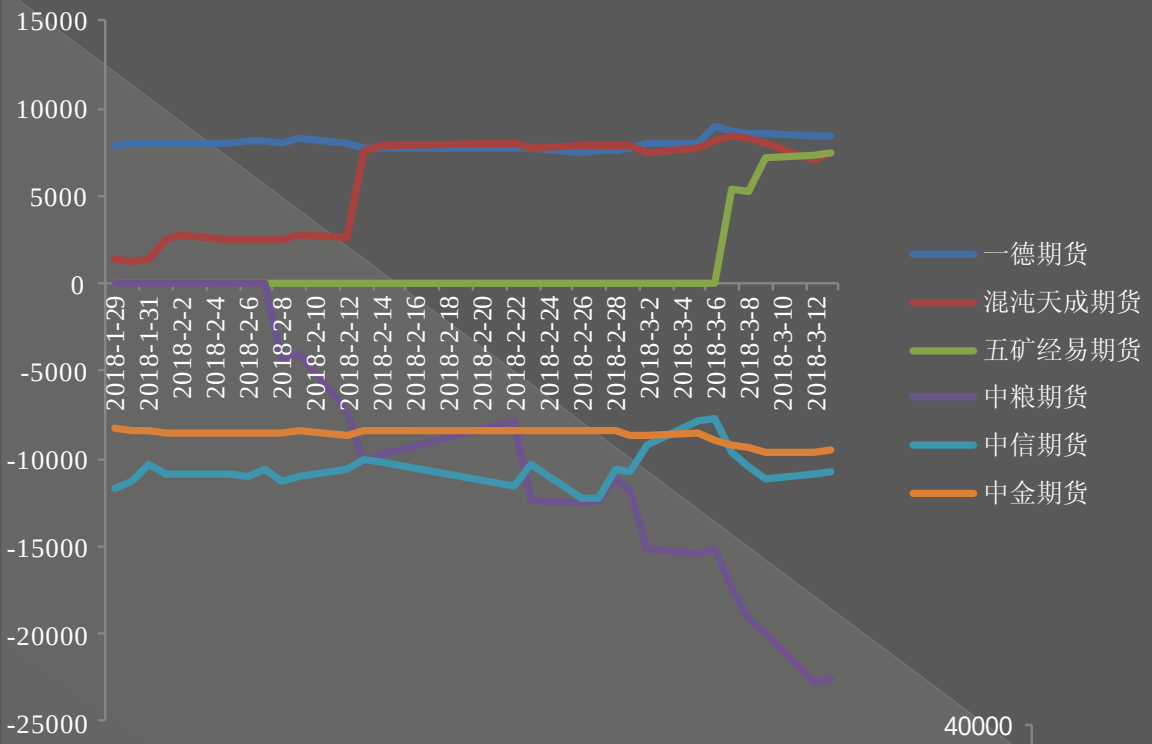


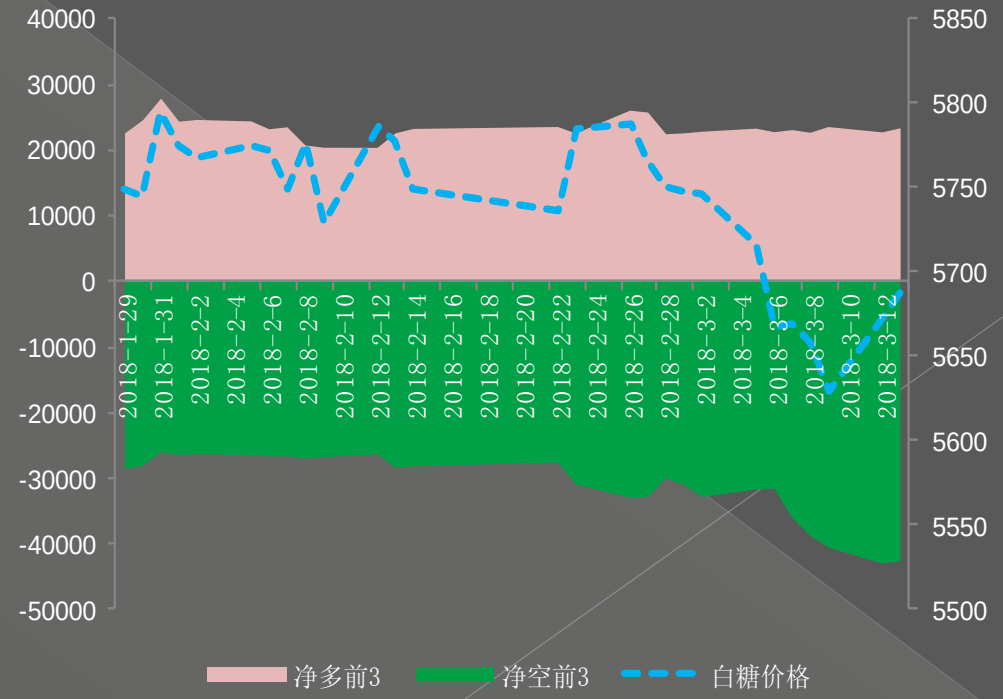
变动幅度		当日	最近5日	平均变化	波动率
cf持仓	多头前3	10.24%	0.83%	0.17%	10.09%
	空头前3	-3.01%	-5.69%	-1.14%	
cf涨幅		-0.06%	-1.89%	-0.38%	
震荡幅度	0.74%	0.90%(月均值)	投机度	0.49	0.35(月均值)



大陆期货

农产品：白糖

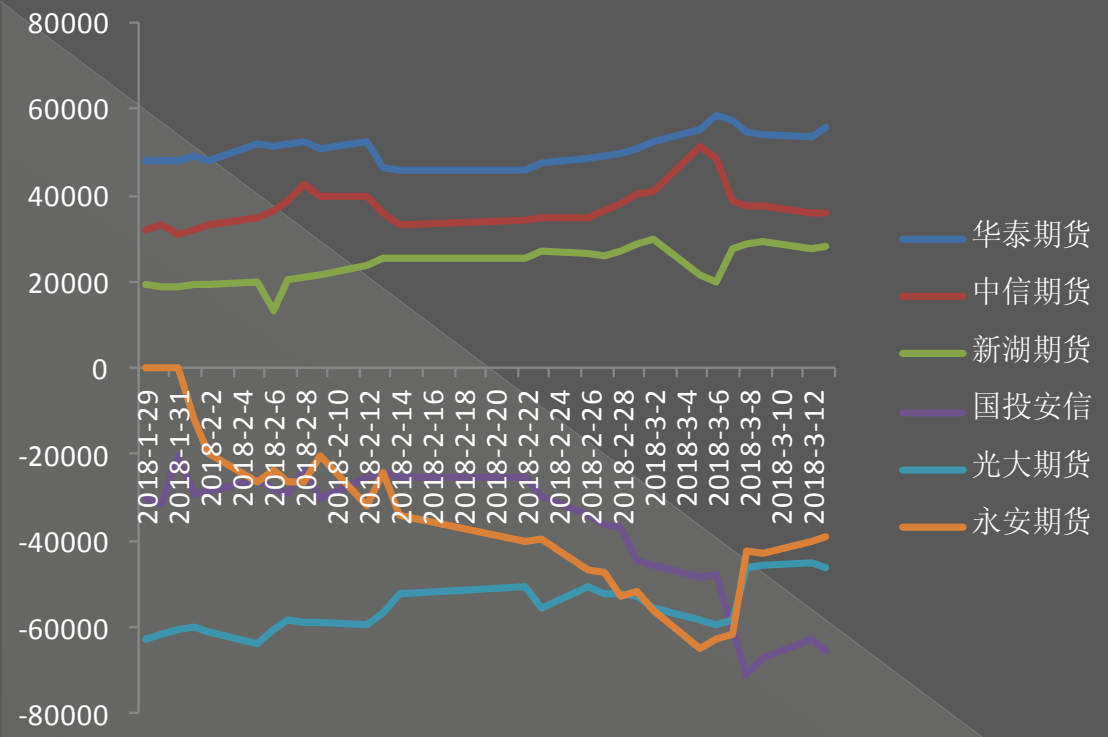




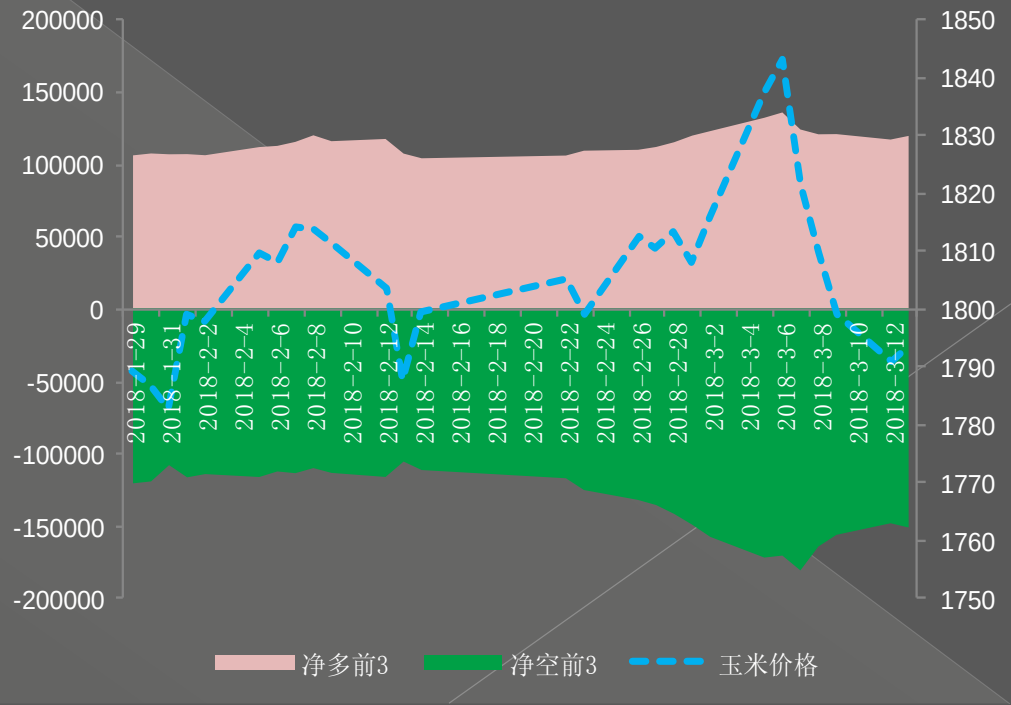
变动幅度		当日	最近5日	平均变化	波动率
sr持仓	多头前3	2.76%	2.66%	0.53%	7.85%
	空头前3	-0.90%	35.04%	7.01%	
sr涨幅		0.28%	0.38%	0.08%	
震荡幅度	0.41%	0.78%(月均值)	投机度	0.35	0.44(月均值)

大陆期货

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	2.15%	-11.96%	-2.39%	9.08%
	空头前3	1.97%	-11.36%	-2.27%	
c涨幅		0.17%	-2.66%	-0.53%	
震荡幅度	0.53%	0.82%(月均值)	投机度	0.37	0.43(月均值)



部分机构资金变动表

制表日期：2018年3月13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	-925.13	-0.52%	-53502.23	-23.31%
南华期货	-2413.51	-3.39%	-6889.11	-9.11%
混沌天成	-527.02	-1.66%	-340.96	-1.08%
海通期货	-189.25	-0.16%	-24942.03	-17.44%
上海大陆	1212.89	32.17%	3598.42	259.93%
中信期货	-12655.81	-5.57%	-25594.58	-10.65%
新湖期货	-5591.59	-7.96%	-7867.77	-10.85%

中粮期货	-7661.12	-3.72%	-9140.54	-4.41%
中信建投	6848.70	19.32%	-8789.51	-17.21%
申银万国	-3600.57	-11.86%	-10345.74	-27.88%
华泰期货	-16402.01	-15.11%	-29848.95	-24.47%
光大期货	11047.88	18.75%	-12205.58	-14.85%
一德期货	-2050.18	-1.78%	19917.94	21.40%
国投期货	-11109.15	-15.66%	-6714.62	-10.09%
金瑞期货	-4133.15	-3.57%	15582.29	16.24%
鲁证期货	5855.59	7.80%	-4158.19	-4.89%
中国国际	-4502.69	-6.68%	-3336.97	-5.04%

部分机构持仓一览

机构	永安期货					
日期	2018-3-6	2018-3-7	2018-3-8	2018-3-9	2018-3-12	2018-3-13
黄金	3925	3921	4465	4060	3756	3795
白银						
沪铜	20089	19872	18194	11914	10586	9625
沪铝		646	-145	812		
沪镍	4685				6041	
沪锌	-3917	-4313	-6513	-7505	-7574	-6418
沪铅				798		
螺纹钢						
铁矿石		5411	3784	-6744	-29182	-37341
焦煤				1787		
焦炭	4754	3179	2609	5455	-2307	-4702
豆油	25773	22782	22143	24603	25282	24627
棕榈油	-6108	-7369	-5884	-7656	-8628	-7583
菜籽油	13001	12826	13758	8015	8557	7281
豆粕	152901	167453	170172	95349	62158	60343
菜籽粕	7963	10611	8250	7501	5091	5451
棉花			5693	3720	8883	11230
白糖			-4124			
玉米	-62930	-61724	-42464	-42719	-40293	-39308
鸡蛋				-125	-24	358
PTA						
聚乙烯	13101	14398	10132	15740		
聚丙烯	19750	22726	26347	22842	10769	9492
甲醇	19716	20497	22491	17823	7706	10815
玻璃						
橡胶	-22626	-23234	-22450	-21976	-22272	-22579
沥青	-4490		-4021		-14023	-8007
动力煤	24475	24204	24559	26661	26072	29187

部分机构持仓一览

机构	南华期货					
日期	2018-3-6	2018-3-7	2018-3-8	2018-3-9	2018-3-12	2018-3-13
黄金	-908	-797	-951	-1043	-1123	-1165
白银	8008	9376		8273	8796	8468
沪铜	4600	4705	4716	5355		
沪铝	-6803	-7537	-14572	-10507	-11710	-10746
沪镍						
沪锌						
沪铅	-507		-558		-779	-967
螺纹钢	24868	-23151		26754	33146	36781
铁矿石						
焦煤						
焦炭	-3383	-3409	-3325	-3301	-2234	
豆油	13245	12022	11212	11628	9822	9758
棕榈油						
菜籽油						
豆粕				-30664		
菜籽粕						
棉花						
白糖	4767	5262	5218	5084	5236	4944
玉米	-18281					
鸡蛋	2425					
PTA		13706	14349	14011	15800	14894
聚乙烯	12867	16633	17114	16994	18509	18911
聚丙烯	-14970	-13783	-8680	-8605	-7615	-8204
甲醇				1737	623	838
玻璃					4916	4805
橡胶		1205	1336	1011	2020	1960
沥青						-4527
动力煤						

部分机构持仓一览

机构	国泰君安					
日期	2018-3-6	2018-3-7	2018-3-8	2018-3-9	2018-3-12	2018-3-13
黄金	3650	3937	3337	3939	4528	4037
白银	-16050	-15506	-16006	-16727	-16059	-16031
沪铜	6409	4789	5144	5004	7125	5702
沪铝	12089	11682	12495	12653	12479	12823
沪镍						
沪锌						
沪铅					702	767
螺纹钢	41908	42686	52653	54324	56707	58874
铁矿石	28803	11698	11745	11821	12639	28152
焦煤				-892		
焦炭	-693			-504		-382
豆油	1744	1288		1731	1705	
棕榈油						
菜籽油	36524	35929	36043	35838	35849	35891
豆粕					30016	
菜籽粕	10456	10490	10529	10388	10565	10562
棉花						
白糖	-7667	-8205	-8181	-7971	-7563	-7502
玉米						
鸡蛋	1080		1244	1172	818	703
PTA	21952					
聚乙烯		-7070	-7695			-5140
聚丙烯	7048	7241	8382	8489	8272	8448
甲醇	-8286	-7888	-6797	-5706	-3392	-1985
玻璃			4462			
橡胶	-4150	-4217	-4354	-4342	-4146	-4800
沥青						
动力煤						

部分机构持仓一览

机构	混沌天成					
日期	2018-3-6	2018-3-7	2018-3-8	2018-3-9	2018-3-12	2018-3-13
黄金						
白银						
沪铜	-8442	-8424	-8448	-8447	-8432	-8442
沪铝						
沪镍	-9076	-8982	-8939	-9192	-9427	-8987
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	2018-3-6	2018-3-7	2018-3-8	2018-3-9	2018-3-12	2018-3-13
黄金	4641	3218	4750	4138	5093	4988
白银	13354	16081	16369	13959	14734	12689
沪铜	-14381	-15132	-15303	-15112	-16066	-15314
沪铝	-3974	-8572	-6248	-8932	-11247	-11511
沪镍	9152	8784	9142	9519	11667	10810
沪锌	2426					
沪铅	1557	1568	1709	3343	3454	3448
螺纹钢	-13383					
铁矿石	-7316	-9071	-10900	-12231	-11534	-8485
焦煤					-1570	
焦炭	1516	557				1031
豆油	7470					
棕榈油	8242	7544	7541	7786	7137	
菜籽油	-5189	-5991	-4932	-5578	-5113	-4906
豆粕	40107	38676	36735	37229		32961
菜籽粕	10083	8273	9032	7895	9368	6810
棉花						
白糖	-3738			-6902	-6834	-7433
玉米	29117	27948	26749	25153	26330	20688
鸡蛋	1652	1136	1252	1017	453	727
PTA	28613	20993	16011	13417		
聚乙烯	-4155		-6213		-6924	-5735
聚丙烯	15269	14124		5010		
甲醇	-5003	1293				-3054
玻璃						
橡胶						
沥青						
动力煤	-4216	-3579		-4196		

部分机构持仓一览

机构	上海大陆					
日期	2018-3-6	2018-3-7	2018-3-8	2018-3-9	2018-3-12	2018-3-13
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				6458	7424	9734
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	-5055		-4242	-6320		
动力煤						

部分机构持仓一览

机构	中粮期货					
日期	2018-3-6	2018-3-7	2018-3-8	2018-3-9	2018-3-12	2018-3-13
黄金						
白银		7978				
沪铜	-10969	-10008	-13223	-12731	-11517	-7312
沪铝	-6552	-6041	-6346	-5823	-7530	-5620
沪镍	6527	6839	7018	6907	6858	7023
沪锌	-3634	-3769	-6404	-8379	-6136	-5787
沪铅						
螺纹钢						
铁矿石						
焦煤						
焦炭		2479	2381			
豆油	-60294	-59177	-55649	-54721	-52221	-51064
棕榈油	-28863	-28115	-26194	-24929	-25089	-24064
菜籽油	-18513	-21637	-21715	-21096	-20689	-18344
豆粕	-140455	-143857	-141085	-135236	-132169	-143220
菜籽粕	-53083	-57022	-58282	-57286	-56395	-55721
棉花	-10428	-9667	-8746	-8776	-8846	-8368
白糖	-15128	-17365	-19124	-19961	-22668	-22565
玉米	-31313	-32809	-47288	-43079	-39217	-38198
鸡蛋	2699	2645	2633	2627	2678	2624
PTA						-17225
聚乙烯						
聚丙烯						
甲醇		-5478				
玻璃	-6489	-4686	-5224	-6315	-5145	-4850
橡胶	-6900	-7225	-7675	-7667	-7593	-7713
沥青						
动力煤	-5428	-5543	-5788	-5922	-6203	-6419

部分机构持仓一览

机构	中信期货					
日期	2018-3-6	2018-3-7	2018-3-8	2018-3-9	2018-3-12	2018-3-13
黄金	6451	7195	7200	8299	7967	7659
白银	-39854	-30306	-35228	-39080	-36691	-36724
沪铜	-23878	-23688	-23963	-24605	-24935	-23466
沪铝	-27797	-27260	-26655	-26488	-28316	-25894
沪镍						5433
沪锌	-6372	-3379				
沪铅	-2874	-3273	-3192	-3889	-3622	-3284
螺纹钢						
铁矿石	-14946	-19043	-13597	-5728		
焦煤	6645	6472	6022	6293	7031	6543
焦炭			1626	850	2355	2775
豆油	-9788	-8666	-10996	-14739	-18210	-16481
棕榈油	-10332	-11337	-11360	-13512	-14050	-13571
菜籽油	-10532	-12330	-12612	-12953	-12743	-12540
豆粕	83884	95512	91759	91918	74302	74631
菜籽粕	15364	21356	21566	20580	19917	19615
棉花	4008	4170	5363	4750	4297	
白糖	-7662	-9675	-10422	-11188	-10931	-10756
玉米	48654	38878	37684	37711	35705	35878
鸡蛋	-145				-338	-390
PTA	35919	32374	31242	29200	15257	
聚乙烯	-6815	-6557	-6766	-9337	-5726	-6109
聚丙烯	8789	8258	6139	6061		
甲醇	-6700	-7236	-6068	-3745	-1716	-1578
玻璃	11258	11531	10976	10673	11972	11667
橡胶						
沥青		-3869			-4129	-4941
动力煤						

部分机构持仓一览

机构	中信建投					
日期	2018-3-6	2018-3-7	2018-3-8	2018-3-9	2018-3-12	2018-3-13
黄金						
白银			10254	10558	9685	9496
沪铜						
沪铝						
沪镍	8124	7939	8134	7954	6617	
沪锌						
沪铅						
螺纹钢						33186
铁矿石				1648		
焦煤						
焦炭	2739	976				
豆油						
棕榈油	-8896	-10412	-8884	-11020	-10296	-12240
菜籽油						
豆粕	50988	51175	51000	51896	50848	51924
菜籽粕						
棉花	7870	7342				
白糖						
玉米	13516	13353				
鸡蛋					582	461
PTA						
聚乙烯						
聚丙烯						
甲醇						
玻璃	-5171	-4540			-4824	-4886
橡胶						
沥青		5010	4985	4187	3526	4709
动力煤						

部分机构持仓一览

机构	新湖期货					
日期	2018-3-6	2018-3-7	2018-3-8	2018-3-9	2018-3-12	2018-3-13
黄金	-1108	-998	-1177	-614	-619	-712
白银						
沪铜	6451	6322	6207	6324	6750	6746
沪铝						
沪镍	-7095		-7121		-7023	
沪锌						
沪铅						
螺纹钢						
铁矿石						
焦煤						
焦炭						
豆油	-7172					
棕榈油	8760	8738	9556	10206	10033	9782
菜籽油	-5608	-5321	-5184	-4583	-4536	-7298
豆粕	-51705	-87045	-81513	-82181	-74847	-73484
菜籽粕						
棉花	3706		3650	3622		
白糖						
玉米	19930	27651	28705	29294	27882	28406
鸡蛋	-270	-326	-306	-365	-223	-176
PTA	-25003	-25348	-25642	-28739	-28724	-28776
聚乙烯						
聚丙烯						
甲醇						
玻璃						
橡胶						
沥青						
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