大陆期货

市场持仓分析

2018/3/19

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
玉米	711.15%	836.04%	1228.37%	-890.11%	-1020.21%	-1360.47%	1601.26%	☆☆☆☆☆
铁矿石	244.90%	282.04%	311.61%	-159.61%	-242.44%	-312.91%	404.51%	☆☆☆☆☆
豆粕	126.81%	98.34%	83.66%	-164.84%	-155.67%	-118.51%	291.65%	☆☆☆☆☆
聚乙烯	120.03%	147.10%	233.23%	-169.27%	-177.26%	-213.34%	289.30%	☆☆☆☆☆
豆油	40.64%	49.22%	67.82%	-83.42%	-97.95%	-83.93%	124.06%	☆☆☆☆☆
棕榈油	41.78%	49.40%	71.78%	-78.57%	-69.51%	-74.35%	120.35%	☆☆☆☆☆
鸡蛋	36.10%	39.57%	60.99%	-69.62%	-77.54%	-69.42%	105.72%	☆☆☆☆☆
聚丙烯	38.19%	47.32%	41.82%	-52.98%	-41.92%	-29.80%	91.17%	☆☆☆☆☆
焦煤	9.10%	8.06%	17.97%	-14.90%	-12.00%	-14.62%	24.00%	☆☆☆☆
沥青	14.52%	11.70%	7.55%	0.97%	-0.54%	0.86%	13.54%	☆☆☆
沪银	9.89%	7.73%	3.59%	-0.99%	-1.81%	-1.10%	10.88%	☆☆☆
焦炭	18.81%	25.67%	22.44%	12.03%	1.80%	-18.40%	6.78%	☆☆
甲醇	6.89%	9.84%	10.84%	2.78%	-0.04%	-4.98%	4.11%	☆
棉花	4.05%	4.14%	2.82%	1.11%	1.27%	-0.96%	2.94%	☆
沪铝	1.77%	1.51%	-0.32%	-0.95%	0.59%	-0.74%	2.72%	☆
沪铜	1.98%	1.82%	0.63%	0.02%	0.24%	-3.08%	1.96%	☆
玻璃	3.68%	1.42%	1.44%	2.08%	1.91%	-1.19%	1.59%	☆
沪镍	-0.05%	-3.18%	-1.14%	-1.23%	-1.45%	-1.20%	1.18%	☆
菜籽粕	1.29%	-2.51%	-3.31%	0.14%	1.29%	1.53%	1.16%	☆
动力煤	2.23%	0.68%	1.57%	3.26%	3.28%	-2.62%	-1.03%	☆
螺纹钢	-8.81%	-3.10%	1.04%	-6.47%	-6.93%	-0.85%	-2.34%	☆
PTA	0.93%	-2.04%	-2.61%	3.43%	3.10%	2.09%	-2.50%	☆
橡胶	-1.60%	-1.12%	-0.29%	1.29%	1.54%	2.14%	-2.89%	☆
沪锌	-0.05%	-0.40%	-0.52%	4.76%	3.55%	3.24%	-4.81%	☆
沪金	0.72%	-0.63%	-0.12%	7.45%	0.43%	-4.05%	-6.73%	☆☆
白糖	-2.23%	-3.67%	-3.12%	4.66%	4.44%	1.33%	-6.88%	☆☆

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
焦煤	35.82%	33.81%	27.36%	-19.50%	-20.64%	-17.73%	55.33%	☆☆☆☆
玻璃	19.16%	11.67%	-4.34%	-4.61%	-3.29%	6.53%	23.77%	☆☆
豆粕	11.56%	6.15%	2.03%	-8.85%	-12.00%	-5.61%	20.41%	☆☆
聚乙烯	14.61%	11.12%	12.86%	-4.26%	-6.29%	-1.75%	18.87%	☆☆
沥青	35.05%	23.24%	11.59%	16.31%	10.12%	3.79%	18.74%	☆☆
焦炭	17.68%	21.62%	21.36%	-0.12%	-3.23%	-20.09%	17.80%	☆☆
豆油	2.57%	4.46%	7.34%	-14.70%	-18.74%	-6.88%	17.27%	☆☆
鸡蛋	-2.17%	0.24%	2.60%	-14.81%	-13.49%	-7.63%	12.64%	☆☆
沪银	7.61%	12.47%	6.39%	-3.85%	-4.93%	-6.09%	11.46%	☆☆
橡胶	7.55%	7.15%	4.79%	-2.78%	-3.37%	-2.26%	10.33%	☆☆
菜籽粕	4.91%	1.54%	-8.30%	-3.16%	-2.37%	6.39%	8.07%	☆
PTA	2.71%	2.80%	-1.83%	-4.31%	-1.41%	3.54%	7.02%	☆
螺纹钢	-3.08%	1.51%	3.94%	-8.56%	-9.52%	0.30%	5.48%	☆
沪镍	0.79%	2.88%	1.07%	-3.82%	-0.08%	3.72%	4.61%	☆
铁矿石	-1.54%	3.35%	4.47%	-3.70%	-5.08%	-5.12%	2.16%	☆
沪锌	11.11%	5.02%	1.03%	9.19%	5.70%	0.27%	1.92%	☆
沪金	1.04%	-0.60%	-1.11%	-0.48%	-7.23%	-14.09%	1.52%	☆
棕榈油	-1.46%	-0.29%	1.47%	-0.76%	2.46%	3.28%	-0.70%	☆
动力煤	4.88%	3.17%	0.41%	6.07%	5.93%	-0.13%	-1.19%	☆
甲醇	1.28%	7.41%	1.95%	3.39%	1.79%	2.64%	-2.10%	☆
沪铜	0.18%	-0.27%	-2.26%	5.56%	6.73%	1.44%	-5.38%	☆
白糖	-0.74%	-0.21%	-2.41%	4.68%	3.54%	1.80%	-5.43%	☆
玉米	-4.35%	-1.15%	-2.45%	3.45%	1.92%	2.33%	-7.80%	☆
棉花	2.34%	0.06%	-1.29%	12.53%	9.34%	3.85%	-10.19%	☆☆
聚丙烯	-11.15%	-6.83%	-4.48%	2.37%	3.71%	0.64%	-13.52%	☆☆
沪铝	-10.00%	-7.67%	-8.09%	11.51%	11.35%	11.21%	-21.52%	☆☆

2018年3月19日机构持仓异动表

金属	
南华期货	黄金净空单变动幅度为：1722手
东证期货	白银净多单变动幅度为：7242手
海通期货	沪镍净多单变动幅度为：-5049手
首创期货	沪锌净多单变动幅度为：1894手
南华期货	沪铅净空单变动幅度为：710手

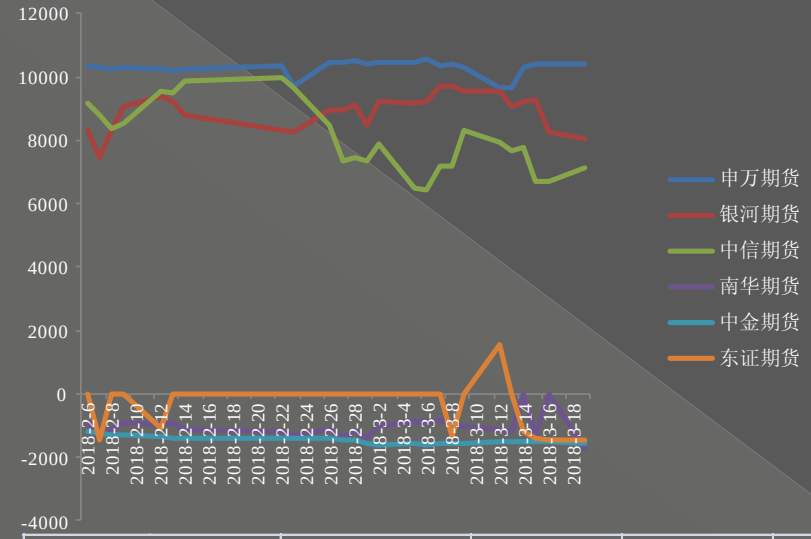
黑色	
永安期货	铁矿石净多单变动幅度为：-10721手
国联期货	铁矿石净多单变动幅度为：-9024手
金元期货	铁矿石净多单变动幅度为：-8758手
国贸期货	铁矿石净空单变动幅度为：-8391手
金瑞期货	铁矿石净多单变动幅度为：22638手
浙商期货	铁矿石净多单变动幅度为：16315手
徽商期货	铁矿石净多单变动幅度为：20726手
一德期货	铁矿石净空单变动幅度为：35094手
光大期货	铁矿石净空单变动幅度为：19867手
兴证期货	铁矿石净空单变动幅度为：21359手
中辉期货	焦煤净多单变动幅度为：1503手

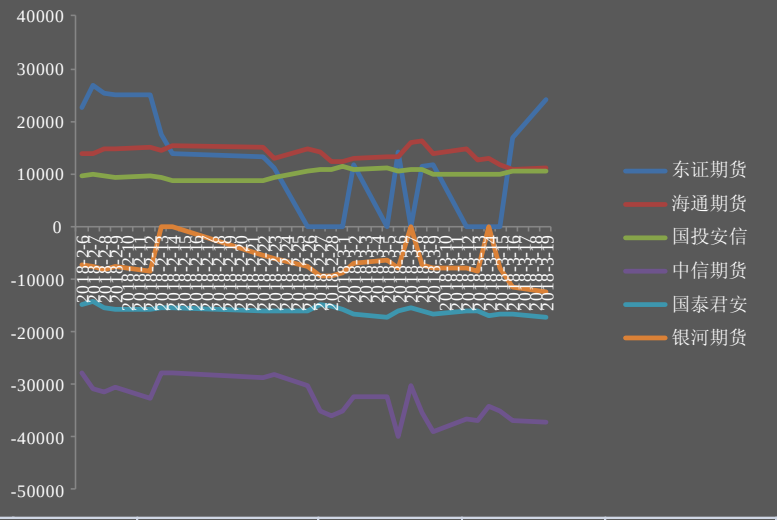
2018年3月19日机构持仓异动表

农产品	
五矿经易	豆油净多单变动幅度为：10212手
前海期货	豆油净多单变动幅度为：5136手
中粮期货	豆油净空单变动幅度为：22980手
国投安信	豆油净空单变动幅度为：16168手
摩根大通	豆油净空单变动幅度为：23903手
申银万国	棕榈油净多单变动幅度为：-7591手
摩根大通	棕榈油净多单变动幅度为：-5677手
和融期货	棕榈油净多单变动幅度为：10296手
上海大陆	棕榈油净多单变动幅度为：10157手
新湖期货	棕榈油净多单变动幅度为：5616手
中粮期货	棕榈油净空单变动幅度为：11024手

化工	
南华期货	聚乙烯净多单变动幅度为：6299手
徽商期货	聚乙烯净多单变动幅度为：10007手
建信期货	聚乙烯净空单变动幅度为：12675手
一德期货	聚乙烯净空单变动幅度为：7030手
国贸期货	聚乙烯净空单变动幅度为：10623手
申银万国	聚丙烯净多单变动幅度为：-5928手
长江期货	聚丙烯净多单变动幅度为：3670手
国泰君安	聚丙烯净多单变动幅度为：2686手
徽商期货	聚丙烯净空单变动幅度为：4987手
大地期货	甲醇净多单变动幅度为：-4965手
兴证期货	甲醇净多单变动幅度为：10311手

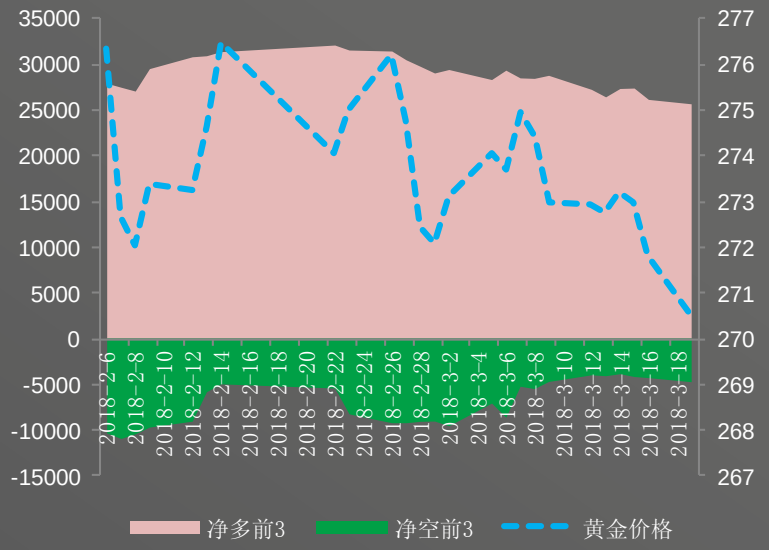
金属板块：AU & AG

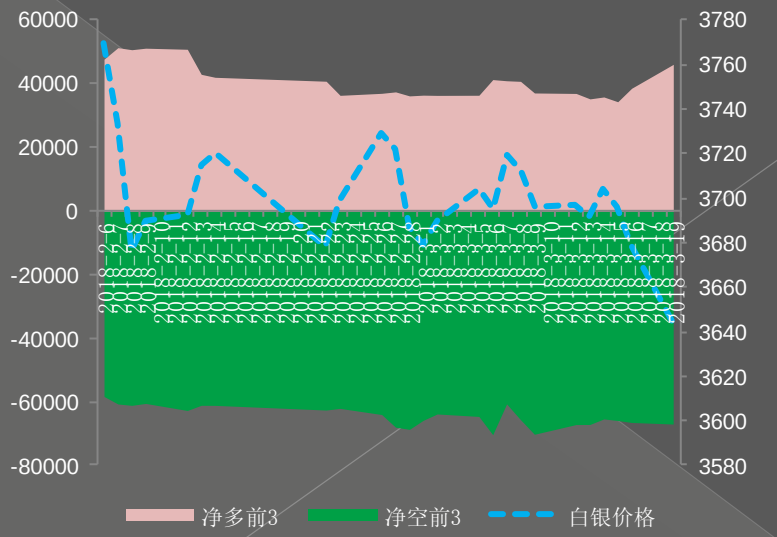




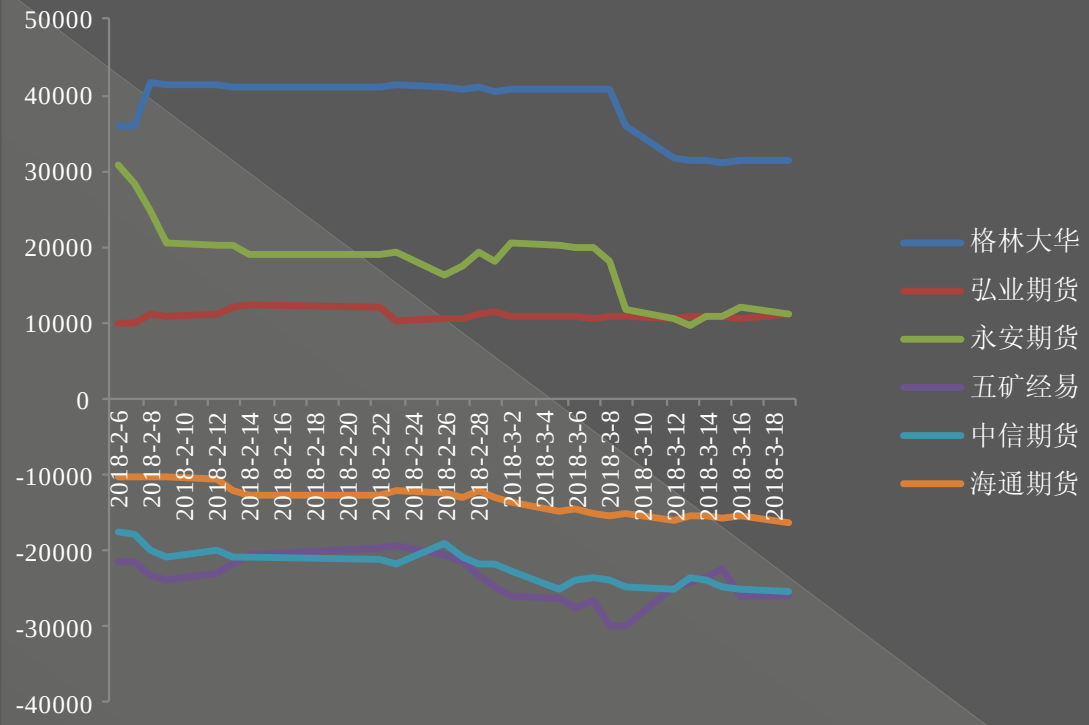
变动幅度		当日	最近5日	平均变化	波动率
au持仓	多头前3	-1.85%	-5.80%	-1.16%	7.13%
	空头前3	10.34%	18.75%	3.75%	
au涨幅		-0.48%	-0.89%	-0.18%	
震荡幅度	0.72%	0.62%(月均值)	投机度	0.37	0.35(月均值)

变动幅度		当日	最近5日	平均变化	波动率
ag持仓	多头前3	19.44%	24.70%	4.94%	8.46%
	空头前3	0.76%	-0.24%	-0.05%	
ag涨幅		-0.95%	-1.44%	-0.29%	
震荡幅度	1.46%	0.94%(月均值)	投机度	0.61	0.47(月均值)

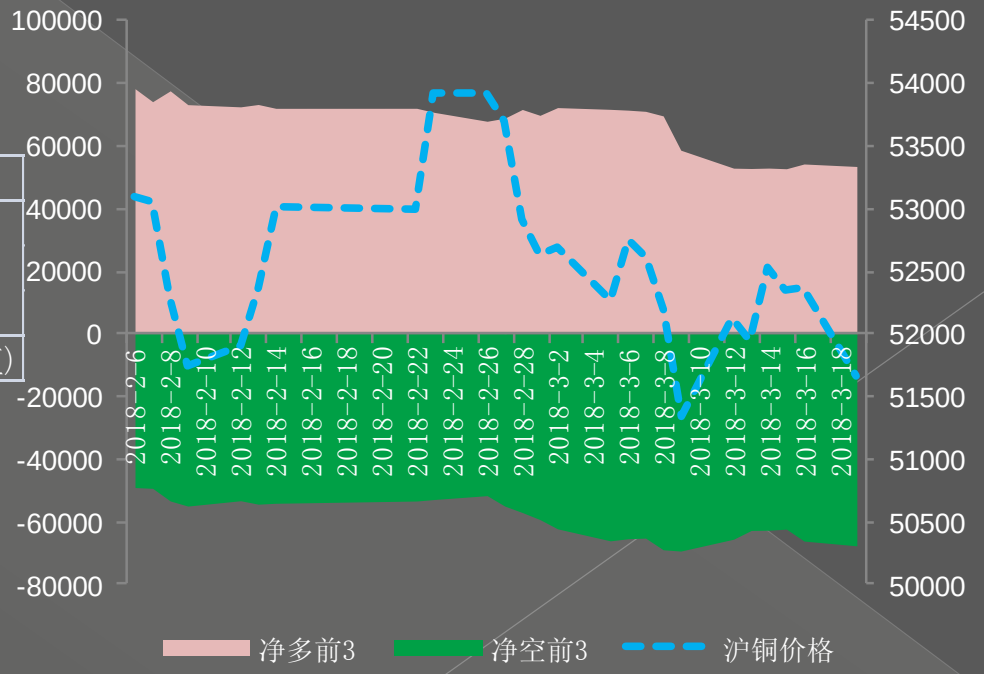




金属板块：Cu

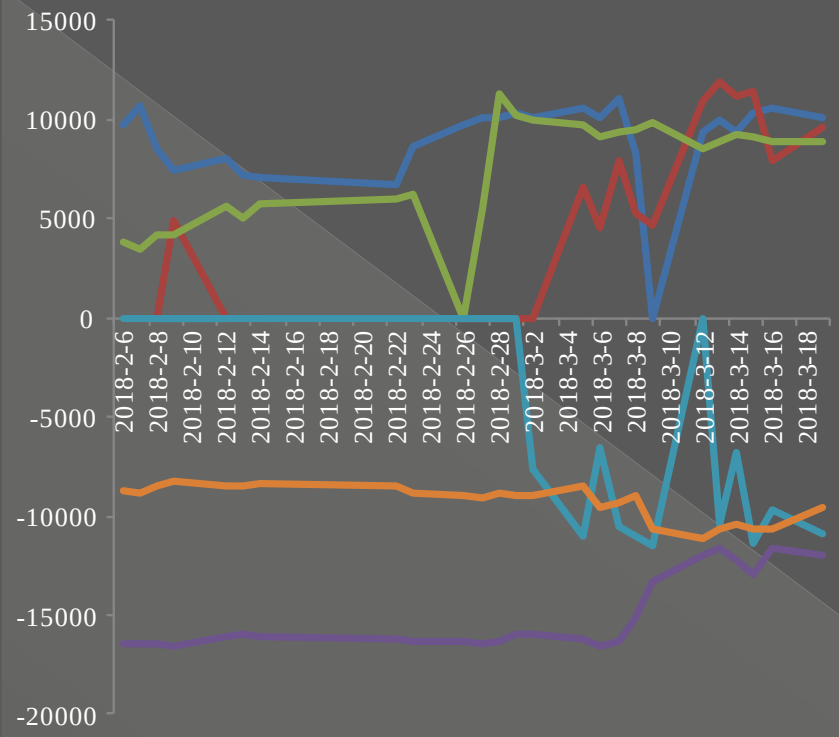


变动幅度		当日	最近5日	平均变化	波动率
cu持仓	多头前3	-1.46%	1.03%	0.21%	15.30%
	空头前3	2.31%	3.24%	0.65%	
cu涨幅		-1.36%	-0.89%	-0.18%	
震荡幅度	1.92%	1.35%(月均值)	投机度	0.54	0.50(月均值)

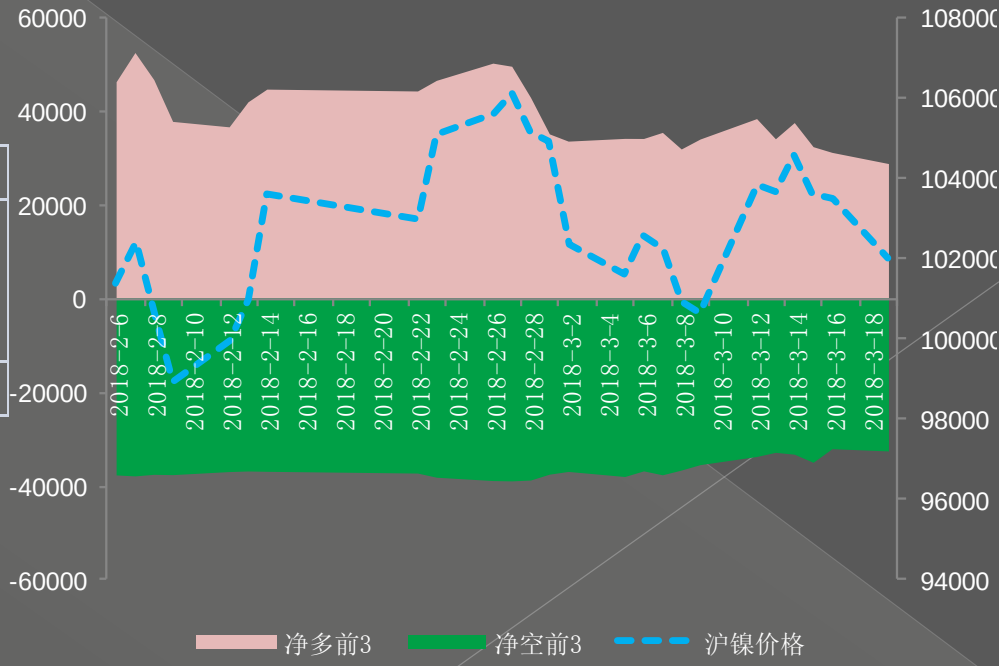


大陆期货

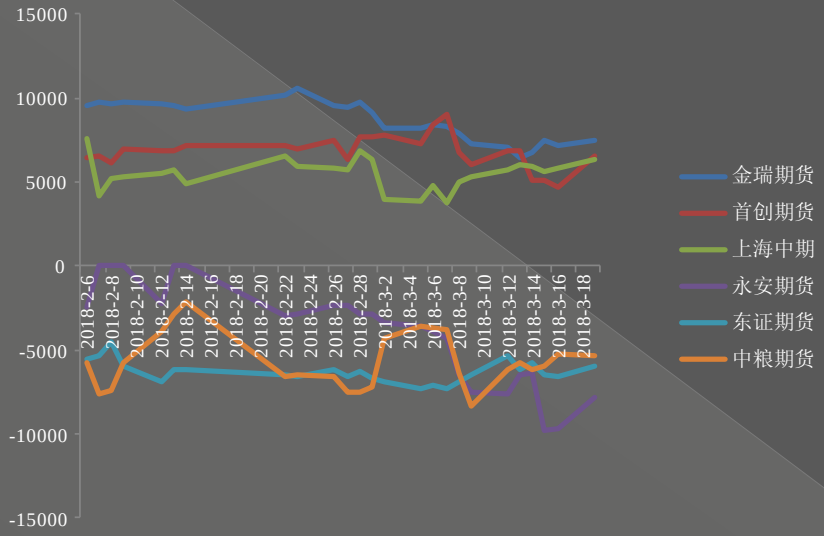
金属板块：Ni

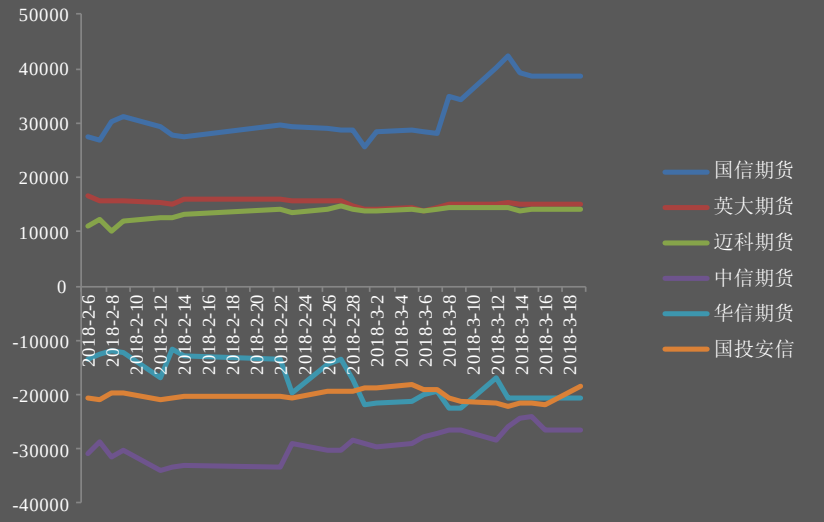


变动幅度		当日	最近5日	平均变化	波动率
ni持仓	多头前3	-7.70%	-25.11%	-5.02%	22.07%
	空头前3	1.49%	-3.50%	-0.70%	
ni涨幅		-1.45%	-1.78%	-0.36%	
震荡幅度	2.11%	2.09%(月均值)	投机度	1.77	1.44(月均值)



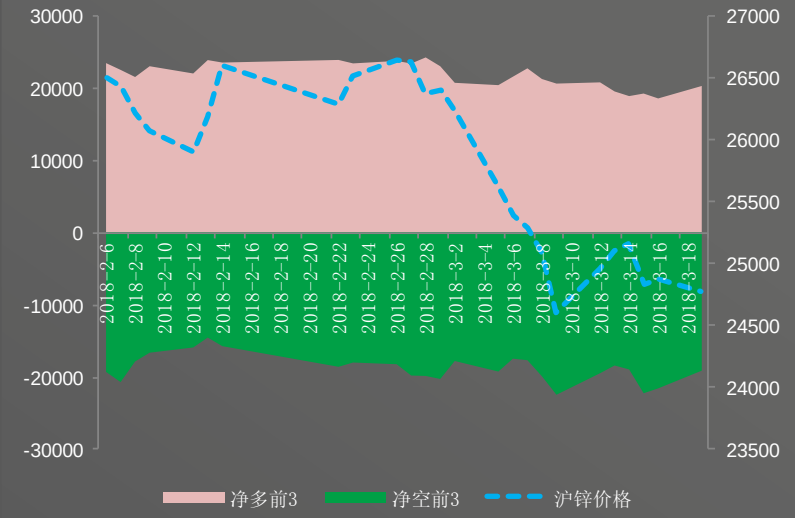
金属板块：Zn & Al

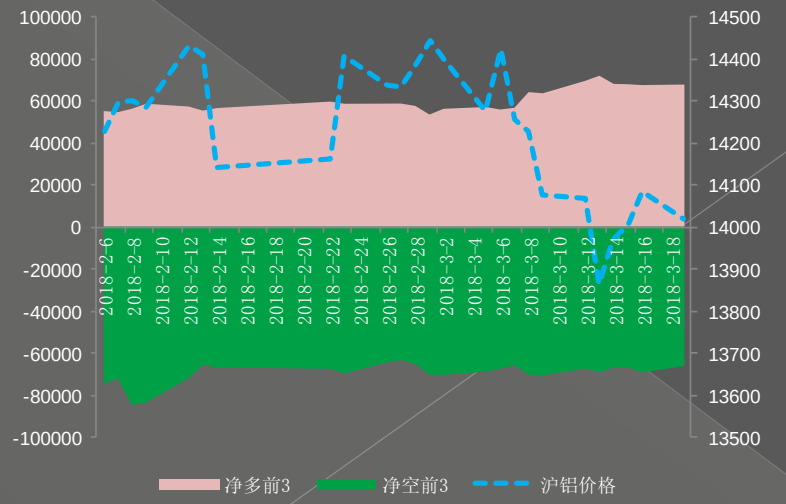




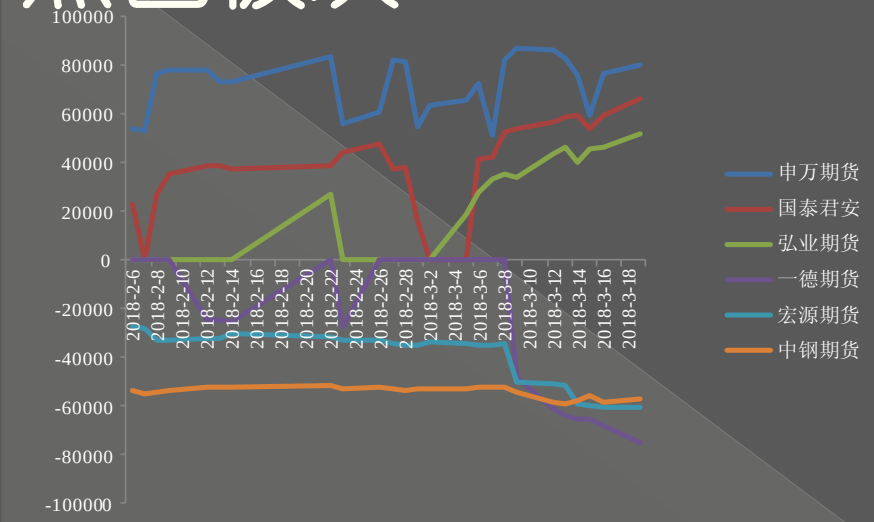
变动幅度		当日	最近5日	平均变化	波动率
zn持仓	多头前3	9.32%	-2.40%	-0.48%	16.22%
	空头前3	-11.35%	-1.83%	-0.37%	
zn涨幅		-0.41%	-0.77%	-0.15%	
震荡幅度	1.39%	1.58%(月均值)	投机度	1.32	1.25(月均值)

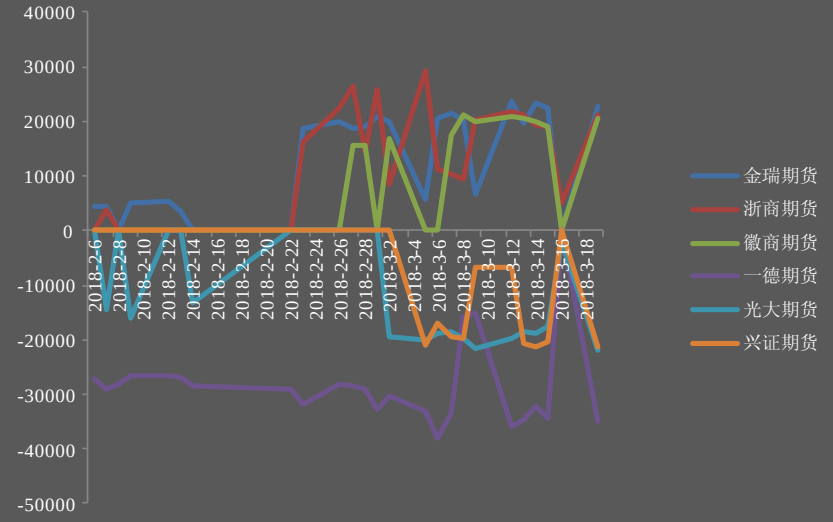
变动幅度		当日	最近5日	平均变化	波动率
al持仓	多头前3	0.36%	-2.56%	-0.51%	13.62%
	空头前3	-4.57%	-1.80%	-0.36%	
al涨幅		-0.44%	-0.34%	-0.07%	
震荡幅度	1.47%	1.52%(月均值)	投机度	0.44	0.59(月均值)





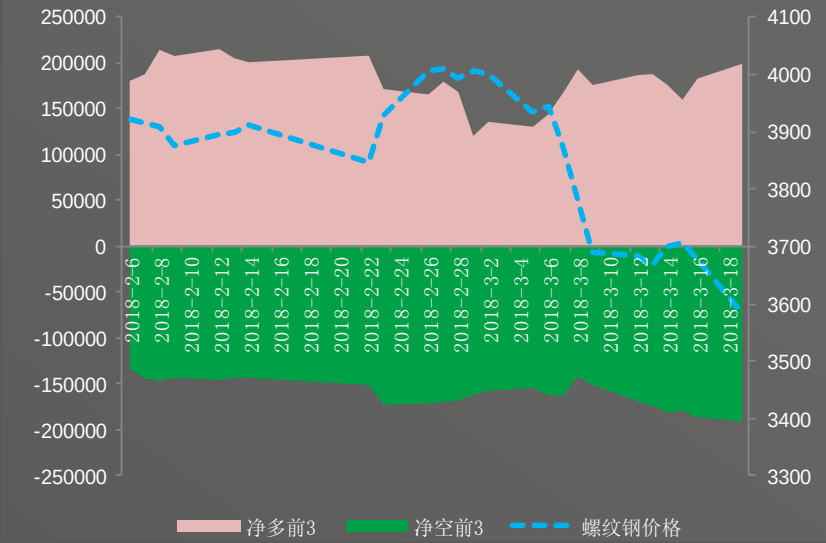
黑色板块：Rb & I

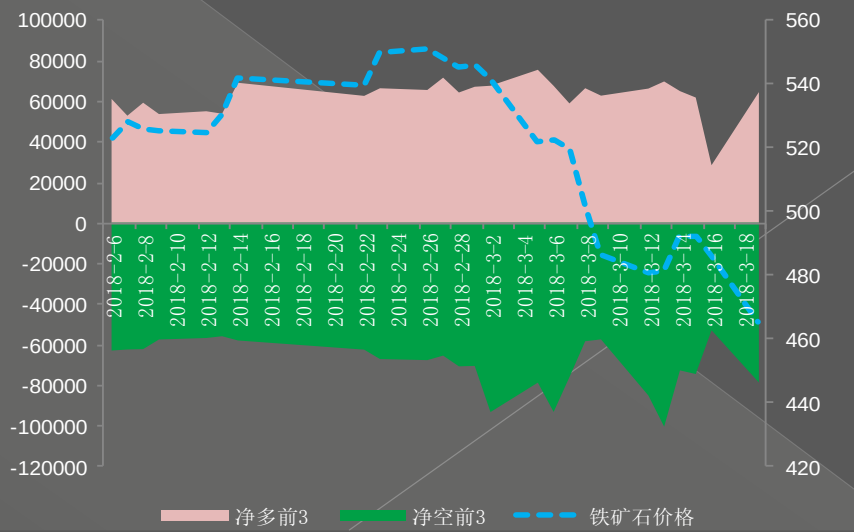




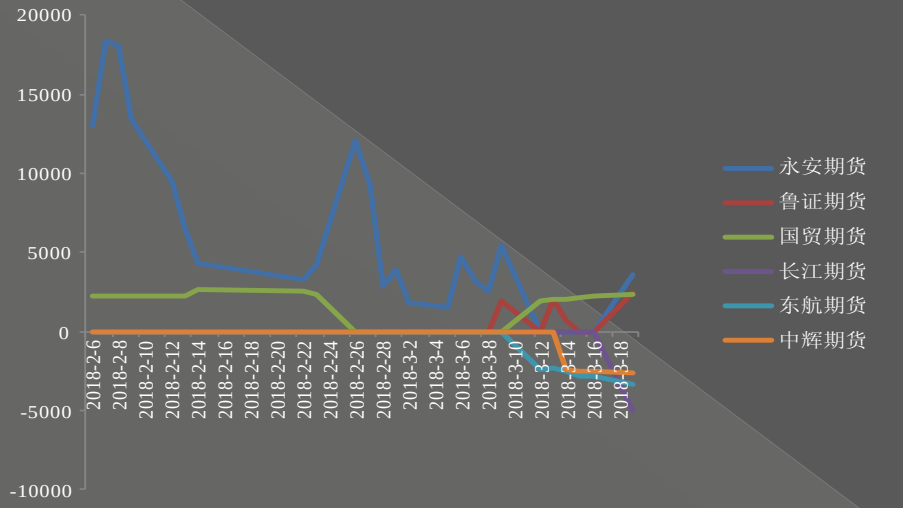
变动幅度		当日	最近5日	平均变化	波动率
rb持仓	多头前3	8.92%	6.65%	1.33%	20.26%
	空头前3	2.56%	12.90%	2.58%	
rb涨幅		-2.42%	-2.62%	-0.52%	
震荡幅度	2.84%	1.79%(月均值)	投机度	1.25	0.98(月均值)

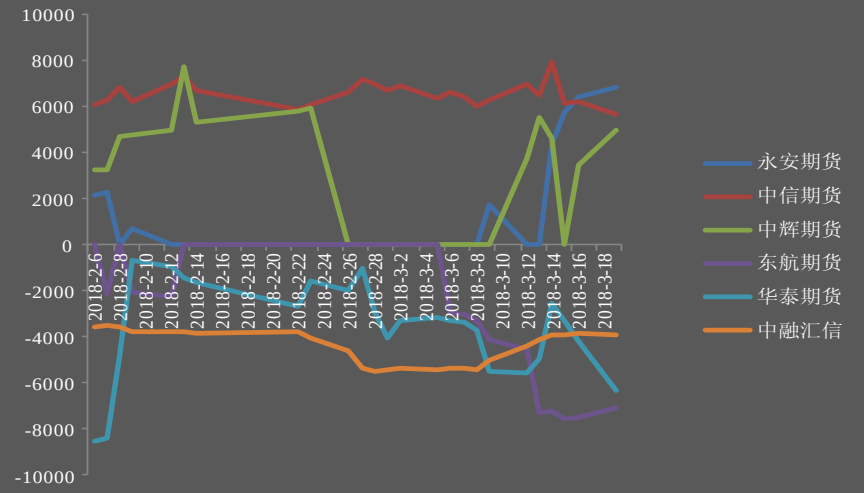
变动幅度		当日	最近5日	平均变化	波动率
I持仓	多头前3	126.97%	-2.64%	-0.53%	28.13%
	空头前3	48.61%	-7.52%	-1.50%	
I涨幅		-4.27%	-3.30%	-0.66%	
震荡幅度	4.36%	2.37%(月均值)	投机度	1.38	1.02(月均值)





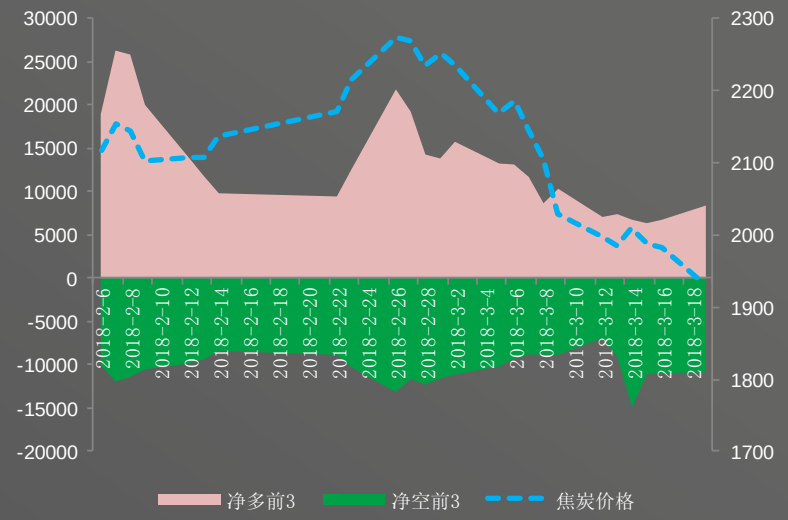
黑色板块：J & JM

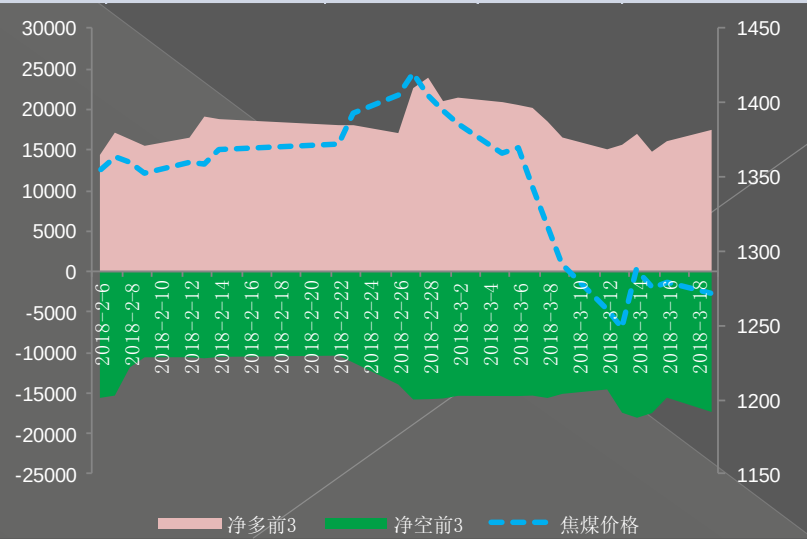




变动幅度		当日	最近5日	平均变化	波动率
j持仓	多头前3	24.38%	18.60%	3.72%	26.94%
	空头前3	-0.92%	56.99%	11.40%	
j涨幅		-2.62%	-3.30%	-0.66%	
震荡幅度	3.80%	2.69%(月均值)	投机度	1.63	1.13(月均值)

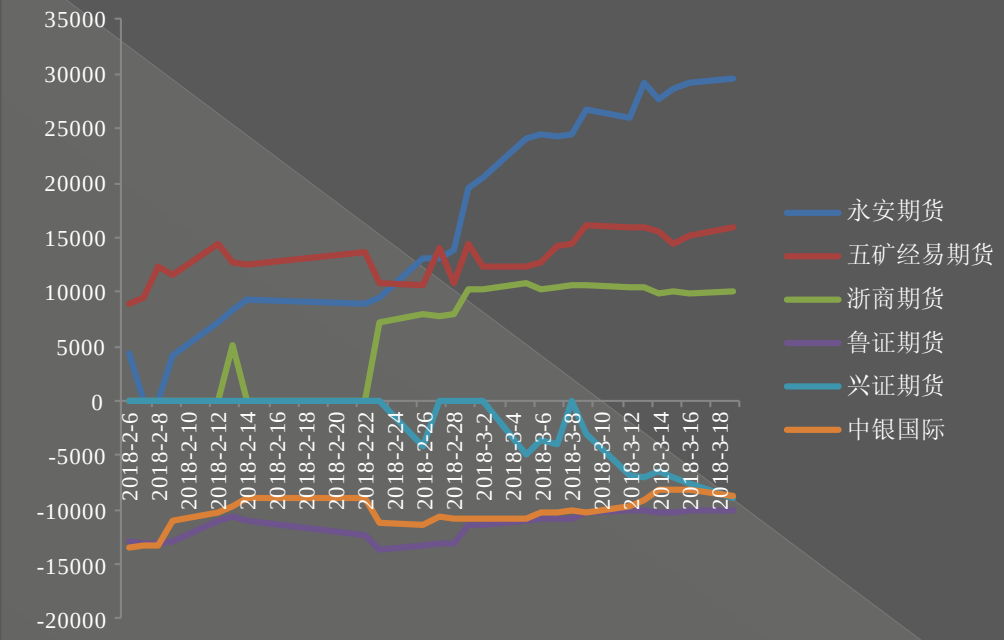
变动幅度		当日	最近5日	平均变化	波动率
jm持仓	多头前3	8.65%	15.83%	3.17%	20.95%
	空头前3	11.42%	19.24%	3.85%	
jm涨幅		-0.56%	0.87%	0.17%	
震荡幅度	4.29%	2.47%(月均值)	投机度	1.44	1.01(月均值)

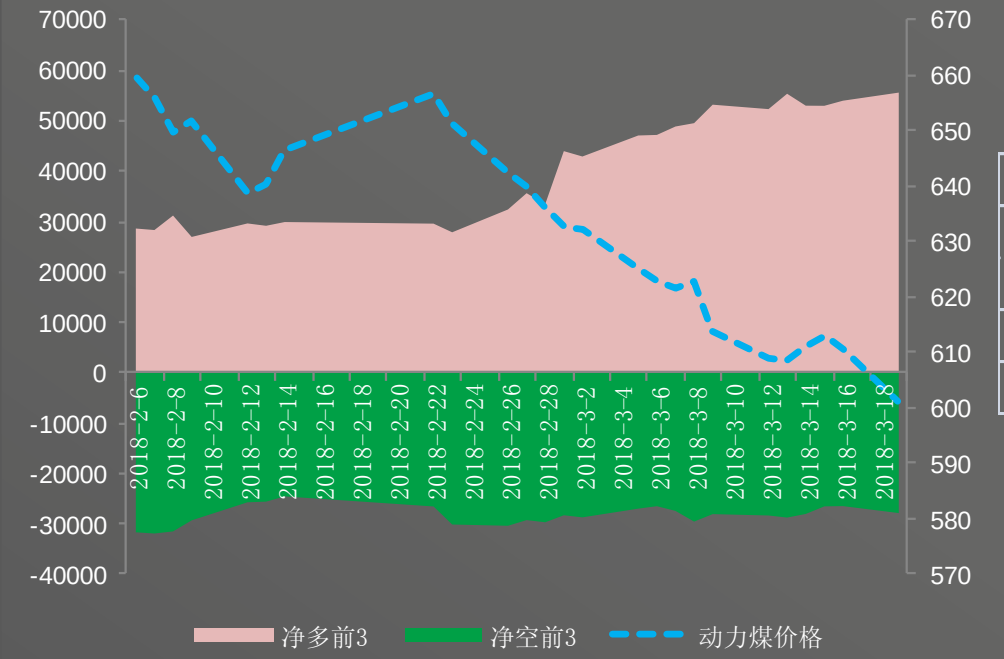




大陆期货

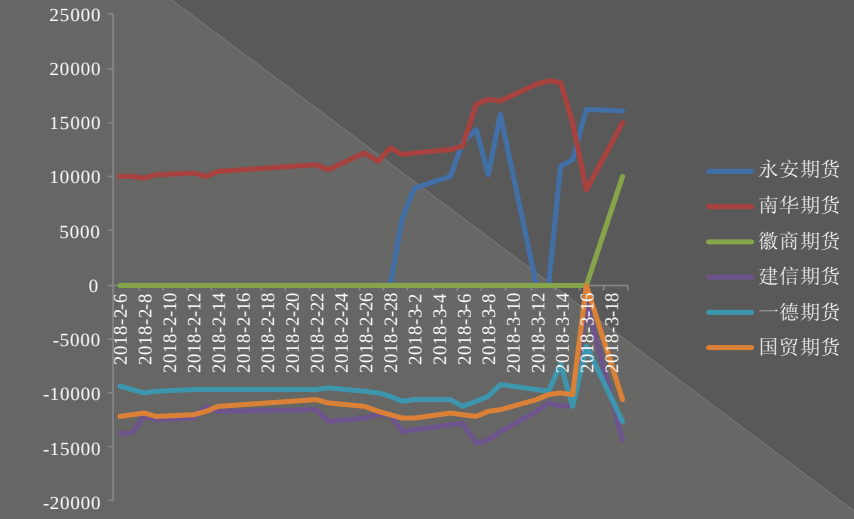
黑色：动力煤

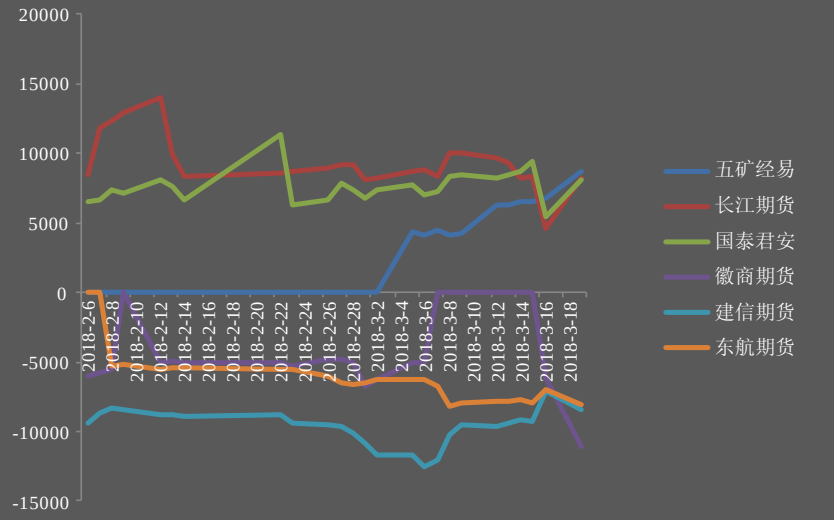




变动幅度		当日	最近5日	平均变化	波动率
zc持仓	多头前3	2.97%	6.25%	1.25%	13.45%
	空头前3	5.23%	-1.69%	-0.34%	
zc涨幅		-1.53%	-1.26%	-0.25%	
震荡幅度	2.15%	1.40%(月均值)	投机度	0.76	0.66(月均值)

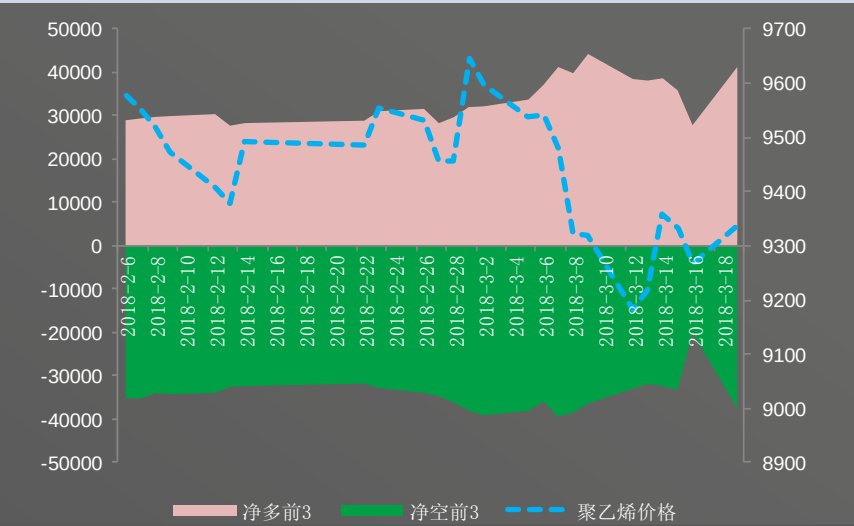
化工：塑料 & PP

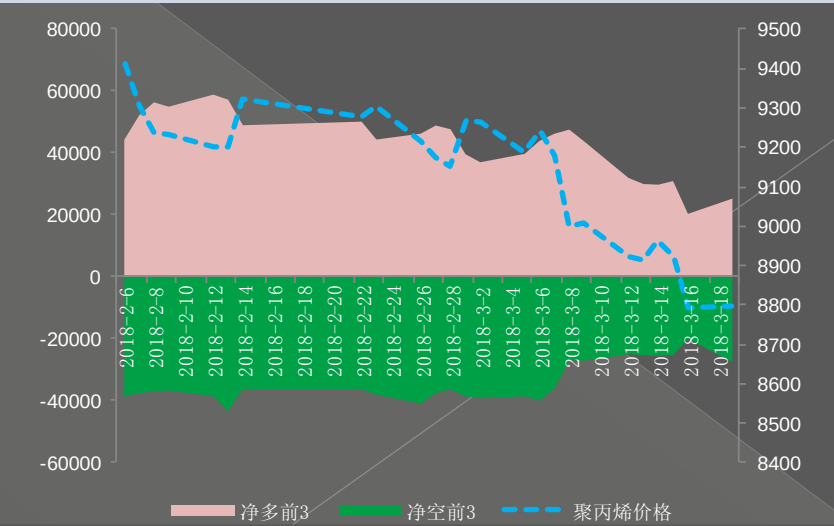




变动幅度		当日	最近5日	平均变化	波动率
l持仓	多头前3	48.59%	7.25%	1.45%	14.14%
	空头前3	86.50%	13.74%	2.75%	
l涨幅		0.77%	1.69%	0.34%	
震荡幅度	1.52%	1.29%(月均值)	投机度	0.78	0.60(月均值)

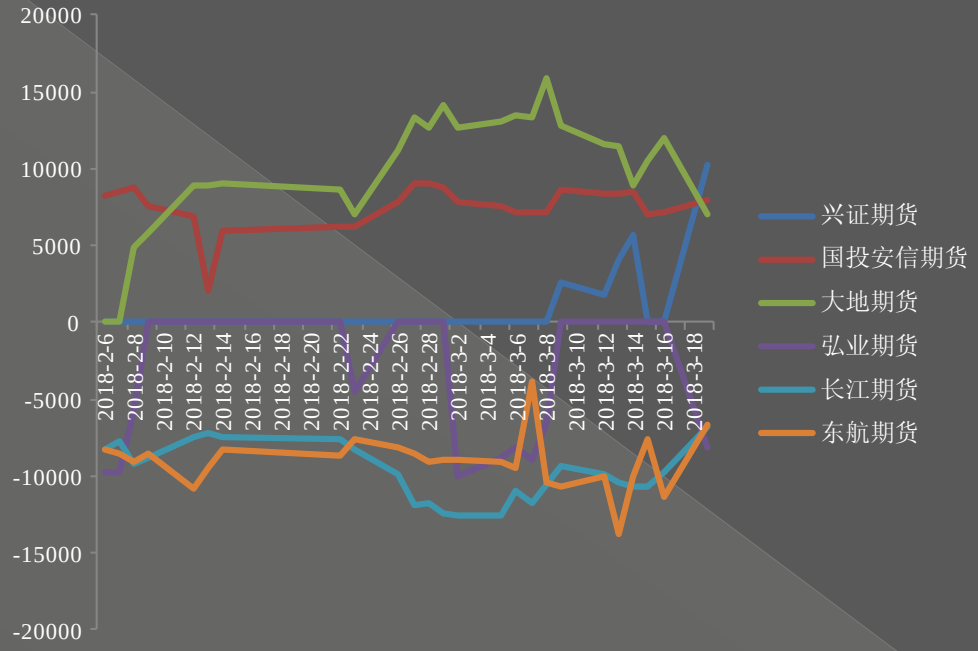
变动幅度		当日	最近5日	平均变化	波动率
pp持仓	多头前3	24.16%	-20.83%	-4.17%	12.39%
	空头前3	36.74%	9.97%	1.99%	
pp涨幅		0.01%	-1.41%	-0.28%	
震荡幅度	0.87%	1.25%(月均值)	投机度	0.64	0.61(月均值)

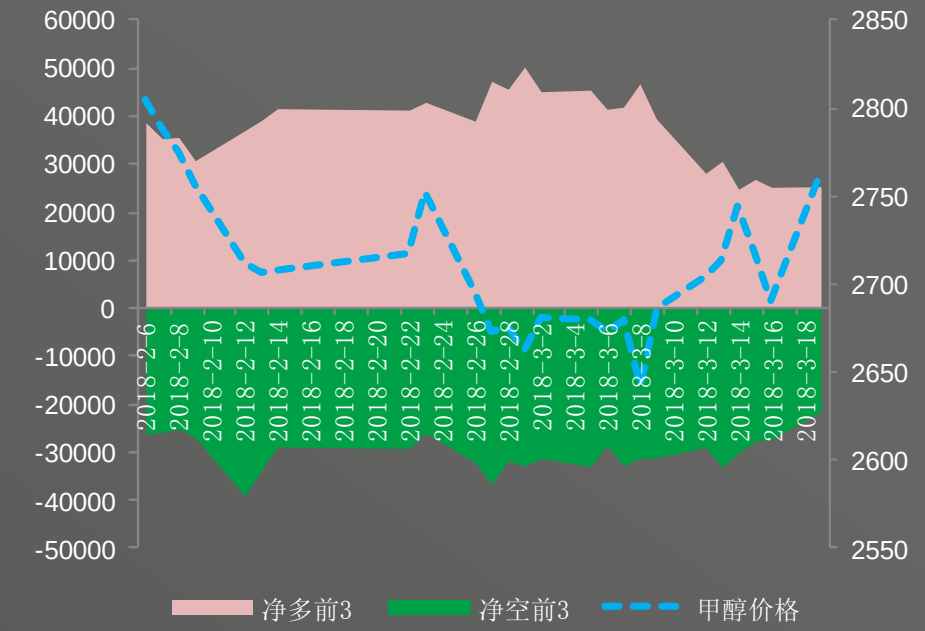




大陆期货

化工：甲醇

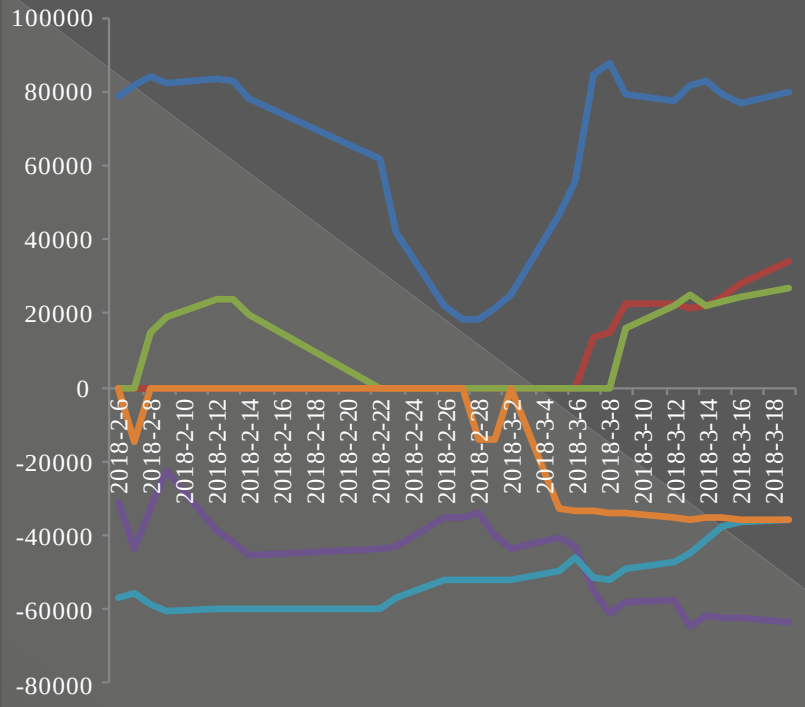


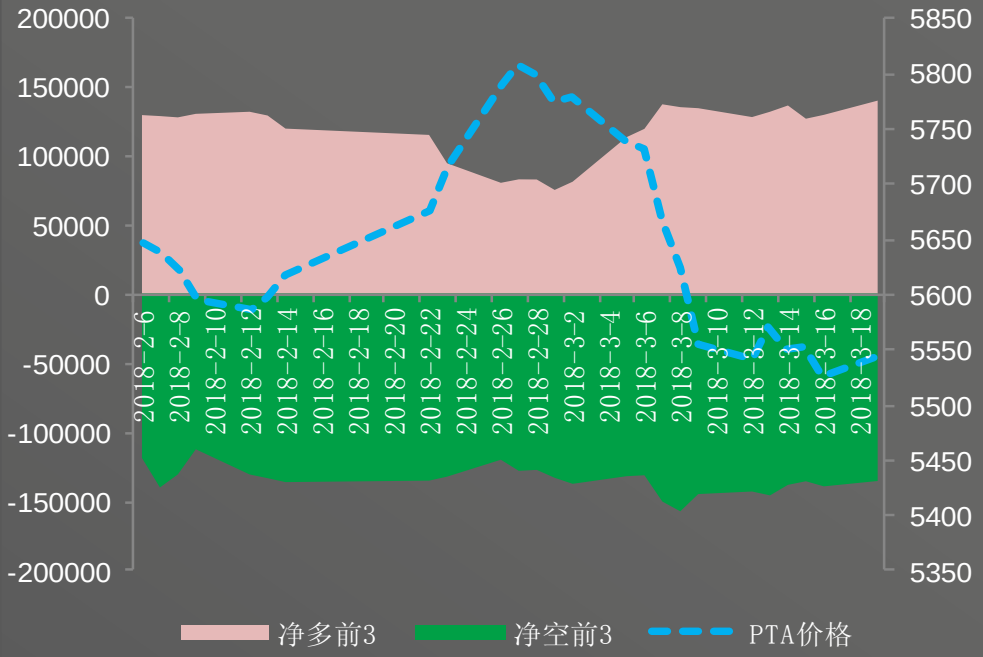


变动幅度		当日	最近5日	平均变化	波动率
ma持仓	多头前3	0.54%	-9.86%	-1.97%	17.89%
	空头前3	-21.11%	-25.82%	-5.16%	
ma涨幅		2.72%	2.21%	0.44%	
震荡幅度	3.04%	1.68%(月均值)	投机度	1.44	1.12(月均值)

大陆期货

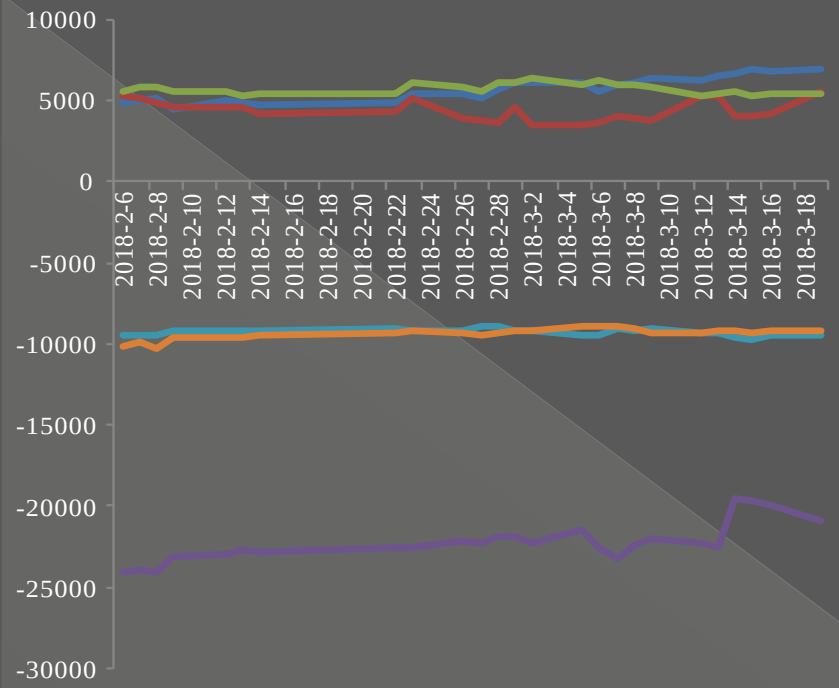
化工：PTA

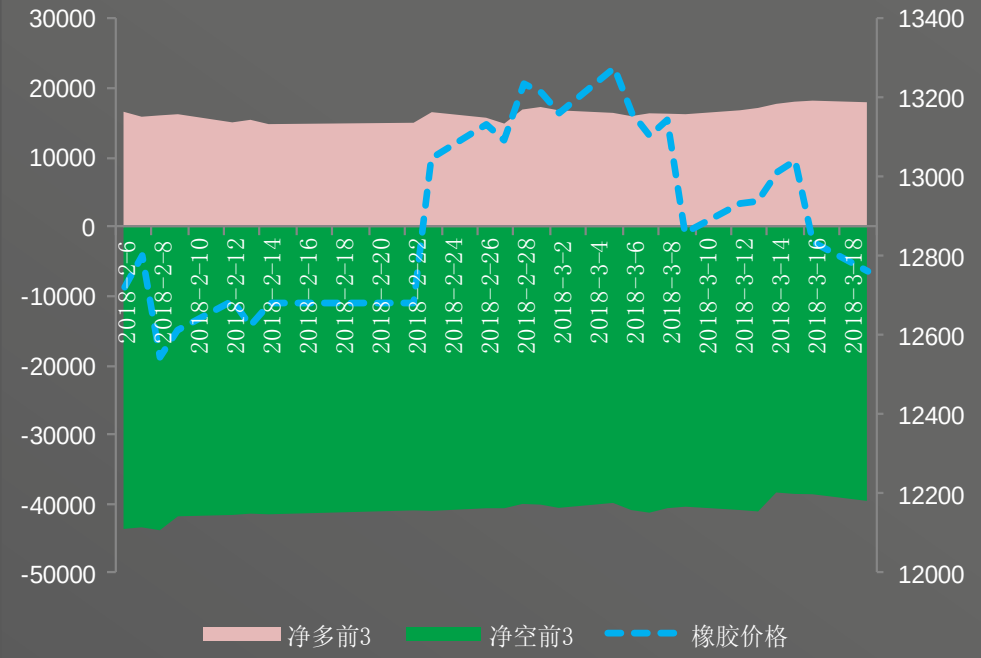




变动幅度		当日	最近5日	平均变化	波动率
pta持仓	多头前3	7.96%	9.32%	1.86%	10.12%
	空头前3	-2.79%	-5.32%	-1.06%	
pta涨幅		0.33%	0.03%	0.01%	
震荡幅度	0.79%	1.24%(月均值)	投机度	0.32	0.45(月均值)

化工：橡胶

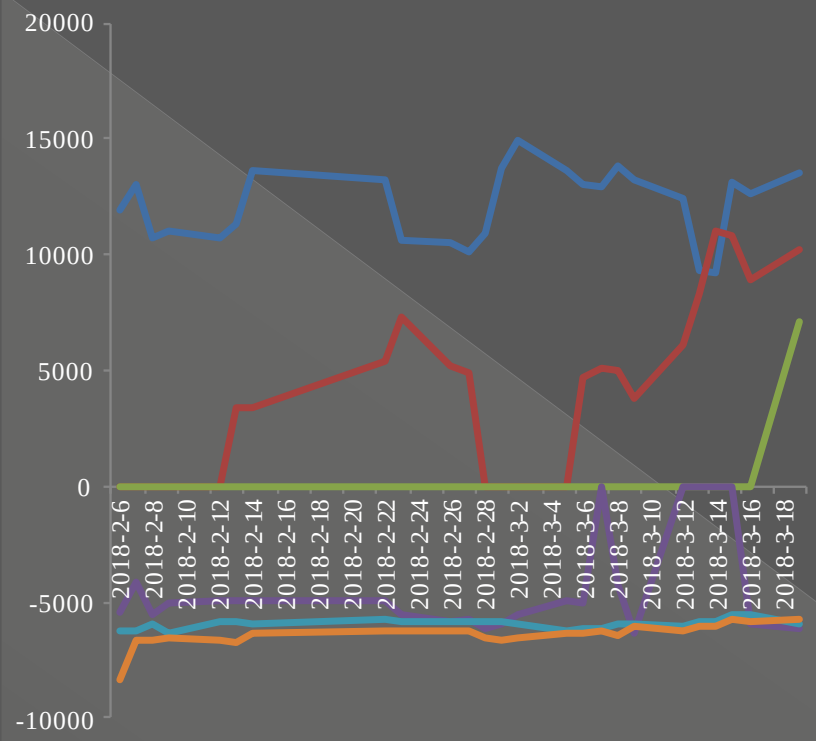


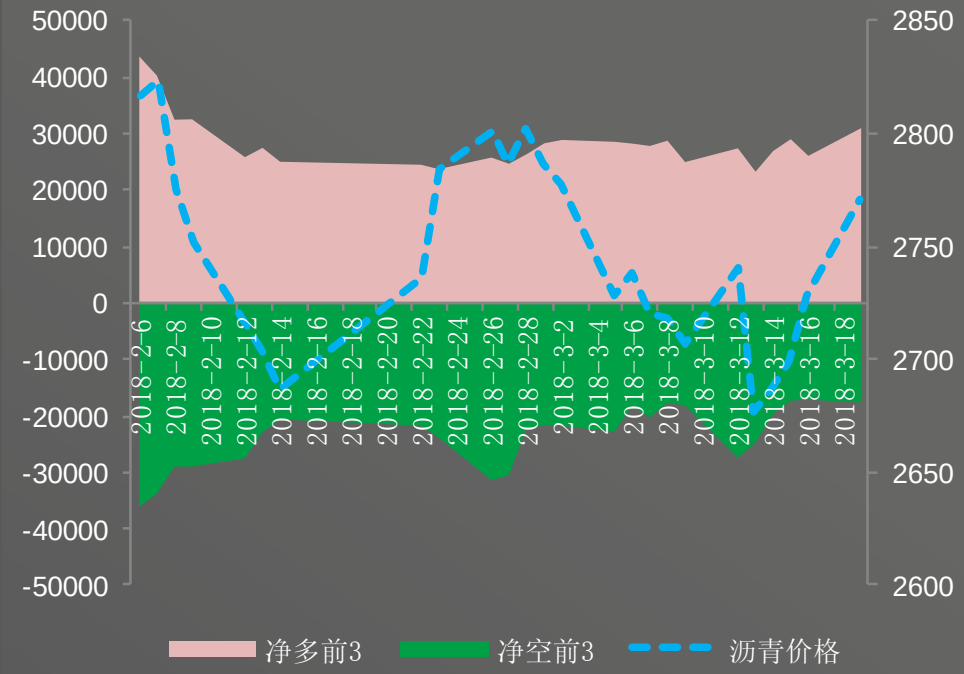


变动幅度		当日	最近5日	平均变化	波动率
ru持仓	多头前3	-1.26%	6.87%	1.37%	15.94%
	空头前3	2.49%	-3.23%	-0.65%	
ru涨幅		-0.55%	-1.33%	-0.27%	
震荡幅度	1.64%	1.97%(月均值)	投机度	0.63	0.73(月均值)

大陆期货

化工：沥青

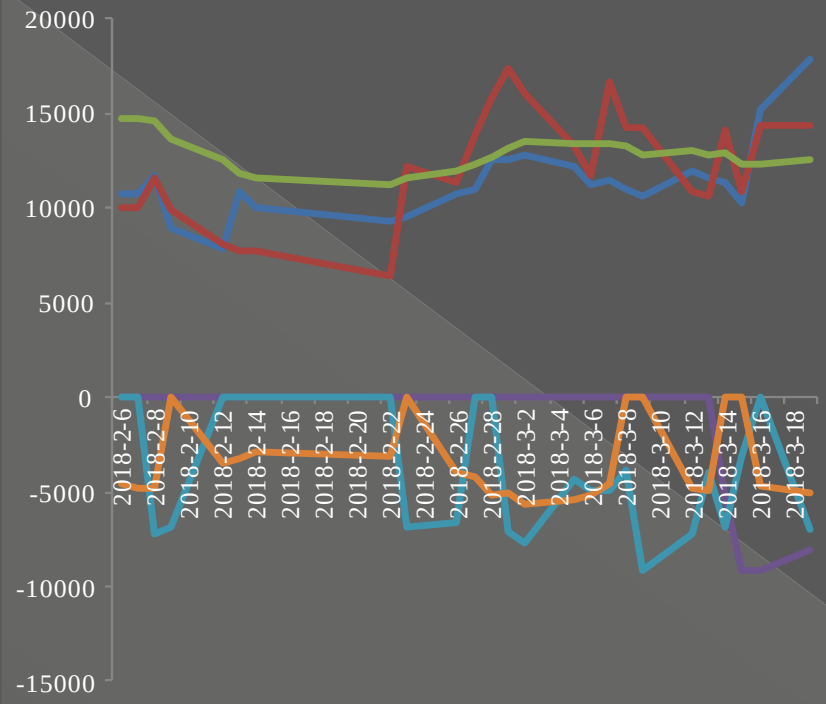


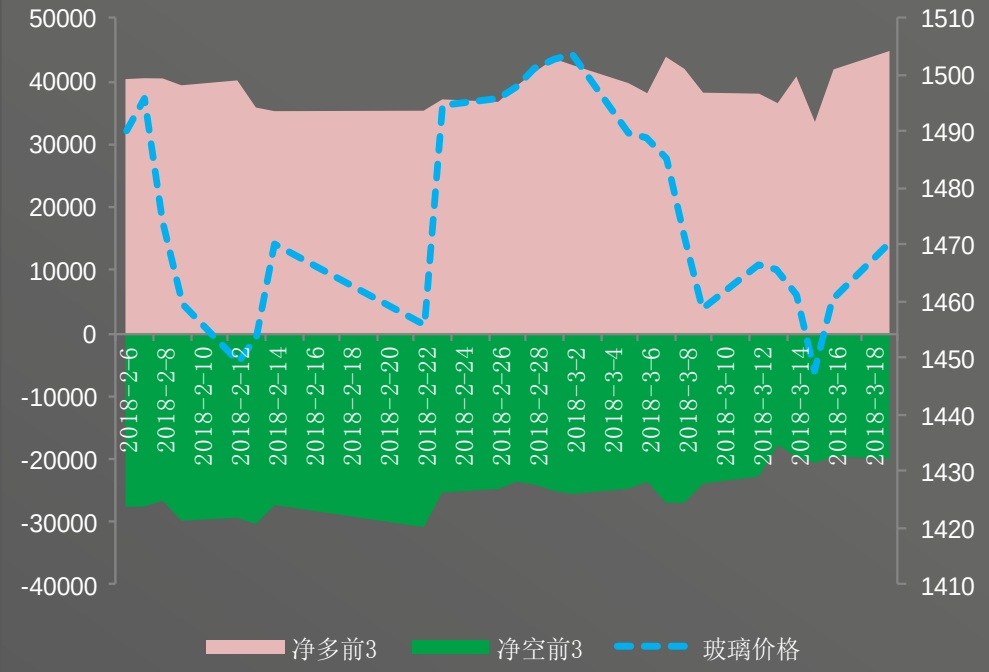


变动幅度		当日	最近5日	平均变化	波动率
bu持仓	多头前3	18.99%	13.12%	2.62%	17.52%
	空头前3	2.79%	-35.51%	-7.10%	
bu涨幅		1.54%	1.09%	0.22%	
震荡幅度	1.91%	1.78%(月均值)	投机度	1.04	0.79(月均值)

大陆期货

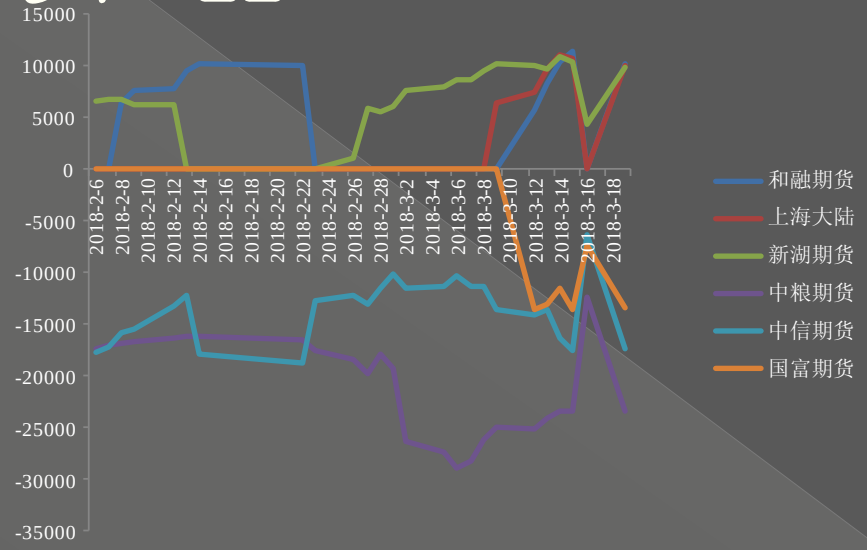
化工：玻璃

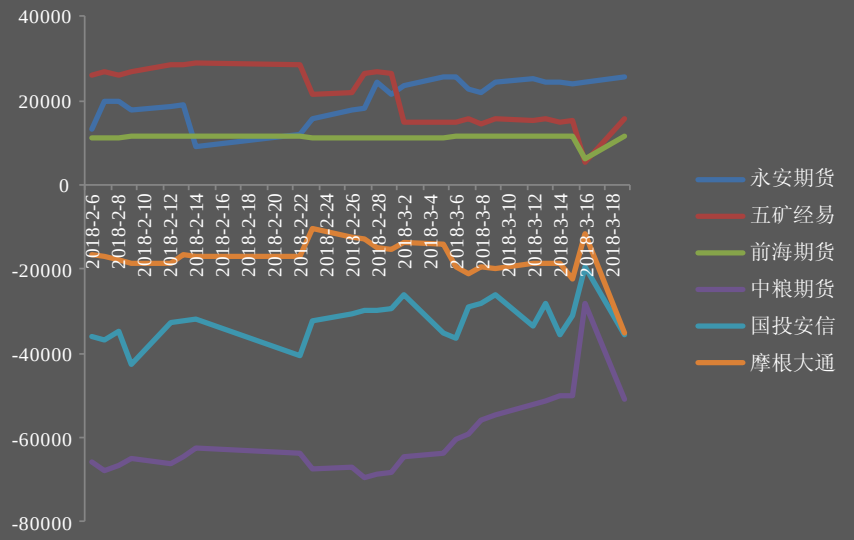




变动幅度		当日	最近5日	平均变化	波动率
fg持仓	多头前3	6.96%	17.81%	3.56%	13.74%
	空头前3	1.98%	-12.15%	-2.43%	
fg涨幅		0.68%	0.25%	0.05%	
震荡幅度	2.12%	1.61%(月均值)	投机度	0.74	0.59(月均值)

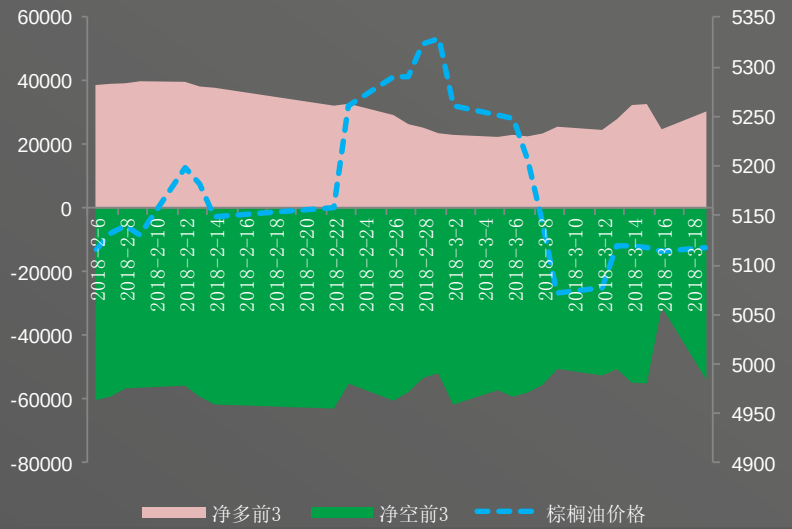
农产品：P & Y

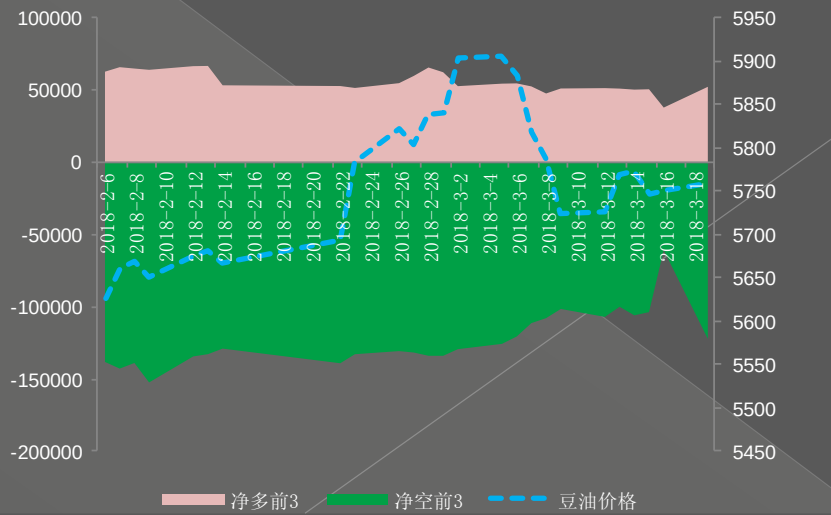




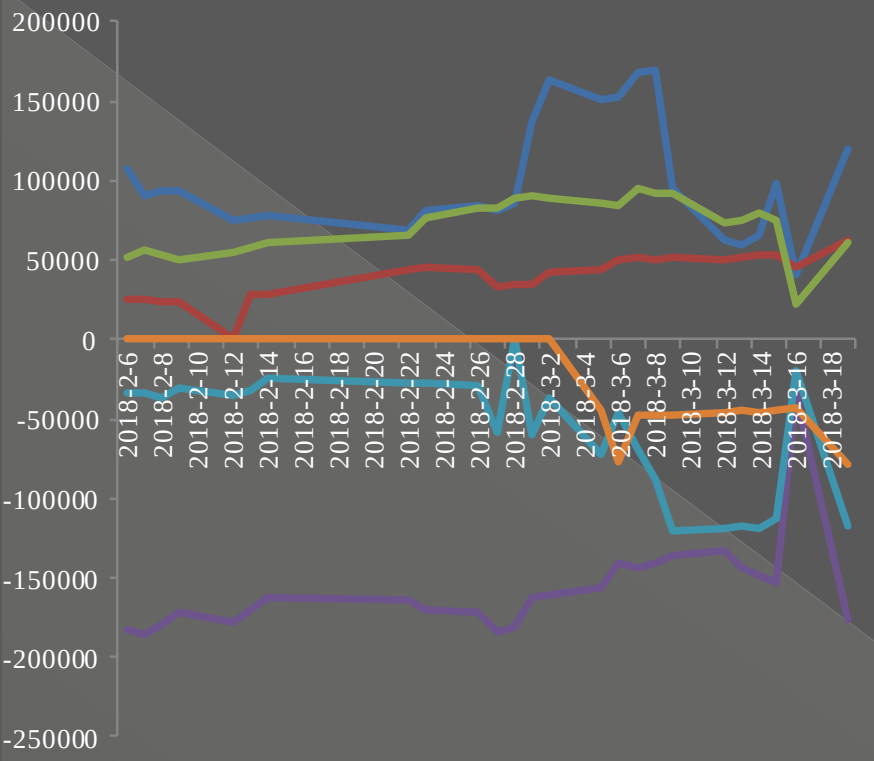
变动幅度		当日	最近5日	平均变化	波动率
p持仓	多头前3	22.55%	23.55%	4.71%	12.59%
	空头前3	73.81%	2.60%	0.52%	
p涨幅		0.09%	0.78%	0.16%	
震荡幅度	1.00%	1.24%(月均值)	投机度	0.53	0.60(月均值)

变动幅度		当日	最近5日	平均变化	波动率
y持仓	多头前3	37.35%	1.74%	0.35%	10.12%
	空头前3	101.92%	14.28%	2.86%	
y涨幅		0.13%	0.55%	0.11%	
震荡幅度	0.97%	1.18%(月均值)	投机度	0.53	0.40(月均值)



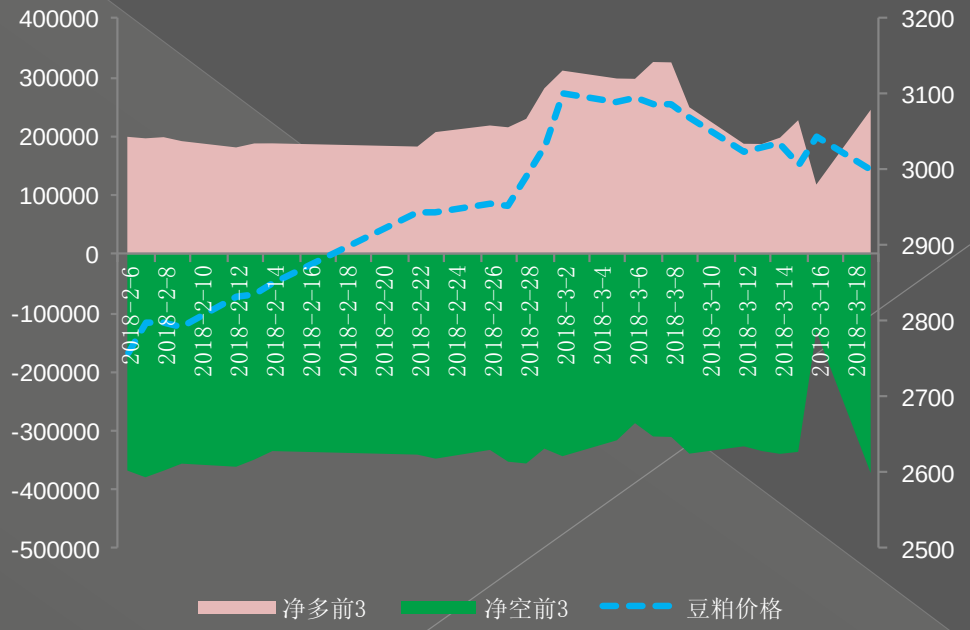


大陆期货



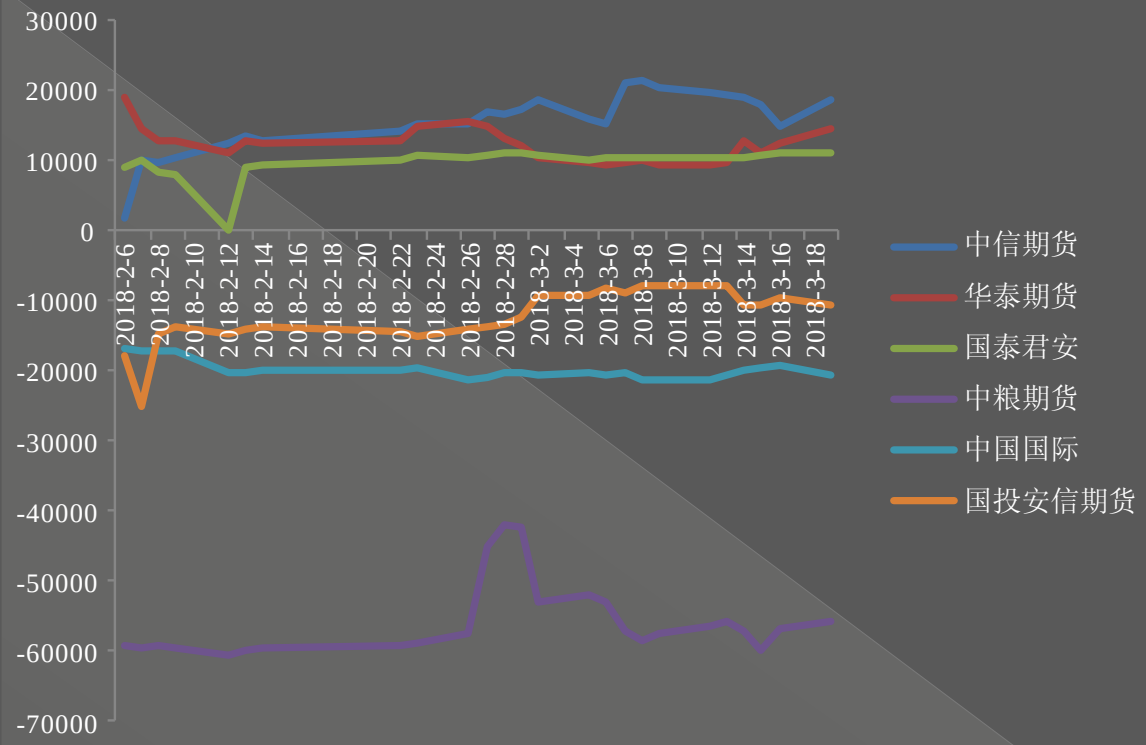
农产品：豆粕

变动幅度		当日	最近5日	平均变化	波动率
m持仓	多头前3	106.87%	30.65%	6.13%	17.91%
	空头前3	185.13%	13.98%	2.80%	
m涨幅		-1.41%	-0.76%	-0.15%	
震荡幅度	1.68%	1.44%(月均值)	投机度	0.53	0.56(月均值)

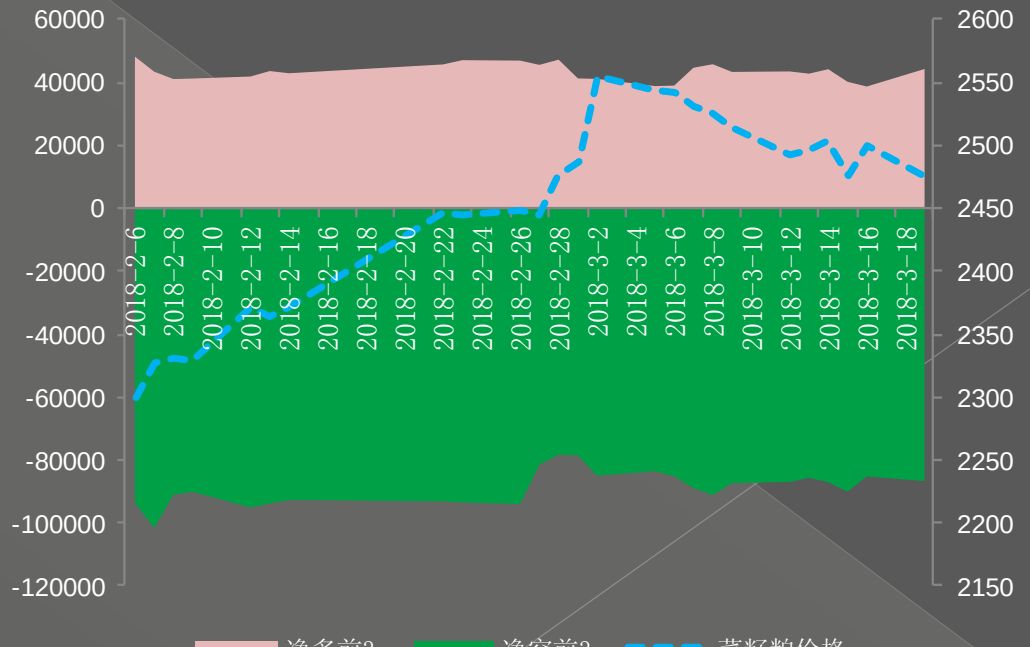


大陆期货

农产品：菜粕

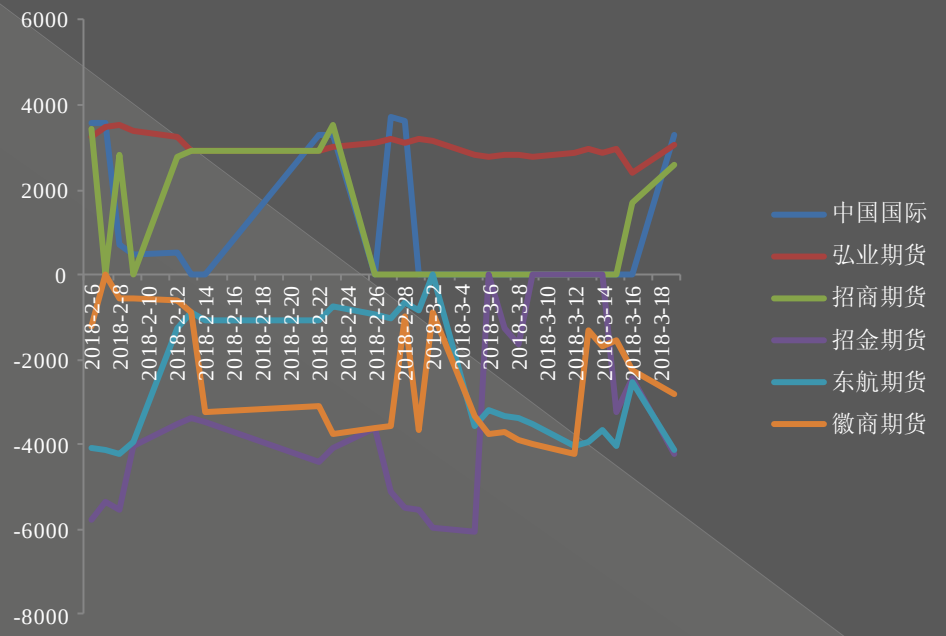


变动幅度		当日	最近5日	平均变化	波动率
rm持仓	多头前3	14.30%	1.76%	0.35%	17.33%
	空头前3	1.74%	-0.30%	-0.06%	
rm涨幅		-0.95%	-0.65%	-0.13%	
震荡幅度	1.59%	1.32%(月均值)	投机度	0.78	0.65(月均值)

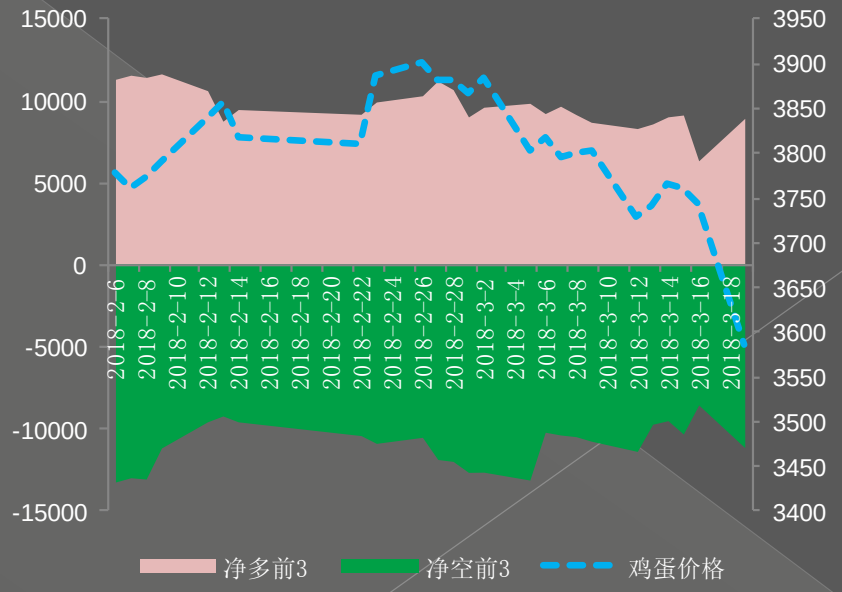


大陆期货

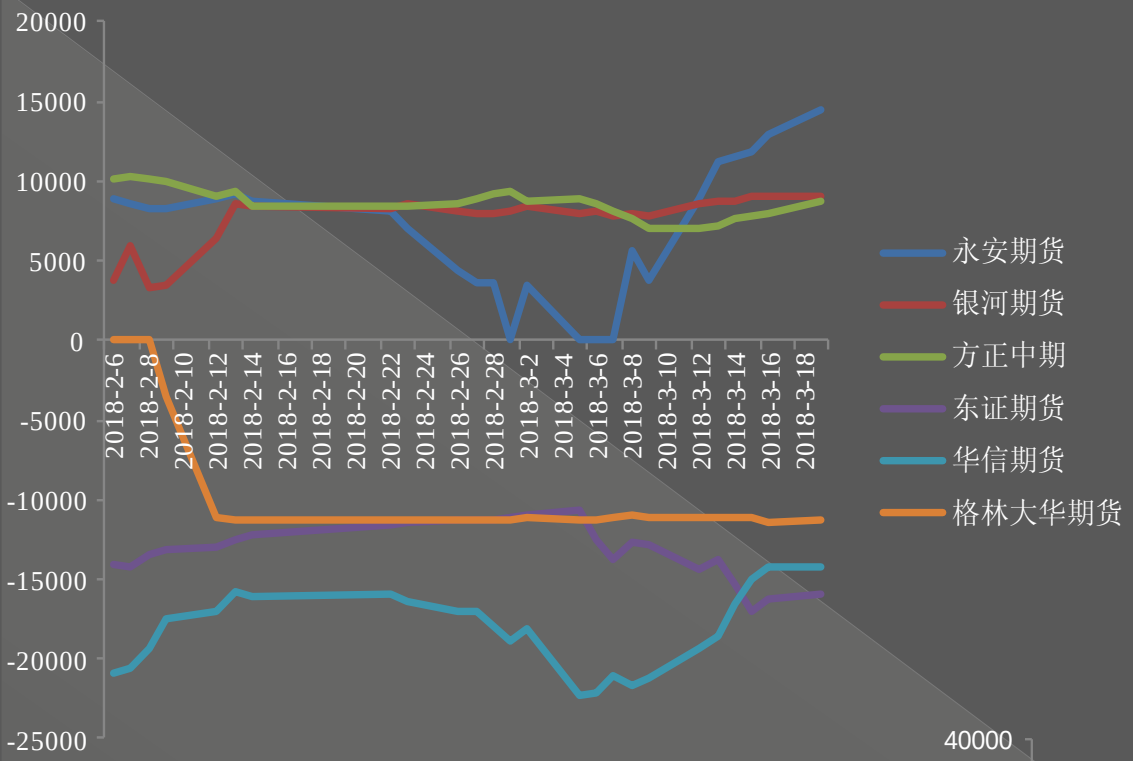
农产品：鸡蛋



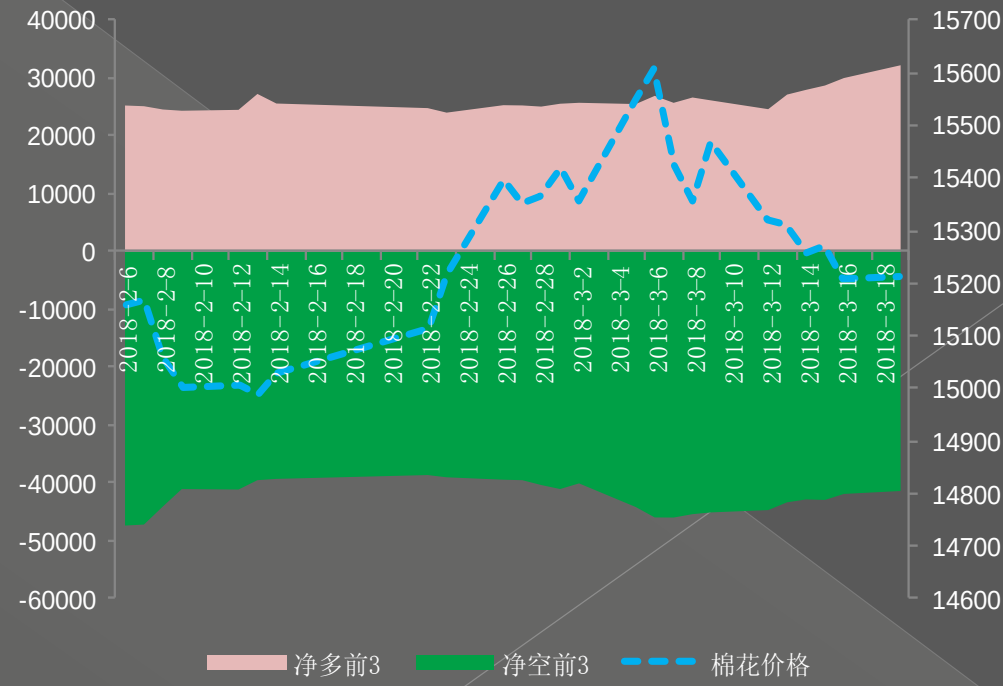
变动幅度		当日	最近5日	平均变化	波动率
jd持仓	多头前3	41.32%	7.59%	1.52%	20.32%
	空头前3	30.15%	-2.04%	-0.41%	
jd涨幅		-4.19%	-3.84%	-0.77%	
震荡幅度	4.34%	1.41%(月均值)	投机度	1.26	0.46(月均值)



农产品：棉花

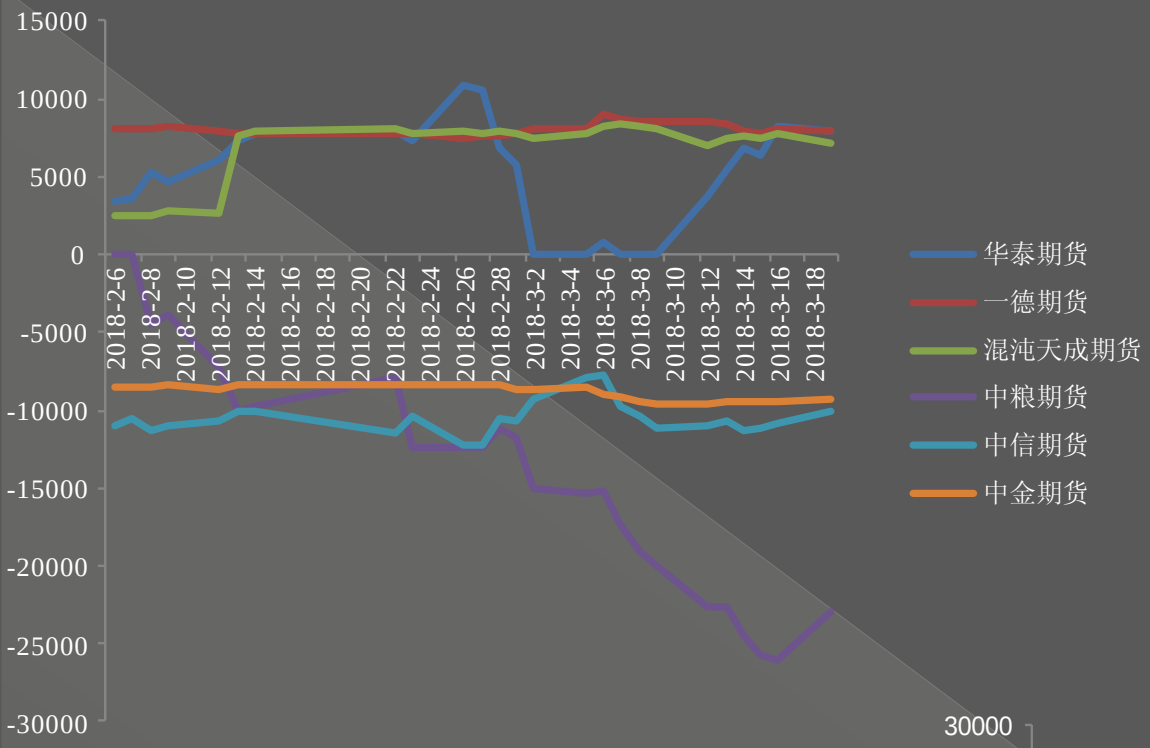


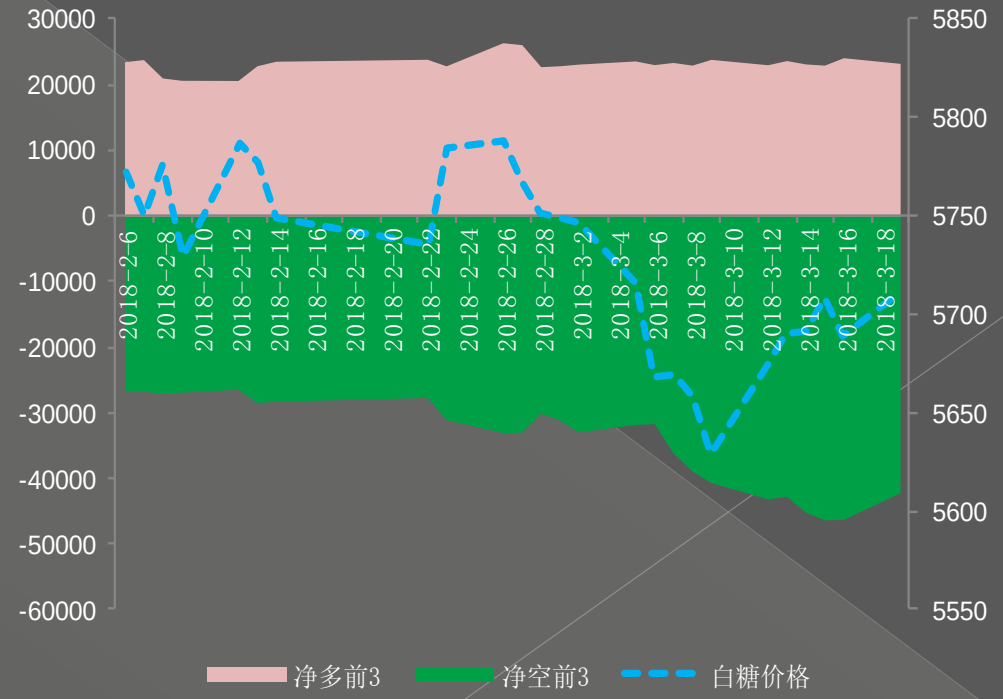
变动幅度		当日	最近5日	平均变化	波动率
cf持仓	多头前3	7.36%	30.80%	6.16%	9.66%
	空头前3	-1.22%	-7.39%	-1.48%	
cf涨幅		0.01%	-0.73%	-0.15%	
震荡幅度	0.63%	0.91%(月均值)	投机度	0.39	0.37(月均值)



大陆期货

农产品：白糖

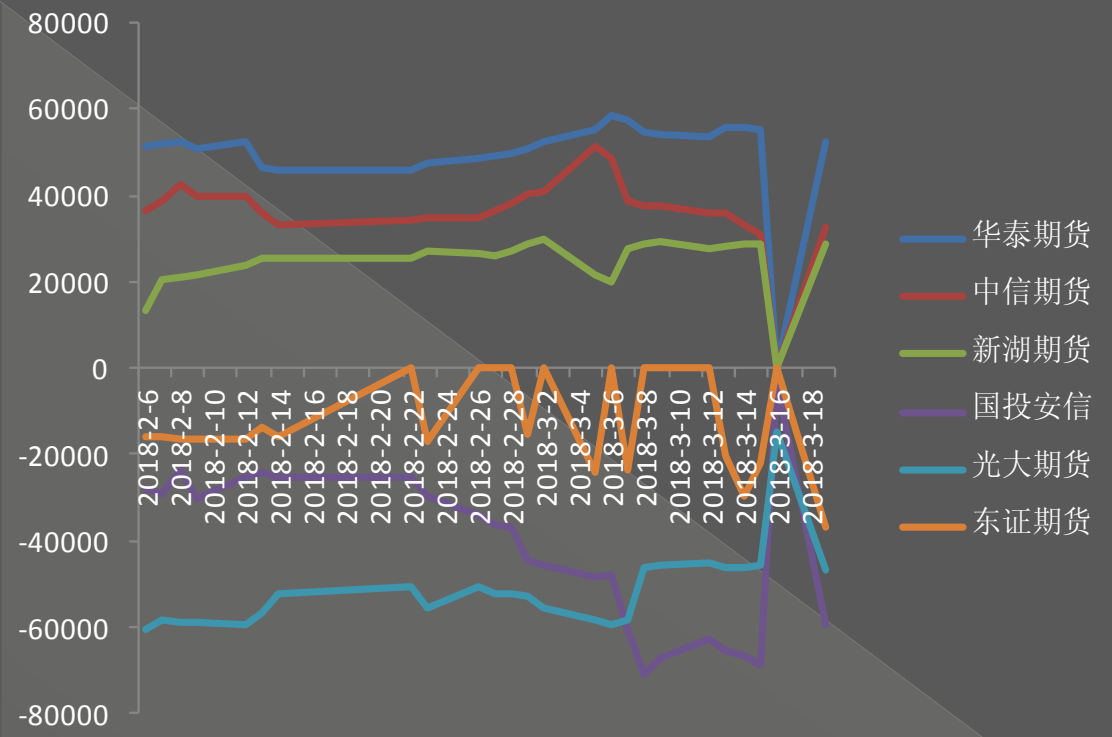




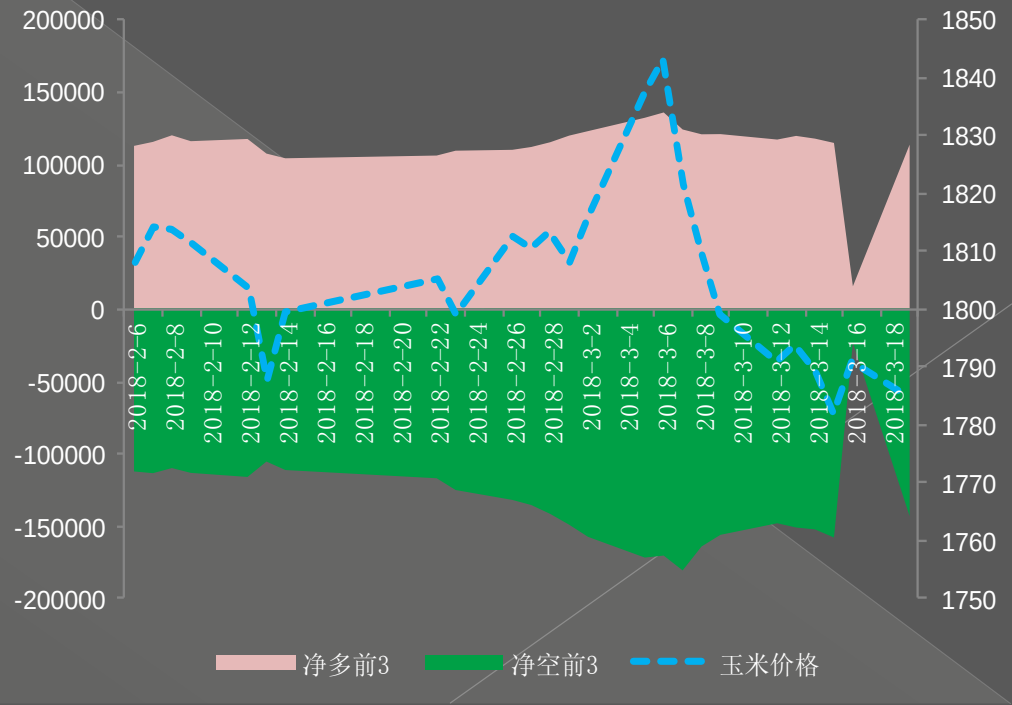
变动幅度		当日	最近5日	平均变化	波动率
sr持仓	多头前3	-3.57%	0.91%	0.18%	7.86%
	空头前3	-8.80%	-2.19%	-0.44%	
sr涨幅		0.39%	0.66%	0.13%	
震荡幅度	0.80%	0.81%(月均值)	投机度	0.51	0.44(月均值)

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	641.85%	-3.03%	-0.61%	9.04%
	空头前3	508.10%	-3.35%	-0.67%	
c涨幅		-0.34%	-0.33%	-0.07%	
震荡幅度	0.84%	0.79%(月均值)	投机度	0.35	0.42(月均值)



部分机构资金变动表

制表日期：2018年3月19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	39524.19	20.96%	51089.05	28.87%
南华期货	5089.70	9.23%	-10904.41	-15.32%
混沌天成	-1291.44	-3.66%	2268.63	7.14%
海通期货	6629.80	6.55%	-10435.80	-8.83%
上海大陆	4056.71	142.85%	3126.60	82.94%
中信期货	20726.21	10.34%	-6236.85	-2.74%
新湖期货	15843.78	29.20%	-138.19	-0.20%

大陆期货

中粮期货	68907.89	51.44%	-2906.90	-1.41%
中信建投	2272.88	10.01%	-10476.40	-29.56%
申银万国	1429.94	5.49%	-2870.75	-9.46%
华泰期货	33469.43	46.13%	-2507.27	-2.31%
光大期货	20214.98	35.78%	17791.66	30.19%
一德期货	31931.48	51.45%	-21038.64	-18.29%
国投期货	1262.60	1.56%	11077.22	15.61%
金瑞期货	9207.95	9.33%	-7812.53	-6.75%
鲁证期货	14376.22	17.46%	21664.93	28.86%
中国国际	1549.31	2.78%	-10148.04	-15.06%

部分机构持仓一览

机构	永安期货					
日期	2018-3-12	2018-3-13	2018-3-14	2018-3-15	2018-3-16	2018-3-19
黄金	3756	3795	3817	4044	3361	3118
白银						
沪铜	10586	9625	10931	10908	12218	11073
沪铝			-6436	-11263	-6605	-11771
沪镍	6041		9903	6894	5730	5943
沪锌	-7574	-6418	-6397	-9806	-9669	-7765
沪铅						
螺纹钢						-38078
铁矿石	-29182	-37341	-12049	12086	10721	-8867
焦煤			4404	5767	6422	6858
焦炭	-2307	-4702	-10015	-5824	-5593	3574
豆油	25282	24627	24584	24255	24683	25691
棕榈油	-8628	-7583		-4582	-3326	-3708
菜籽油	8557	7281	6683	7268	7289	5605
豆粕	62158	60343	65318	98049	41423	120730
菜籽粕	5091	5451		176	569	-1344
棉花	8883	11230	11468	11908	12965	14421
白糖						
玉米	-40293	-39308	-39609	-43376	4126	-35334
鸡蛋	-24	358	973	1091		
PTA			-15209	-18785	-19359	-19087
聚乙烯			11025	11640	16174	16148
聚丙烯	10769	9492	10705	10199	7606	6621
甲醇	7706	10815	7442	7651	1763	
玻璃						
橡胶	-22272	-22579	-19563	-19662	-19960	-20980
沥青	-14023	-8007	-5756	-5718		7138
动力煤	26072	29187	27710	28564	29156	29678

部分机构持仓一览

机构	南华期货					
日期	2018-3-12	2018-3-13	2018-3-14	2018-3-15	2018-3-16	2018-3-19
黄金	-1123	-1165		-1283		-1722
白银	8796	8468	8592	8431		
沪铜					4348	
沪铝	-11710	-10746	5617	4691	4632	4904
沪镍						
沪锌						
沪铅	-779	-967	-860	-566	-780	-1490
螺纹钢	33146	36781	37280	36750	39314	41112
铁矿石						
焦煤						
焦炭	-2234			-1968		
豆油	9822	9758	9669	10079	6694	10678
棕榈油						
菜籽油				-5551	-4756	
豆粕						
菜籽粕			-9863	-9312	-8549	-9788
棉花						
白糖	5236	4944	5185	4896	4670	4711
玉米					-4121	
鸡蛋				2338		2466
PTA	15800	14894	16452	15351	16025	17012
聚乙烯	18509	18911	18661	15011	8749	15048
聚丙烯	-7615	-8204	-8705	-8234		-7652
甲醇	623	838		1945	1318	1278
玻璃	4916	4805	4426			4799
橡胶	2020	1960	1975	1648		
沥青		-4527	-4868			
动力煤						

部分机构持仓一览

机构	国泰君安					
日期	2018-3-12	2018-3-13	2018-3-14	2018-3-15	2018-3-16	2018-3-19
黄金	4528	4037	5699	5735	6090	6410
白银	-16059	-16031	-16852	-16560	-16491	-17327
沪铜	7125	5702	7529	6485	6609	6553
沪铝	12479	12823	11739	6869	11163	11770
沪镍						
沪锌				-2507		
沪铅	702	767		697	720	742
螺纹钢	56707	58874	59606	54368	59348	66648
铁矿石	12639	28152	10143	8295		11529
焦煤			-530	-823	-802	-2533
焦炭		-382	-475	-819	-832	
豆油	1705					
棕榈油						
菜籽油	35849	35891	36057	36280	36476	36851
豆粕	30016					
菜籽粕	10565	10562	10668	10864	11127	11231
棉花						
白糖	-7563	-7502	-7294	-7119	-7092	-6641
玉米						
鸡蛋	818	703	609	603		1292
PTA						
聚乙烯		-5140			-2992	
聚丙烯	8272	8448	8757	9485	5481	8167
甲醇	-3392	-1985	-1445			-1230
玻璃						
橡胶	-4146	-4800	-4670	-5011	-5472	-5851
沥青						-4207
动力煤						

部分机构持仓一览

机构	混沌天成					
日期	2018-3-12	2018-3-13	2018-3-14	2018-3-15	2018-3-16	2018-3-19
黄金						
白银						
沪铜	-8432	-8442	-9634	-9629	-9638	-10088
沪铝						
沪镍	-9427	-8987	-9343	-9220	-8913	-7819
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					-4800	
鸡蛋						
PTA						
聚乙烯						
聚丙烯						
甲醇						
玻璃						
橡胶						
沥青						
动力煤						

六陆期货

部分机构持仓一览

机构	海通期货					
日期	2018-3-12	2018-3-13	2018-3-14	2018-3-15	2018-3-16	2018-3-19
黄金	5093	4988	4983	5295	5222	4618
白银	14734	12689	13016	11878	10974	11096
沪铜	-16066	-15314	-15479	-15616	-15468	-16398
沪铝	-11247	-11511	-10020	-4806	-9569	-5091
沪镍	11667	10810	10498	8260	11562	6513
沪锌						
沪铅	3454	3448	3470	4025	2906	3152
螺纹钢						
铁矿石	-11534	-8485	692			-4989
焦煤	-1570			-1709	-1658	-725
焦炭		1031	2356	-105		1246
豆油					4510	
棕榈油	7137				281	3086
菜籽油	-5113	-4906	-6810	-6391		
豆粕		32961	36051	35461	16882	34950
菜籽粕	9368	6810	7963	6654	7795	6223
棉花						3149
白糖	-6834	-7433	-7464	-6883	-6694	-6208
玉米	26330	20688	20593	17679		13904
鸡蛋	453	727	1312	1265		-270
PTA						
聚乙烯	-6924	-5735	-5993	-5892		
聚丙烯				3467	-4687	4493
甲醇		-3054	4185	-1089	-3458	4999
玻璃				-5775	-3815	-2105
橡胶						
沥青						
动力煤					-4195	-5511

部分机构持仓一览

机构	上海大陆					
日期	2018-3-12	2018-3-13	2018-3-14	2018-3-15	2018-3-16	2018-3-19
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	7424	9734	11057	10782	-2407	10157
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					-5897	-6130
动力煤						

部分机构持仓一览

机构	中粮期货					
日期	2018-3-12	2018-3-13	2018-3-14	2018-3-15	2018-3-16	2018-3-19
黄金						
白银					7920	7626
沪铜	-11517	-7312	-8170	-6815	-7795	-8002
沪铝	-7530	-5620	-6413	-6645	-8059	-6431
沪镍	6858	7023				
沪锌	-6136	-5787	-6180	-5917	-5228	-5364
沪铅				641	627	553
螺纹钢						
铁矿石					3869	
焦煤						
焦炭						
豆油	-52221	-51064	-49978	-49939	-27871	-50851
棕榈油	-25089	-24064	-23341	-23323	-12302	-23326
菜籽油	-20689	-18344	-20308	-22738	-21366	-22831
豆粕	-132169	-143220	-147730	-152821	-34187	-176607
菜籽粕	-56395	-55721	-56926	-59957	-56596	-55601
棉花	-8846	-8368	-7804	-7831	-5144	-4762
白糖	-22668	-22565	-24456	-25794	-26083	-22880
玉米	-39217	-38198	-34931	-31214		-31487
鸡蛋	2678	2624	2598	2584	1564	
PTA		-17225				
聚乙烯			8499	8262	1059	8519
聚丙烯						
甲醇						
玻璃	-5145	-4850				
橡胶	-7593	-7713	-7723	-7737	-7503	-7528
沥青						
动力煤	-6203	-6419	-6699	-6830	-6006	-6240

部分机构持仓一览

机构	中信期货					
日期	2018-3-12	2018-3-13	2018-3-14	2018-3-15	2018-3-16	2018-3-19
黄金	7967	7659	7762	6693	6693	7155
白银	-36691	-36724	-34169	-34961	-36908	-37121
沪铜	-24935	-23466	-23833	-24619	-25030	-25470
沪铝	-28316	-25894	-24363	-24042	-26444	-26370
沪镍		5433	5025	6201	7447	6787
沪锌					3879	4153
沪铅	-3622	-3284	-2747	-2675	-1376	-1747
螺纹钢						
铁矿石			-7480	-7511	-18998	-9491
焦煤	7031	6543	7984	6200	6252	5712
焦炭	2355	2775	2415	1872	1787	
豆油	-18210	-16481	-15871	-18402	-13072	-17541
棕榈油	-14050	-13571	-16357	-17582	-6279	-17305
菜籽油	-12743	-12540	-11161	-11479	-9729	-7028
豆粕	74302	74631	79297	75344	22403	61850
菜籽粕	19917	19615	19168	18241	15068	18767
棉花	4297					
白糖	-10931	-10756	-11280	-11098	-10851	-10063
玉米	35705	35878	32995	30983	-956	32593
鸡蛋	-338	-390	-646	-1004		
PTA	15257					
聚乙烯	-5726	-6109	-6159	-6624	-6661	-9965
聚丙烯						
甲醇	-1716	-1578			-1638	2821
玻璃	11972	11667	11329	10324	15289	17922
橡胶						
沥青	-4129	-4941	-5298	-4974	-4770	-4055
动力煤						

部分机构持仓一览

机构	中信建投					
日期	2018-3-12	2018-3-13	2018-3-14	2018-3-15	2018-3-16	2018-3-19
黄金						
白银	9685	9496	8082	9141		
沪铜						
沪铝						
沪镍	6617					
沪锌						
沪铅						
螺纹钢		33186	29786	28545		
铁矿石						
焦煤						
焦炭				2051	2303	
豆油						
棕榈油	-10296	-12240	-5345	-10613	4074	-8933
菜籽油						
豆粕	50848	51924	53037	53720	44963	62147
菜籽粕						
棉花						
白糖						
玉米						
鸡蛋	582	461				777
PTA						
聚乙烯						
聚丙烯						
甲醇						
玻璃	-4824	-4886			-4663	-5000
橡胶						
沥青	3526	4709	6616	5017	3661	
动力煤						

部分机构持仓一览

机构	新湖期货					
日期	2018-3-12	2018-3-13	2018-3-14	2018-3-15	2018-3-16	2018-3-19
黄金	-619	-712	-635	-1279	-1268	-677
白银						
沪铜	6750	6746	6721	6622	7165	7311
沪铝						
沪镍	-7023					
沪锌						
沪铅						
螺纹钢						
铁矿石						
焦煤						
焦炭						
豆油					4437	5601
棕榈油	10033	9782	10920	10457	4317	9933
菜籽油	-4536	-7298	-7096			-6684
豆粕	-74847	-73484	-72549	-69873	-37013	-69655
菜籽粕						
棉花				3006	3027	
白糖						
玉米	27882	28406	28948	28961		28793
鸡蛋	-223	-176			-3505	
PTA	-28724	-28776	-29314	-30472	-30368	-30408
聚乙烯						
聚丙烯			-4620	-4892	-3903	-5116
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