大陆期货

市场持仓分析

2018/5/23

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	
	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
动力煤	15.14%	11.96%	12.55%	-1.39%	-3.17%	3.21%	16.53%	☆☆☆
甲醇	7.80%	4.51%	4.99%	-6.05%	-4.48%	4.22%	13.85%	☆☆☆
玻璃	17.51%	17.58%	15.43%	4.07%	5.01%	1.33%	13.44%	☆☆☆
豆粕	14.51%	11.87%	4.51%	1.48%	2.41%	5.25%	13.03%	☆☆☆
焦煤	-5.95%	-7.96%	-15.35%	-16.46%	-17.08%	-17.24%	10.51%	☆☆☆
沪铝	9.19%	7.35%	-1.36%	-1.20%	0.00%	-1.33%	10.39%	☆☆☆
沥青	-3.80%	-11.46%	-12.04%	-11.26%	-9.90%	-7.75%	7.46%	☆☆
聚丙烯	3.85%	3.96%	2.24%	-3.34%	-4.77%	-5.54%	7.19%	☆☆
豆油	4.62%	1.94%	2.95%	1.79%	2.12%	2.26%	2.83%	☆
玉米	-0.09%	-1.24%	-3.80%	-2.24%	-1.69%	-0.70%	2.15%	☆
铁矿石	1.14%	3.84%	1.86%	-0.48%	-0.19%	-5.19%	1.62%	☆
聚乙烯	1.74%	0.05%	0.14%	0.85%	-0.42%	1.04%	0.89%	☆
焦炭	4.29%	-4.45%	-12.90%	3.76%	0.54%	-8.79%	0.52%	☆
PTA	2.11%	1.75%	-0.26%	1.89%	1.63%	3.32%	0.22%	☆
棉花	-9.77%	-7.63%	-6.31%	-9.78%	-5.82%	-0.32%	0.01%	☆
棕榈油	8.02%	6.90%	5.57%	8.18%	7.44%	5.38%	-0.16%	☆
沪银	-9.24%	-6.87%	-4.59%	-8.83%	-8.19%	-5.65%	-0.41%	☆
白糖	-2.22%	-1.33%	-1.76%	-0.71%	-1.36%	-1.83%	-1.51%	☆
螺纹钢	2.20%	5.73%	7.71%	6.39%	5.14%	4.23%	-4.19%	☆
橡胶	-8.40%	-6.68%	-6.04%	-3.01%	-3.52%	-2.15%	-5.39%	☆☆
沪金	-2.37%	-0.34%	-1.71%	3.26%	1.19%	-15.72%	-5.63%	☆☆
沪锌	-0.52%	0.67%	0.21%	7.66%	8.89%	8.84%	-8.18%	☆☆
菜籽粕	-5.16%	0.33%	23.47%	3.03%	2.29%	8.34%	-8.19%	☆☆
沪铜	-13.03%	-11.53%	-7.66%	-2.88%	-4.43%	-2.79%	-10.15%	☆☆☆
鸡蛋	1.28%	10.10%	12.98%	15.65%	12.91%	18.13%	-14.38%	☆☆☆
沪镍	-3.53%	-3.75%	-2.72%	24.22%	16.23%	7.35%	-27.75%	☆☆☆☆

近5日持仓变化

品种	五日变化						近五日头寸变化参考	
	净多前3	净多前5	净多前10	净空前3	净空前5	净空前10	净多前3-净空前3	指标参考
动力煤	65.09%	50.48%	25.93%	31.50%	26.86%	24.40%	33.59%	☆☆☆
聚丙烯	34.03%	23.93%	15.40%	5.83%	4.45%	0.84%	28.20%	☆☆
沥青	17.92%	18.22%	13.84%	2.63%	6.84%	12.00%	15.29%	☆☆
棉花	11.68%	14.33%	24.55%	-1.15%	-0.55%	16.18%	12.84%	☆☆
焦煤	-15.98%	-18.43%	-28.25%	-27.74%	-25.44%	-25.70%	11.76%	☆☆
豆粕	6.43%	1.98%	-9.45%	-1.52%	-2.61%	-0.59%	7.95%	☆
PTA	12.21%	4.99%	-2.65%	5.45%	-1.80%	-5.49%	6.75%	☆
白糖	10.25%	14.51%	12.17%	8.54%	6.76%	8.16%	1.71%	☆
沪铝	-6.20%	-8.95%	-13.51%	-5.88%	-3.82%	-6.74%	-0.32%	☆
聚乙烯	-0.06%	2.92%	5.22%	1.68%	0.00%	5.82%	-1.74%	☆
橡胶	-0.33%	6.70%	18.02%	5.25%	5.22%	6.34%	-5.58%	☆
沪锌	-1.67%	-4.54%	-4.62%	4.10%	1.54%	-2.83%	-5.77%	☆
螺纹钢	44.60%	34.16%	18.75%	51.06%	46.44%	29.78%	-6.46%	☆
沪银	-20.74%	-15.11%	-11.85%	-14.27%	-12.72%	-13.47%	-6.47%	☆
玉米	-0.23%	1.76%	11.97%	7.05%	11.12%	11.69%	-7.28%	☆
沪金	-8.75%	-5.16%	-0.98%	1.64%	-2.92%	-13.08%	-10.39%	☆☆
鸡蛋	-4.30%	0.83%	-1.06%	7.65%	0.95%	-6.63%	-11.95%	☆☆
沪镍	10.60%	0.29%	-3.53%	23.56%	26.06%	14.99%	-12.96%	☆☆
玻璃	-15.20%	-13.35%	0.80%	-2.22%	5.22%	9.59%	-12.98%	☆☆
沪铜	-17.01%	-19.67%	-15.32%	-3.99%	-1.75%	0.32%	-13.02%	☆☆
甲醇	7.91%	1.40%	-2.21%	25.23%	13.24%	23.58%	-17.32%	☆☆
豆油	1.50%	7.15%	15.17%	21.72%	25.95%	24.77%	-20.22%	☆☆
焦炭	-39.50%	-35.81%	-38.20%	-8.25%	-10.16%	-21.48%	-31.25%	☆☆☆
菜籽粕	-25.62%	-16.76%	-9.16%	7.84%	7.47%	3.96%	-33.45%	☆☆☆
棕榈油	-12.74%	-10.69%	-6.57%	28.33%	23.99%	23.72%	-41.07%	☆☆☆
铁矿石	-17.88%	7.72%	68.87%	30.81%	27.01%	25.66%	-48.70%	☆☆☆

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=[（今日净多前3持仓量/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=[（今日净多前3持仓量/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>=50%	20%=<绝对值<50%	10%=<绝对值<20%	5%=<绝对值<10%	绝对值<5%
☆☆☆☆☆	☆☆☆☆	☆☆☆	☆☆	☆

2018年5月23日机构持仓异动表

金属	
中信期货	白银净空单变动幅度为：-8479手
海通期货	沪铜净空单变动幅度为：4473手
南华期货	沪镍净空单变动幅度为：8153手
方正中期	沪锌净空单变动幅度为：2615手

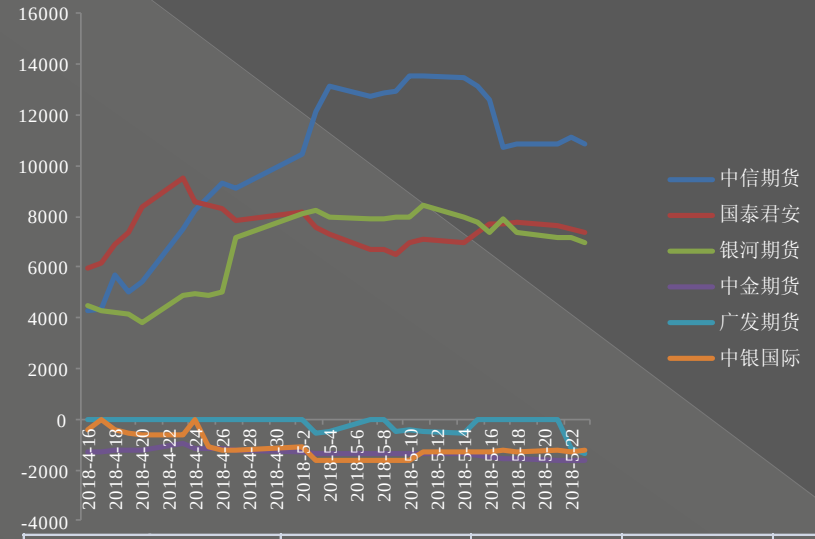
黑色	
国泰君安	焦煤净多单变动幅度为：-1433手
集成期货	焦煤净空单变动幅度为：-2601手
永安期货	焦炭净多单变动幅度为：-4222手
永安期货	焦炭净空单变动幅度为：2439手

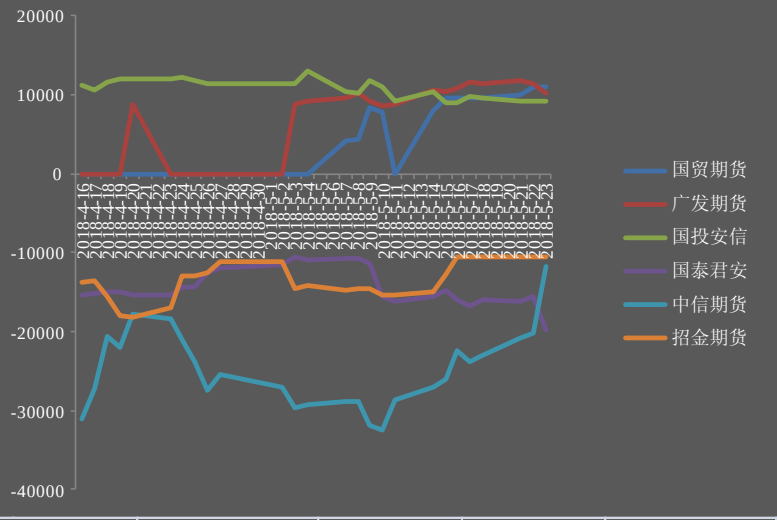
2018年5月23日机构持仓异动表

农产品	
金元期货	棕榈油净多单变动幅度为：3971手
申银万国	棕榈油净空单变动幅度为：6447手
五矿经易	豆粕净多单变动幅度为：29955手
中信建投	菜籽粕净多单变动幅度为：9663手
兴证期货	棉花净多单变动幅度为：-7750手
南华期货	棉花净多单变动幅度为：-12712手
鲁证期货	鸡蛋净多单变动幅度为：2006手
招金期货	鸡蛋净空单变动幅度为：1916手

化工	
华泰期货	甲醇净多单变动幅度为：-3037手
兴证期货	甲醇净多单变动幅度为：8740手
长江期货	玻璃净空单变动幅度为：4364手
中信建投	沥青净多单变动幅度为：-5026手
中信建投	沥青净多单变动幅度为：-5026手

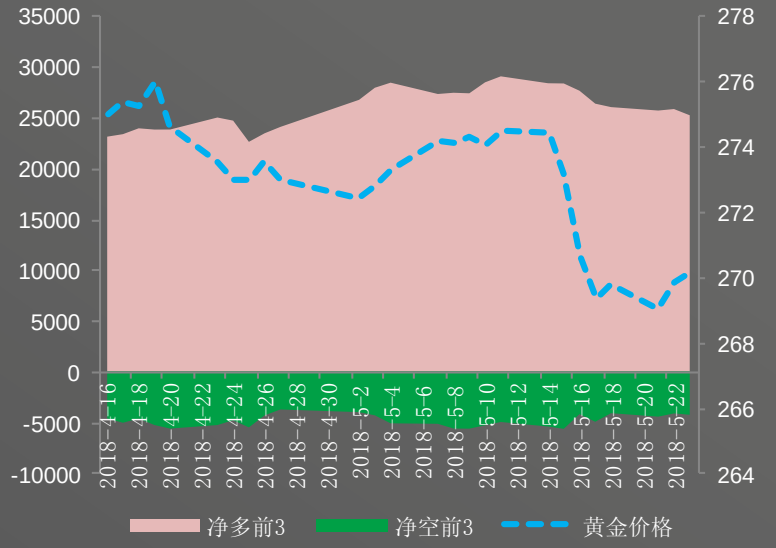
金属板块：AU & AG

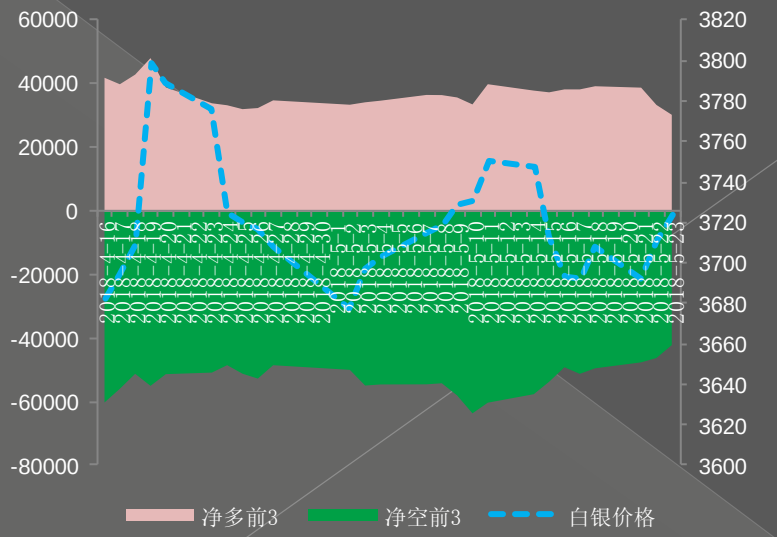




变动幅度		当日	最近5日	平均变化	波动率
au持仓	多头前3	-2.37%	-8.75%	-1.75%	6.78%
	空头前3	3.26%	1.64%	0.33%	
au涨幅		0.12%	-0.20%	-0.04%	
震荡幅度	0.51%	0.49%(月均值)	投机度	0.32	0.40(月均值)

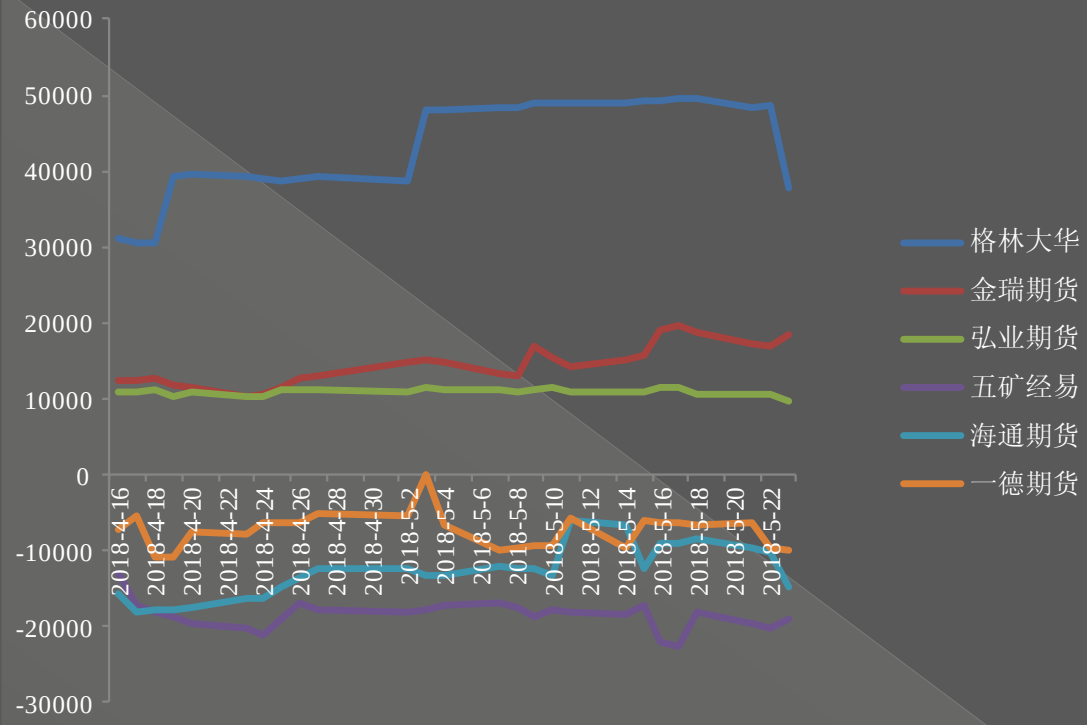
变动幅度		当日	最近5日	平均变化	波动率
ag持仓	多头前3	-9.24%	-20.74%	-4.15%	9.57%
	空头前3	-8.83%	-14.27%	-2.85%	
ag涨幅		0.35%	0.82%	0.16%	
震荡幅度	0.57%	0.66%(月均值)	投机度	0.35	0.44(月均值)



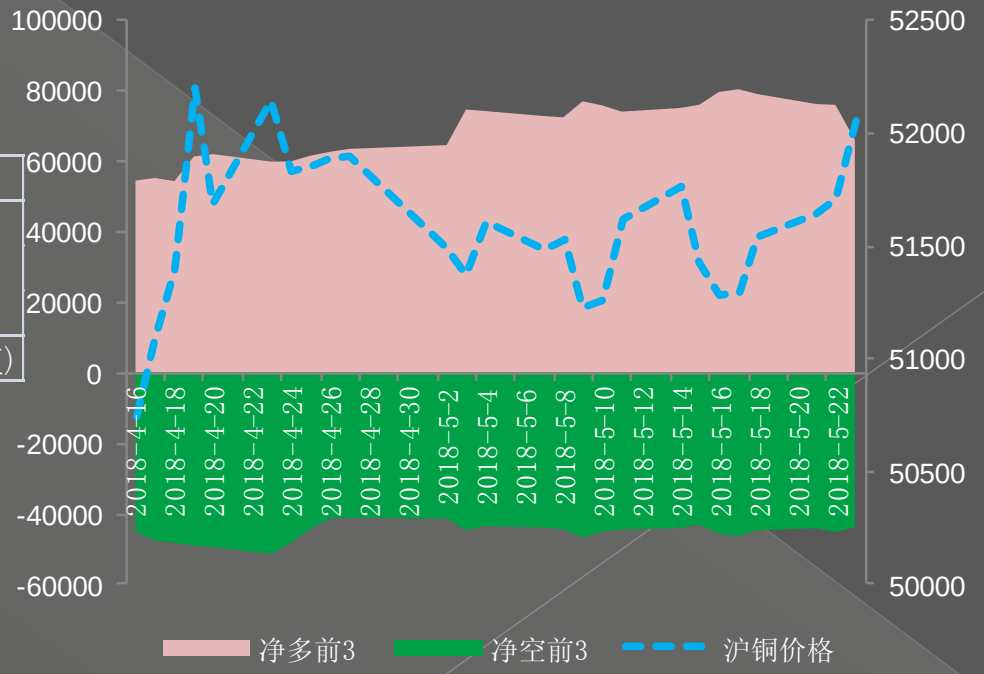


大陆期货

金属板块：Cu

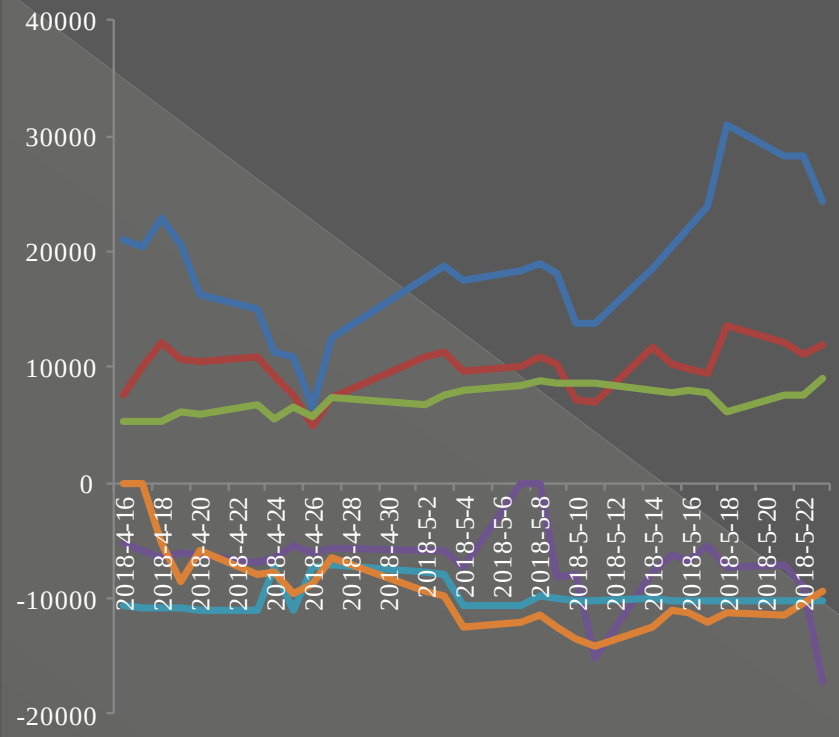


变动幅度		当日	最近5日	平均变化	波动率
cu持仓	多头前3	-13.03%	-17.01%	-3.40%	10.93%
	空头前3	-2.88%	-3.99%	-0.80%	
cu涨幅		0.68%	1.50%	0.30%	
震荡幅度	1.07%	0.86%(月均值)	投机度	0.63	0.47(月均值)

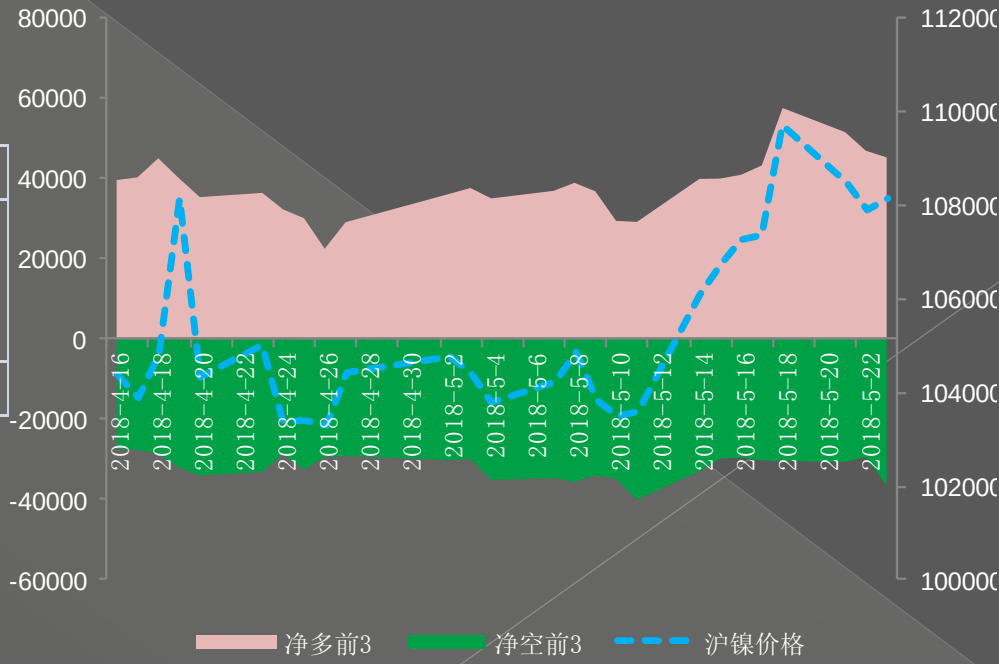


大陆期货

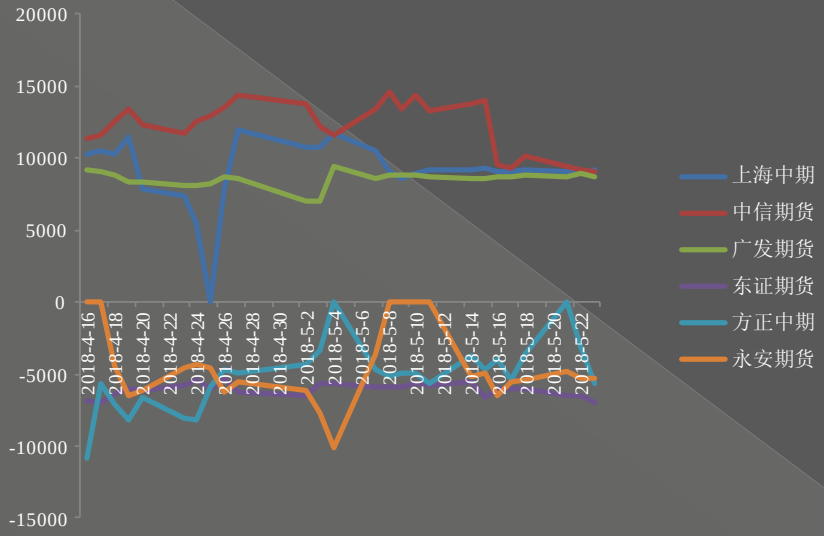
金属板块：Ni

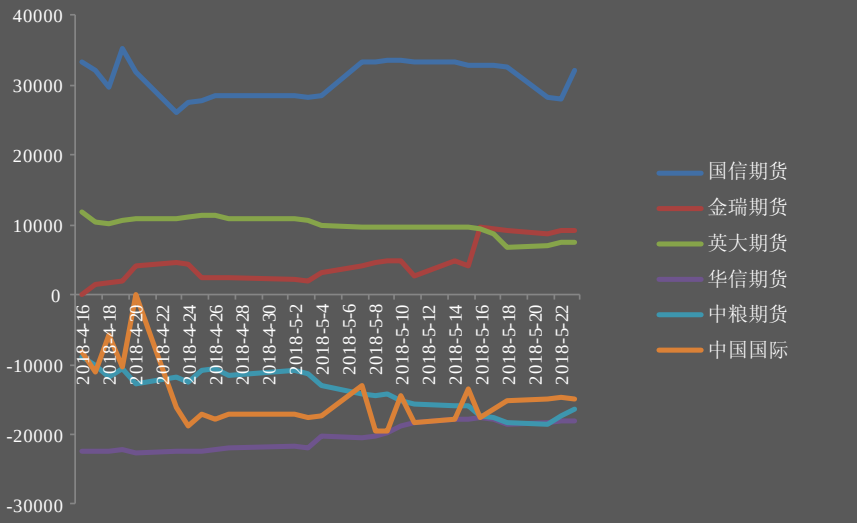


变动幅度		当日	最近5日	平均变化	波动率
ni持仓	多头前3	-3.53%	10.60%	2.12%	25.10%
	空头前3	24.22%	23.56%	4.71%	
ni涨幅		0.22%	0.81%	0.16%	
震荡幅度	1.68%	1.77%(月均值)	投机度	1.10	1.31(月均值)



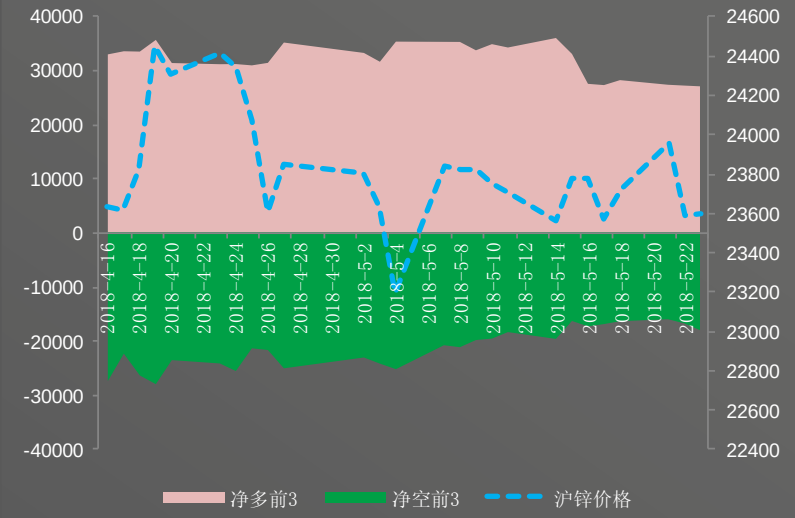
金属板块：Zn & Al

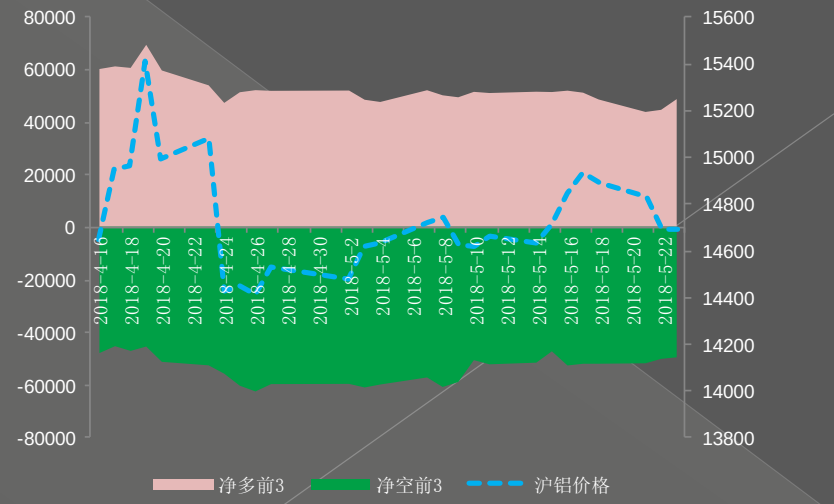




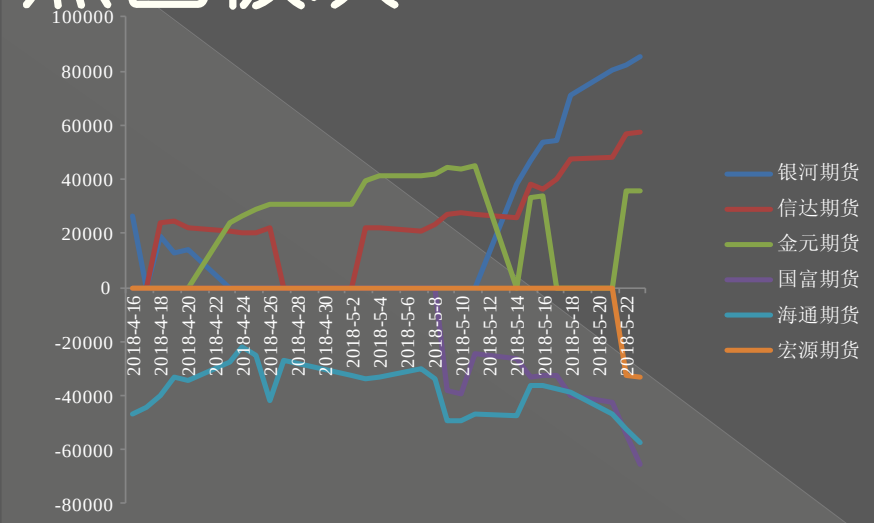
变动幅度		当日	最近5日	平均变化	波动率
zn持仓	多头前3	-0.52%	-1.67%	-0.33%	18.29%
	空头前3	7.66%	4.10%	0.82%	
zn涨幅		0.05%	-0.77%	-0.15%	
震荡幅度	0.99%	1.58%(月均值)	投机度	0.94	1.15(月均值)

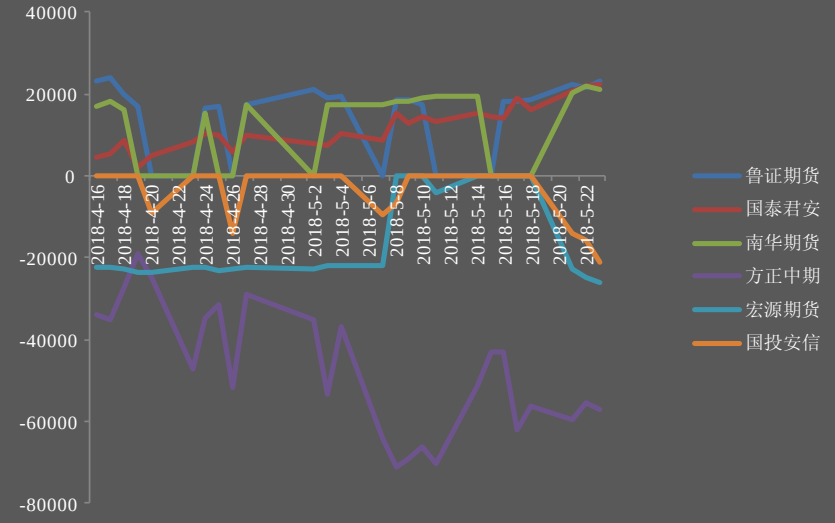
变动幅度		当日	最近5日	平均变化	波动率
al持仓	多头前3	9.19%	-6.20%	-1.24%	20.81%
	空头前3	-1.20%	-5.88%	-1.18%	
al涨幅		-0.01%	-1.05%	-0.21%	
震荡幅度	0.62%	1.13%(月均值)	投机度	0.33	0.54(月均值)





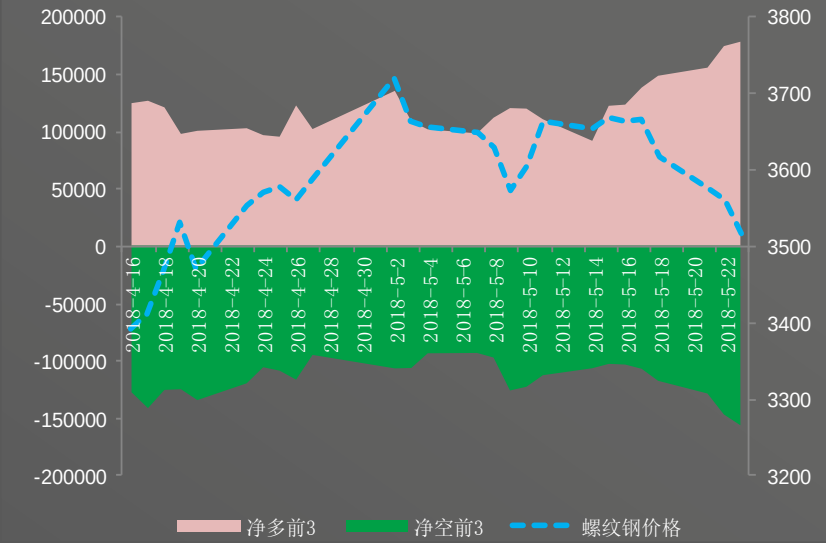
黑色板块：Rb & I

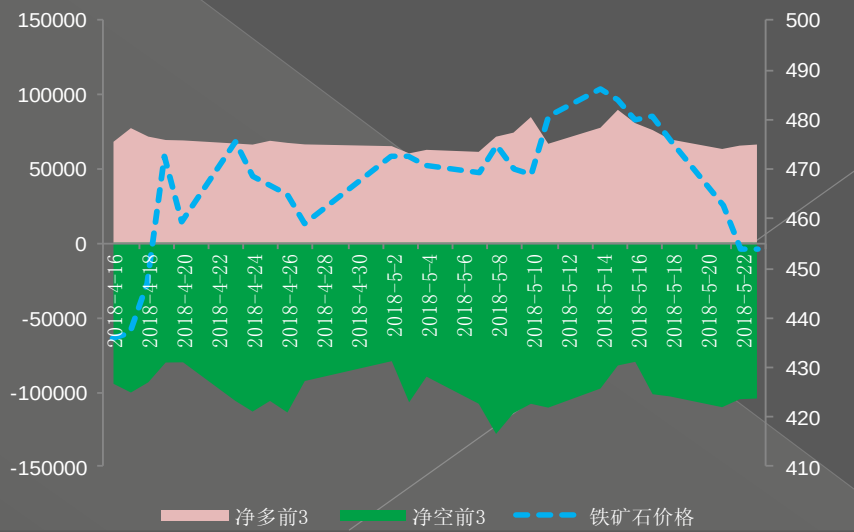




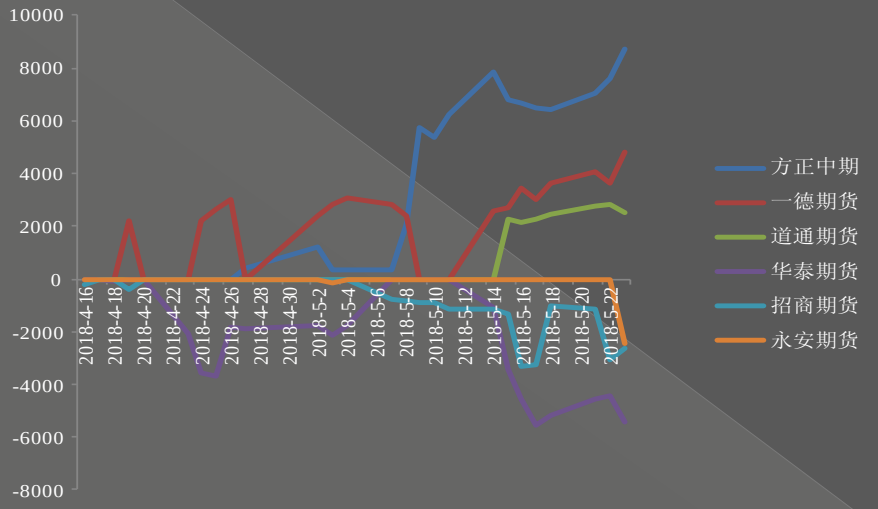
变动幅度		当日	最近5日	平均变化	波动率
rb持仓	多头前3	2.20%	44.60%	8.92%	25.11%
	空头前3	6.39%	51.06%	10.21%	
rb涨幅		-1.18%	-4.00%	-0.80%	
震荡幅度	1.98%	1.71%(月均值)	投机度	1.01	1.25(月均值)

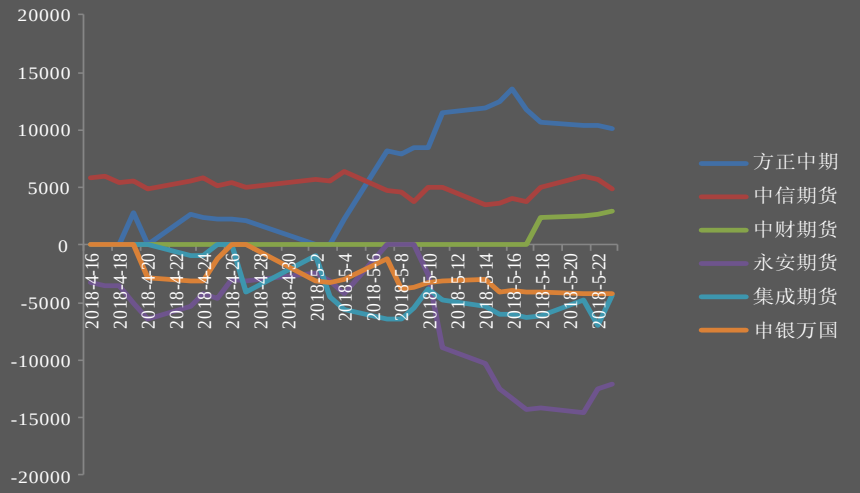
变动幅度		当日	最近5日	平均变化	波动率
I持仓	多头前3	1.14%	-17.88%	-3.58%	29.46%
	空头前3	-0.48%	30.81%	6.16%	
I涨幅		0.00%	-5.42%	-1.08%	
震荡幅度	1.94%	2.70%(月均值)	投机度	1.15	1.33(月均值)





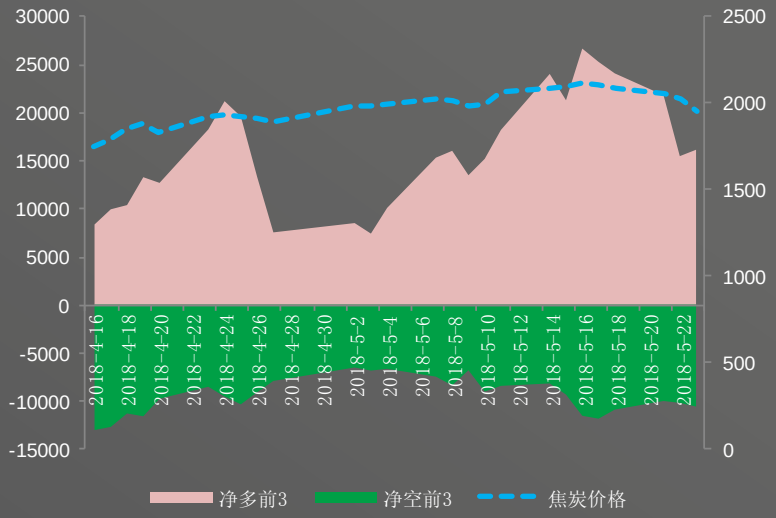
黑色板块：J & JM

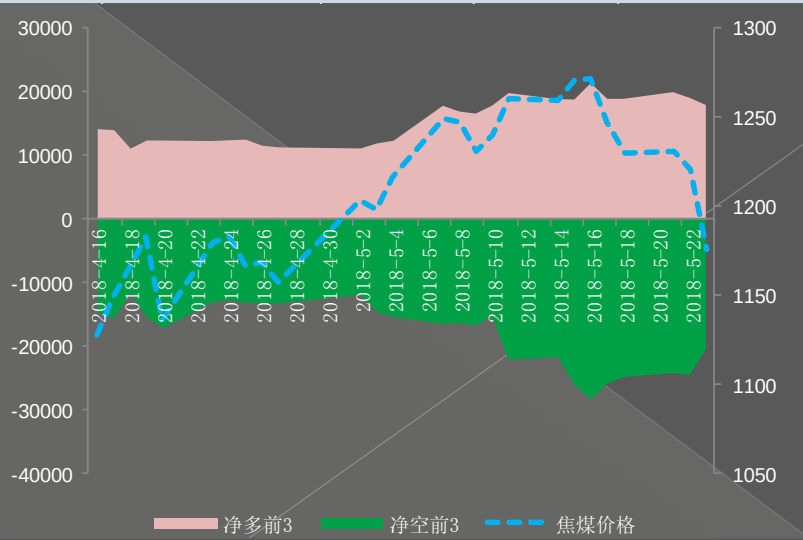




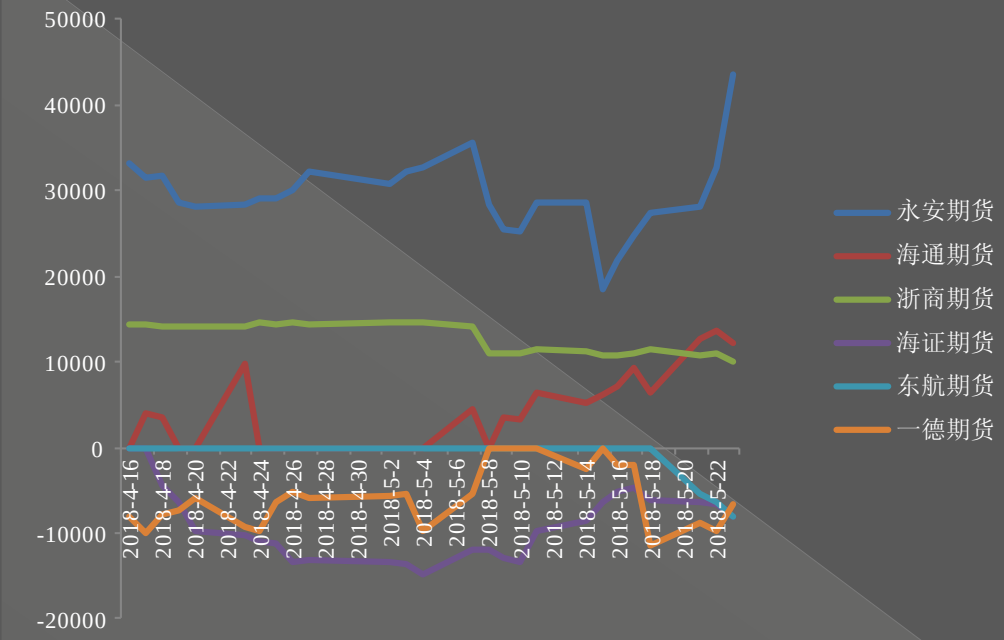
变动幅度		当日	最近5日	平均变化	波动率
j持仓	多头前3	4.29%	-39.50%	-7.90%	42.87%
	空头前3	3.76%	-8.25%	-1.65%	
j涨幅		-3.06%	-7.53%	-1.51%	
震荡幅度	3.95%	2.71%(月均值)	投机度	1.71	1.42(月均值)

变动幅度		当日	最近5日	平均变化	波动率
jm持仓	多头前3	-5.95%	-15.98%	-3.20%	30.73%
	空头前3	-16.46%	-27.74%	-5.55%	
jm涨幅		-3.70%	-7.56%	-1.51%	
震荡幅度	5.18%	2.86%(月均值)	投机度	1.40	1.25(月均值)

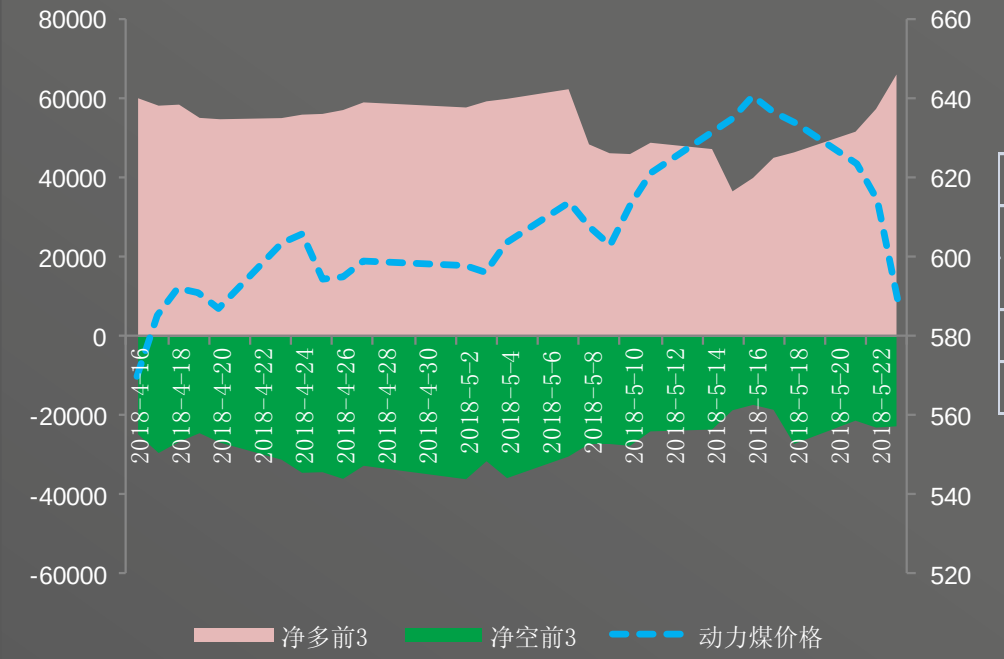




大陆期货

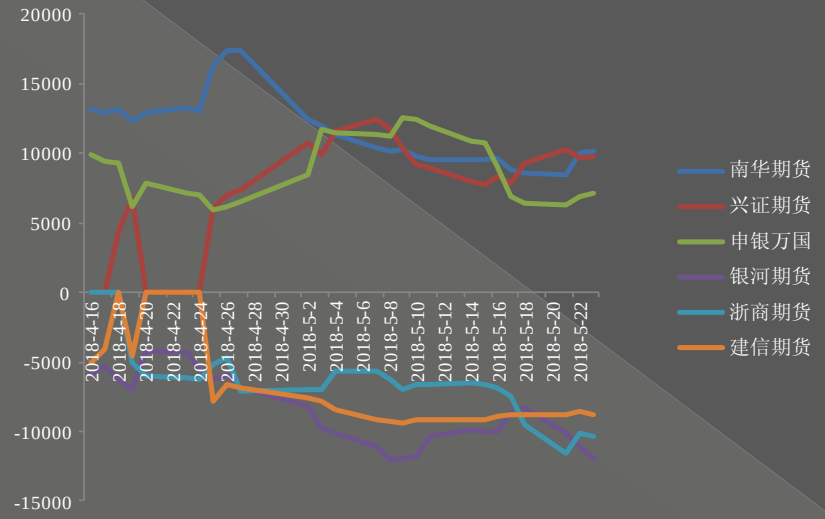


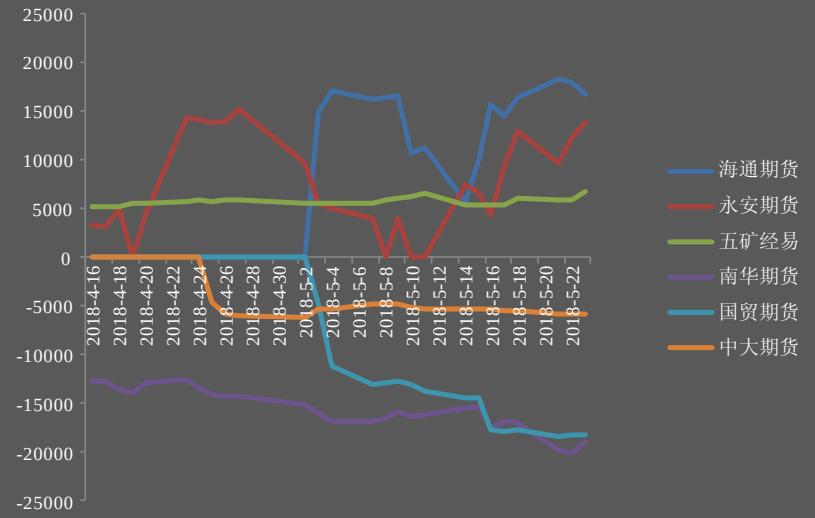
黑色：动力煤



变动幅度		当日	最近5日	平均变化	波动率
zc持仓	多头前3	15.14%	65.09%	13.02%	34.80%
	空头前3	-1.39%	31.50%	6.30%	
zc涨幅		-4.02%	-7.96%	-1.59%	
震荡幅度	3.68%	1.89%(月均值)	投机度	1.74	0.88(月均值)

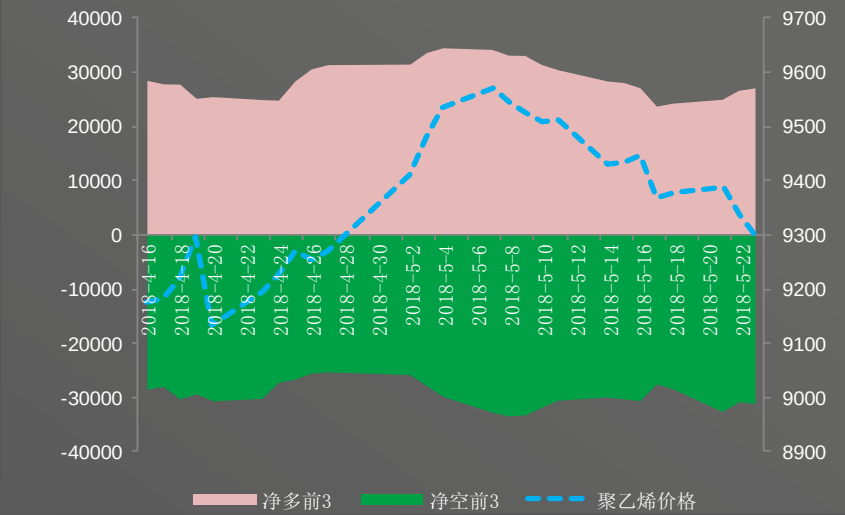
化工：塑料 & PP

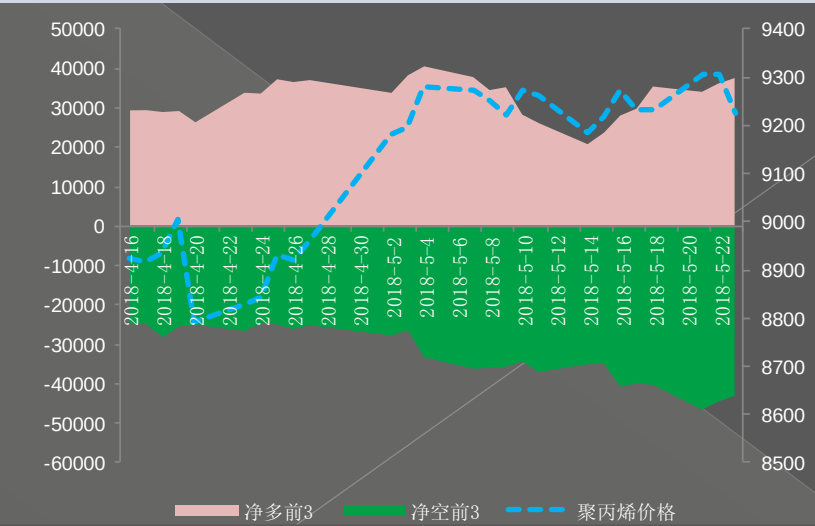




变动幅度		当日	最近5日	平均变化	波动率
l持仓	多头前3	1.74%	-0.06%	-0.01%	11.99%
	空头前3	0.85%	1.68%	0.34%	
l涨幅		-0.40%	-1.58%	-0.32%	
震荡幅度	0.76%	1.12%(月均值)	投机度	0.42	0.58(月均值)

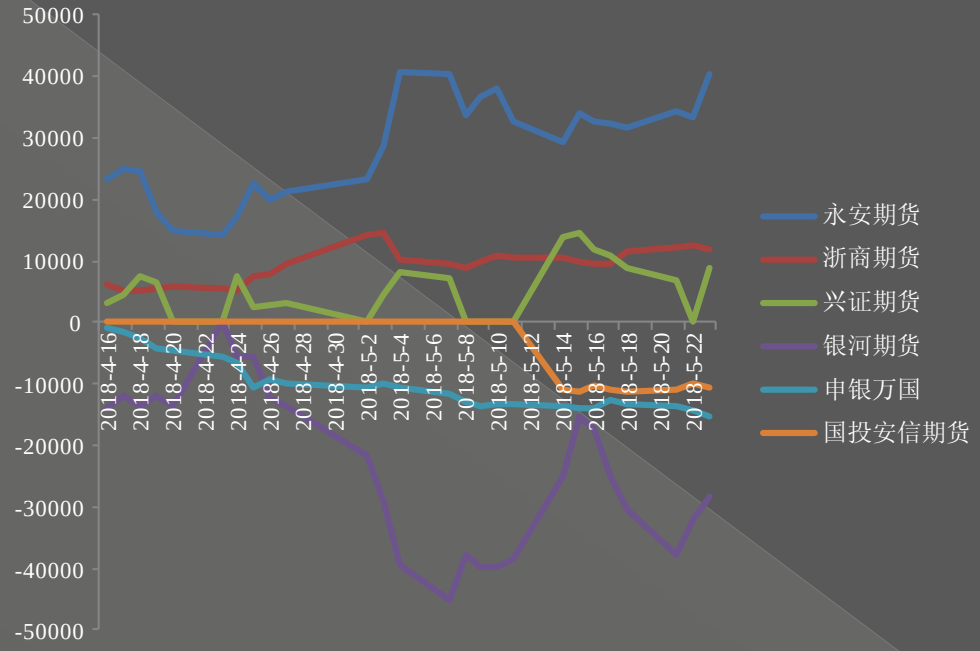
变动幅度		当日	最近5日	平均变化	波动率
pp持仓	多头前3	3.85%	34.03%	6.81%	15.29%
	空头前3	-3.34%	5.83%	1.17%	
pp涨幅		-0.87%	-0.51%	-0.10%	
震荡幅度	1.29%	1.31%(月均值)	投机度	0.56	0.74(月均值)

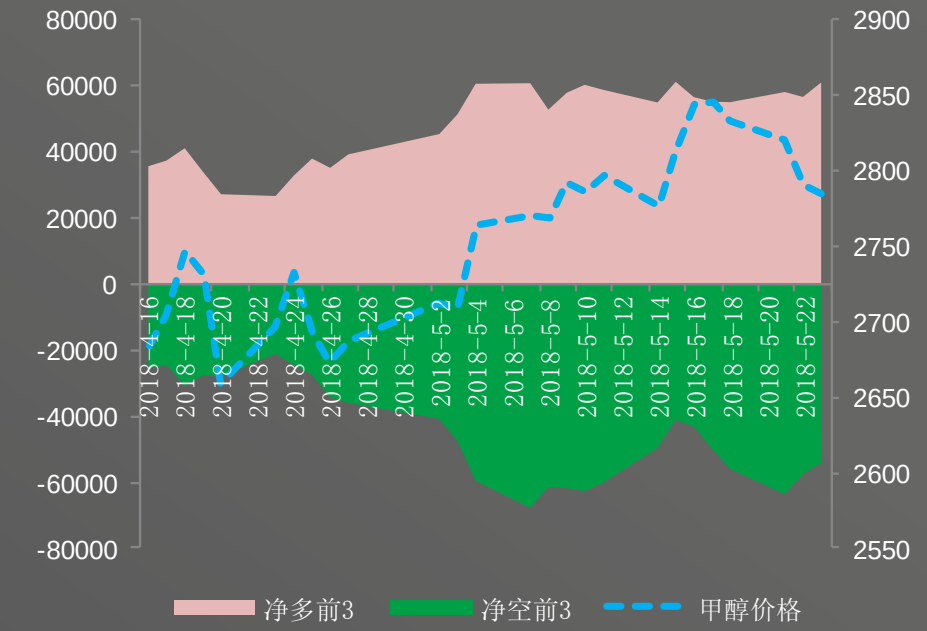




大陆期货

化工：甲醇

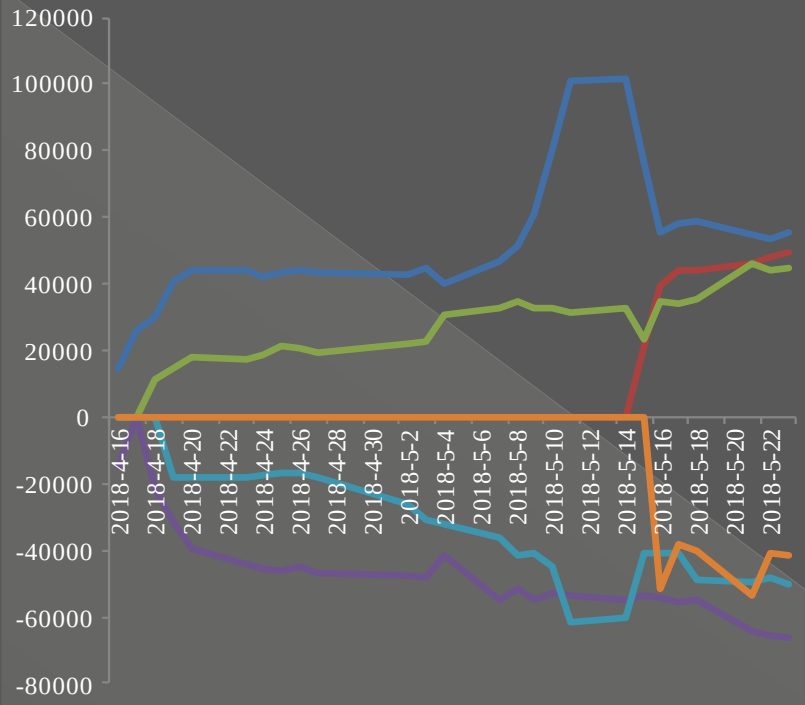


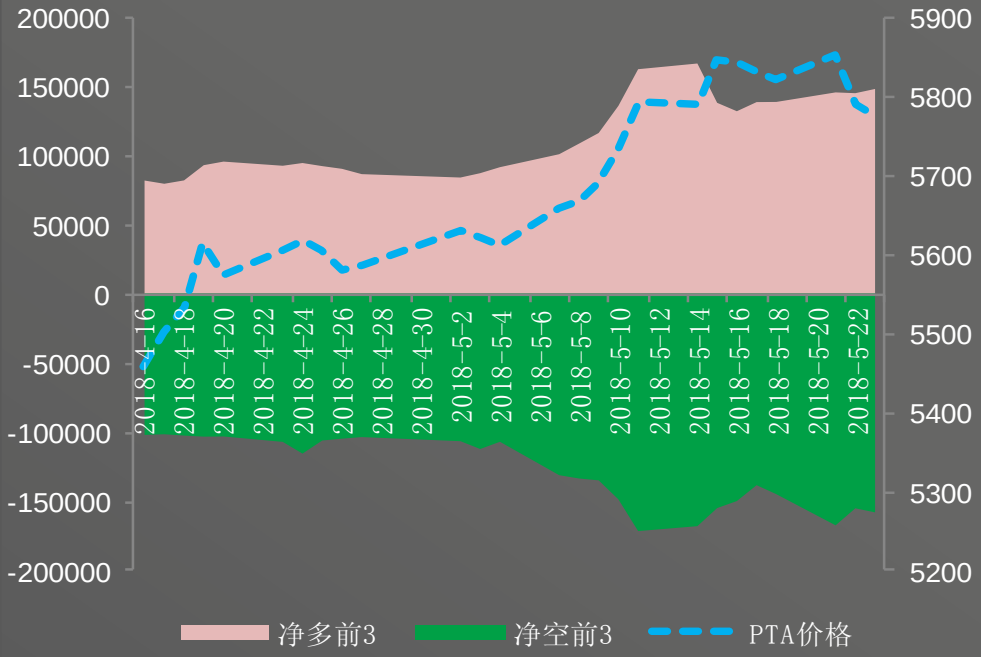


变动幅度		当日	最近5日	平均变化	波动率
ma持仓	多头前3	7.80%	7.91%	1.58%	18.77%
	空头前3	-6.05%	25.23%	5.05%	
ma涨幅		-0.21%	-2.10%	-0.42%	
震荡幅度	1.19%	1.63%(月均值)	投机度	0.69	0.88(月均值)

大陆期货

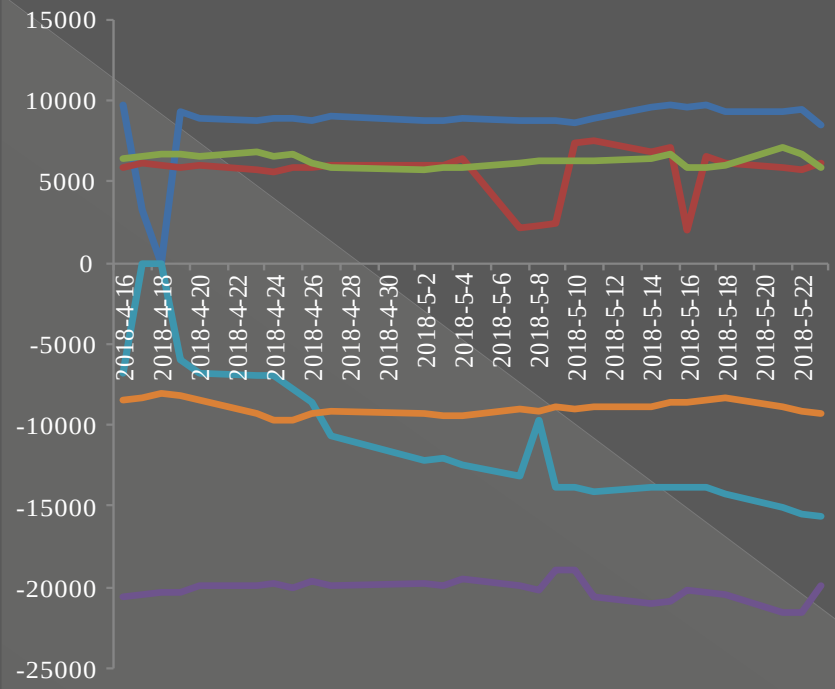
化工：PTA

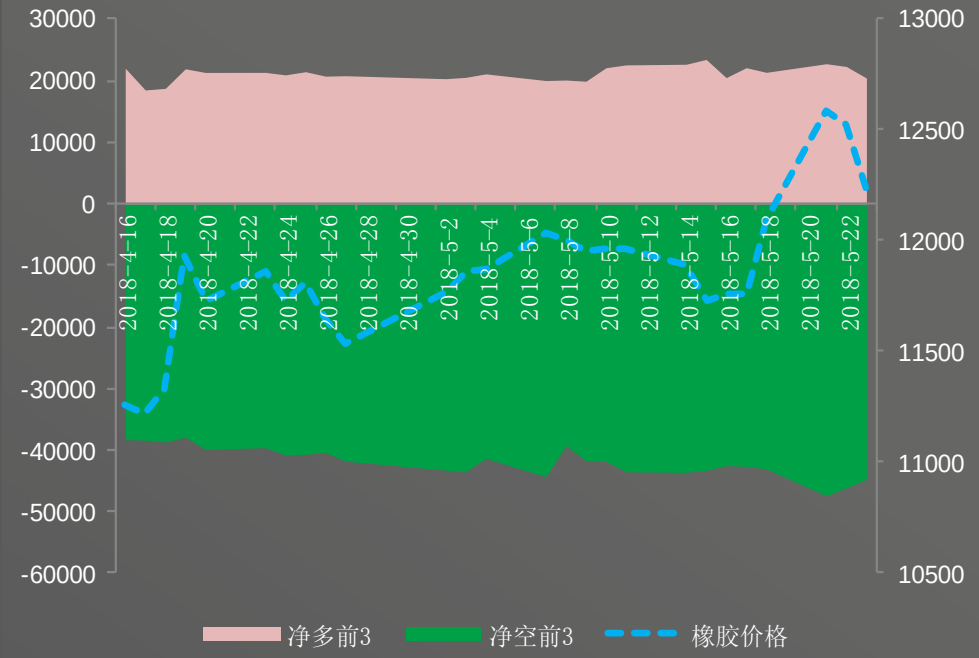




变动幅度		当日	最近5日	平均变化	波动率
pta持仓	多头前3	2.11%	12.21%	2.44%	17.12%
	空头前3	1.89%	5.45%	1.09%	
pta涨幅		-0.26%	-1.22%	-0.24%	
震荡幅度	1.21%	1.12%(月均值)	投机度	0.48	0.44(月均值)

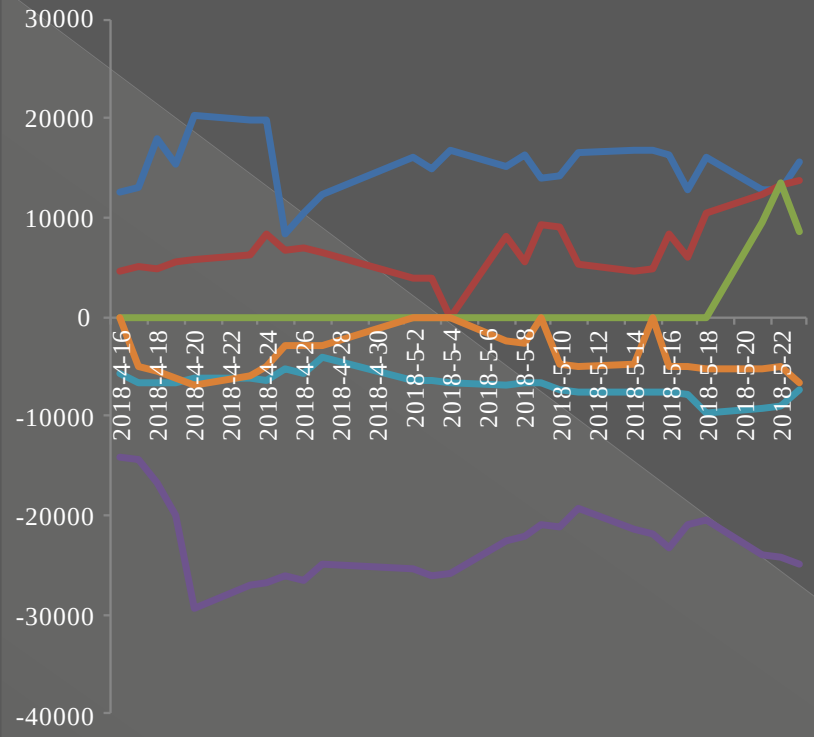
化工：橡胶

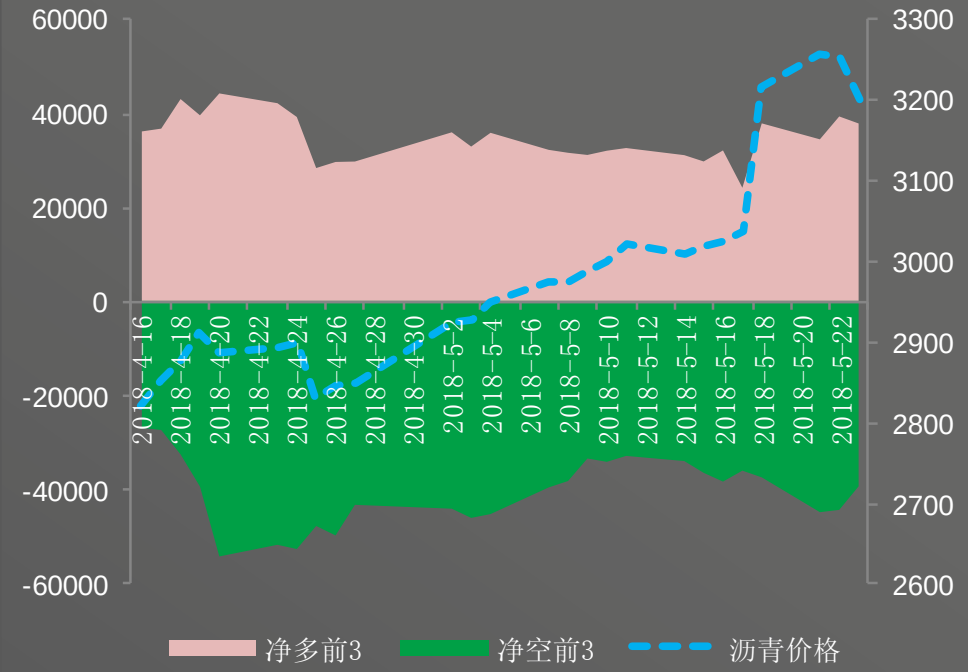




变动幅度		当日	最近5日	平均变化	波动率
ru持仓	多头前3	-8.40%	-0.33%	-0.07%	28.69%
	空头前3	-3.01%	5.25%	1.05%	
ru涨幅		-2.27%	4.10%	0.82%	
震荡幅度	5.17%	2.44%(月均值)	投机度	1.61	1.01(月均值)

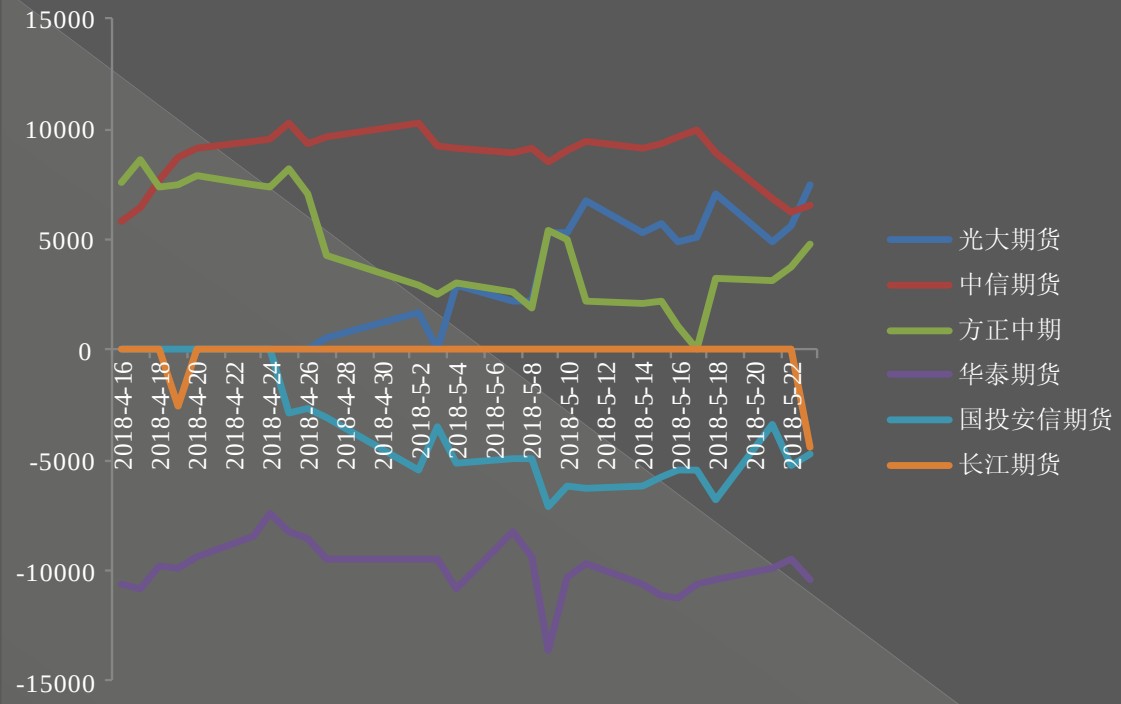
化工：沥青

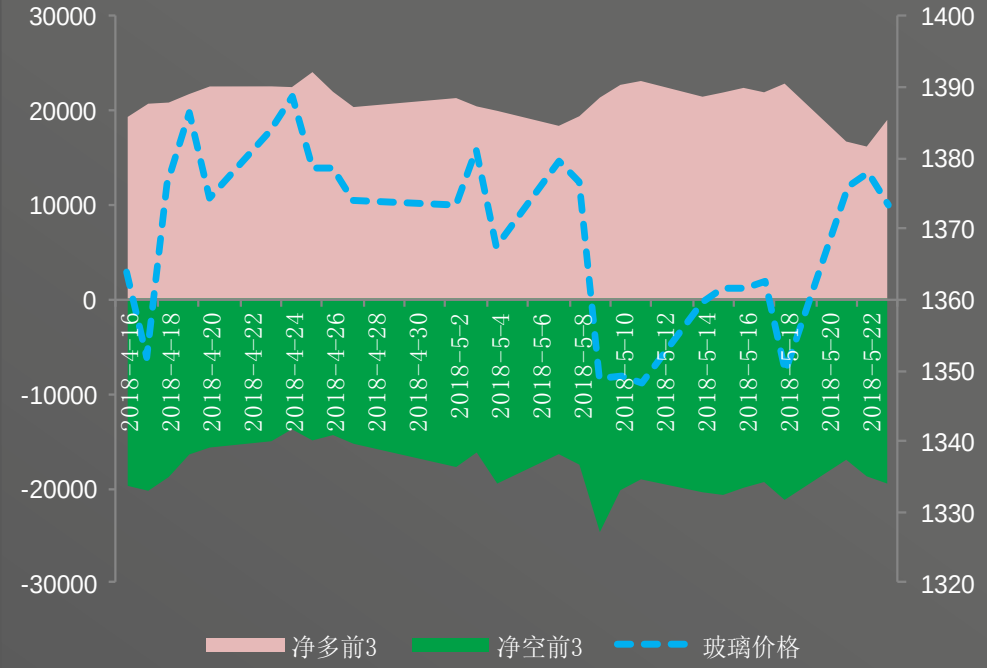




变动幅度		当日	最近5日	平均变化	波动率
bu持仓	多头前3	-3.80%	17.92%	3.58%	40.37%
	空头前3	-11.26%	2.63%	0.53%	
bu涨幅		-1.69%	5.72%	1.14%	
震荡幅度	3.35%	1.78%(月均值)	投机度	1.68	0.96(月均值)

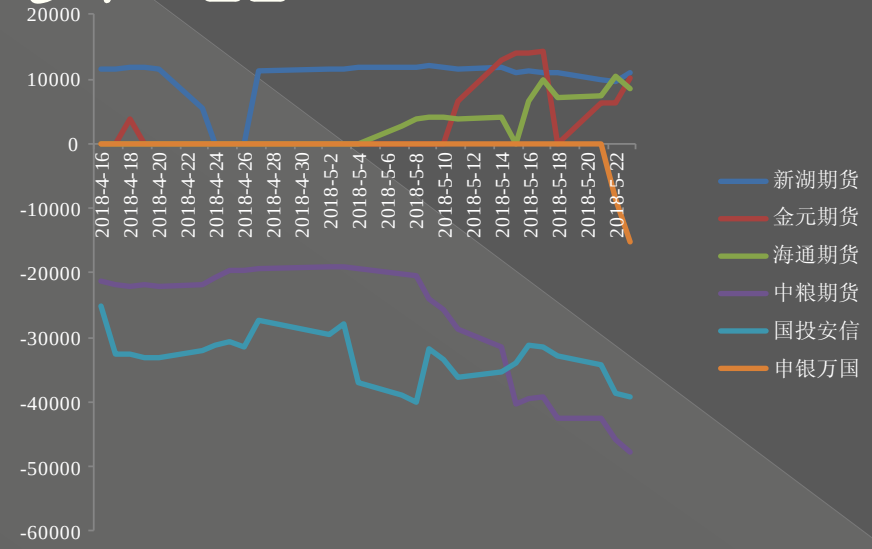
化工：玻璃



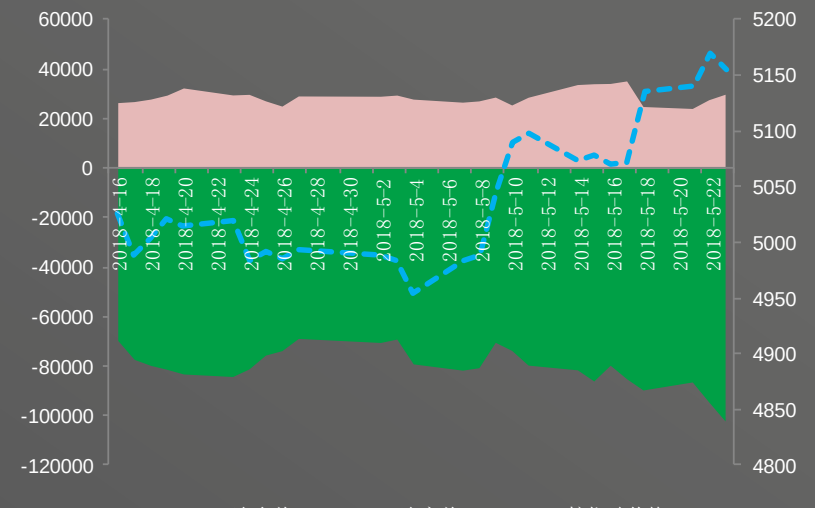


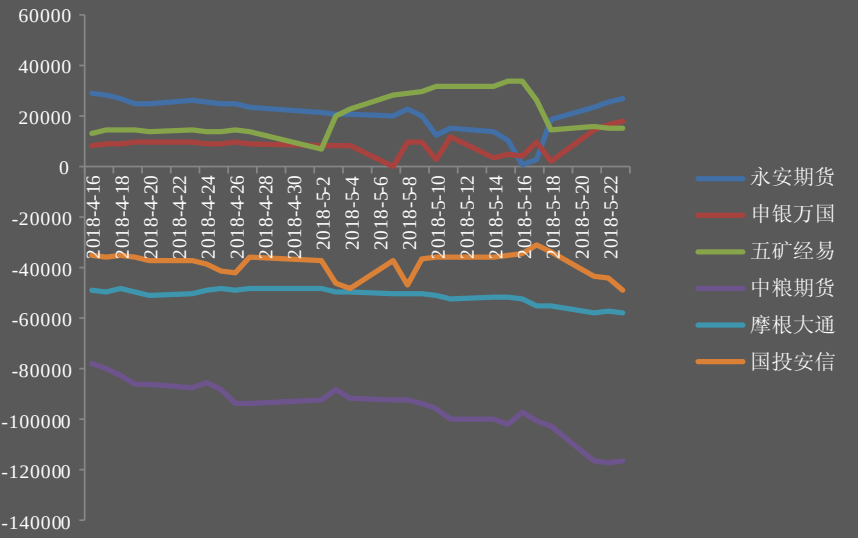
变动幅度		当日	最近5日	平均变化	波动率
fg持仓	多头前3	17.51%	-15.20%	-3.04%	13.31%
	空头前3	4.07%	-2.22%	-0.44%	
fg涨幅		-0.34%	0.86%	0.17%	
震荡幅度	1.55%	1.35%(月均值)	投机度	0.70	0.59(月均值)

农产品：P & Y

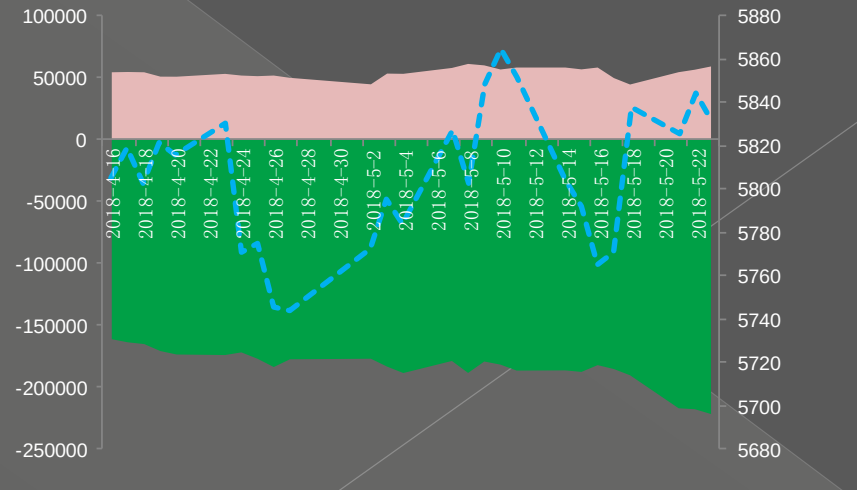


变动幅度		当日	最近5日	平均变化	波动率
p持仓	多头前3	8.02%	-12.74%	-2.55%	15.60%
	空头前3	8.18%	28.33%	5.67%	
p涨幅		-0.30%	1.68%	0.34%	
震荡幅度	1.17%	0.92%(月均值)	投机度	0.49	0.49(月均值)

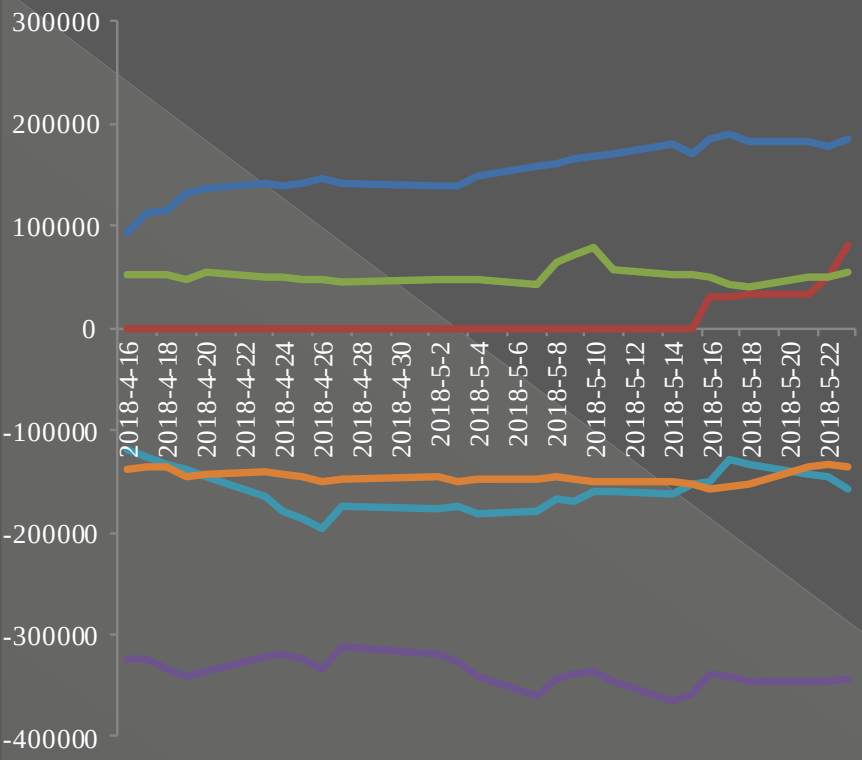




变动幅度		当日	最近5日	平均变化	波动率
y持仓	多头前3	4.62%	1.50%	0.30%	10.02%
	空头前3	1.79%	21.72%	4.34%	
y涨幅		-0.22%	1.14%	0.23%	
震荡幅度	1.14%	0.95%(月均值)	投机度	0.41	0.36(月均值)

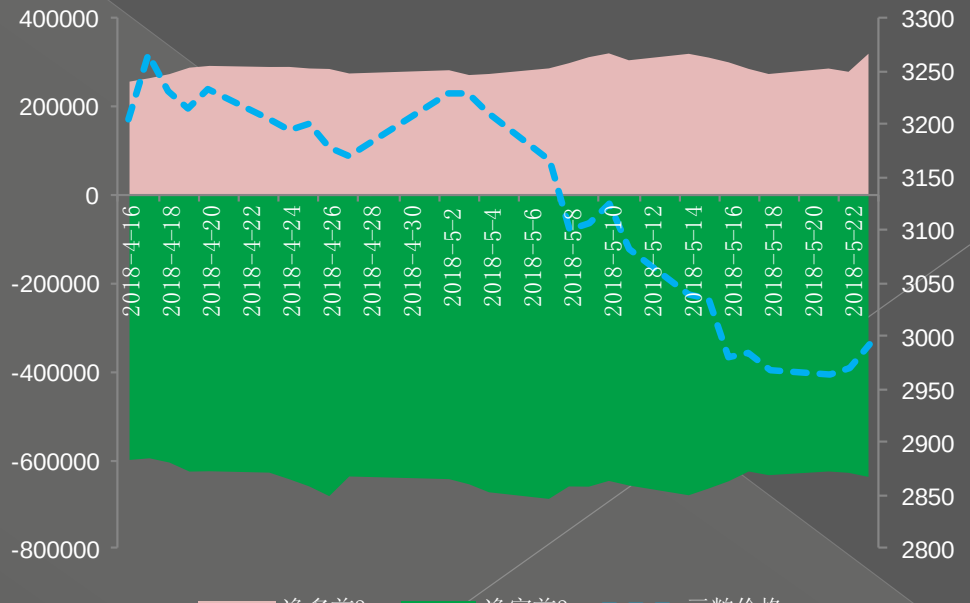


大陆期货



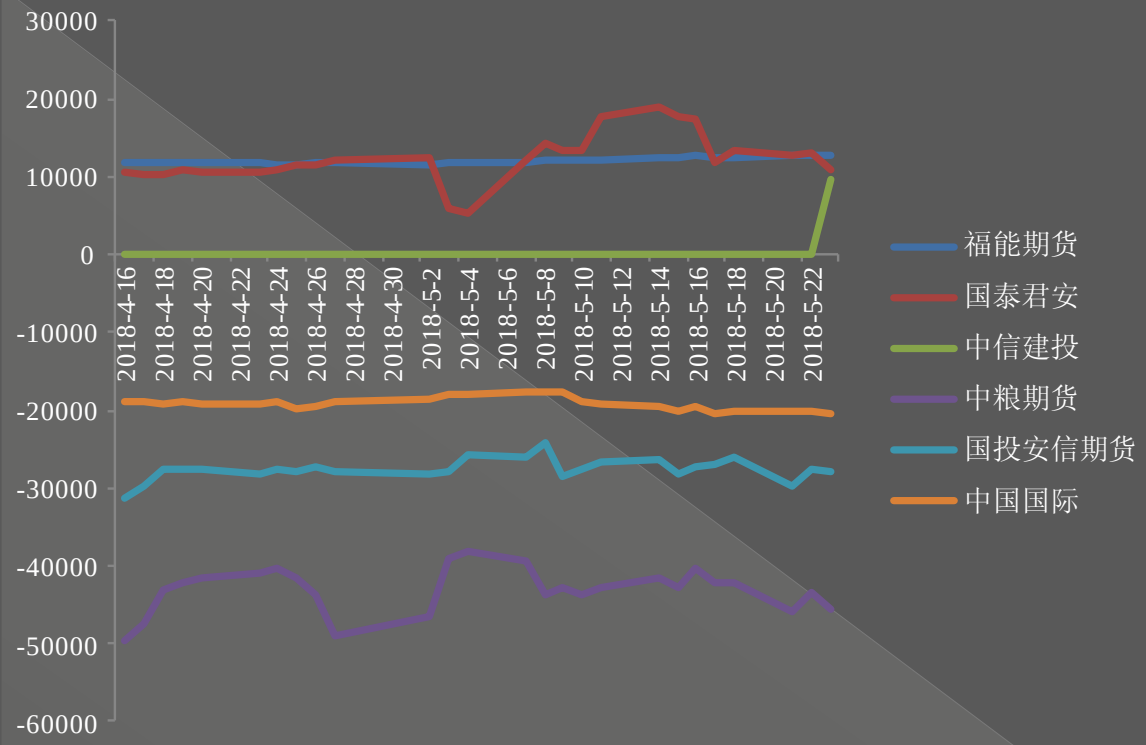
农产品：豆粕

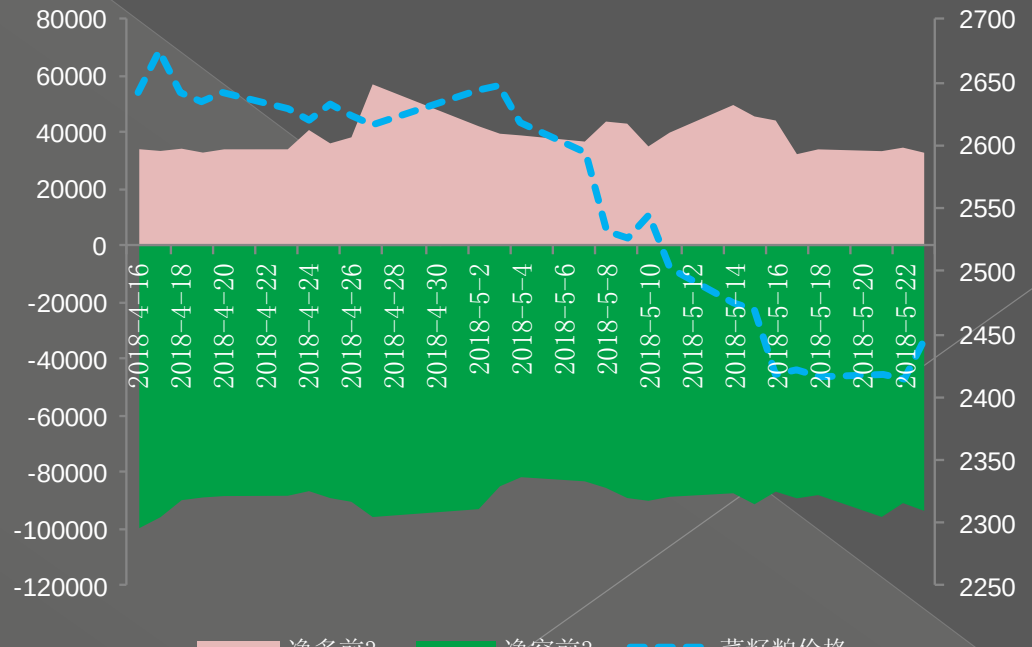
变动幅度		当日	最近5日	平均变化	波动率
m持仓	多头前3	14.51%	6.43%	1.29%	29.36%
	空头前3	1.48%	-1.52%	-0.30%	
m涨幅		0.74%	0.38%	0.08%	
震荡幅度	1.49%	1.58%(月均值)	投机度	0.51	0.50(月均值)



大陆期货

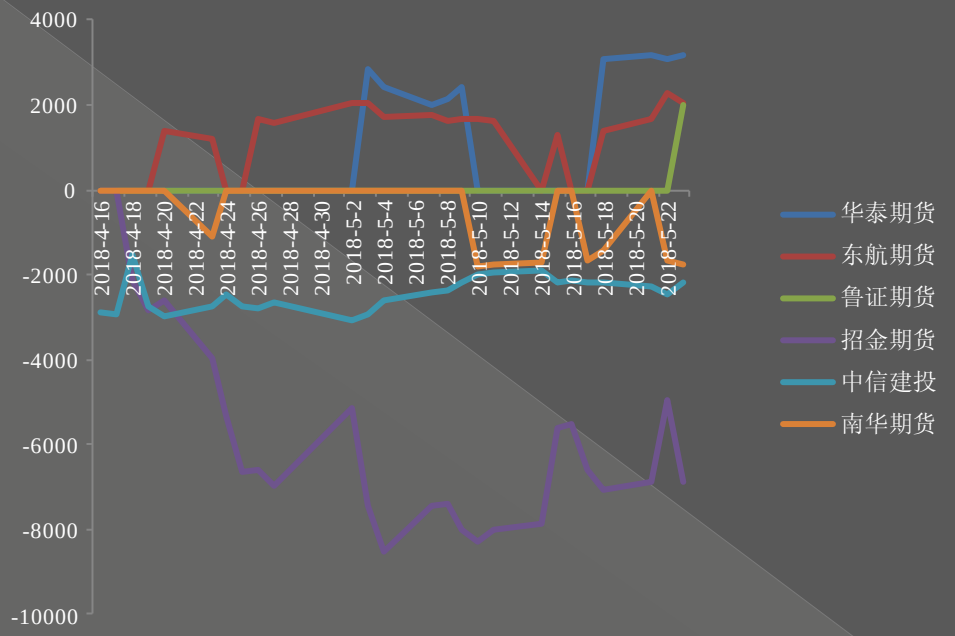
农产品：菜粕





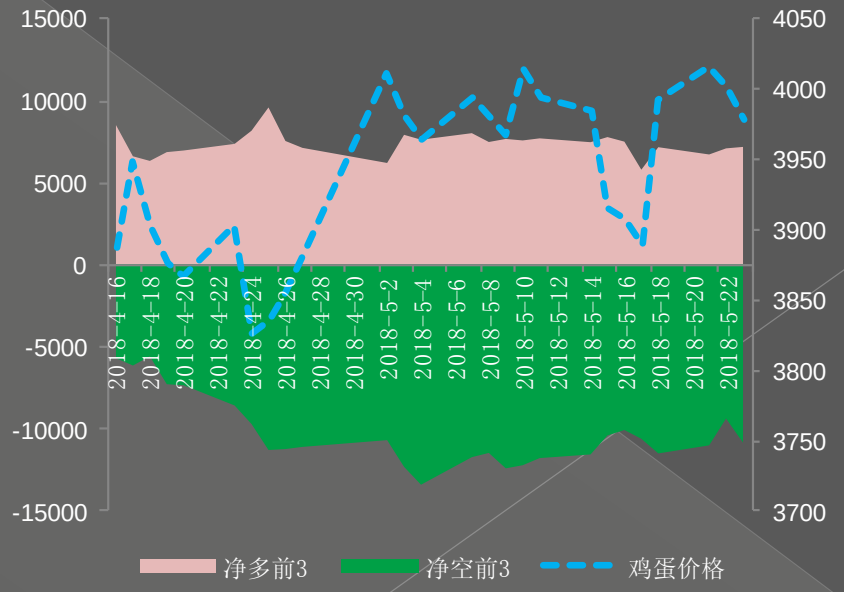
变动幅度		当日	最近5日	平均变化	波动率
rm持仓	多头前3	-5.16%	-25.62%	-5.12%	29.44%
	空头前3	3.03%	7.84%	1.57%	
rm涨幅		1.40%	1.22%	0.24%	
震荡幅度	1.67%	1.54%(月均值)	投机度	1.02	0.74(月均值)

大陆期货



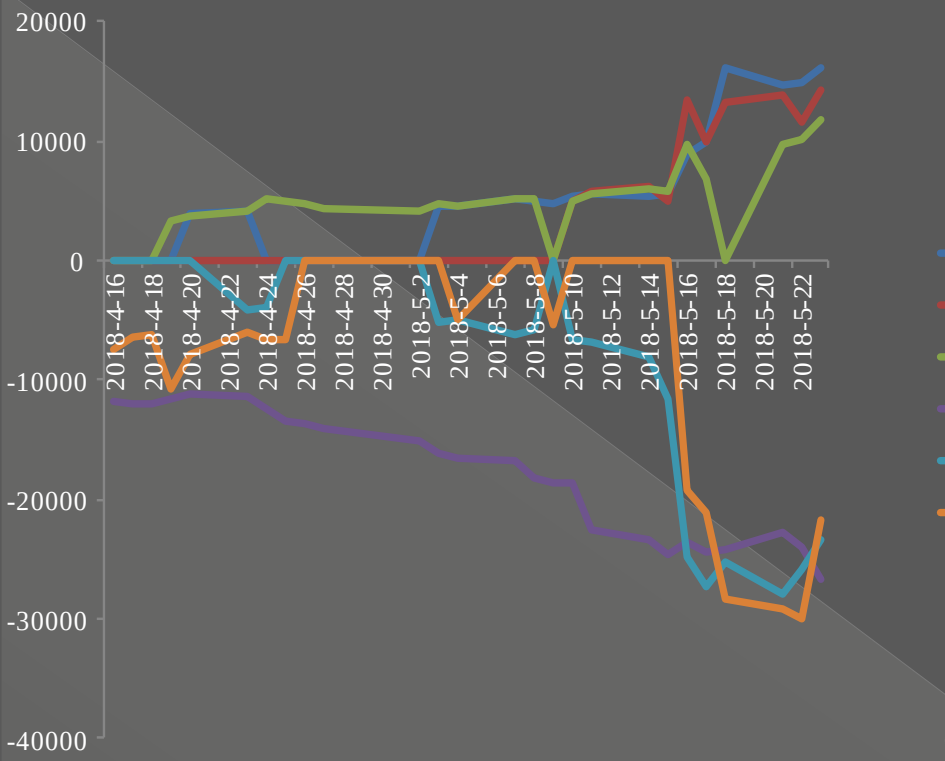
农产品：鸡蛋

变动幅度		当日	最近5日	平均变化	波动率
jd持仓	多头前3	1.28%	-4.30%	-0.86%	20.70%
	空头前3	15.65%	7.65%	1.53%	
jd涨幅		-0.58%	1.80%	0.36%	
震荡幅度	1.75%	1.65%(月均值)	投机度	0.84	0.73(月均值)

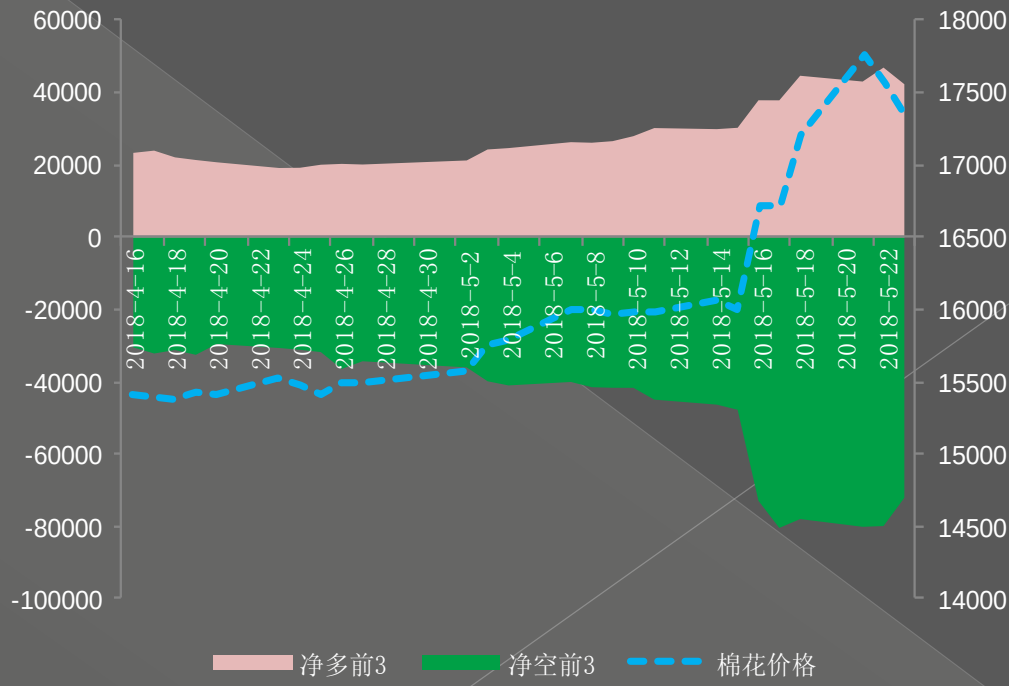


大陆期货

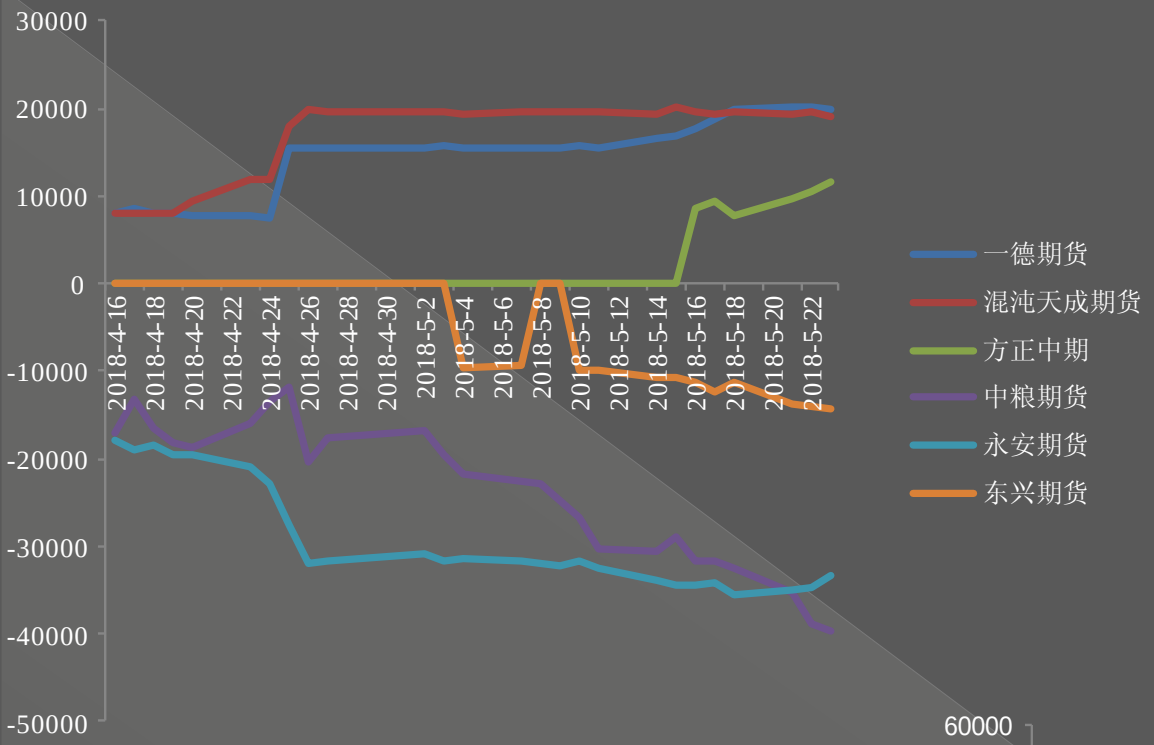
农产品：棉花



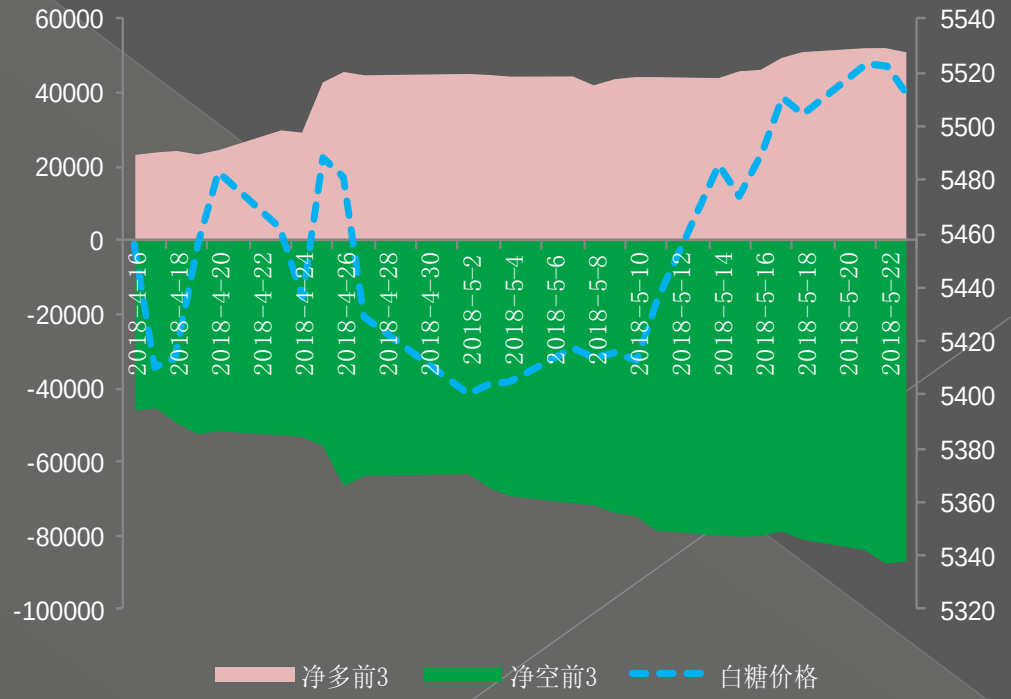
变动幅度		当日	最近5日	平均变化	波动率
cf持仓	多头前3	-9.77%	11.68%	2.34%	42.56%
	空头前3	-9.78%	-1.15%	-0.23%	
cf涨幅		-1.29%	3.75%	0.75%	
震荡幅度	4.06%	1.48%(月均值)	投机度	2.61	0.89(月均值)



农产品：白糖

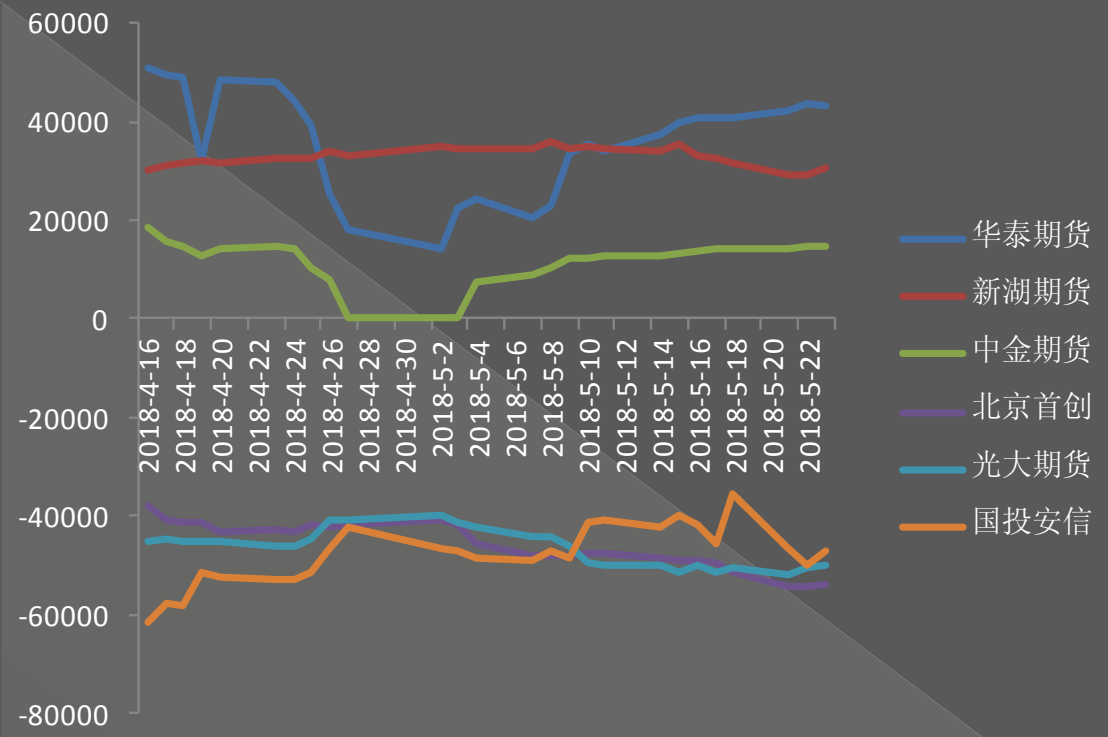


变动幅度		当日	最近5日	平均变化	波动率
sr持仓	多头前3	-2.22%	10.25%	2.05%	11.40%
	空头前3	-0.71%	8.54%	1.71%	
sr涨幅		-0.19%	0.40%	0.08%	
震荡幅度	0.88%	0.86%(月均值)	投机度	0.53	0.47(月均值)

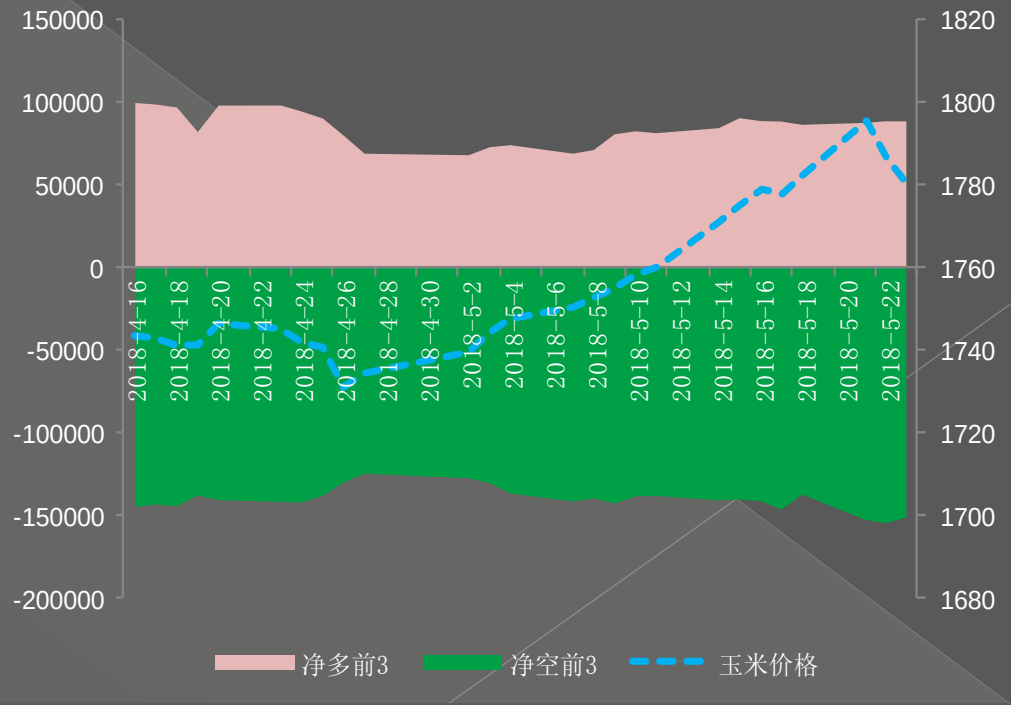


大陆期货

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	-0.09%	-0.23%	-0.05%	10.24%
	空头前3	-2.24%	7.05%	1.41%	
c涨幅		-0.34%	0.08%	0.02%	
震荡幅度	0.91%	0.65%(月均值)	投机度	0.34	0.30(月均值)



部分机构资金变动表

制表日期：2018年5月23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	2271.03	0.81%	-22699.26	-7.46%
南华期货	-22174.55	-17.70%	2638.88	2.63%
混沌天成	15083.62	--	15083.62	--
海通期货	2174.56	1.49%	29363.88	24.66%
上海大陆	1650.30	5.01%	12705.52	58.14%
中信期货	-18551.88	-10.42%	-32051.68	-16.74%
新湖期货	-1046.33	-1.52%	10569.79	18.44%

大陆期货

中粮期货	1216.02	0.34%	46140.15	14.63%
中信建投	-14737.64	-27.70%	-14688.87	-27.63%
申银万国	1652.91	2.46%	15880.96	29.99%
华泰期货	18196.46	31.02%	3646.30	4.98%
光大期货	-12572.00	-11.00%	-24339.13	-19.31%
一德期货	2771.07	1.93%	15153.00	11.53%
国投期货	14294.76	18.38%	5265.84	6.07%
金瑞期货	-2996.90	-3.11%	-20190.45	-17.80%
鲁证期货	-1900.98	-3.61%	-11563.16	-18.54%
中国国际	152.95	0.19%	17744.72	28.37%

部分机构持仓一览

机构	永安期货					
日期	2018-5-16	2018-5-17	2018-5-18	2018-5-21	2018-5-22	2018-5-23
黄金	2320	2352	2486	3006	2623	2435
白银	-7869	-7402	-7251	-7420	-5535	-5920
沪铜	3011	3174		2651		
沪铝			2563	3656	4087	1308
沪镍	22055	24038	30933	28255	28306	24480
沪锌	-6502	-5476	-5425	-4809	-5331	-5332
沪铅	4067	4328	4413	3670	3195	2959
螺纹钢	25621	43596	30125	23099	13401	28201
铁矿石			-9691	-15352	-18495	-11957
焦煤	-13365	-14270	-14113	-14584	-12495	-12054
焦炭	16512	15313	13943	10650	4222	-2439
豆油	1046	2763	18965	24121	25518	26908
棕榈油	5627	5704	6262			
菜籽油	10649	9744	9275	7984	7048	5581
豆粕	186273	189729	184045	182903	177880	185333
菜籽粕	-905	2123	1639	1972	1213	5218
棉花	-24451	-28542	-24114	-20776	-13307	-18314
白糖	-34283	-34142	-35619	-35030	-34740	-33325
玉米	-24421	-23976	-27788	-29737	-33911	-28374
鸡蛋					725	1110
PTA	55518	58419	59082	54858	53707	55505
聚乙烯	-6058	-5586		-6349	-7812	-7514
聚丙烯	4394	9347	12947	9686	12315	13951
甲醇	32859	32332	31588	34291	33380	40514
玻璃	5971	2130	3975	2824	2526	4776
橡胶	-20179	-20315	-20483	-21596	-21519	-19942
沥青	-23305	-20961	-20491	-23857	-24287	-25012
动力煤	21979	24842	27433	28178	32762	43654

部分机构持仓一览

机构	南华期货					
日期	2018-5-16	2018-5-17	2018-5-18	2018-5-21	2018-5-22	2018-5-23
黄金	-878	-963	-1066	-924	-837	-882
白银	8927	9151	9770	5893	9369	9120
沪铜	4036	4295	4148	3744	3742	4428
沪铝	6878	7257	6592	6250	6277	6592
沪镍	-6602	-5477	-7316	-7090	-8979	-17132
沪锌	3563	3994	4629	4676	3624	3492
沪铅						
螺纹钢			-11301			
铁矿石				20233	22116	21075
焦煤						
焦炭	-2569	-2565				
豆油	-8771					
棕榈油						
菜籽油				-5596	-10468	-10609
豆粕	-39152	-33471	-34250	-31613	-30279	
菜籽粕	-9727	-8066	-9273	-11554	-11942	-11279
棉花			10712	11695	12712	
白糖	6558	6855	7270	7294	7239	7525
玉米	-12027		-10346			
鸡蛋		-1665	-1447		-1643	-1741
PTA	-51461	-38047	-40216	-53673	-41204	-41333
聚乙烯	9644	8841	8573	8469	10102	10185
聚丙烯	-17572	-16744	-17005	-19811	-20114	-18936
甲醇	8750					
玻璃			-2334		2075	
橡胶	1110	1275	1377		1749	1672
沥青			3942			
动力煤		1449	807	1063	879	-4565

部分机构持仓一览

机构	国泰君安					
日期	2018-5-16	2018-5-17	2018-5-18	2018-5-21	2018-5-22	2018-5-23
黄金	7742	7706	7798	7627	7542	7409
白银	-15989	-16748	-15913	-16109	-15437	-19718
沪铜	9284	8869	7207	7866	3468	3698
沪铝			4727	4580	5159	5062
沪镍						
沪锌						
沪铅	1746	1242	1855	1746	1856	1974
螺纹钢			-18936	-21786	-24326	-25391
铁矿石	14200	19093	16413	20915	22126	22256
焦煤		3341	3210	3575	3109	1676
焦炭	-953	-977		-1127	-910	-351
豆油		-13368				
棕榈油	3906	4211	4481	4430		
菜籽油	24183	24275	24350	25188	26285	26471
豆粕		24306				
菜籽粕	17345	11710	13317	12762	13224	10954
棉花		7338	15338	11590	10549	8656
白糖	-8674					
玉米						
鸡蛋				1005	1012	
PTA	28998	30543	30912	30601	31638	33240
聚乙烯	4336	4789	4372	6274	5998	5622
聚丙烯						
甲醇	9544	8294	7863	6050		
玻璃	-2597	-2470	-1600	-1644		-1976
橡胶						
沥青	8237	6042	10539	12398	13214	13821
动力煤					-2301	-3634

部分机构持仓一览

机构	混沌天成					
日期	2018-5-16	2018-5-17	2018-5-18	2018-5-21	2018-5-22	2018-5-23
黄金						
白银						
沪铜						-5795
沪铝						
沪镍						
沪锌						
沪铅						
螺纹钢						
铁矿石						
焦煤						
焦炭						
豆油						
棕榈油						
菜籽油						
豆粕						
菜籽粕						
棉花						
白糖						
玉米						
鸡蛋						
PTA						
聚乙烯						
聚丙烯						
甲醇						
玻璃						
橡胶						
沥青						
动力煤						

部分机构持仓一览

机构	海通期货					
日期	2018-5-16	2018-5-17	2018-5-18	2018-5-21	2018-5-22	2018-5-23
黄金		2441			2854	2566
白银						
沪铜	-8981	-9151	-8326	-9564	-10241	-14714
沪铝						
沪镍	9947	9519	13522	12144	11208	12012
沪锌		-4048	-3938		-3723	-3695
沪铅	6606	6799	7059	7552	6209	5943
螺纹钢	-36441	-37379	-38959	-46700	-52549	-57037
铁矿石	-1473	584		-10068	-13464	
焦煤		958				-1062
焦炭	1732		655	309		308
豆油						
棕榈油	6543	9975	7055	7393	10381	8570
菜籽油			1124			4655
豆粕	29189	27939	29314	30881	31259	
菜籽粕		-733	-338		-363	-396
棉花	13401	9908	13267	13820	11562	14261
白糖	5861	10969	11344	12492	12046	10980
玉米	7507	7295	7319	9535	8070	8894
鸡蛋				1039		
PTA	38443	37539	36936	39871	25133	20091
聚乙烯						
聚丙烯	15757	14557	16386	18389	17973	16853
甲醇	6719	9116	7718	7457	6921	7175
玻璃	-2098	-2295	-1618	-2139	-3245	-2579
橡胶						
沥青	4474	4486		9181	9340	6946
动力煤	7246	9229	6535	12718	13647	12320

部分机构持仓一览

机构	上海大陆					
日期	2018-5-16	2018-5-17	2018-5-18	2018-5-21	2018-5-22	2018-5-23
黄金						
白银						
沪铜	6429	5966	6060	6137	6074	6077
沪铝						
沪镍						
沪锌						
沪铅						
螺纹钢						
铁矿石						
焦煤						
焦炭						
豆油						
棕榈油	8928	8948				
菜籽油						
豆粕						
菜籽粕						
棉花				11188	9793	10806
白糖						
玉米						
鸡蛋						
PTA						
聚乙烯						
聚丙烯						
甲醇						
玻璃						
橡胶						
沥青	-2775					
动力煤						

部分机构持仓一览

机构	中粮期货					
日期	2018-5-16	2018-5-17	2018-5-18	2018-5-21	2018-5-22	2018-5-23
黄金						
白银	8872	5490			8751	
沪铜	-8671	-9190	-9237	-12114	-11848	-8597
沪铝	-17338	-17601	-18188	-18431	-17410	-16379
沪镍					-5993	-4875
沪锌	6643	6344	4294	2773	2877	
沪铅	-1018	-1604				
螺纹钢						
铁矿石					15779	15151
焦煤						
焦炭	2782	2730				
豆油	-96730	-100189	-102288	-116543	-117182	-116008
棕榈油	-39319	-39098	-42354	-42471	-45850	-47805
菜籽油	-28473	-28359	-30575	-31796	-35947	-36875
豆粕	-338298	-339797	-345563	-345175	-346532	-343578
菜籽粕	-40219	-42045	-42095	-45930	-43283	-45512
棉花	-8112	-10643			-12293	-20737
白糖	-31586	-31654	-32423	-35194	-38847	-39519
玉米	-28583	-30212	-30018	-30496	-30975	-30427
鸡蛋						
PTA	23274	23128	27885	29715	16201	16204
聚乙烯	-4104	-4199	-4127	-4043		-4629
聚丙烯						
甲醇						
玻璃						
橡胶	-7537	-7501	-7609	-8013	-8006	-8089
沥青				-4647	-4542	-4502
动力煤	-4837	-4898	-4901		1633	260

部分机构持仓一览

机构	中信期货					
日期	2018-5-16	2018-5-17	2018-5-18	2018-5-21	2018-5-22	2018-5-23
黄金	12579	10757	10895	10886	11164	10880
白银	-22367	-23748	-22888	-20825	-20128	-11649
沪铜	-14333	-13868	-12980	-12235	-12888	-8950
沪铝				-4592	-5227	-5664
沪镍	-11241	-11955	-11191	-11343	-10372	-9304
沪锌	9585	9361	10138	9452	9257	9038
沪铅	-4884	-4033	-3659	-3286	-3023	-2362
螺纹钢	-14409	-11326	-16972	-6622		
铁矿石	-9886	-10963	-10280	5471	9199	10142
焦煤	4074	3761	5055	5971	5656	4861
焦炭	-2062	-1998			86	1163
豆油						
棕榈油	-4845					
菜籽油	-11106	-10401	-10592	-11963	-11813	-9779
豆粕	51064	48602	51420	55066	52383	53080
菜籽粕	4724	3253	3347	7225	3127	3543
棉花						
白糖	-14356	-12959	-12789	-13498	-11620	-9713
玉米	14661	15261	12459	15866	15398	14310
鸡蛋						
PTA	34648	33927	35221	46089	44338	44664
聚乙烯	-9660	-9001	-8260	-8124	-7822	-8128
聚丙烯	5605	5703	5238	5049	5061	5389
甲醇					5041	
玻璃	9672	9994	8990	6830	6275	6577
橡胶			-4366		-5345	-5395
沥青	5095	5300	4655			
动力煤		1155				

部分机构持仓一览

机构	中信建投					
日期	2018-5-16	2018-5-17	2018-5-18	2018-5-21	2018-5-22	2018-5-23
黄金	2186					
白银					6780	6765
沪铜						
沪铝						
沪镍	-5372	-5479	-5775	-5647	-5686	-5784
沪锌						
沪铅						
螺纹钢						
铁矿石	40604	38576	34964			
焦煤		2819	3179	2433		
焦炭					-2304	
豆油				8477	8296	
棕榈油	-9111	-14334	-14321	-6477	-9132	-8209
菜籽油				4087	4818	
豆粕						
菜籽粕						9663
棉花	6590	9994	10986	10967	11603	10523
白糖						
玉米						
鸡蛋	-2150	-2169	-2179	-2281	-2470	-2180
PTA	15287					
聚乙烯						
聚丙烯						
甲醇		7018	7547			
玻璃						
橡胶			5190	5550		
沥青	-3432	-3062		9498	13528	8502
动力煤						

六陆期货

部分机构持仓一览

机构	新湖期货					
日期	2018-5-16	2018-5-17	2018-5-18	2018-5-21	2018-5-22	2018-5-23
黄金	-874	-906	-823		-941	
白银						
沪铜						
沪铝						
沪镍						
沪锌						
沪铅						
螺纹钢				-29717	-29909	-31208
铁矿石						
焦煤						
焦炭						
豆油	2275		2684	-8562	-11679	-12053
棕榈油	11397	11079	11151	9834	9689	11098
菜籽油	-5734	-5597	-8639	-8909	-7212	-7415
豆粕	-102194	-98216	-96402	-80568	-80502	-79227
菜籽粕						
棉花						
白糖						
玉米	33045	32450	31622	29345	29414	30488
鸡蛋	1621	1645	1753	1857		-1543
PTA						
聚乙烯		3327				
聚丙烯						
甲醇						
玻璃						
橡胶	-6056	-6025	-6033	-6132	-6071	-5960
沥青		-3708	-5085	-5237	-6811	-6436
动力煤				-4784		

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