



市场持仓分析

2018/2/1

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	2.32%	-2.61%	-3.33%	18.74%	15.24%	9.20%	-16.42%	☆☆☆
甲醇	-1.20%	-0.87%	-6.58%	4.67%	2.74%	6.55%	-5.87%	☆☆
焦煤	-6.57%	-8.16%	-8.59%	11.00%	12.13%	9.56%	-17.57%	☆☆☆
动力煤	12.97%	10.66%	5.13%	-4.54%	-3.29%	-3.54%	17.51%	☆☆☆
铁矿石	-2.40%	-3.34%	-2.87%	3.52%	3.58%	3.91%	-5.92%	☆☆
玻璃	-14.82%	-12.37%	-10.12%	6.54%	6.48%	8.29%	-21.36%	☆☆☆☆
豆粕	4.77%	4.07%	2.72%	-0.29%	-0.74%	-1.75%	5.06%	☆☆
玉米	-0.18%	-3.21%	2.23%	-14.52%	-12.19%	-5.85%	14.34%	☆☆☆
棕榈油	1.31%	5.71%	4.04%	-3.88%	-3.21%	-2.77%	5.19%	☆☆
鸡蛋	-3.05%	-3.45%	-1.32%	1.01%	1.28%	1.54%	-4.06%	☆
沪镍	-2.44%	-2.40%	-1.85%	0.04%	0.50%	1.56%	-2.48%	☆
菜籽粕	5.88%	4.84%	3.11%	-2.54%	-4.63%	-2.70%	8.42%	☆☆
橡胶	2.19%	1.05%	0.20%	-1.12%	-0.19%	0.43%	3.31%	☆
豆油	-1.64%	-0.03%	2.25%	-2.12%	-3.08%	-1.91%	0.48%	☆
沪铜	-0.89%	0.19%	0.56%	0.07%	0.75%	1.37%	-0.96%	☆
棉花	1.81%	-0.63%	-1.32%	3.28%	2.89%	2.97%	-1.47%	☆
白糖	-2.01%	-0.13%	-1.10%	3.27%	3.45%	-0.48%	-5.28%	☆☆
沪锌	0.98%	0.46%	-2.27%	-0.03%	0.81%	-0.31%	1.01%	☆
聚乙烯	-2.98%	-2.90%	-4.29%	-4.03%	-3.81%	1.35%	1.05%	☆
聚丙烯	-2.54%	-5.66%	-0.28%	1.90%	0.03%	1.21%	-4.44%	☆
沥青	-1.88%	2.86%	0.39%	0.25%	0.47%	-0.27%	-2.13%	☆
沪银	-0.26%	-0.55%	0.47%	-3.33%	-2.39%	-1.19%	3.07%	☆
PTA	3.15%	0.23%	-0.94%	5.54%	4.83%	4.36%	-2.39%	☆
沪金	-4.60%	-3.20%	-1.53%	13.47%	9.06%	5.03%	-18.07%	☆☆☆
沪铝	2.62%	2.69%	1.98%	-2.80%	-2.64%	-1.84%	5.41%	☆☆
螺纹钢	2.14%	1.86%	3.63%	-2.78%	-2.34%	-1.05%	4.92%	☆

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	-2.79%	-6.00%	-9.63%	11.00%	9.63%	9.52%	-13.79%	☆☆
玉米	-0.02%	0.14%	-3.88%	-2.48%	-4.65%	1.55%	2.46%	☆
棕榈油	1.50%	7.84%	7.52%	-5.89%	-7.92%	-6.28%	7.40%	☆
动力煤	7.90%	5.49%	4.85%	-21.82%	-12.27%	-6.51%	29.72%	☆☆
聚丙烯	-1.98%	-2.16%	3.59%	17.18%	10.49%	5.68%	-19.16%	☆☆
橡胶	4.46%	4.08%	4.88%	-3.89%	-4.64%	-2.42%	8.36%	☆
棉花	-4.00%	-9.21%	-16.60%	13.87%	12.06%	14.63%	-17.88%	☆☆
鸡蛋	-5.25%	-3.66%	-0.74%	3.82%	2.22%	2.62%	-9.07%	☆
菜籽粕	15.93%	10.00%	11.96%	-12.43%	-14.28%	-9.93%	28.37%	☆☆
铁矿石	-9.49%	-5.58%	0.61%	5.74%	7.51%	2.19%	-15.23%	☆☆
豆油	15.34%	14.91%	5.61%	-0.79%	-2.83%	-3.32%	16.13%	☆☆
沪镍	-19.51%	-13.44%	-12.10%	5.13%	5.61%	6.19%	-24.64%	☆☆
焦炭	-12.82%	-15.98%	-18.40%	10.68%	13.60%	17.07%	-23.51%	☆☆
沥青	-2.94%	3.32%	0.12%	5.90%	4.64%	0.49%	-8.84%	☆
沪银	29.64%	19.79%	12.75%	-0.81%	-3.04%	-4.96%	30.46%	☆☆☆
沪铝	17.92%	15.22%	5.68%	-8.95%	-9.33%	-7.42%	26.87%	☆☆
沪金	-5.60%	-4.72%	-5.47%	5.42%	1.55%	2.13%	-11.01%	☆☆
焦煤	9.09%	6.06%	-0.79%	-3.89%	-4.22%	1.24%	12.98%	☆☆
沪锌	2.13%	-6.52%	0.23%	-5.50%	-3.31%	-3.49%	7.63%	☆
聚乙烯	-17.78%	-15.36%	-12.61%	13.52%	9.95%	7.74%	-31.30%	☆☆☆
沪铜	-6.95%	-3.69%	0.17%	-3.21%	2.23%	-0.05%	-3.75%	☆
豆粕	8.88%	7.29%	8.37%	-4.84%	-7.08%	-6.05%	13.73%	☆☆
螺纹钢	-8.15%	-7.34%	-6.78%	6.88%	10.94%	8.66%	-15.04%	☆☆
PTA	13.34%	6.15%	-3.63%	7.12%	6.77%	9.86%	6.22%	☆
白糖	-2.89%	-2.86%	2.57%	2.63%	-4.01%	-5.91%	-5.51%	☆
玻璃	-16.61%	-13.33%	-8.26%	3.01%	6.88%	6.70%	-19.62%	☆☆

2018年2月1日机构持仓异动表

金属

金属	
招金期货	黄金净空单变动幅度为：2111手
海通期货	沪镍净多单变动幅度为：-10188手
建信期货	沪锌净多单变动幅度为：-6508手
海通期货	沪锌净多单变动幅度为：2685手
海通期货	沪铅净多单变动幅度为：-536手
国泰君安	沪铅净多单变动幅度为：1002手

黑色

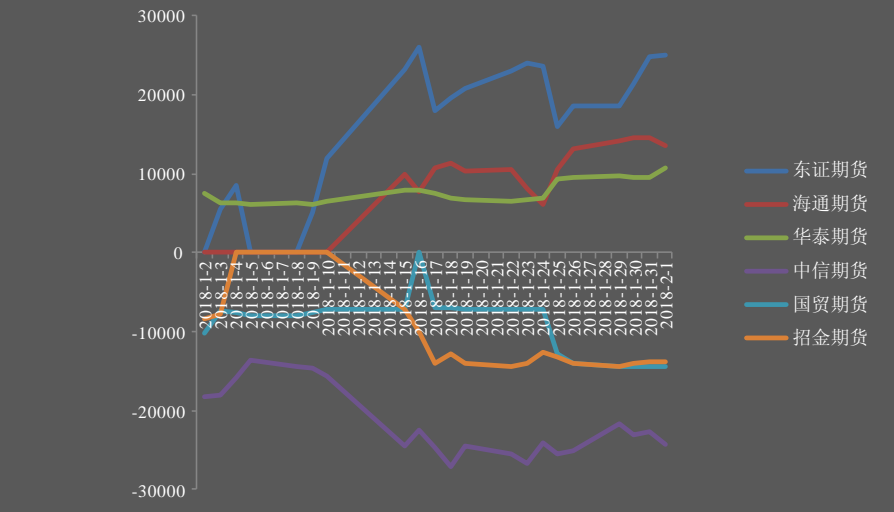
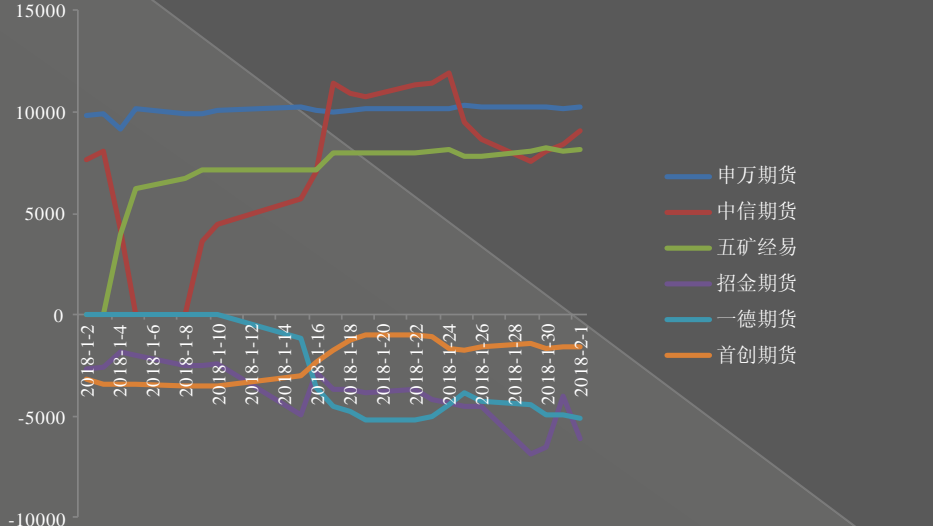
黑色	
浙商期货	螺纹钢净空单变动幅度为：41076手
冠通期货	铁矿石净多单变动幅度为：17057手
永安期货	焦煤净多单变动幅度为：3812手
银河期货	焦煤净空单变动幅度为：2619手
东证期货	焦炭净多单变动幅度为：-2217手
永安期货	焦炭净多单变动幅度为：4887手
兴证期货	焦炭净空单变动幅度为：2372手
长江期货	焦炭净空单变动幅度为：2312手
华信期货	动力煤净多单变动幅度为：-3403手
永安期货	动力煤净多单变动幅度为：3308手

2018年2月1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：4300手
南华期货	白糖净多单变动幅度为：-5101手
国泰君安	玉米净多单变动幅度为：-12466手
国投安信	玉米净空单变动幅度为：8509手
中信建投	鸡蛋净多单变动幅度为：2899手

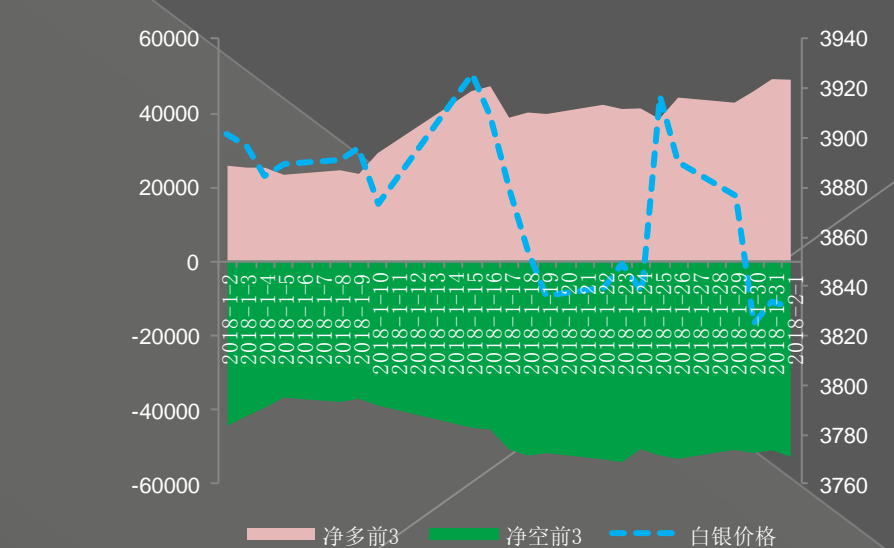
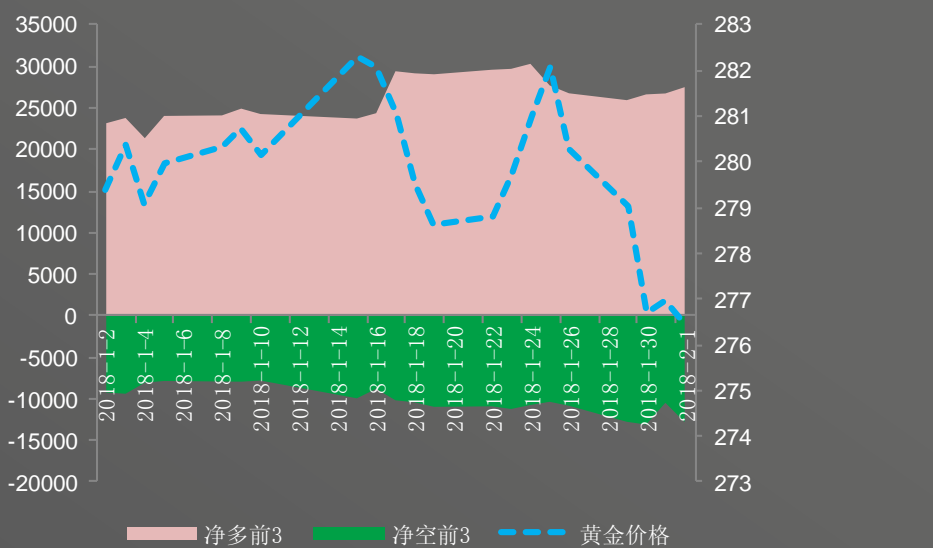
化工	
中信期货	PTA净多单变动幅度为：11355手
长安期货	聚乙烯净多单变动幅度为：5135手
永安期货	聚丙烯净多单变动幅度为：3962手
国泰君安	聚丙烯净多单变动幅度为：4135手
中信期货	玻璃净多单变动幅度为：-7701手
中信期货	玻璃净多单变动幅度为：-7701手
方正中期	沥青净空单变动幅度为：-8055手
申万期货	沥青净多单变动幅度为：11218手
新湖期货	沥青净空单变动幅度为：1949手
中国国际	橡胶净多单变动幅度为：-4214手

金属板块：AU & AG



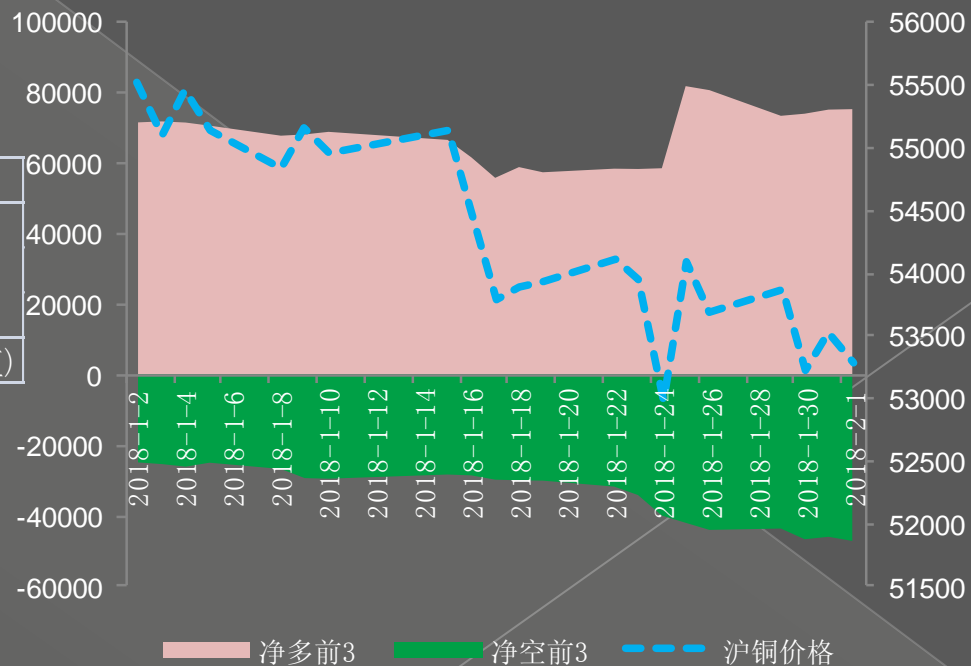
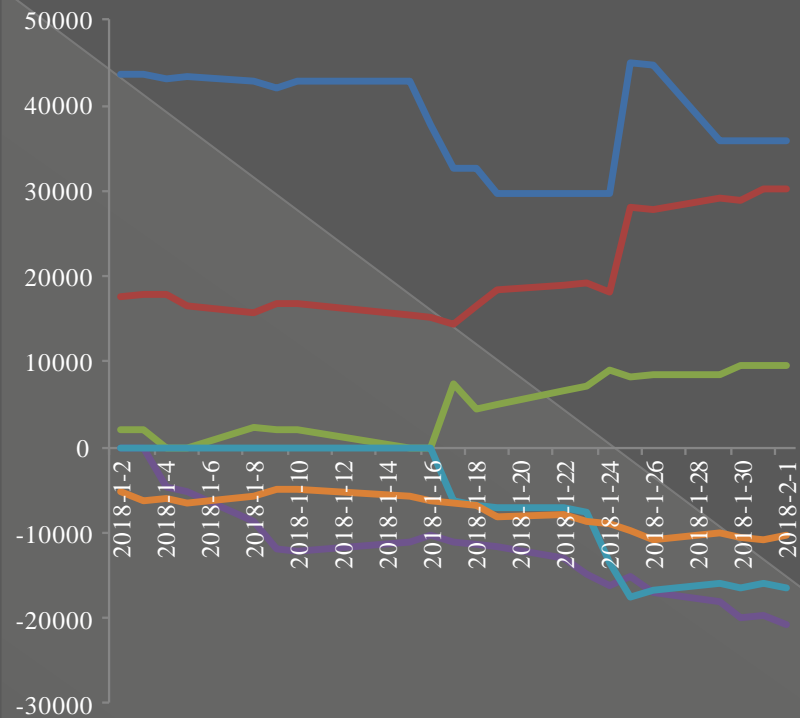
变动幅度		当日	最近5日	平均变化	波动率
au持仓	多头前3	2.84%	-0.74%	-0.15%	6.71%
	空头前3	22.10%	23.55%	4.71%	
au涨幅		-0.19%	-2.00%	-0.40%	
震荡幅度	0.42%	0.53%(月均值)	投机度	0.34	0.38(月均值)

变动幅度		当日	最近5日	平均变化	波动率
ag持仓	多头前3	-0.31%	27.64%	5.53%	11.31%
	空头前3	3.43%	0.74%	0.15%	
ag涨幅		-0.05%	-2.18%	-0.44%	
震荡幅度	0.47%	0.82%(月均值)	投机度	0.32	0.48(月均值)



金属板块：Cu

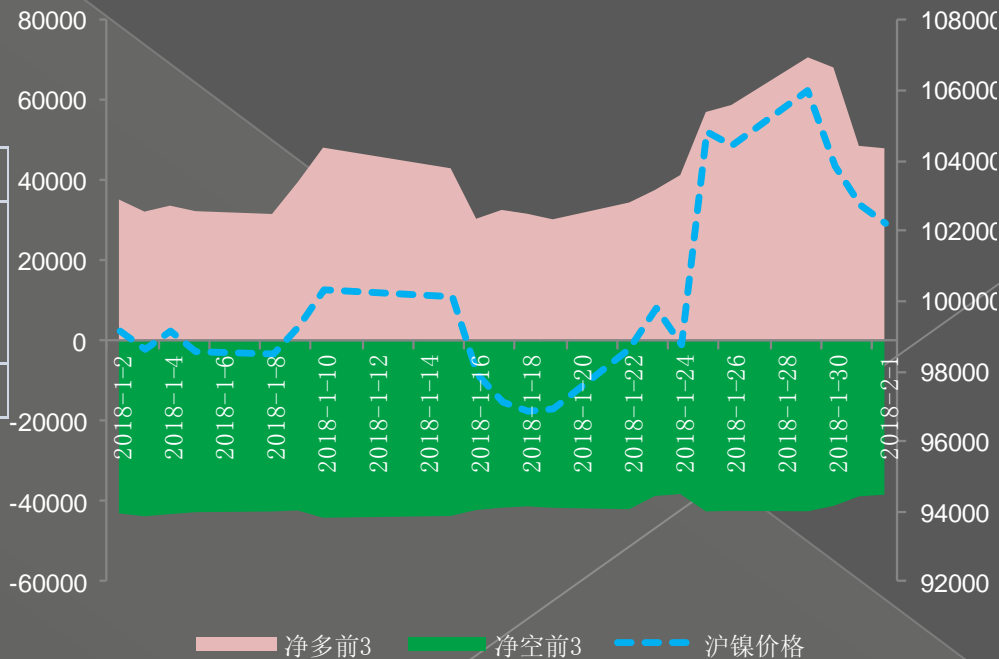
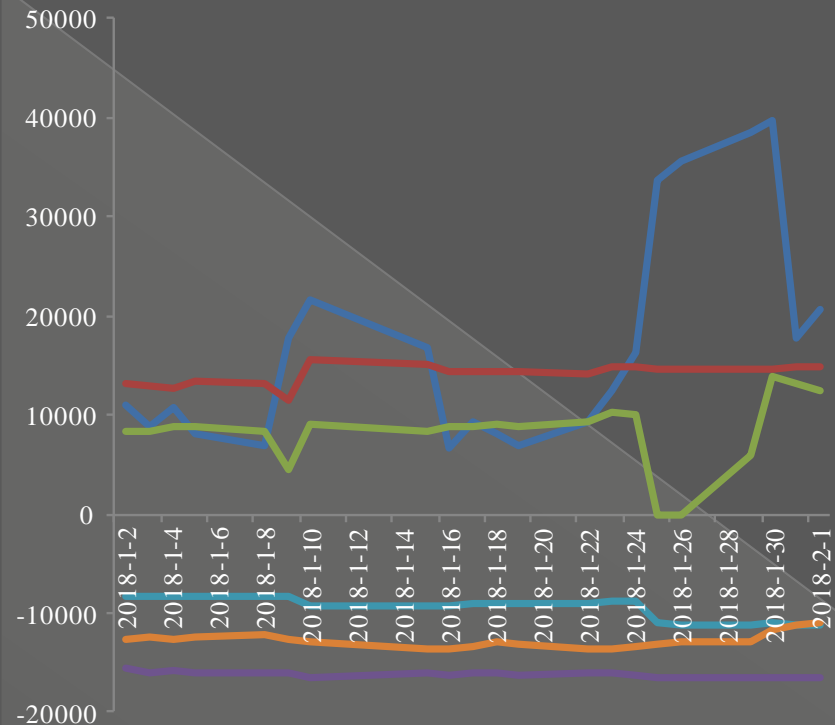
- 格林大华
- 永安期货
- 弘业期货
- 五矿经易
- 中信期货
- 海通期货



变动幅度		当日	最近5日	平均变化	波动率
cu持仓	多头前3	0.18%	-7.98%	-1.60%	13.42%
	空头前3	2.54%	12.20%	2.44%	
cu涨幅		-0.42%	-1.49%	-0.30%	
震荡幅度	0.84%	1.22%(月均值)	投机度	0.41	0.54(月均值)

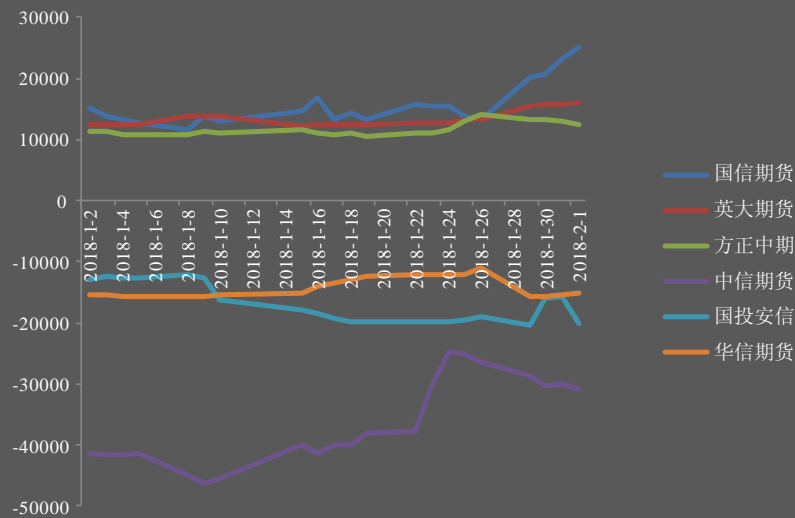
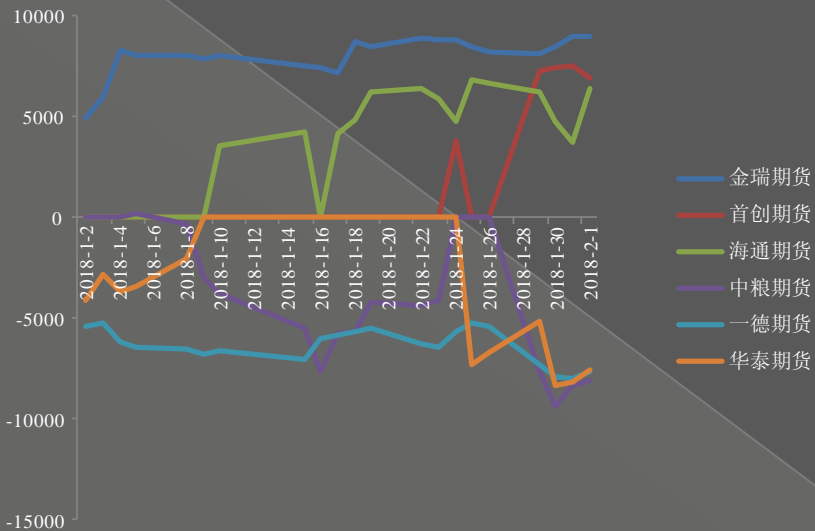
金属板块：Ni

- 永安期货
- 国贸期货
- 华泰期货
- 兴业期货
- 江海汇鑫
- 信达期货



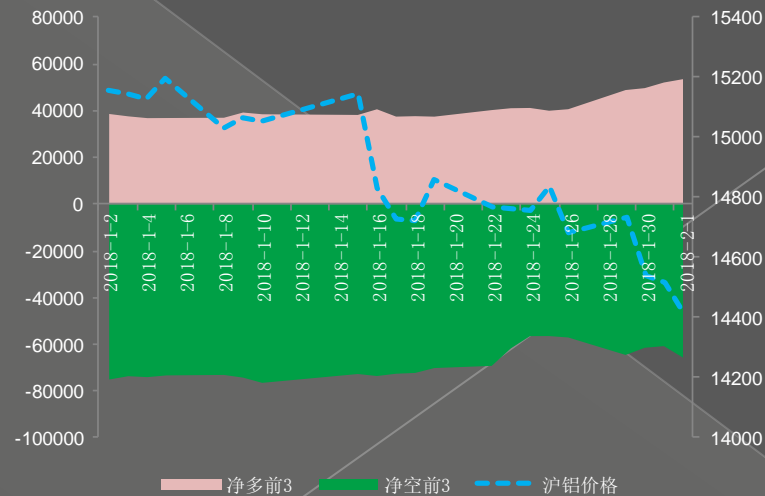
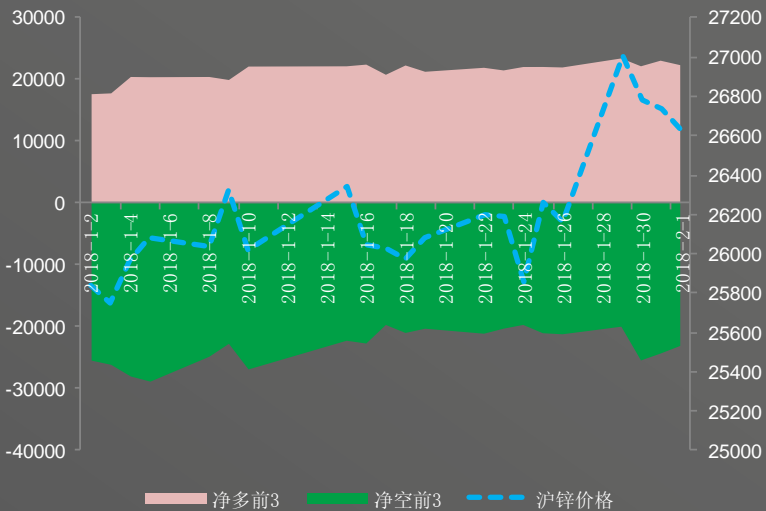
变动幅度		当日	最近5日	平均变化	波动率
ni持仓	多头前3	-1.21%	-15.80%	-3.16%	27.06%
	空头前3	-1.10%	-9.82%	-1.96%	
ni涨幅		-0.51%	-2.48%	-0.50%	
震荡幅度	1.48%	2.28%(月均值)	投机度	1.44	1.34(月均值)

金属板块：Zn & Al

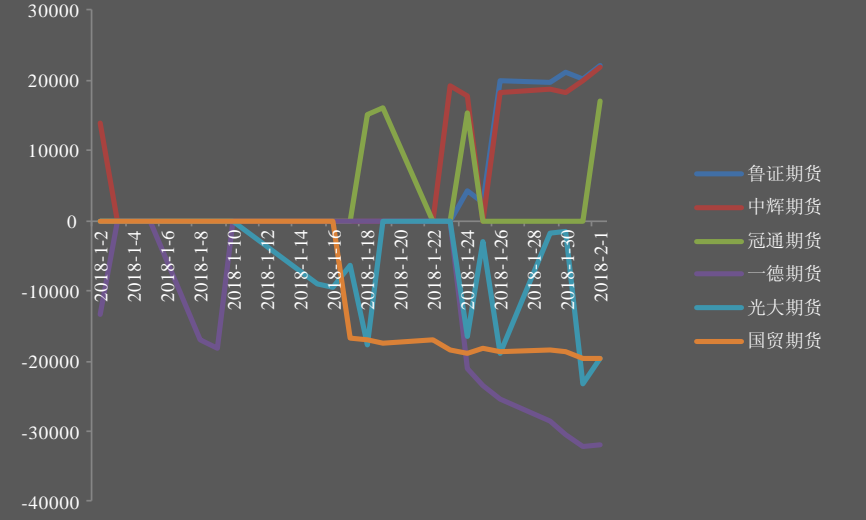
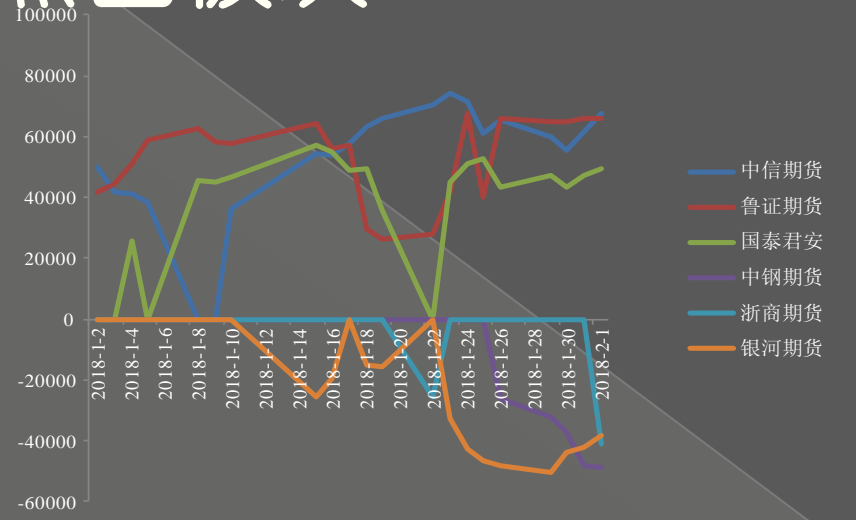


变动幅度		当日	最近5日	平均变化	波动率
zn持仓	多头前3	-3.14%	1.33%	0.27%	16.11%
	空头前3	-5.07%	9.77%	1.95%	
zn涨幅		-0.41%	1.38%	0.28%	
震荡幅度	0.75%	1.32%(月均值)	投机度	0.72	0.97(月均值)

变动幅度		当日	最近5日	平均变化	波动率
al持仓	多头前3	2.76%	33.67%	6.73%	12.02%
	空头前3	8.09%	16.35%	3.27%	
al涨幅		-0.69%	-2.84%	-0.57%	
震荡幅度	1.39%	1.45%(月均值)	投机度	0.53	0.54(月均值)

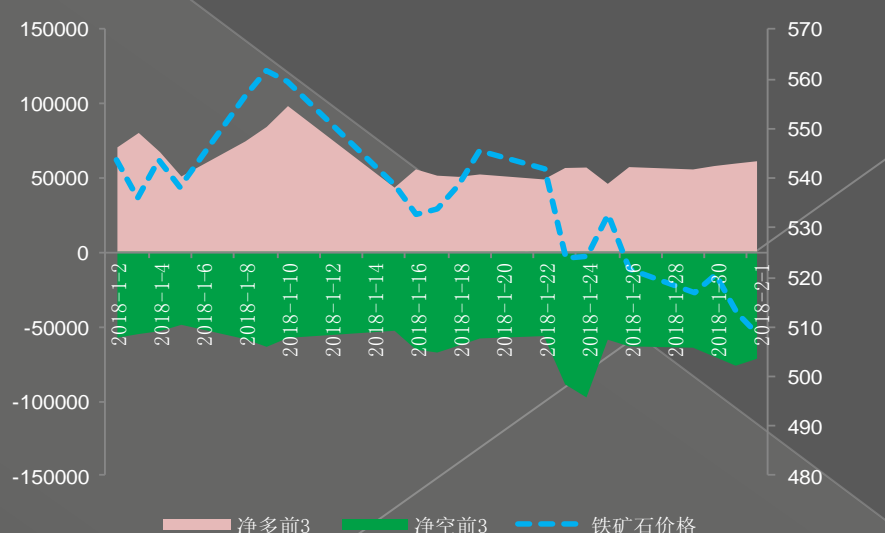
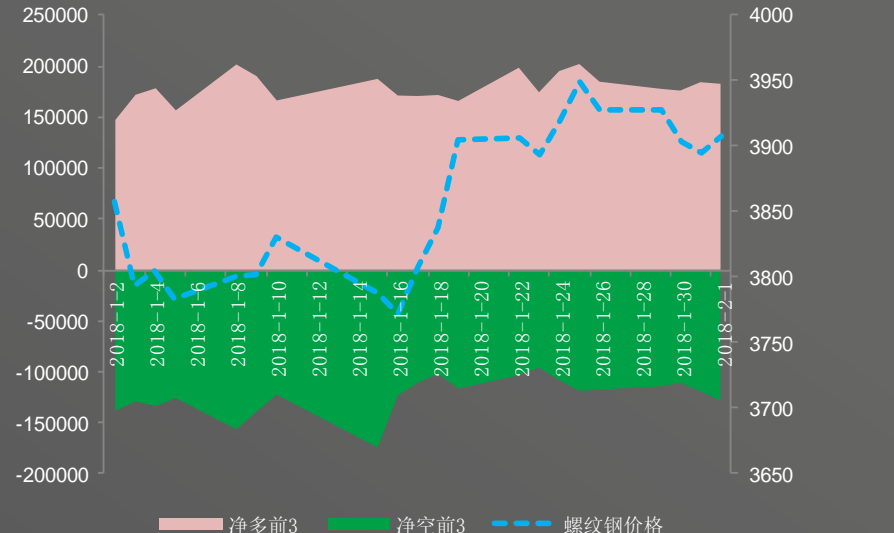


黑色板块：Rb & I

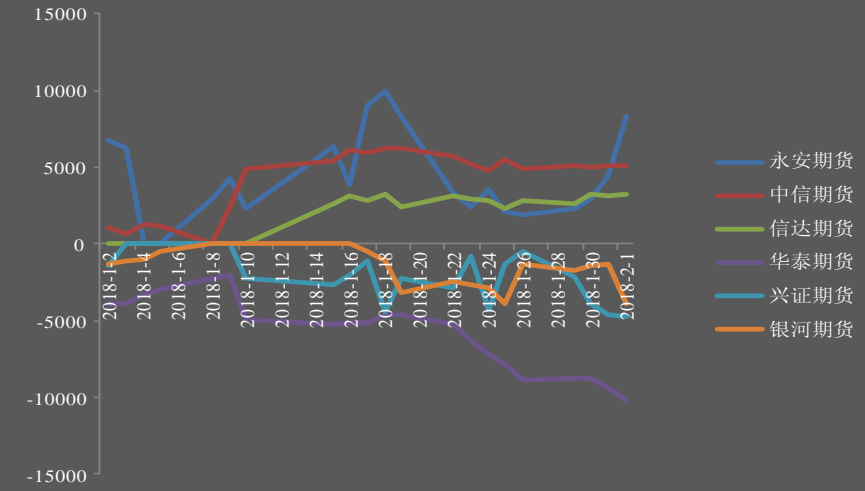
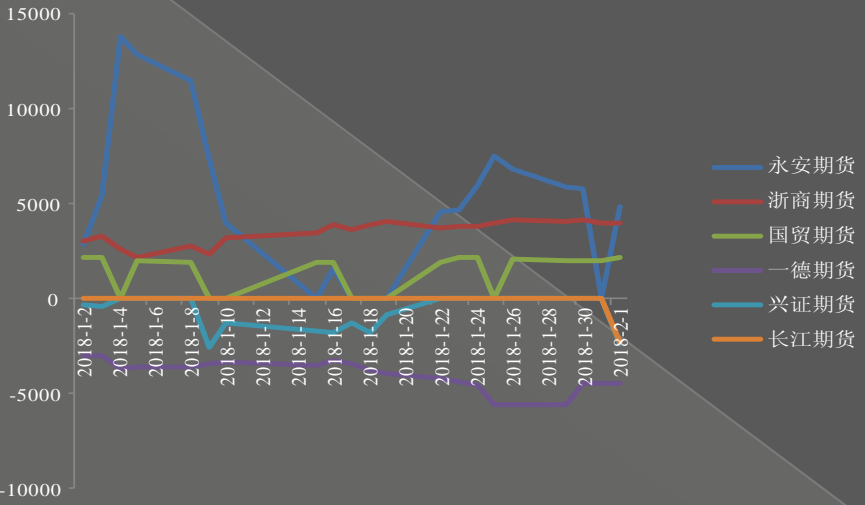


变动幅度		当日	最近5日	平均变化	波动率
rb持仓	多头前3	-0.85%	-9.59%	-1.92%	13.58%
	空头前3	7.64%	8.03%	1.61%	
rb涨幅		0.33%	-1.02%	-0.20%	
震荡幅度	1.24%	1.58%(月均值)	投机度	0.98	1.14(月均值)

变动幅度		当日	最近5日	平均变化	波动率
I持仓	多头前3	2.65%	33.31%	6.66%	28.98%
	空头前3	-6.14%	21.70%	4.34%	
I涨幅		-0.85%	-4.52%	-0.90%	
震荡幅度	1.57%	2.56%(月均值)	投机度	0.84	1.12(月均值)

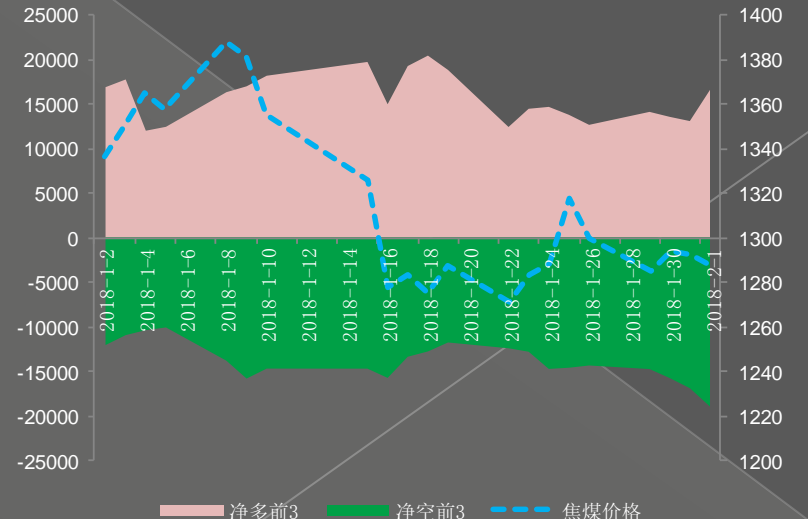
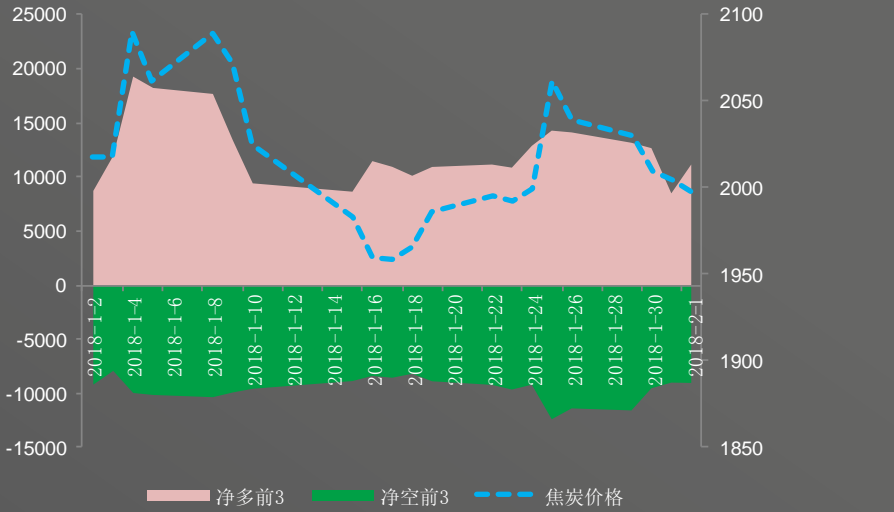


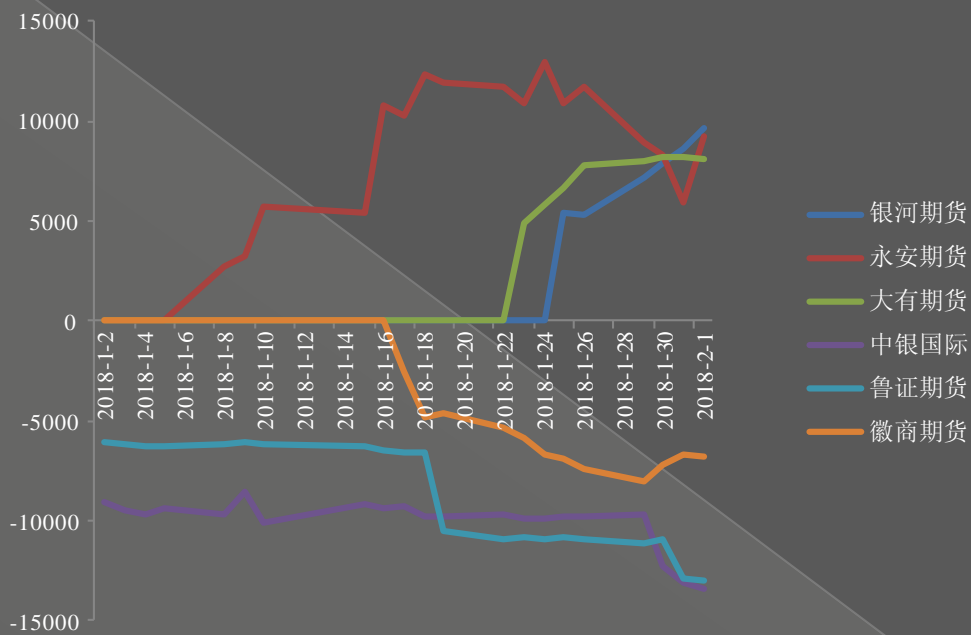
黑色板块：J & JM



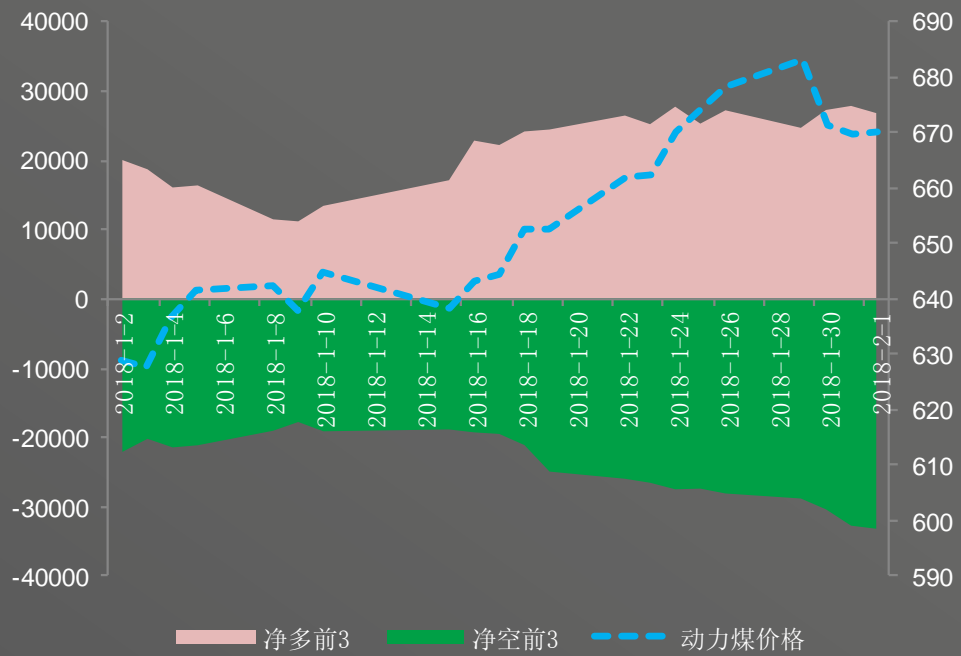
变动幅度		当日	最近5日	平均变化	波动率
j持仓	多头前3	31.50%	-21.92%	-4.38%	23.05%
	空头前3	0.33%	-27.05%	-5.41%	
j涨幅		-0.37%	-3.15%	-0.63%	
震荡幅度	2.01%	2.53%(月均值)	投机度	1.16	1.25(月均值)

变动幅度		当日	最近5日	平均变化	波动率
jm持仓	多头前3	26.80%	20.35%	4.07%	23.57%
	空头前3	12.21%	29.83%	5.97%	
jm涨幅		-0.39%	-2.29%	-0.46%	
震荡幅度	1.62%	2.73%(月均值)	投机度	1.15	1.31(月均值)



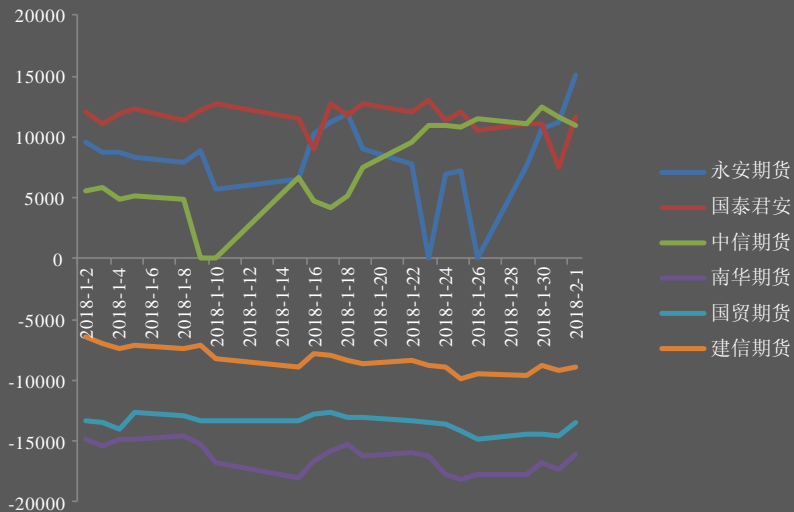
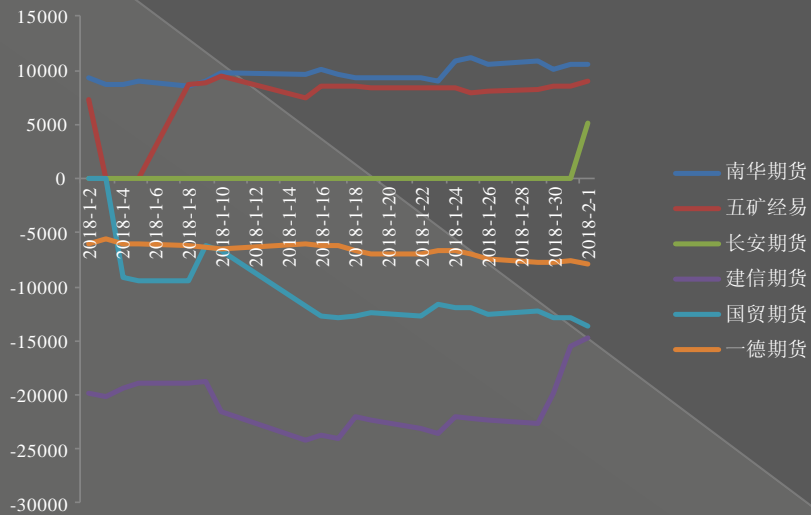


黑色：动力煤



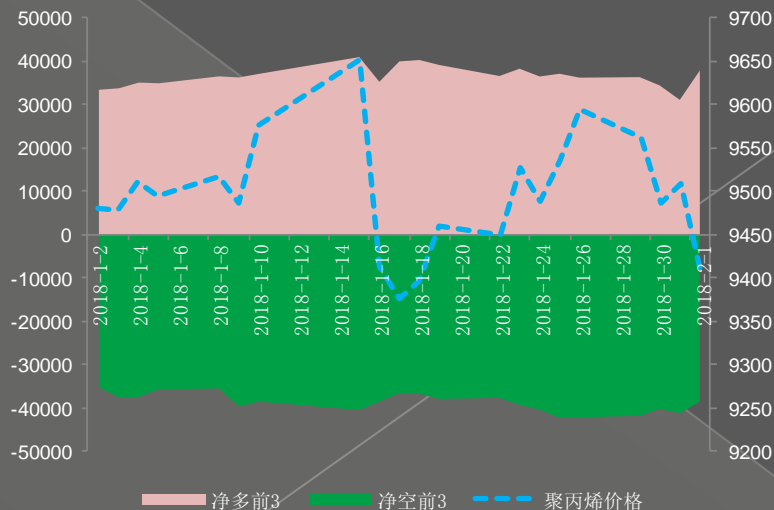
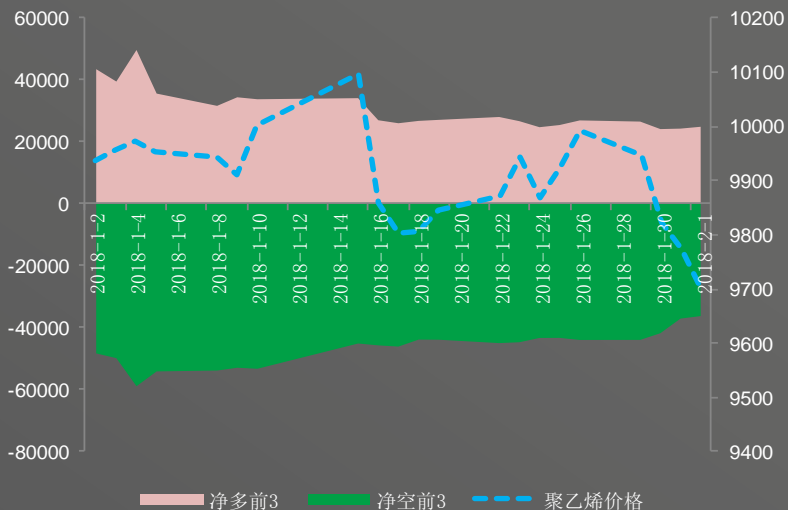
变动幅度		当日	最近5日	平均变化	波动率
zc持仓	多头前3	-3.74%	6.03%	1.21%	14.95%
	空头前3	1.34%	21.05%	4.21%	
zc涨幅		0.04%	-0.61%	-0.12%	
震荡幅度	0.86%	1.48%(月均值)	投机度	0.57	0.68(月均值)

化工：塑料 & PP

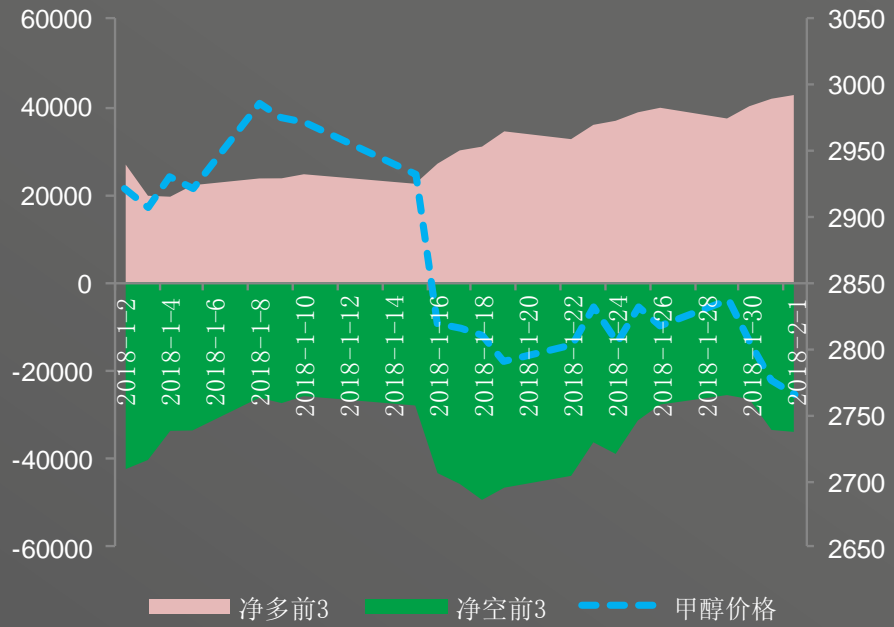
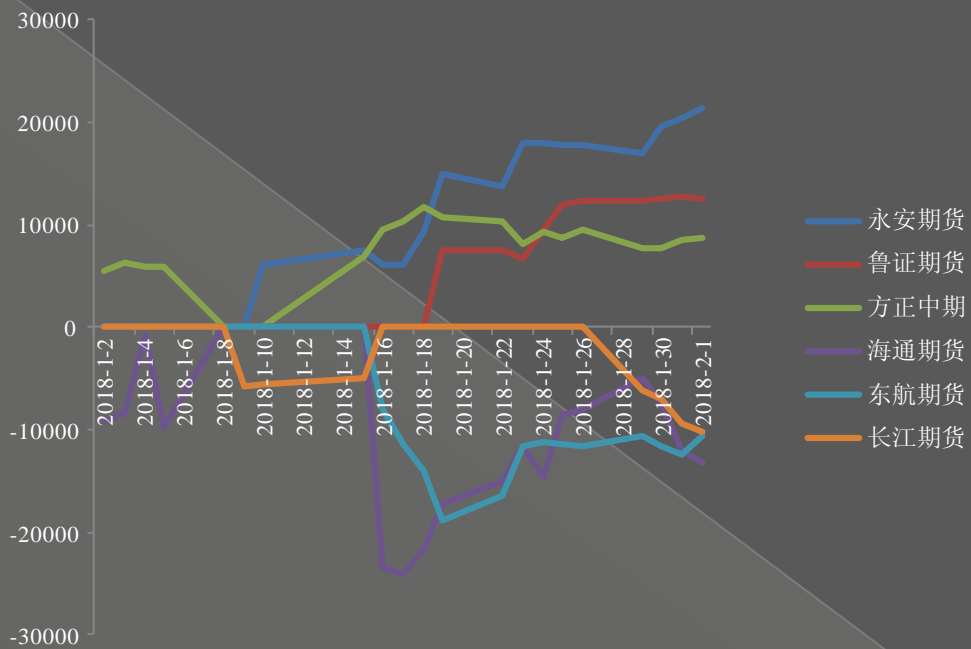


变动幅度		当日	最近5日	平均变化	波动率
I持仓	多头前3	2.44%	-2.19%	-0.44%	13.49%
	空头前3	-2.20%	-16.28%	-3.26%	
I涨幅		-0.77%	-2.26%	-0.45%	
震荡幅度	1.37%	1.34%(月均值)	投机度	0.51	0.62(月均值)

变动幅度		当日	最近5日	平均变化	波动率
pp持仓	多头前3	21.91%	2.05%	0.41%	14.22%
	空头前3	-6.52%	-8.99%	-1.80%	
pp涨幅		-1.07%	-1.35%	-0.27%	
震荡幅度	1.32%	1.36%(月均值)	投机度	0.60	0.67(月均值)

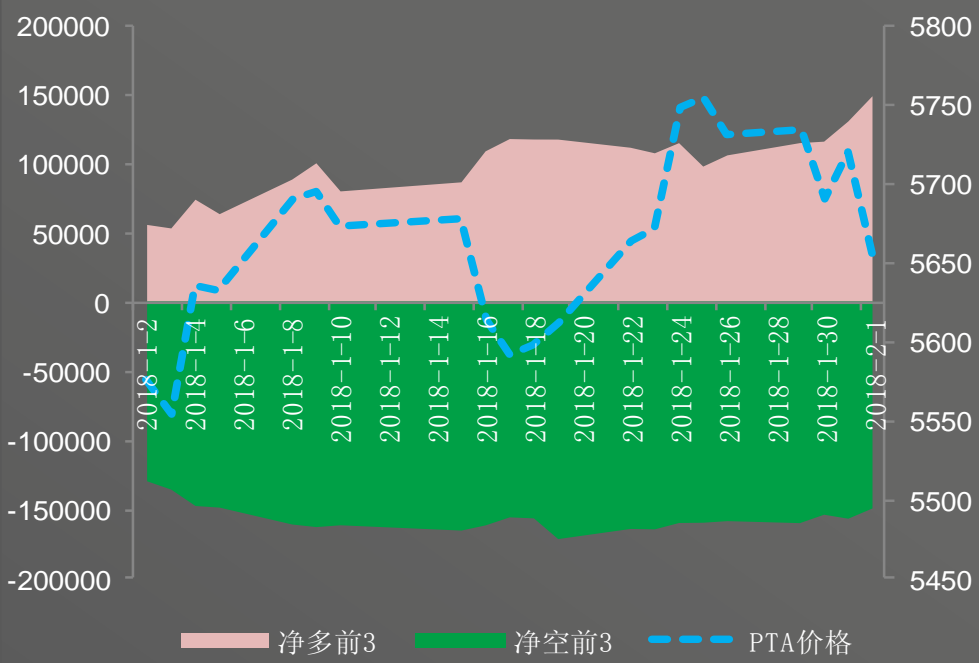
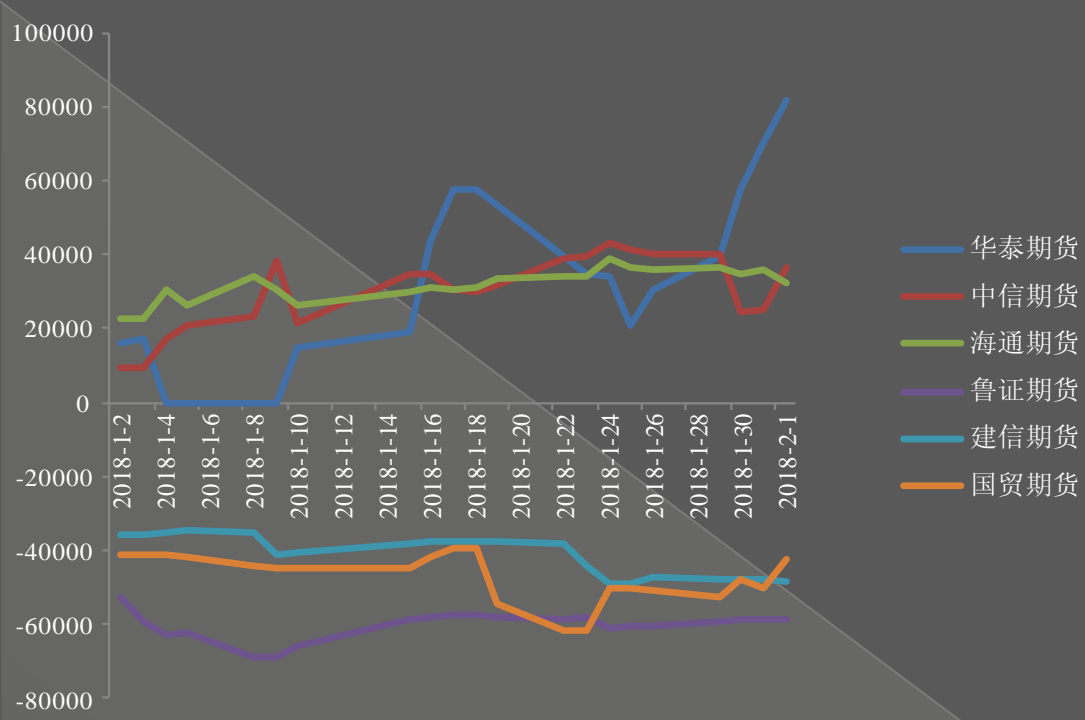


化工：甲醇



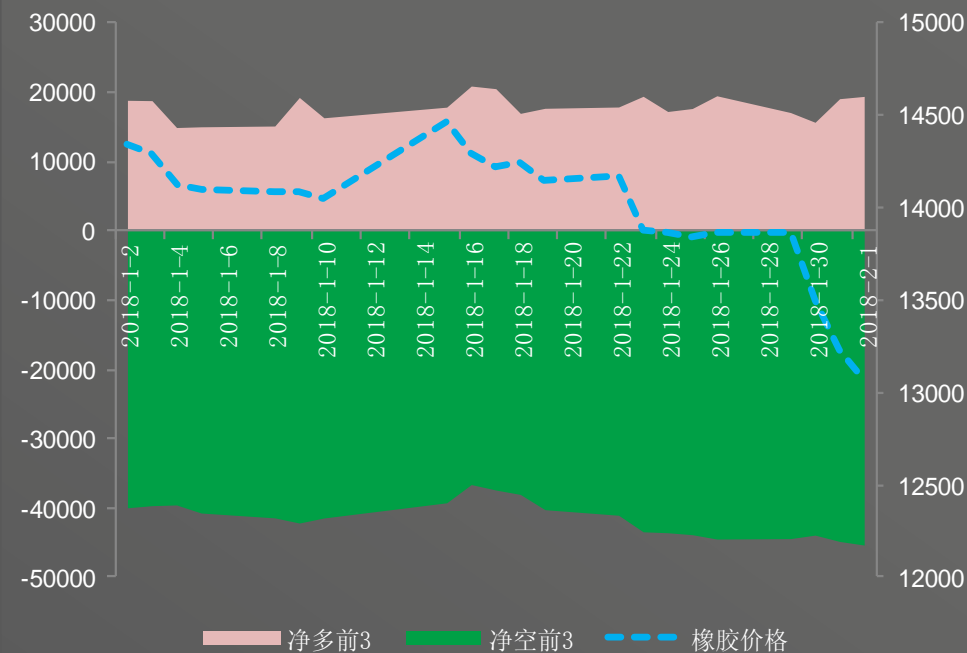
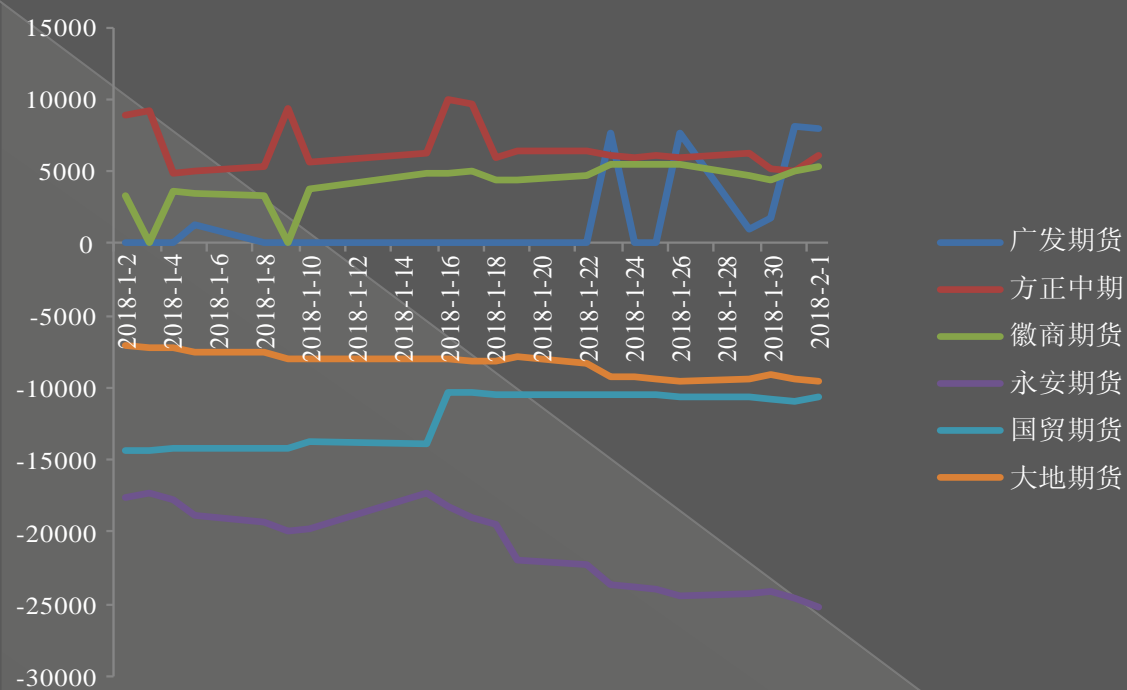
变动幅度		当日	最近5日	平均变化	波动率
ma持仓	多头前3	2.00%	10.15%	2.03%	20.42%
	空头前3	1.30%	8.28%	1.66%	
ma涨幅		-0.42%	-2.38%	-0.48%	
震荡幅度	1.24%	1.85%(月均值)	投机度	0.90	1.21(月均值)

化工：PTA



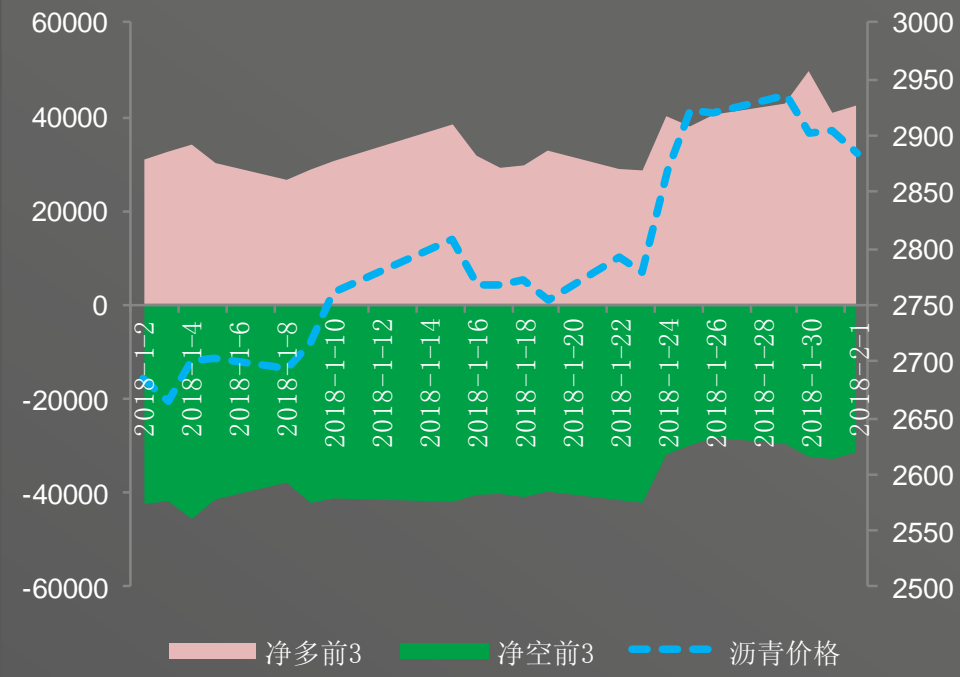
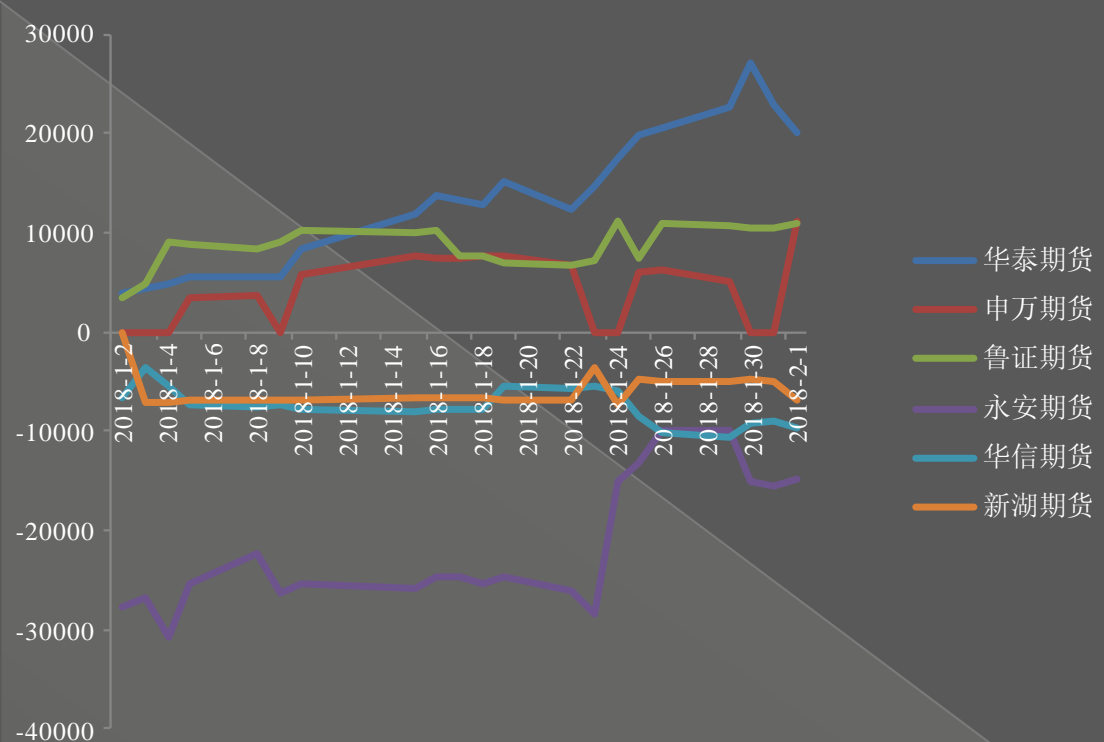
变动幅度		当日	最近5日	平均变化	波动率
pta持仓	多头前3	14.02%	52.10%	10.42%	11.51%
	空头前3	-4.72%	-6.46%	-1.29%	
pta涨幅		-1.19%	-1.80%	-0.36%	
震荡幅度	1.66%	1.19%(月均值)	投机度	0.52	0.45(月均值)

化工：橡胶



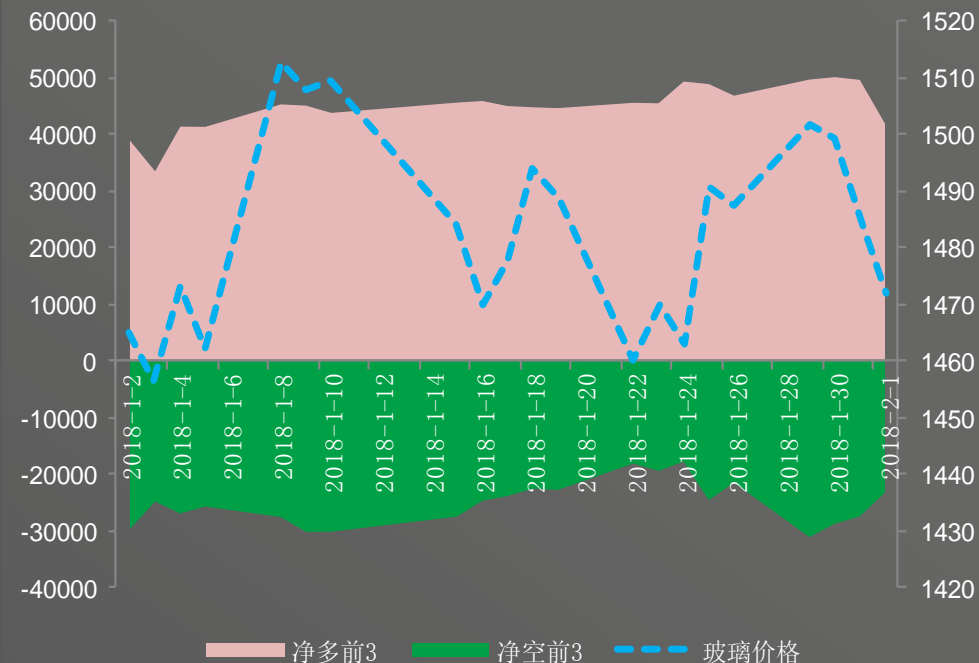
变动幅度		当日	最近5日	平均变化	波动率
ru持仓	多头前3	1.73%	9.92%	1.98%	18.56%
	空头前3	1.16%	3.41%	0.68%	
ru涨幅		-1.21%	-5.55%	-1.11%	
震荡幅度	2.19%	1.93%(月均值)	投机度	0.62	0.88(月均值)

化工：沥青



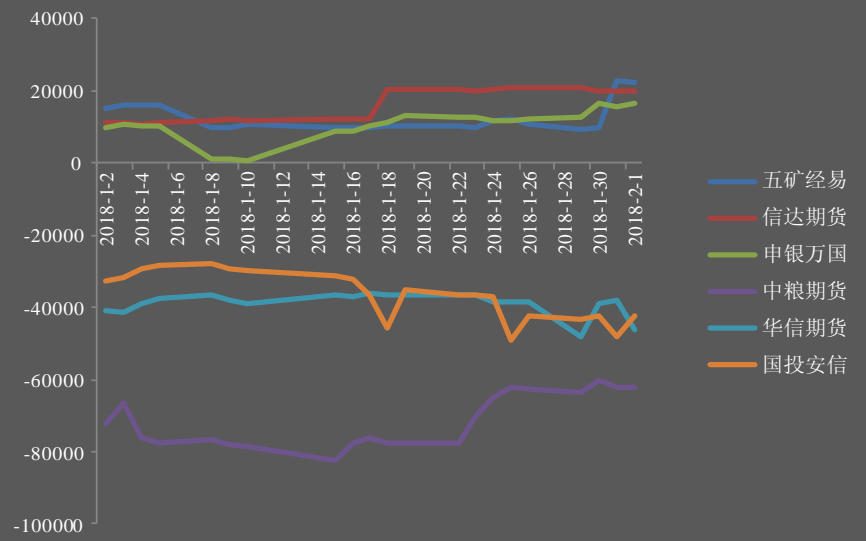
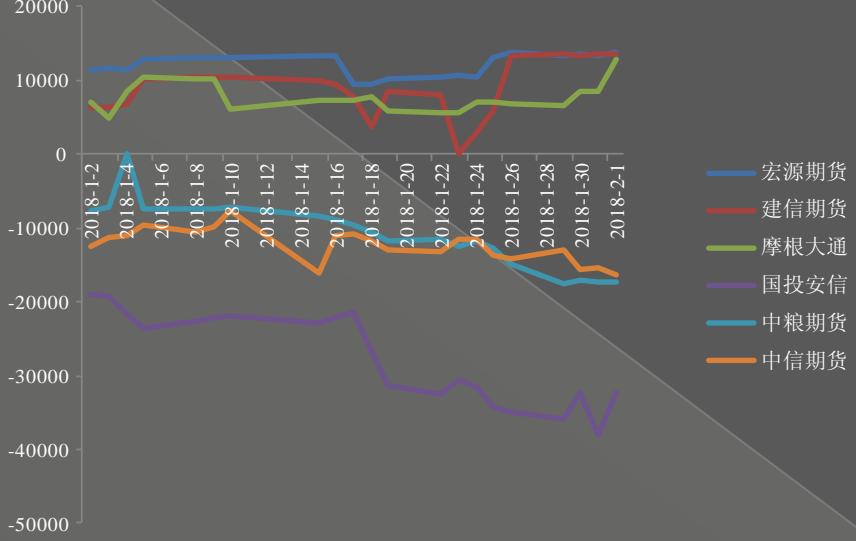
变动幅度		当日	最近5日	平均变化	波动率
bu持仓	多头前3	3.78%	11.75%	2.35%	18.98%
	空头前3	-4.35%	4.86%	0.97%	
bu涨幅		-0.76%	-1.37%	-0.27%	
震荡幅度	1.77%	1.71%(月均值)	投机度	0.87	0.77(月均值)

化工：玻璃



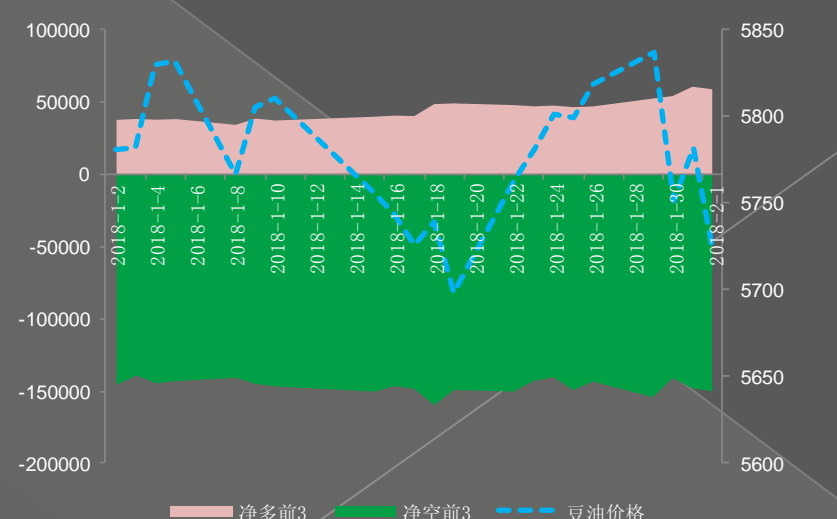
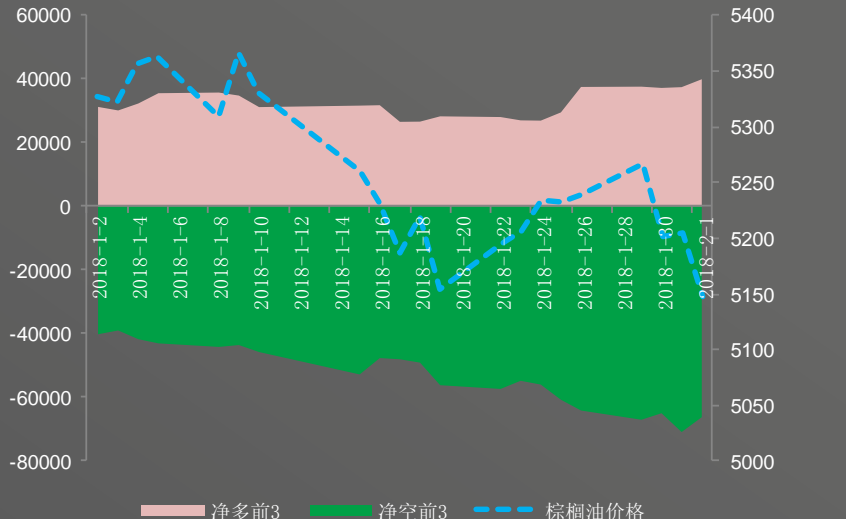
变动幅度		当日	最近5日	平均变化	波动率
fg持仓	多头前3	-15.57%	-14.30%	-2.86%	19.56%
	空头前3	-15.42%	-5.60%	-1.12%	
fg涨幅		-0.86%	-1.27%	-0.25%	
震荡幅度	1.14%	1.67%(月均值)	投机度	0.40	0.53(月均值)

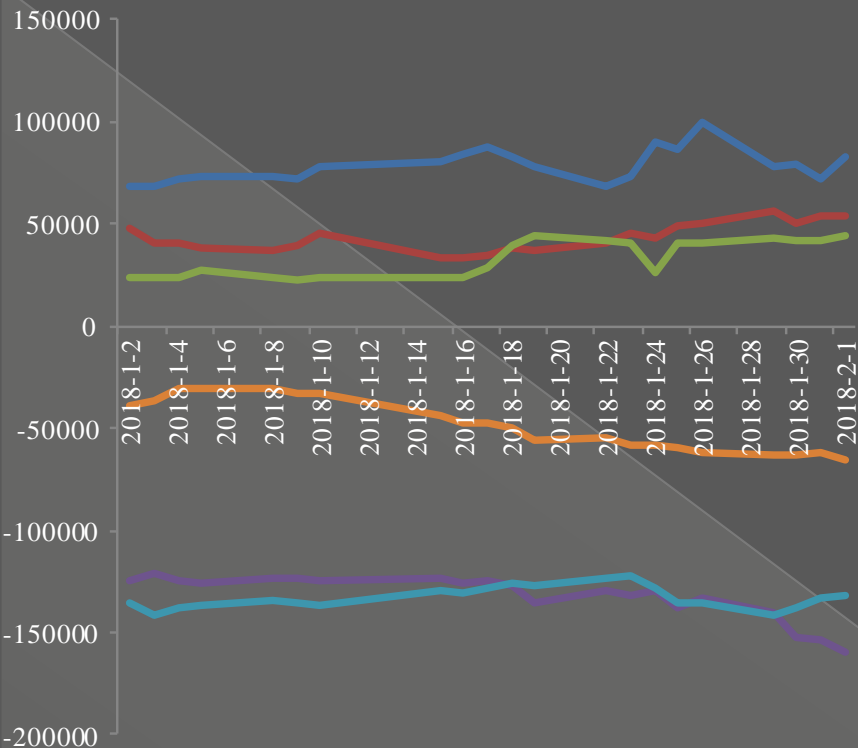
农产品：P & Y



变动幅度		当日	最近5日	平均变化	波动率
p持仓	多头前3	6.61%	35.22%	7.04%	13.63%
	空头前3	-6.59%	9.03%	1.81%	
p涨幅		-1.08%	-1.60%	-0.32%	
震荡幅度	1.59%	1.07%(月均值)	投机度	0.54	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	-2.76%	26.33%	5.27%	12.59%
	空头前3	1.45%	0.67%	0.13%	
y涨幅		-1.05%	-1.34%	-0.27%	
震荡幅度	1.21%	1.02%(月均值)	投机度	0.31	0.29(月均值)

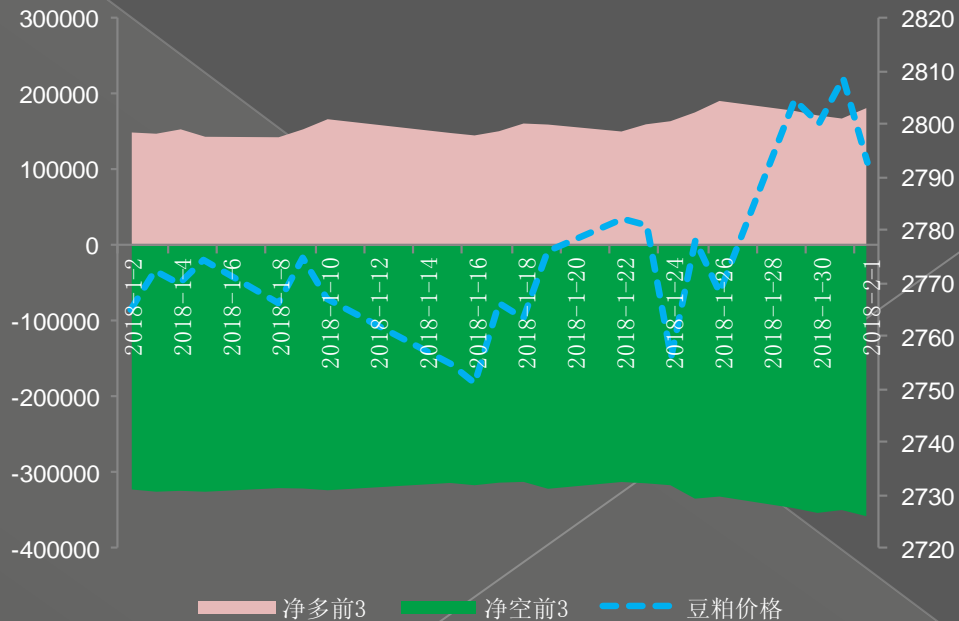




- 永安期货
- 中信期货
- 海通期货
- 中粮期货
- 华信期货
- 摩根大通

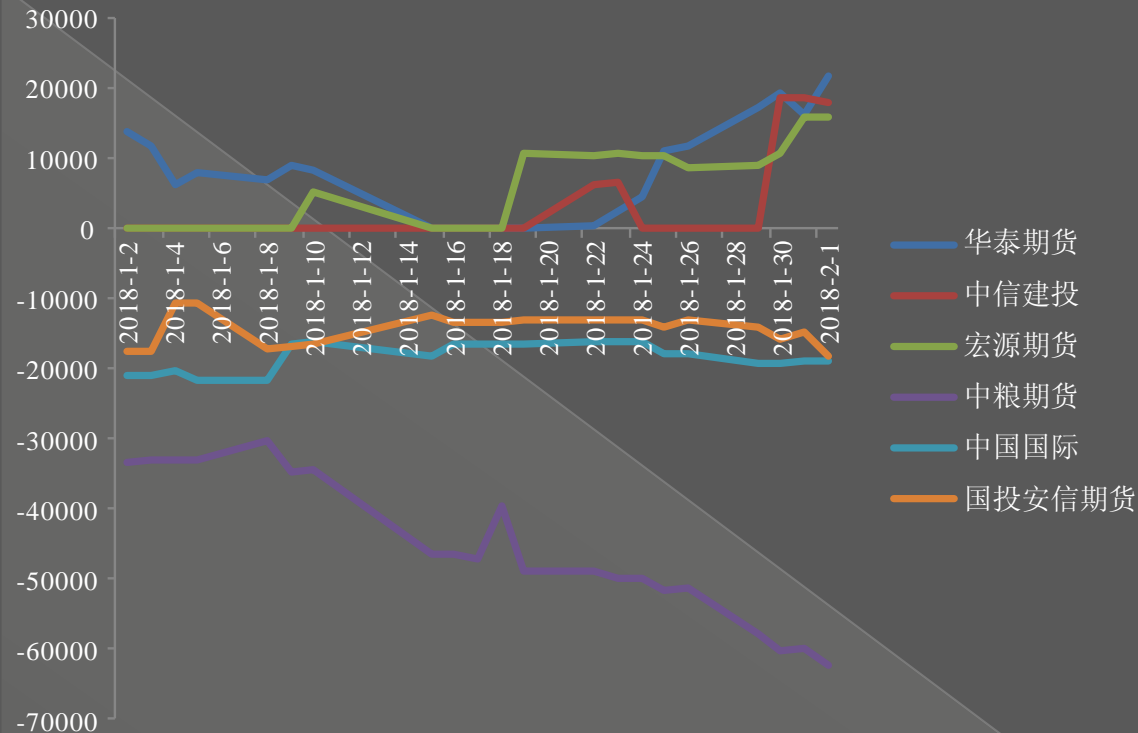
农产品：豆粕

变动幅度		当日	最近5日	平均变化	波动率
m持仓	多头前3	8.18%	3.24%	0.65%	9.55%
	空头前3	2.33%	6.94%	1.39%	
m涨幅		-0.56%	0.54%	0.11%	
震荡幅度	0.60%	0.87%(月均值)	投机度	0.29	0.30(月均值)

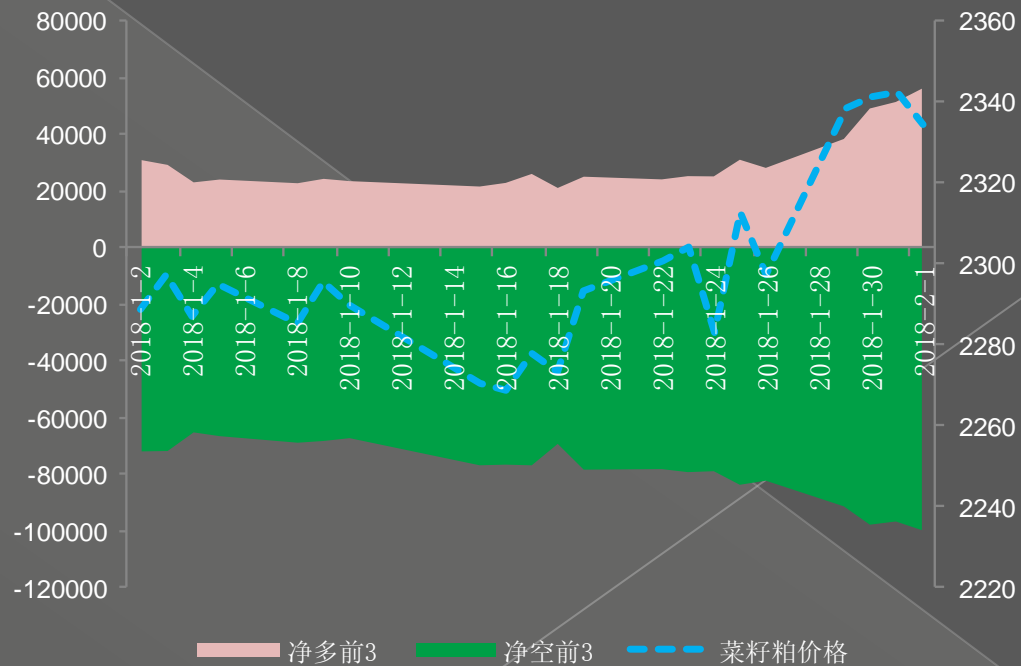


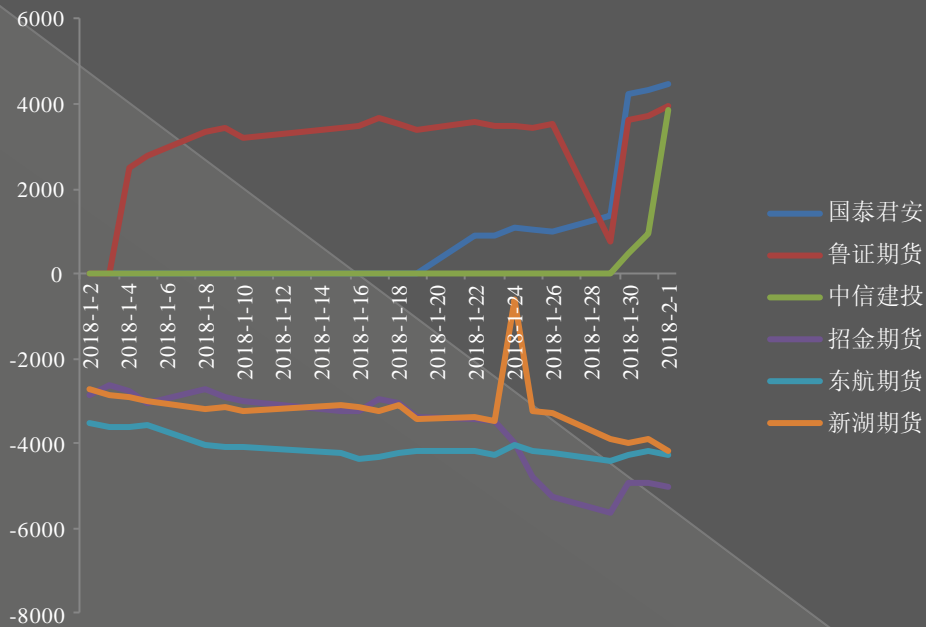
- 净多前3
- 净空前3
- 豆粕价格

农产品：菜粕



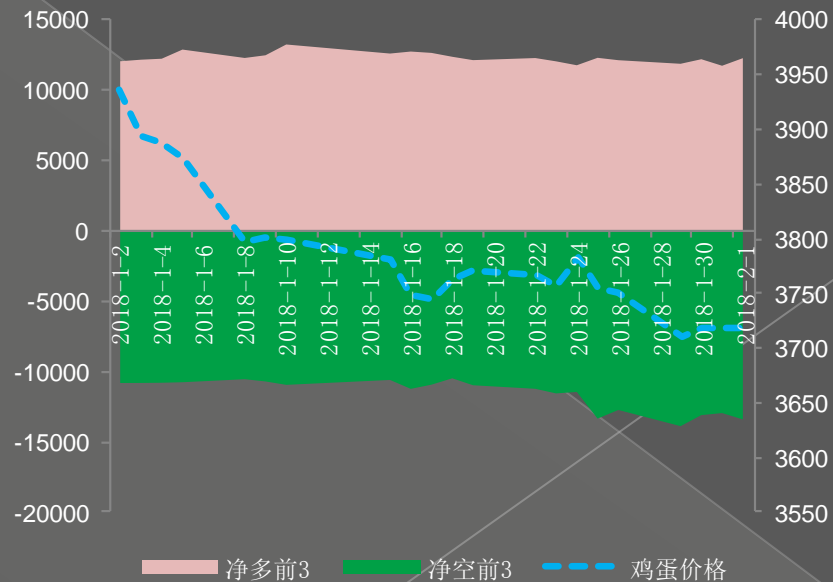
变动幅度		当日	最近5日	平均变化	波动率
rm持仓	多头前3	9.07%	80.34%	16.07%	11.74%
	空头前3	3.18%	19.18%	3.84%	
rm涨幅		-0.34%	0.93%	0.19%	
震荡幅度	0.70%	1.02%(月均值)	投机度	0.43	0.47(月均值)



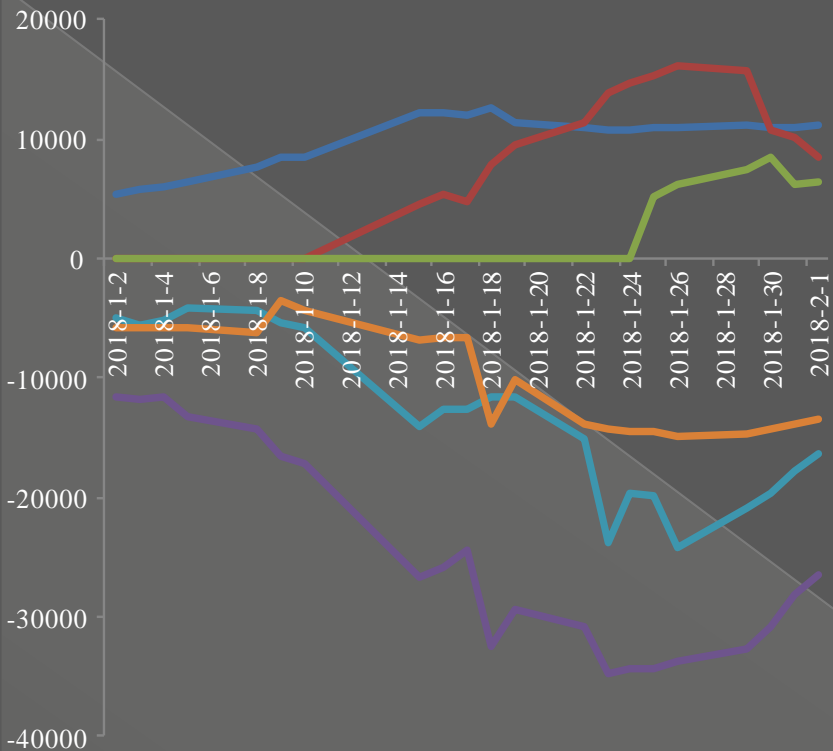


农产品：鸡蛋

变动幅度		当日	最近5日	平均变化	波动率
jd持仓	多头前3	4.57%	-0.20%	-0.04%	9.91%
	空头前3	3.49%	0.43%	0.09%	
jd涨幅		-0.04%	-0.99%	-0.20%	
震荡幅度	0.82%	1.11%(月均值)	投机度	0.26	0.38(月均值)

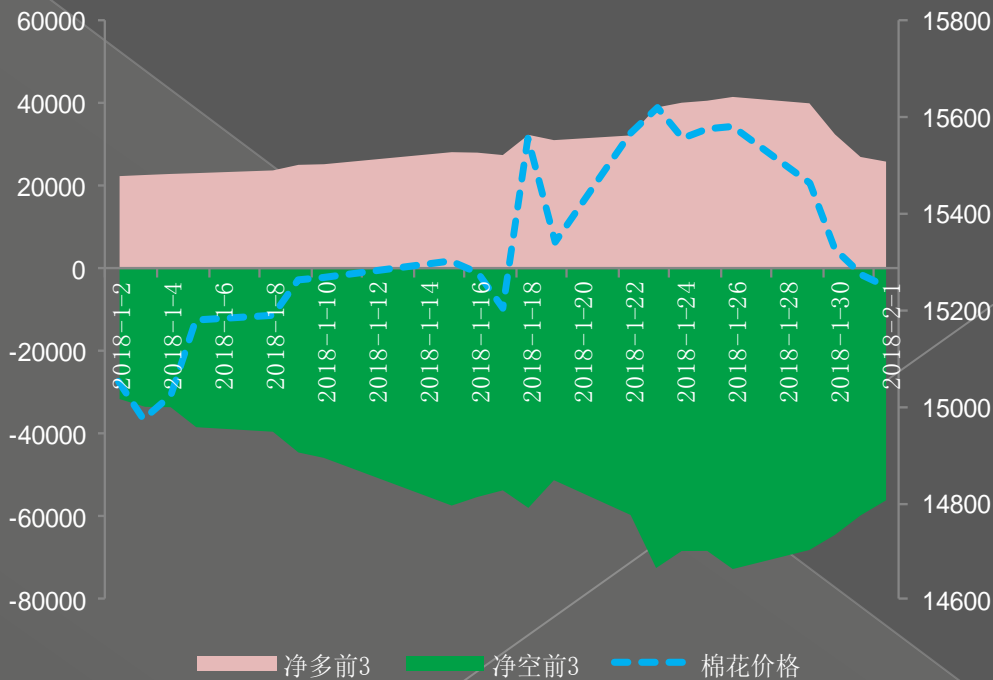


农产品：棉花



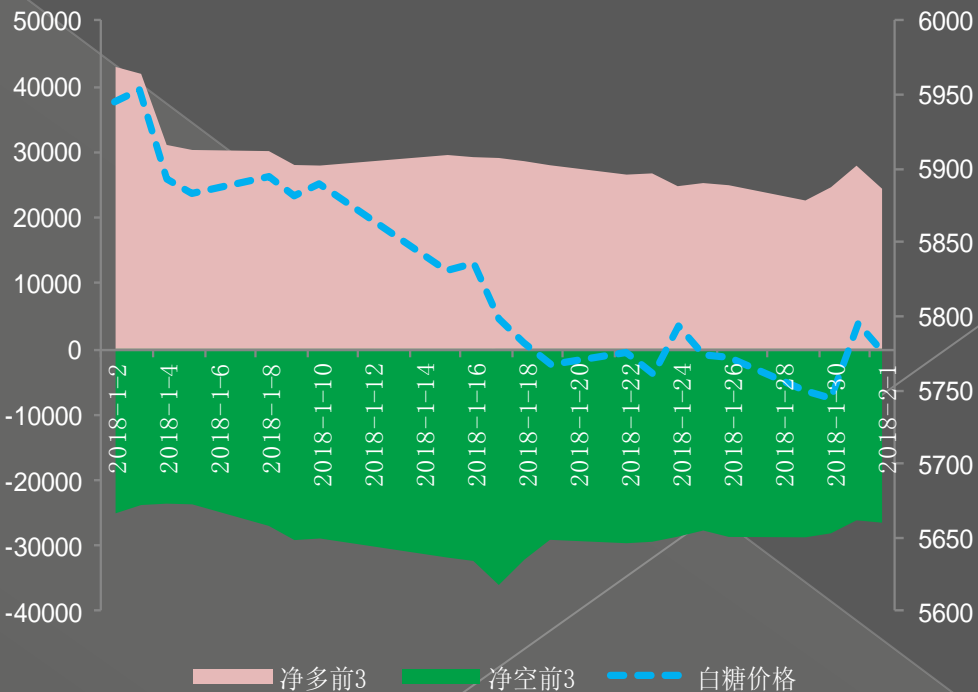
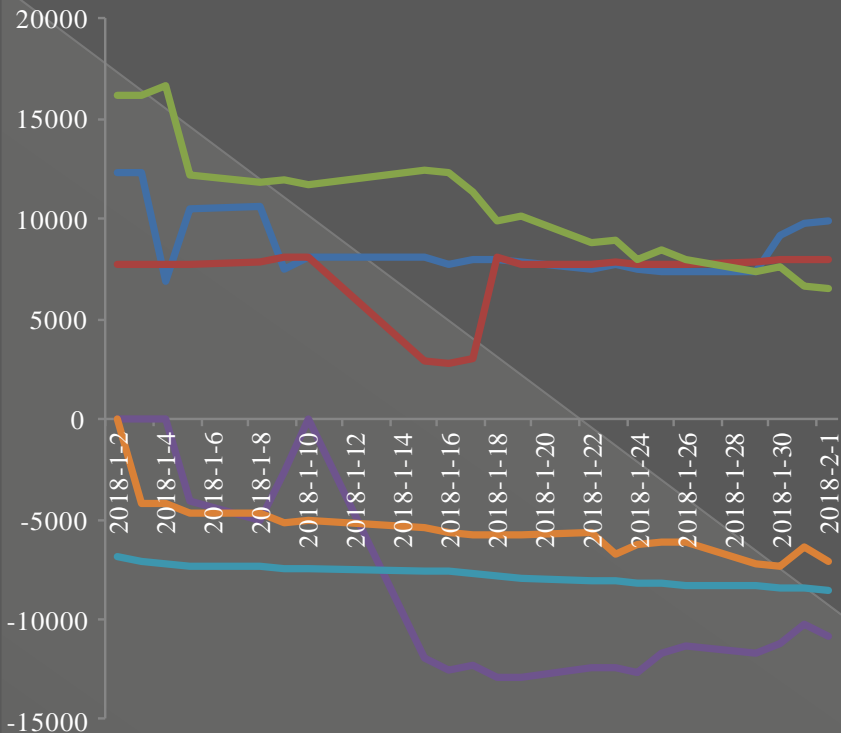
- 方正中期
- 华泰期货
- 永安期货
- 华信期货
- 东证期货
- 中国国际

变动幅度		当日	最近5日	平均变化	波动率
cf持仓	多头前3	-4.15%	-36.12%	-7.22%	12.84%
	空头前3	-6.16%	-17.97%	-3.59%	
cf涨幅		-0.16%	-2.11%	-0.42%	
震荡幅度	0.60%	1.06%(月均值)	投机度	0.29	0.44(月均值)



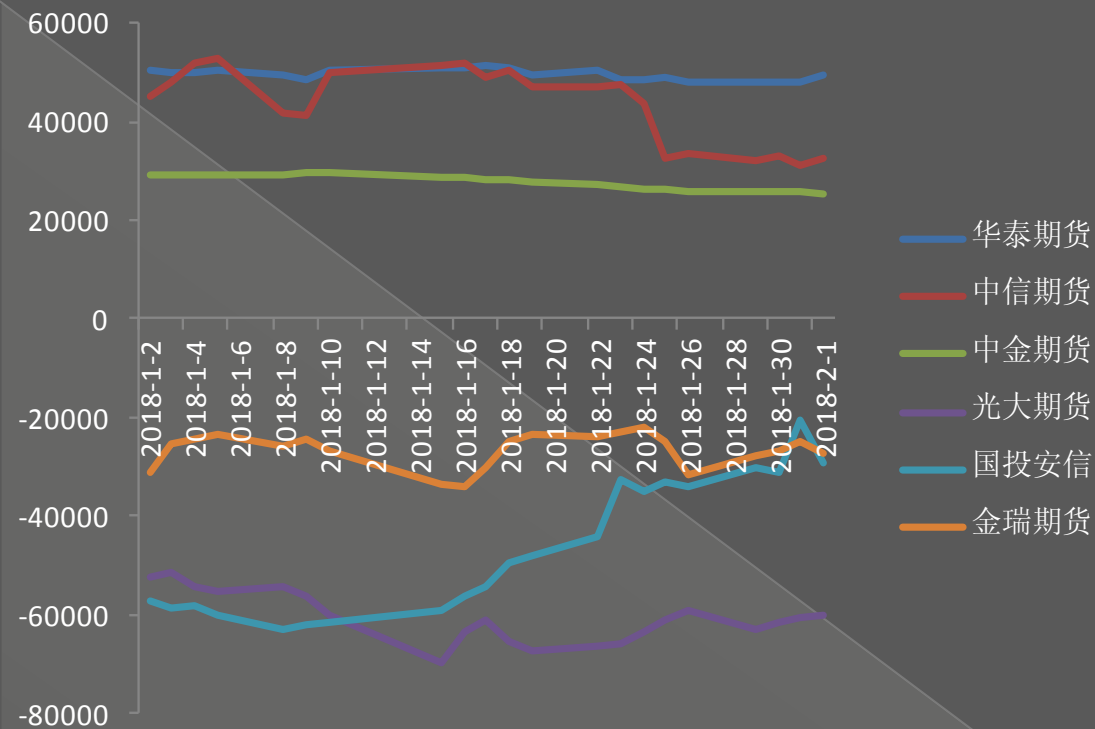
- 净多前3
- 净空前3
- 棉花价格

农产品：白糖

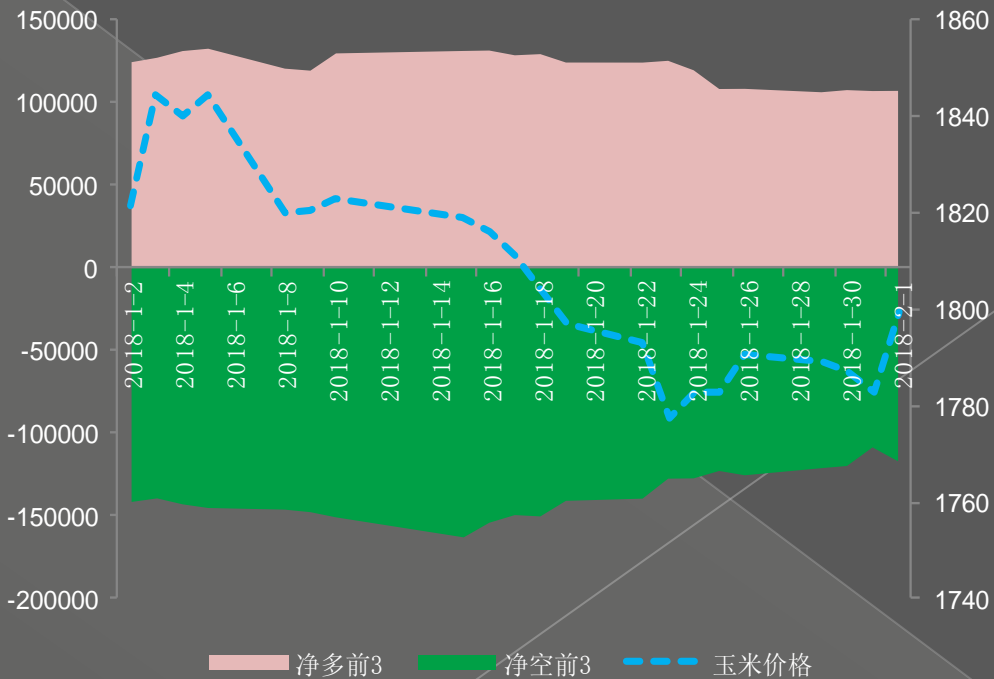


变动幅度		当日	最近5日	平均变化	波动率
sr持仓	多头前3	-12.57%	-3.41%	-0.68%	6.97%
	空头前3	1.38%	-4.31%	-0.86%	
sr涨幅		-0.34%	0.01%	0.00%	
震荡幅度	0.97%	0.82%(月均值)	投机度	0.57	0.46(月均值)

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	0.11%	-1.03%	-0.21%	8.80%
	空头前3	7.78%	-4.75%	-0.95%	
c涨幅		0.92%	0.93%	0.19%	
震荡幅度	1.07%	0.76%(月均值)	投机度	0.51	0.33(月均值)



部分机构资金变动表

制表日期：2018年2月1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	15209.33	6.27%	-1946.35	-0.75%
南华期货	18704.72	37.61%	11461.04	20.12%
混沌天成	156.97	0.58%	2893.36	12.00%
海通期货	-28427.00	-21.23%	-23487.44	-18.21%
上海大陆	3576.93	37.16%	-8709.29	-39.75%
中信期货	10702.89	5.15%	27.94	0.01%
新湖期货	-5334.94	-9.99%	-10876.61	-18.44%

中粮期货	1018.87	0.62%	2249.23	1.39%
中信建投	-11295.26	-21.42%	-19785.85	-32.32%
申银万国	-5277.54	-11.13%	-4390.03	-9.44%
华泰期货	-8781.01	-6.92%	11647.37	10.95%
光大期货	18116.73	32.38%	36670.03	98.05%
一德期货	-3247.94	-2.62%	8277.79	7.37%
国投期货	-11522.25	-12.88%	-28962.58	-27.09%
金瑞期货	-8863.06	-9.89%	-12331.76	-13.25%
鲁证期货	-9712.43	-8.49%	16786.52	19.08%
中国国际	2100.52	4.16%	539.23	1.04%

部分机构持仓一览

机构	永安期货					
日期	2018-1-25	2018-1-26	2018-1-29	2018-1-30	2018-1-31	2018-2-1
黄金	5319	5457	5359	5205	5206	5161
白银						
沪铜	28197	27780	29297	28911	30198	30328
沪铝	-6345	-4639			-6978	-7653
沪镍	33735	35655	38577	39656	17728	20686
沪锌	-7952	-8927	5959			
沪铅						
螺纹钢					-18696	
铁矿石	-14824	-14492	-13634			
焦煤	2139	1877	2300	2986	4508	8320
焦炭	7562	6841	5895	5850	-1913	4887
豆油		13153	17507	17700	17729	15803
棕榈油			-7140	-6848	-7190	-7460
菜籽油	14603	14993	14842	14665	15269	15325
豆粕	86130	100183	78679	79388	72415	83602
菜籽粕	-2380		-4193	-4381	-3863	-5497
棉花	5285	6257	7393	8464	6177	6498
白糖	-4617	-4661	-3672	-3723	-7428	-5453
玉米						-12254
鸡蛋		509	763	496	592	765
PTA						
聚乙烯						-4506
聚丙烯	7285		7632	10735	11176	15138
甲醇	17882	17913	17015	19575	20354	21485
玻璃	-6792	-5806	-8016	-8047	-6794	-6478
橡胶	-23958	-24407	-24295	-24054	-24595	-25229
沥青	-13292	-9994	-10024	-15042	-15638	-14908
动力煤	10955	11780	8919	8327	5938	9246

部分机构持仓一览

机构	南华期货					
日期	2018-1-25	2018-1-26	2018-1-29	2018-1-30	2018-1-31	2018-2-1
黄金	-829	-664		-766		-1040
白银	7805	7620	7913	7949	6872	6651
沪铜						2681
沪铝	-8365	-11360	-11682	-12645	-11911	-14885
沪镍						
沪锌	-4272	-3442	-3294			
沪铅		-779	-642		-513	
螺纹钢						-24667
铁矿石						
焦煤	2098					
焦炭						1741
豆油						
棕榈油						
菜籽油					14	
豆粕						
菜籽粕	-10619	-10911	-11160	-11065	-11409	-11572
棉花						
白糖	9104	9259	5306	5644	10282	5181
玉米	-13699	-14618	-15348	-13675	-14425	-14652
鸡蛋						
PTA	-17239	-16676	-16862	-17523	-18288	-16364
聚乙烯	11264	10552	10859	10035	10629	10575
聚丙烯	-18081	-17682	-17698	-16769	-17307	-16026
甲醇	-5869	-6389	-5861		-5688	
玻璃						
橡胶						
沥青						
动力煤				-3912		-3786

部分机构持仓一览

机构	国泰君安					
日期	2018-1-25	2018-1-26	2018-1-29	2018-1-30	2018-1-31	2018-2-1
黄金						
白银	-13216	-12354	-11760	-12225	-12291	-12404
沪铜	-4204					
沪铝		2105		3546	2378	2997
沪镍	-7103	-6804	-6838	-6463		-5172
沪锌	-3475		-4227	-5022	-5335	-5597
沪铅		559	773	763		1002
螺纹钢	52999	43695	47504	43692	47341	49477
铁矿石	10706	10919	11673	11216	13061	13659
焦煤		1960		2723		
焦炭	2407	2032				
豆油			13898	14217		
棕榈油						
菜籽油	25267	26511	26514	26463	27186	27119
豆粕					22599	22214
菜籽粕	7409	7375			8591	8888
棉花						
白糖	-6082	-6114	-7206	-7376	-6423	-7121
玉米	26937	26704	26034	26552	27747	15281
鸡蛋	1063	989	1353	4228	4333	4473
PTA			13626			25719
聚乙烯						
聚丙烯	12002	10537	11088	11143	7457	11592
甲醇				-1801	-2925	-2852
玻璃	4193	5062	4908	4259	6403	4202
橡胶	-4224		-4140	-4659	-5495	-5079
沥青			6375	5089		6527
动力煤						

部分机构持仓一览

机构	混沌天成					
日期	2018-1-25	2018-1-26	2018-1-29	2018-1-30	2018-1-31	2018-2-1
黄金						
白银						
沪铜	-8917	-8500	-8500	-9037	-8920	-9012
沪铝			4108	4146	4114	4160
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	2018-1-25	2018-1-26	2018-1-29	2018-1-30	2018-1-31	2018-2-1
黄金	3946	3020	3102	3308	2752	
白银	10562	13257	14261	14550	14568	13532
沪铜	-9685	-10721	-10070	-10473	-10699	-10161
沪铝						
沪镍	8692	8359	17471	7596	16075	5887
沪锌	6864	6707	6241	4748	3727	6412
沪铅	1191	1130	1589	1384	1254	718
螺纹钢	-25885	-36378	-24927	-25922	-24704	
铁矿石	6817	4081	6361	4980	3005	4597
焦煤	2714	531				
焦炭	2587				470	857
豆油					8727	9318
棕榈油			5006			
菜籽油	-5870	-5128	-5344	-5663	-5401	-5315
豆粕	40658	40882	43756	42060	42213	44607
菜籽粕	7153		8154	9346	8951	8760
棉花		4965		4999	4473	4235
白糖	-7803	-9159	-8756	-8549	-6079	-6122
玉米	7565	7626	7849		7109	9780
鸡蛋		525				
PTA	36298	35799	36571	34986	36157	32015
聚乙烯	5993	8189	6864			
聚丙烯		10664	5395	5976	6119	
甲醇	-8632	-8032	-4878	-7403	-11967	-13188
玻璃	5251	4405	6485	6822	5862	5968
橡胶		-4209				
沥青	5967	7321	8093	12061	6835	6309
动力煤					-1796	

部分机构持仓一览

机构	上海大陆					
日期	2018-1-25	2018-1-26	2018-1-29	2018-1-30	2018-1-31	2018-2-1
黄金						
白银						
沪铜						
沪铝						
沪镍						
沪锌						
沪铅						
螺纹钢	28559	27819	30525	28705	20810	30198
铁矿石						
焦煤						
焦炭						
豆油						
棕榈油						
菜籽油						
豆粕						
菜籽粕						
棉花	6827	6810	6832			
白糖						
玉米						
鸡蛋						
PTA						
聚乙烯						
聚丙烯						
甲醇						
玻璃						
橡胶						
沥青					-5225	-4852
动力煤						

部分机构持仓一览

机构	中粮期货					
日期	2018-1-25	2018-1-26	2018-1-29	2018-1-30	2018-1-31	2018-2-1
黄金						
白银			6682			
沪铜	-6491	-5357	-3012			
沪铝						
沪镍	8244	8433	8419	8525	8394	8227
沪锌			-7627	-9329	-8302	-8025
沪铅	-1158	-1227	-1237	-1121	-1107	-775
螺纹钢						
铁矿石						
焦煤	-2852	-2934	-2992	-3031		
焦炭						
豆油	-61876	-62721	-63363	-60024	-62269	-62101
棕榈油	-12691	-14961	-17470	-17101	-17288	-17318
菜籽油	-6793	-7521	-7593	-7522	-7979	-7671
豆粕	-137969	-133188	-140506	-151776	-153007	-159139
菜籽粕	-51425	-51307	-57880	-60180	-59860	-62324
棉花	-13298	-14198	-14219	-13607	-13346	-13345
白糖					2293	153
玉米						-12868
鸡蛋	4129	4147	4204	4172	3710	3238
PTA						
聚乙烯						
聚丙烯						
甲醇						
玻璃	-5945	-5971	-6898	-6949	-5675	-5497
橡胶	-8067	-8061	-8053	-7980	-7887	-7943
沥青						
动力煤						

部分机构持仓一览

机构	中信期货					
日期	2018-1-25	2018-1-26	2018-1-29	2018-1-30	2018-1-31	2018-2-1
黄金	9493	8631	7562	8068	8412	9060
白银	-25547	-25106	-21722	-23102	-22638	-24250
沪铜	-17443	-16648	-15892	-16562	-15959	-16552
沪铝	-25014	-26362	-28706	-30245	-29894	-30797
沪镍						
沪锌	-5847	-5711	-5109	-4905	-4483	-4266
沪铅	-2160	-2420	-2877	-2803	-2917	-2963
螺纹钢	60904	65390	60131	55366	61819	67467
铁矿石	-5071	-7511	-8630	-12161	-14082	-14155
焦煤	5522	4940	5088	5026	5152	5094
焦炭	-3491	-3128	-3015	-2743		651
豆油						
棕榈油	-13654	-14233	-12935	-15609	-15431	-16423
菜籽油	-9567	-9421	-9873	-10978	-11528	-11801
豆粕	49522	50407	56275	50989	53633	53812
菜籽粕			7808	9782	8926	11620
棉花						
白糖	-11690	-11289	-11718	-11220	-10284	-10827
玉米	32561	33491	32183	32997	31253	32361
鸡蛋						
PTA	41368	40320	39825	24518	25037	36392
聚乙烯						
聚丙烯	10845	11455	11150	12420	11594	11033
甲醇			1866			-2524
玻璃	19613	19249	19971	20053	19705	12004
橡胶						
沥青						
动力煤	5316				6056	5916

部分机构持仓一览

机构	中信建投					
日期	2018-1-25	2018-1-26	2018-1-29	2018-1-30	2018-1-31	2018-2-1
黄金						
白银		-4620			9914	9958
沪铜						
沪铝						
沪镍		5765	5622			
沪锌						
沪铅					511	
螺纹钢	-27590	-27105				
铁矿石		18853	17267		17596	15895
焦煤	-343	-129			-2261	
焦炭						
豆油	13155	13135	13059	13242	13202	13184
棕榈油	-12357	-13734	-13509	-11419	-11806	-10848
菜籽油						
豆粕	21407	19856		27017	26440	26600
菜籽粕				18849	18813	18089
棉花	11335	11433	10933	10892	5529	
白糖						
玉米	15791	7582				
鸡蛋		-434		461	956	3855
PTA						
聚乙烯						
聚丙烯	14156	13988	13986			
甲醇						
玻璃	-4798	-4865	-4525	-4912	-4511	-4789
橡胶						
沥青	-4648	-4413	-4695			
动力煤						

部分机构持仓一览

机构	新湖期货					
日期	2018-1-25	2018-1-26	2018-1-29	2018-1-30	2018-1-31	2018-2-1
黄金						
白银						
沪铜						
沪铝						
沪镍				4667		
沪锌						
沪铅						
螺纹钢	36437	35891	37145	37957	34673	35353
铁矿石						
焦煤						
焦炭						
豆油						
棕榈油	6832	6701	6730	6567	6507	6699
菜籽油	-4524	-7540	-5185	-5073	-4980	-5307
豆粕	-35376	-36223	-26487	-30208	-31263	-32972
菜籽粕						
棉花						
白糖						
玉米	18379	18883	19139	18753	18878	19385
鸡蛋	-3228	-3273	-3909	-3967	-3898	-4178
PTA	-21976	-21946	-22227	-19675	-19524	-17141
聚乙烯	-5712	-5756	-5711	-4604	-4892	-4871
聚丙烯	-4701	-4998	-4944	-4566		
甲醇	-6122	-5969	-6174	-6318	-6119	-5703
玻璃						
橡胶	-4577	-4610	-4214		-4677	
沥青	-4856	-4939	-5028	-4865	-4911	-6860
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

