



市场持仓分析

2018/3/7

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	-7.00%	-3.24%	0.60%	2.09%	-0.60%	0.71%	-9.09%	☆☆
甲醇	-5.21%	-3.53%	-0.68%	6.06%	3.94%	2.08%	-11.27%	☆☆☆
焦煤	-1.89%	-0.70%	-2.39%	-3.46%	-2.76%	-2.35%	1.58%	☆
动力煤	3.84%	4.09%	2.29%	0.17%	-1.68%	-3.46%	3.67%	☆
铁矿石	2.27%	2.51%	4.27%	-9.03%	-7.31%	-4.86%	11.30%	☆☆☆
玻璃	16.68%	13.70%	7.31%	-2.86%	-4.42%	-6.47%	19.54%	☆☆☆
豆粕	10.03%	8.81%	7.57%	-8.16%	-6.78%	-6.56%	18.20%	☆☆☆
玉米	-0.84%	-3.16%	-2.58%	-0.79%	-0.95%	0.69%	-0.05%	☆
棕榈油	-6.25%	-4.33%	1.06%	-0.90%	-0.63%	-0.05%	-5.35%	☆☆
鸡蛋	0.72%	-0.40%	0.90%	0.75%	0.43%	-3.65%	-0.03%	☆
沪镍	-1.82%	-1.66%	1.05%	-1.18%	0.31%	1.91%	-0.64%	☆
菜籽粕	6.21%	3.36%	1.27%	-5.55%	-5.80%	-1.75%	11.75%	☆☆☆
橡胶	1.29%	0.27%	3.07%	-2.01%	-2.03%	-3.58%	3.30%	☆
豆油	1.26%	1.06%	2.37%	-0.62%	-0.05%	-2.79%	1.88%	☆
沪铜	-0.75%	-0.85%	-1.66%	1.71%	2.10%	0.50%	-2.46%	☆
棉花	9.16%	5.22%	-0.77%	2.11%	2.57%	0.89%	7.05%	☆☆
白糖	0.66%	1.64%	2.72%	-7.44%	-5.58%	-2.93%	8.11%	☆☆
沪锌	3.97%	4.79%	3.11%	4.90%	2.60%	-4.02%	-0.92%	☆
聚乙烯	-1.54%	-1.91%	-3.46%	-1.20%	-1.42%	2.01%	-0.33%	☆
聚丙烯	3.65%	5.59%	5.07%	2.25%	1.60%	-4.40%	1.41%	☆
沥青	0.53%	0.29%	2.92%	0.95%	-1.02%	-2.22%	-0.42%	☆
沪银	-0.77%	-5.31%	-3.29%	11.95%	10.88%	9.48%	-12.72%	☆☆☆
PTA	18.73%	13.33%	4.48%	-18.45%	-13.19%	-4.19%	37.17%	☆☆☆☆☆
沪金	1.75%	2.57%	-1.32%	7.30%	12.19%	10.81%	-5.55%	☆☆
沪铝	1.01%	1.66%	-0.46%	-0.31%	0.52%	-0.67%	1.32%	☆
螺纹钢	0.94%	4.67%	4.96%	3.82%	1.18%	-3.07%	-2.88%	☆

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
甲醇	0.39%	3.24%	3.73%	-4.85%	-1.70%	-5.40%	5.24%	☆
玉米	4.01%	3.23%	11.11%	-16.09%	-16.55%	-13.20%	20.11%	☆☆
棕榈油	-15.57%	-11.46%	-1.04%	-17.33%	-13.14%	-7.21%	1.76%	☆
动力煤	26.92%	21.77%	13.50%	-10.66%	-14.85%	-17.69%	37.58%	☆☆☆
聚丙烯	0.39%	2.11%	-1.96%	4.83%	6.48%	3.45%	-4.44%	☆
橡胶	3.89%	2.40%	0.17%	-2.85%	-2.27%	-5.62%	6.74%	☆
棉花	4.22%	7.77%	9.59%	-7.82%	-4.86%	-6.98%	12.04%	☆☆
鸡蛋	-9.84%	-10.03%	-4.51%	6.12%	6.20%	4.35%	-15.97%	☆☆
菜籽粕	-0.24%	0.35%	1.94%	1.20%	0.97%	1.66%	-1.44%	☆
铁矿石	3.27%	10.07%	7.24%	-10.56%	-9.75%	-12.05%	13.82%	☆☆
豆油	-12.57%	-8.81%	-4.09%	14.24%	13.16%	-0.08%	-26.81%	☆☆
沪镍	3.82%	2.97%	2.99%	-2.82%	-3.61%	-7.37%	6.63%	☆
焦炭	0.28%	6.36%	0.61%	14.56%	12.32%	5.66%	-14.27%	☆☆
沥青	6.80%	5.11%	5.59%	3.08%	2.20%	-3.62%	3.72%	☆
沪银	2.09%	3.44%	0.42%	8.48%	8.37%	11.47%	-6.40%	☆
沪铝	3.26%	0.25%	-1.22%	-1.02%	0.91%	-0.09%	4.29%	☆
沪金	-0.99%	2.88%	-0.05%	11.19%	14.47%	12.88%	-12.18%	☆☆
焦煤	-12.15%	-13.08%	-16.72%	13.50%	11.66%	8.01%	-25.65%	☆☆
沪锌	-3.68%	-6.00%	-5.28%	17.01%	8.10%	-0.04%	-20.69%	☆☆
聚乙烯	8.65%	5.06%	-0.31%	5.84%	2.99%	-1.21%	2.82%	☆
沪铜	1.96%	2.40%	0.41%	-2.37%	-3.54%	-4.40%	4.33%	☆
豆粕	38.90%	33.21%	26.55%	14.92%	4.40%	-12.74%	23.99%	☆☆
螺纹钢	11.68%	11.29%	13.84%	-0.20%	-3.68%	-12.81%	11.88%	☆☆
PTA	28.92%	21.07%	7.96%	-15.38%	-10.04%	-5.24%	44.31%	☆☆☆
白糖	-12.37%	-5.79%	-1.15%	-4.26%	-3.85%	-1.96%	-8.11%	☆
玻璃	3.91%	5.73%	7.03%	5.71%	4.24%	-2.72%	-1.80%	☆

2018年3月7日机构持仓异动表

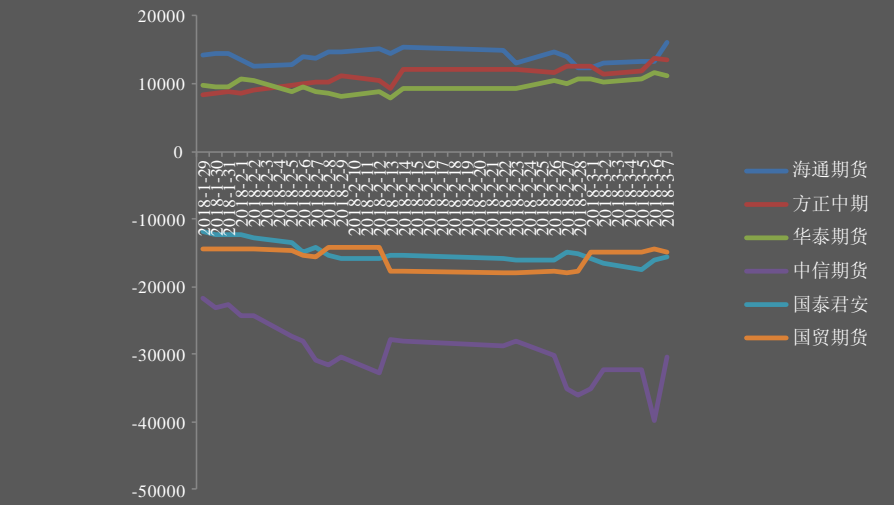
金属

东证期货	白银净多单变动幅度为：-14041手
鲁证期货	沪镍净空单变动幅度为：3997手
兴证期货	沪锌净空单变动幅度为：2182手
国投安信	沪铅净多单变动幅度为：575手

黑色

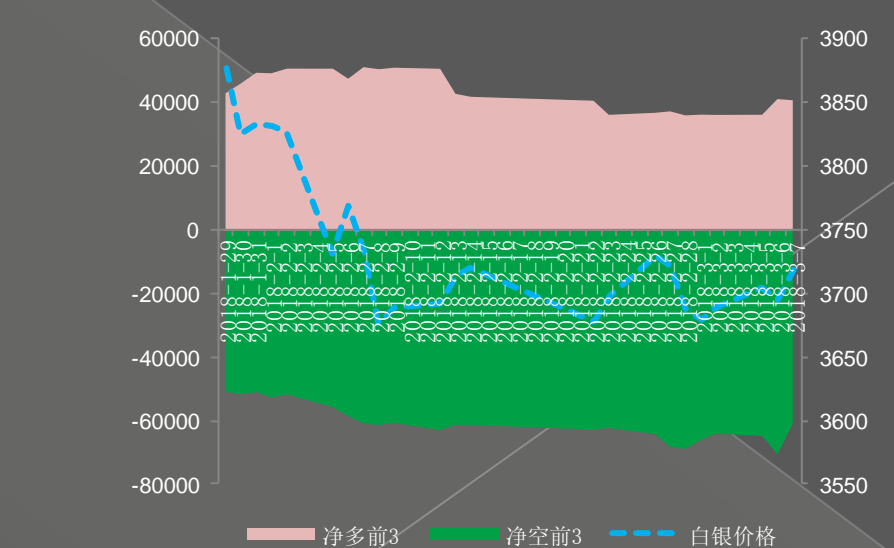
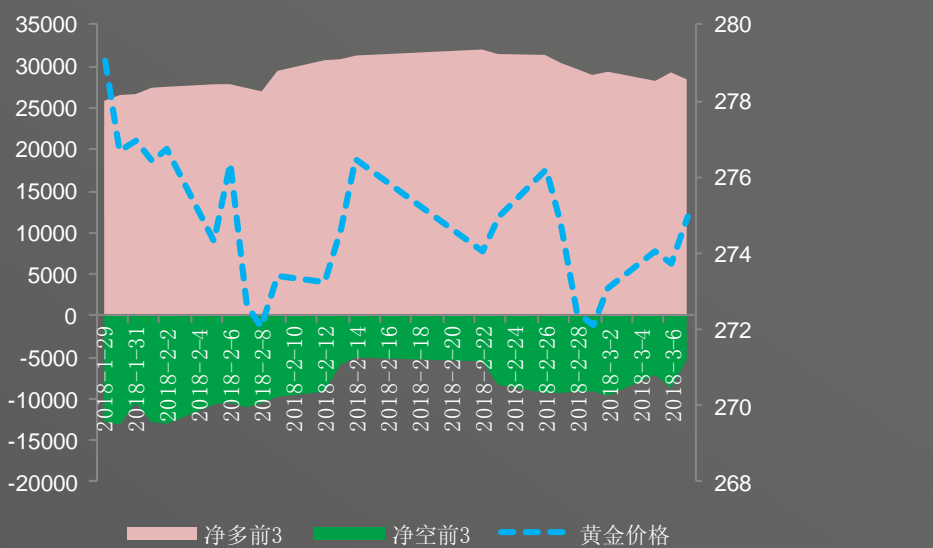
申万期货	螺纹钢净多单变动幅度为：-21739手
光大期货	螺纹钢净空单变动幅度为：-34707手
鲁证期货	螺纹钢净多单变动幅度为：73142手
兴证期货	螺纹钢净空单变动幅度为：42562手
国泰君安	铁矿石净多单变动幅度为：-17105手
永安期货	焦炭净多单变动幅度为：-1575手

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	-2.88%	-4.26%	-0.85%	9.37%
	空头前3	-39.10%	-42.14%	-8.43%	
au涨幅		0.45%	0.92%	0.18%	
震荡幅度	0.62%	0.71%(月均值)	投机度	0.45	0.38(月均值)

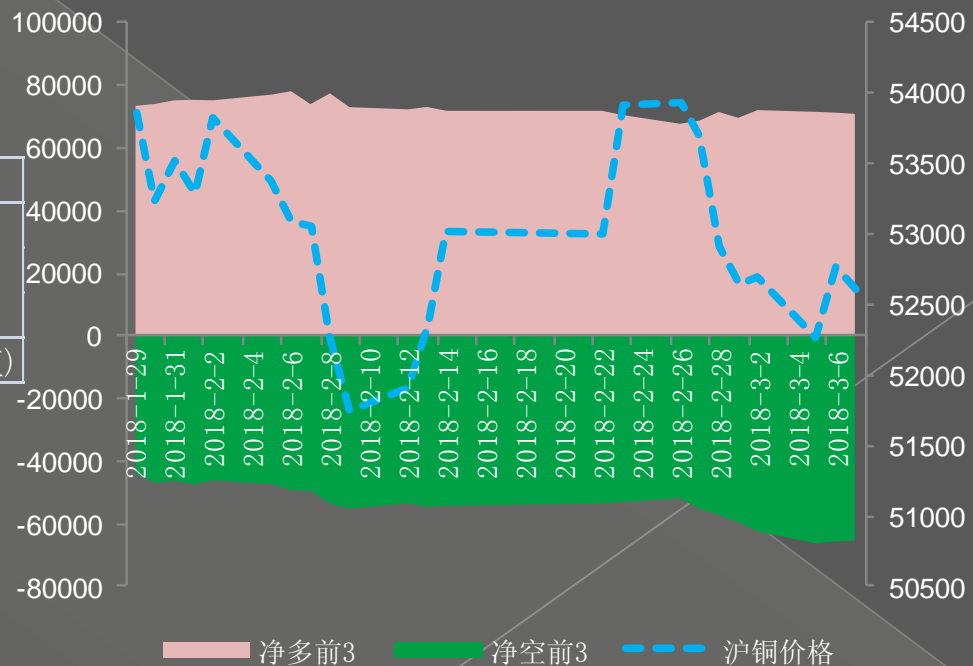
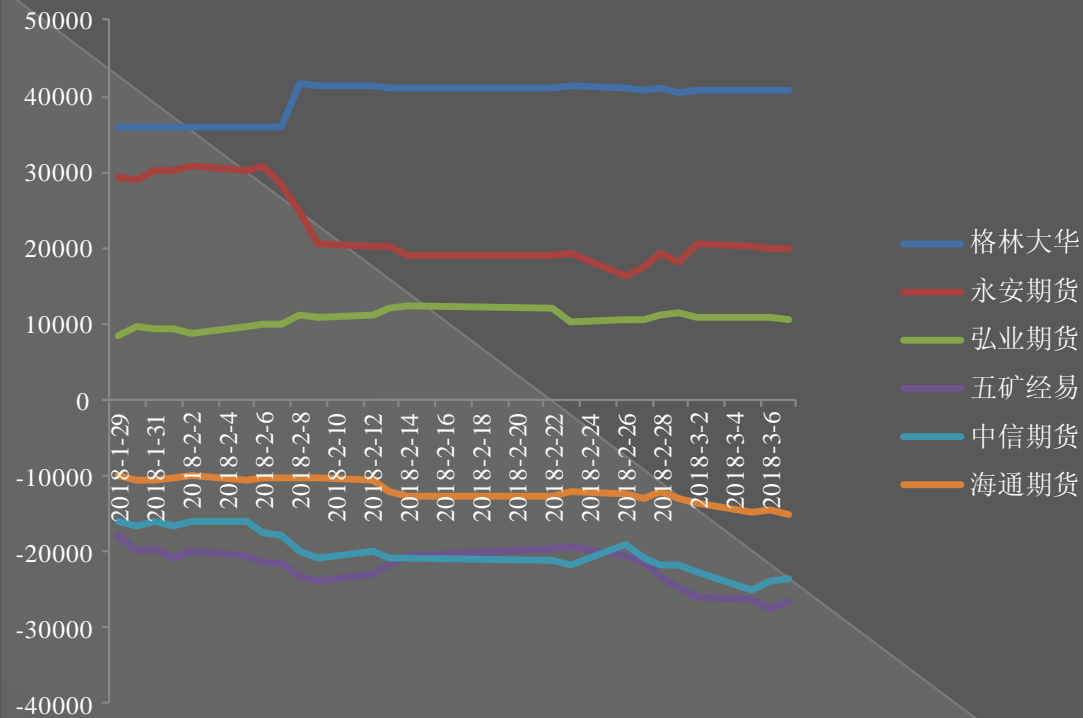
变动幅度		当日	最近5日	平均变化	波动率
ag持仓	多头前3	-0.88%	13.14%	2.63%	13.92%
	空头前3	-13.78%	-11.67%	-2.33%	
ag涨幅		0.64%	0.86%	0.17%	
震荡幅度	1.00%	1.04%(月均值)	投机度	0.65	0.49(月均值)



净多前3 净空前3 黄金价格

净多前3 净空前3 白银价格

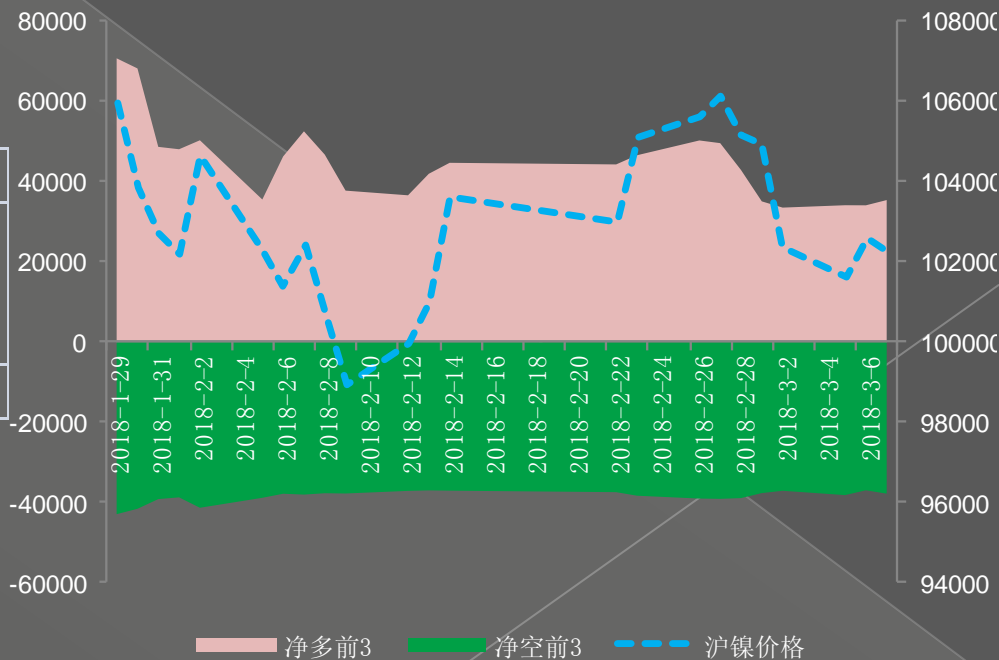
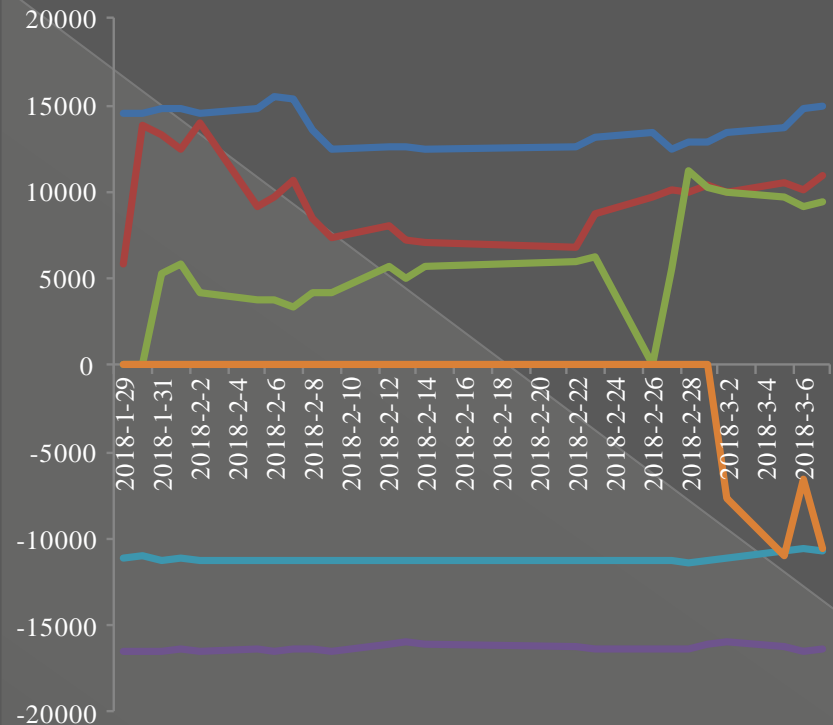
金属板块：Cu



变动幅度		当日	最近5日	平均变化	波动率
cu持仓	多头前3	-0.52%	-0.82%	-0.16%	14.02%
	空头前3	-0.32%	14.31%	2.86%	
cu涨幅		-0.28%	-0.57%	-0.11%	
震荡幅度	0.95%	1.29%(月均值)	投机度	0.41	0.53(月均值)

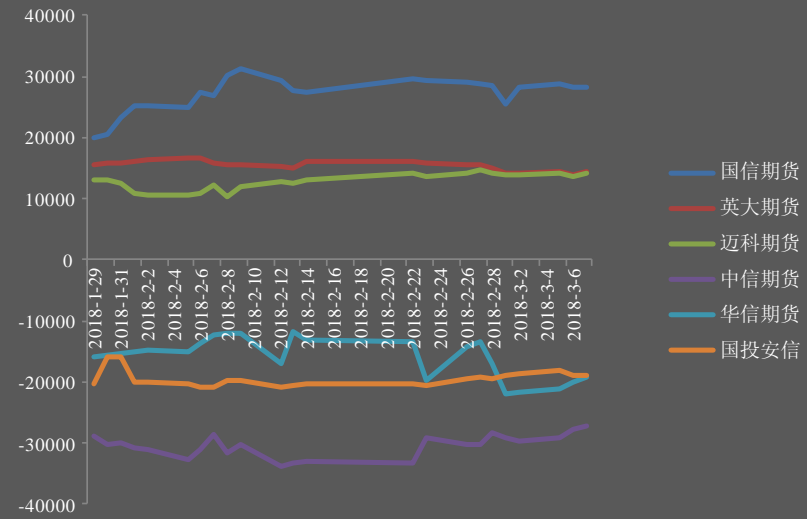
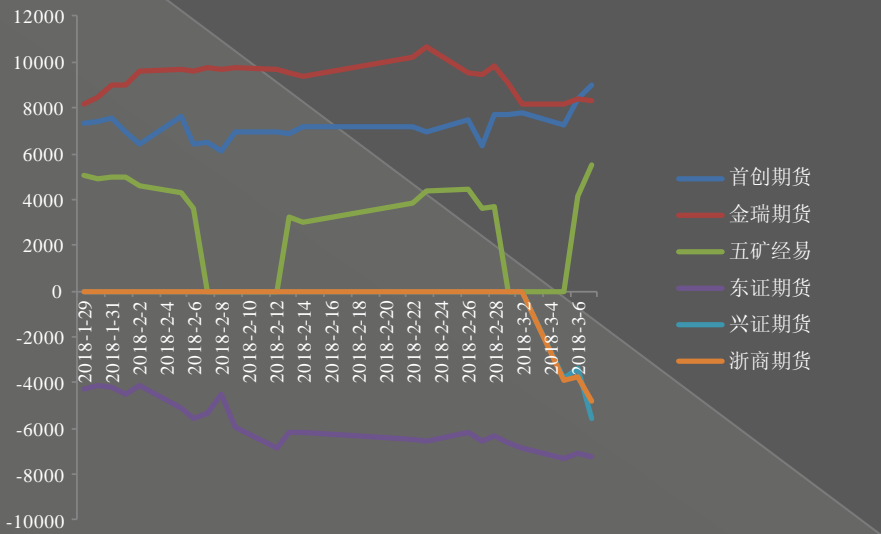
金属板块：Ni

- 国贸期货
- 华泰期货
- 方正中期
- 兴业期货
- 江海汇鑫
- 鲁证期货



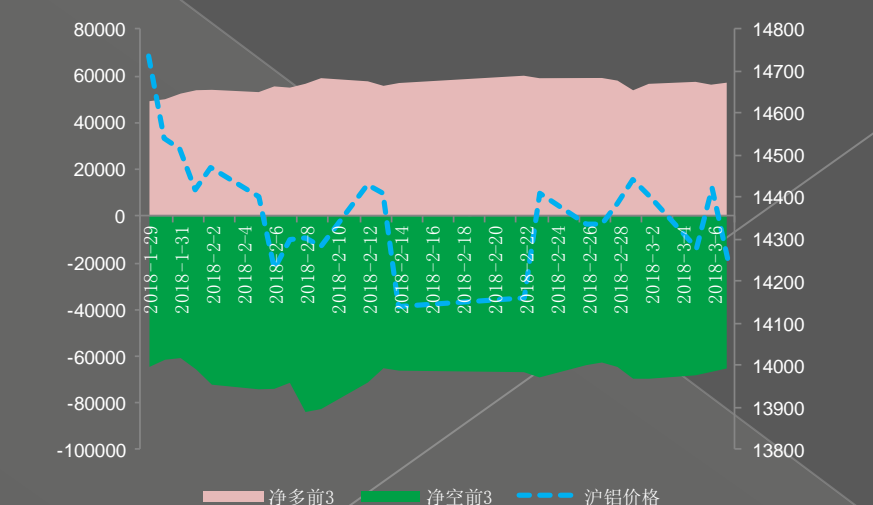
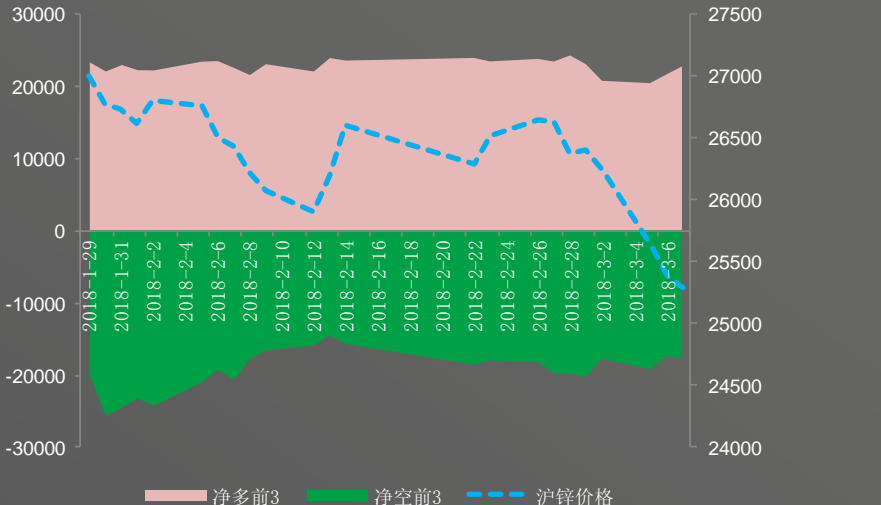
变动幅度		当日	最近5日	平均变化	波动率
ni持仓	多头前3	3.82%	-17.46%	-3.49%	23.31%
	空头前3	2.27%	-2.87%	-0.57%	
ni涨幅		-0.32%	-2.76%	-0.55%	
震荡幅度	1.45%	2.36%(月均值)	投机度	1.34	1.53(月均值)

金属板块：Zn & Al

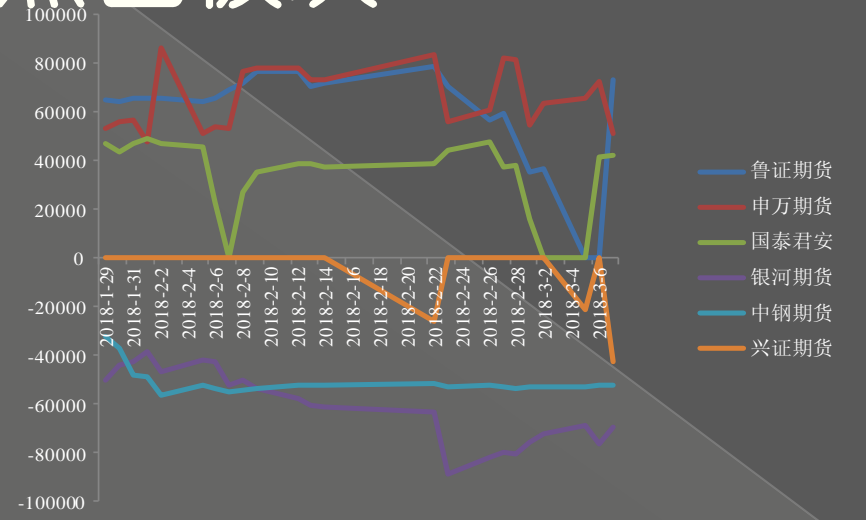


变动幅度		当日	最近5日	平均变化	波动率
zn持仓	多头前3	5.39%	-6.22%	-1.24%	13.67%
	空头前3	1.21%	-10.96%	-2.19%	
zn涨幅		-0.36%	-4.11%	-0.82%	
震荡幅度	1.13%	1.56% (月均值)	投机度	1.17	1.14 (月均值)

变动幅度		当日	最近5日	平均变化	波动率
al持仓	多头前3	1.53%	-1.52%	-0.30%	13.45%
	空头前3	-2.22%	1.01%	0.20%	
al涨幅		-1.17%	-0.89%	-0.18%	
震荡幅度	1.74%	1.53% (月均值)	投机度	0.61	0.60 (月均值)

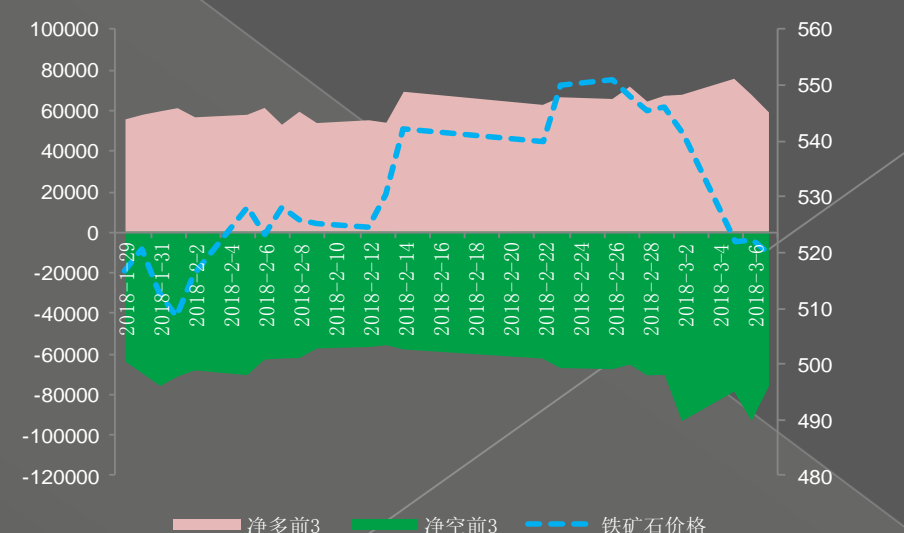
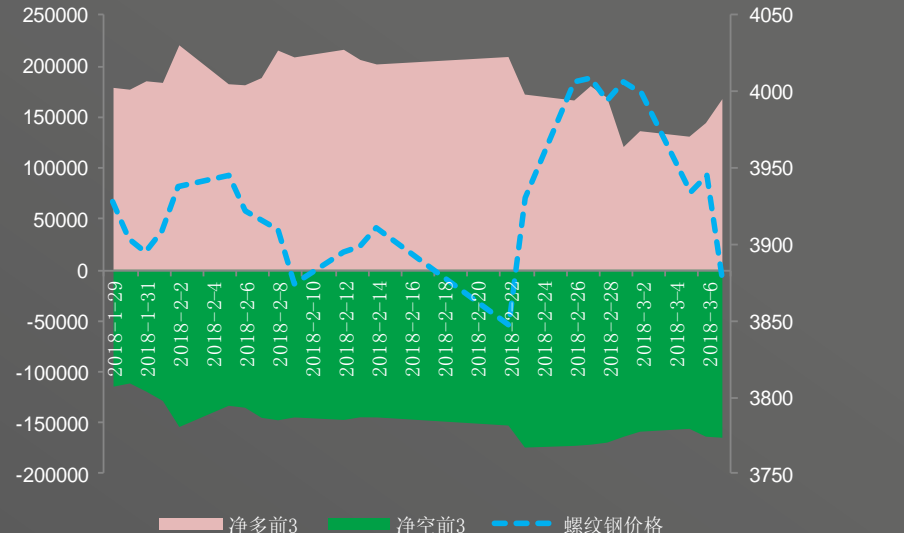


黑色板块：Rb & I

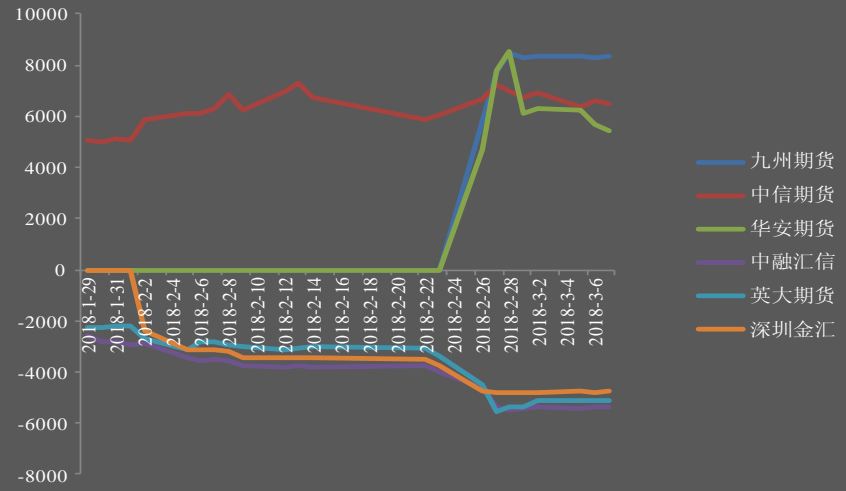
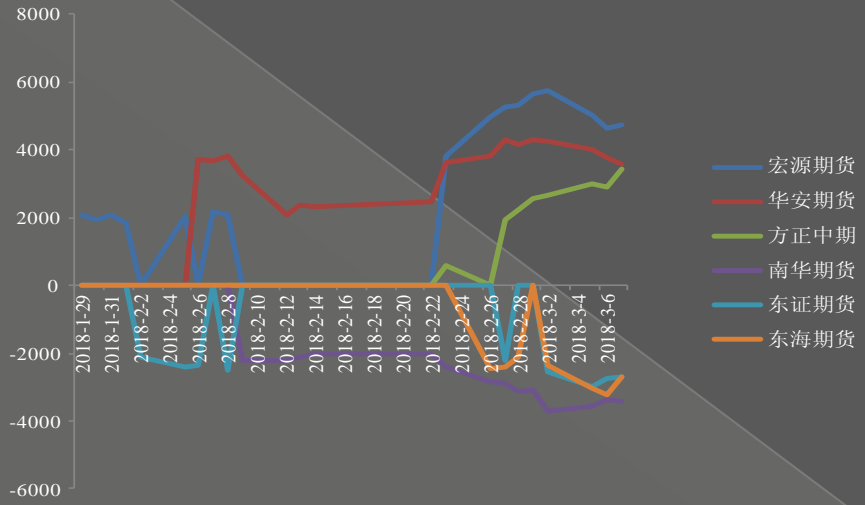


变动幅度		当日	最近5日	平均变化	波动率
rb持仓	多头前3	16.30%	-0.76%	-0.15%	15.40%
	空头前3	0.65%	-2.82%	-0.56%	
rb涨幅		-1.83%	-3.04%	-0.61%	
震荡幅度	2.36%	1.52%(月均值)	投机度	1.13	0.86(月均值)

变动幅度		当日	最近5日	平均变化	波动率
I持仓	多头前3	-12.82%	-8.37%	-1.67%	21.04%
	空头前3	-18.37%	7.53%	1.51%	
I涨幅		-0.51%	-4.71%	-0.94%	
震荡幅度	1.79%	2.08%(月均值)	投机度	0.96	0.94(月均值)

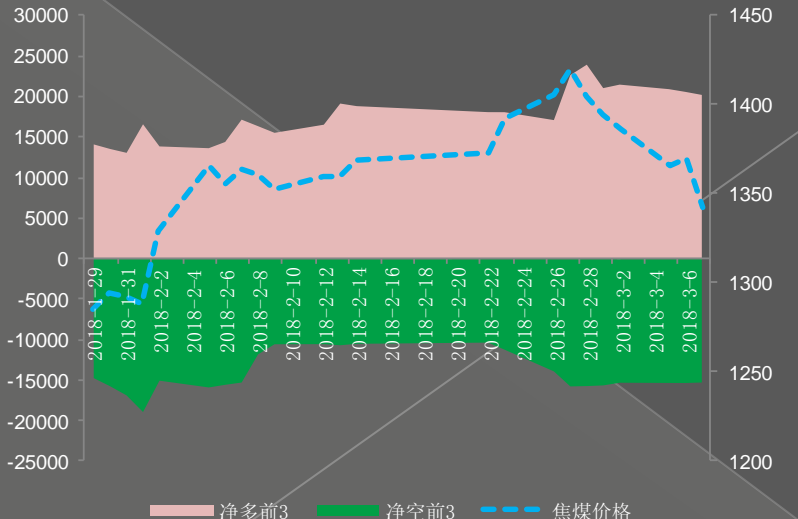
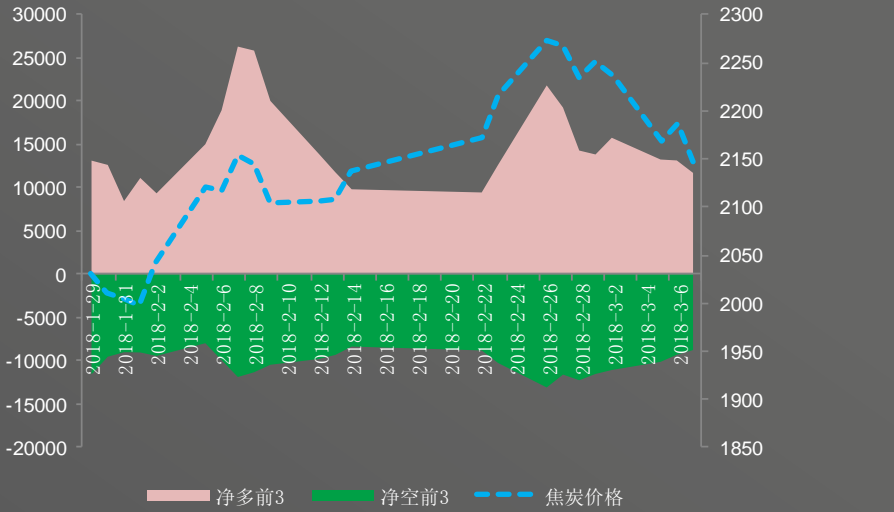


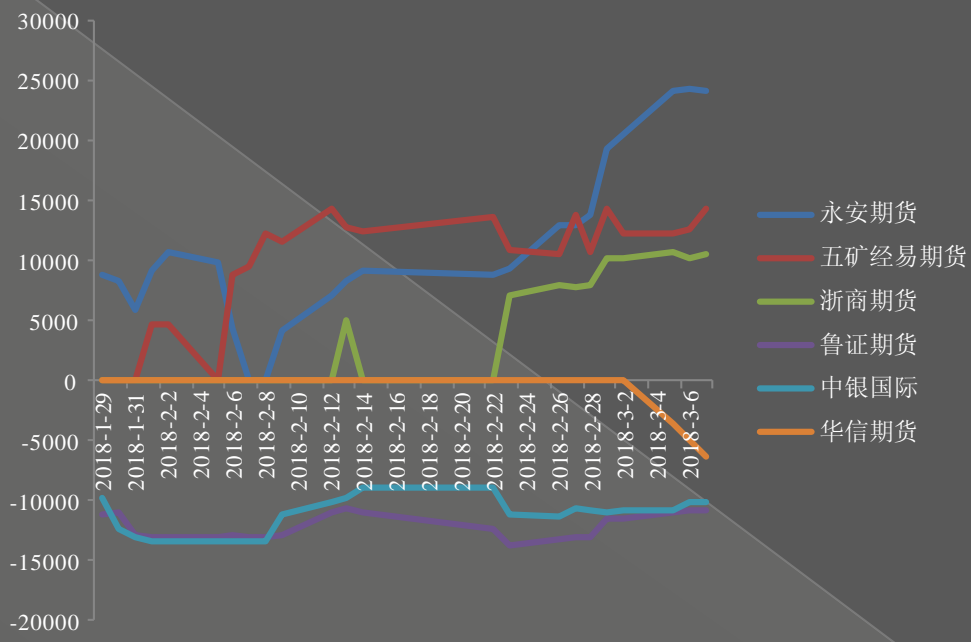
黑色板块：J & JM



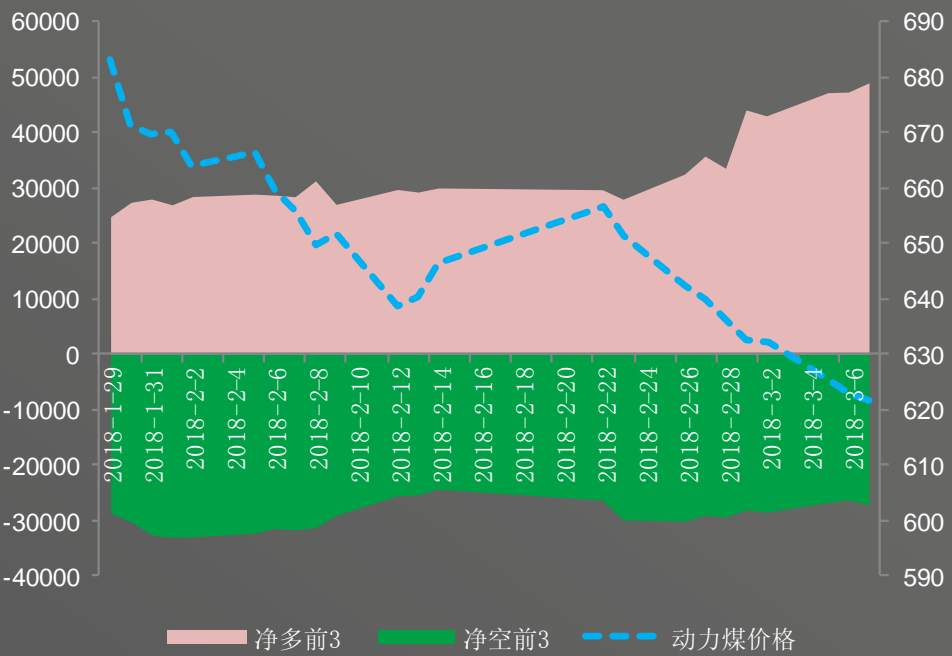
变动幅度		当日	最近5日	平均变化	波动率
j持仓	多头前3	-10.93%	-18.04%	-3.61%	26.25%
	空头前3	-5.86%	-28.50%	-5.70%	
j涨幅		-1.89%	-4.00%	-0.80%	
震荡幅度	3.07%	2.45%(月均值)	投机度	1.18	1.02(月均值)

变动幅度		当日	最近5日	平均变化	波动率
jm持仓	多头前3	-1.80%	-15.52%	-3.10%	19.47%
	空头前3	-0.39%	-2.81%	-0.56%	
jm涨幅		-2.03%	-4.45%	-0.89%	
震荡幅度	3.45%	2.26%(月均值)	投机度	0.89	0.99(月均值)



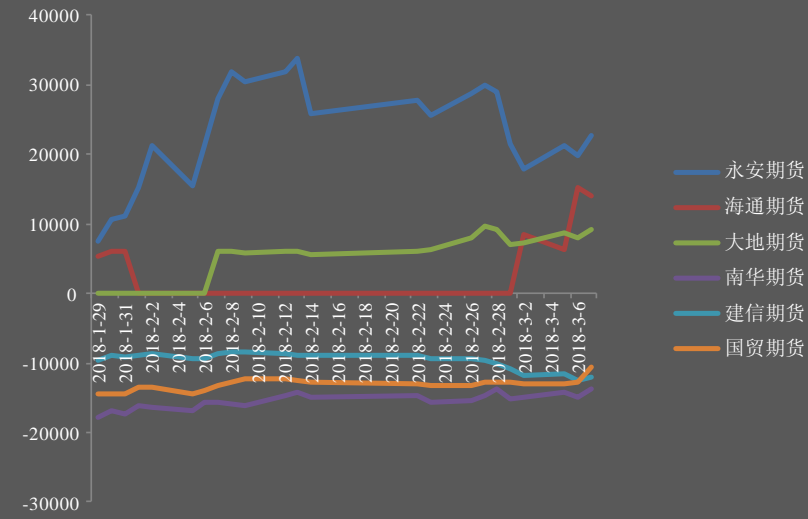
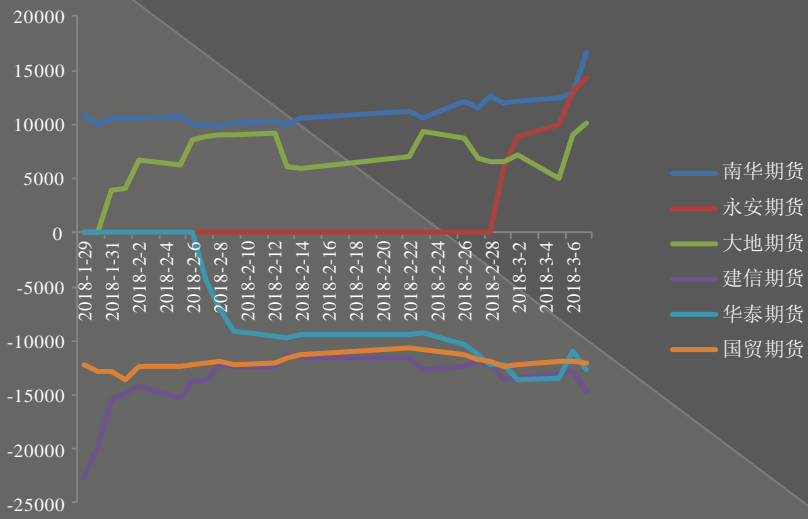


黑色：动力煤



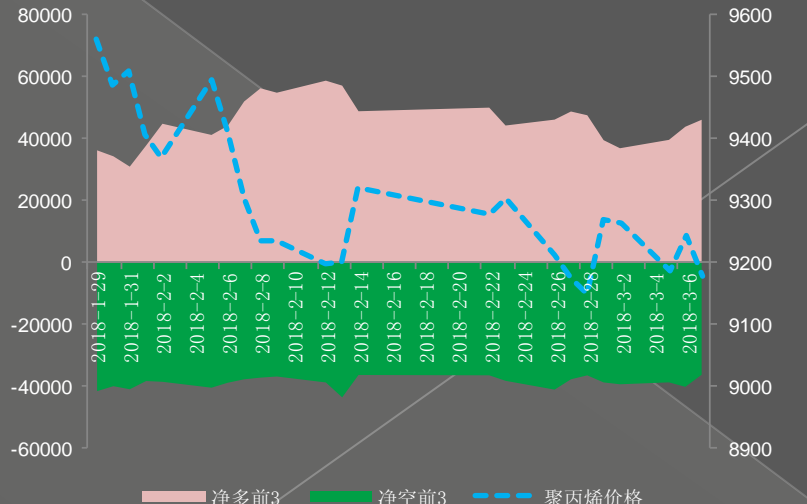
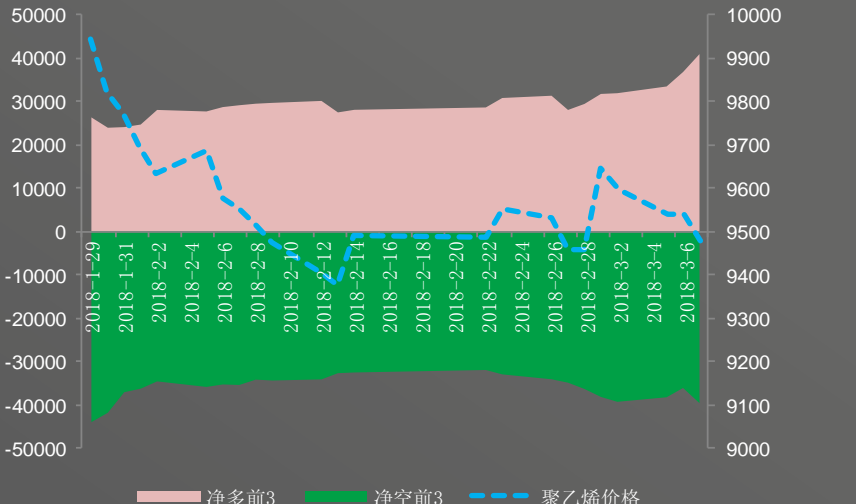
变动幅度		当日	最近5日	平均变化	波动率
zc持仓	多头前3	3.53%	46.00%	9.20%	13.17%
	空头前3	3.52%	-7.62%	-1.52%	
zc涨幅		-0.20%	-2.26%	-0.45%	
震荡幅度	0.74%	1.42% (月均值)	投机度	0.49	0.69 (月均值)

化工：塑料 & PP

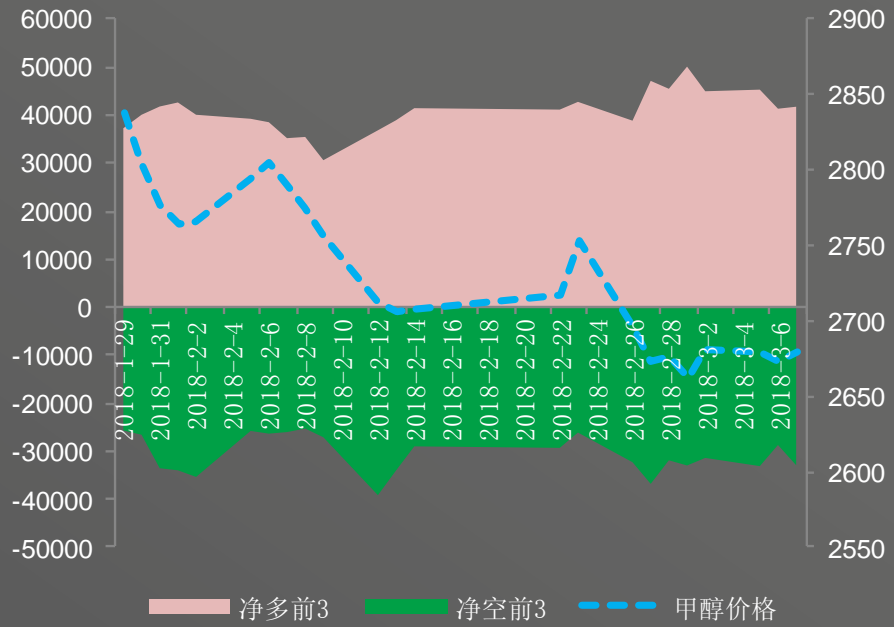
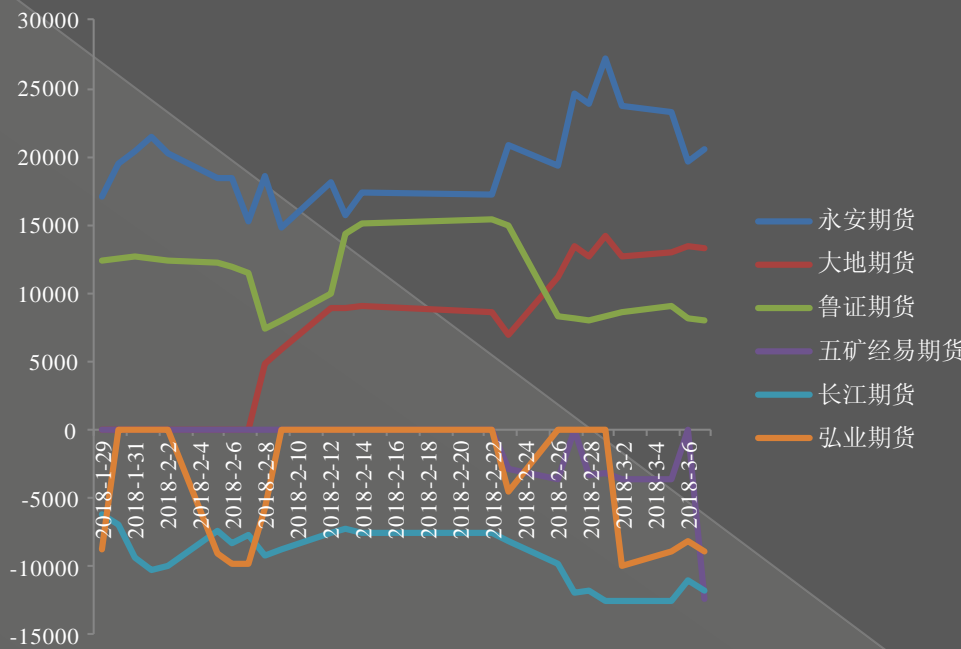


变动幅度		当日	最近5日	平均变化	波动率
I持仓	多头前3	11.27%	39.18%	7.84%	11.95%
	空头前3	9.66%	8.97%	1.79%	
I涨幅		-0.66%	0.23%	0.05%	
震荡幅度	1.44%	1.20%(月均值)	投机度	0.81	0.54(月均值)

变动幅度		当日	最近5日	平均变化	波动率
pp持仓	多头前3	5.13%	-3.05%	-0.61%	12.01%
	空头前3	-9.73%	-0.51%	-0.10%	
pp涨幅		-0.70%	0.30%	0.06%	
震荡幅度	1.21%	1.24%(月均值)	投机度	0.72	0.60(月均值)

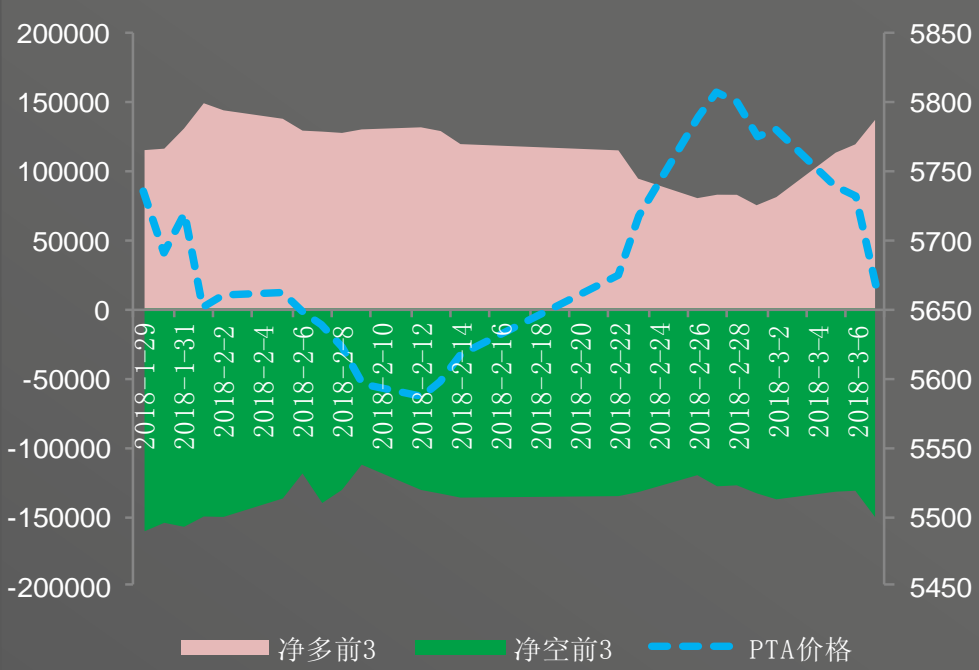
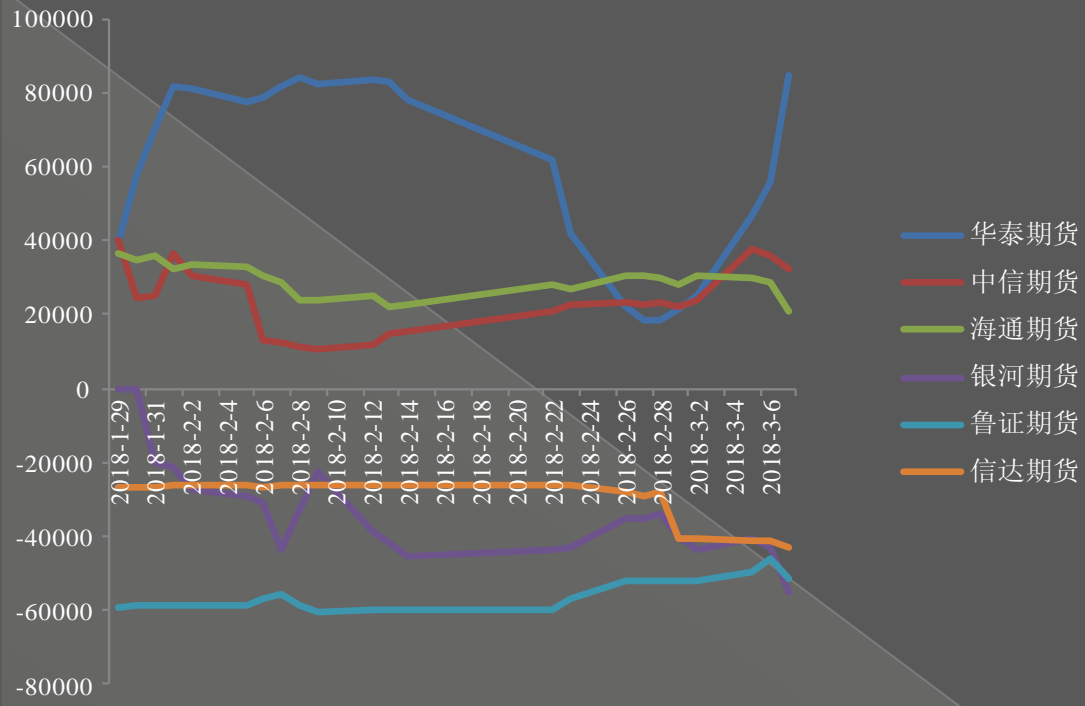


化工：甲醇



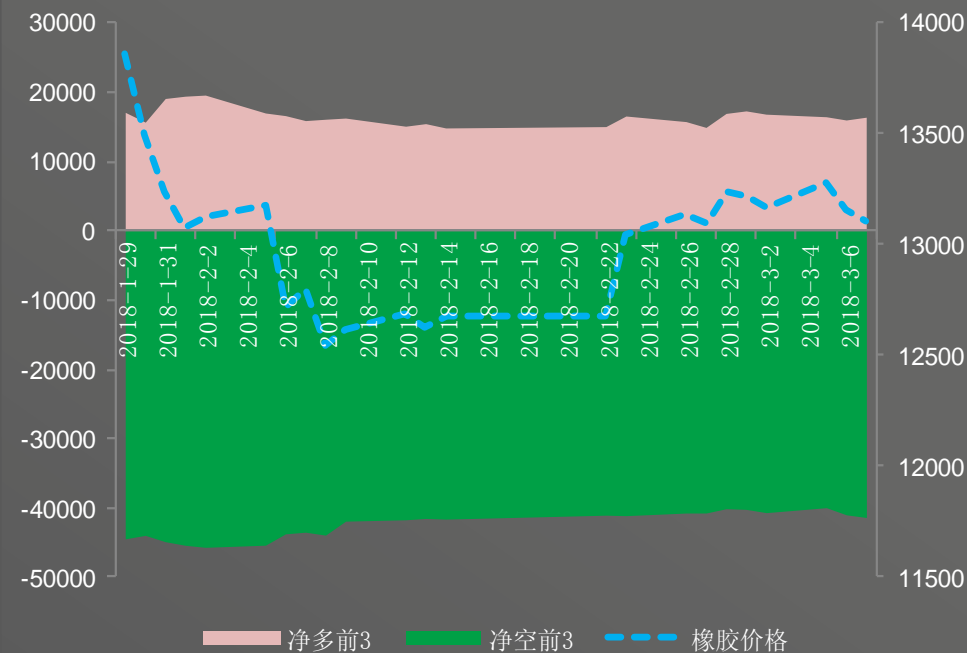
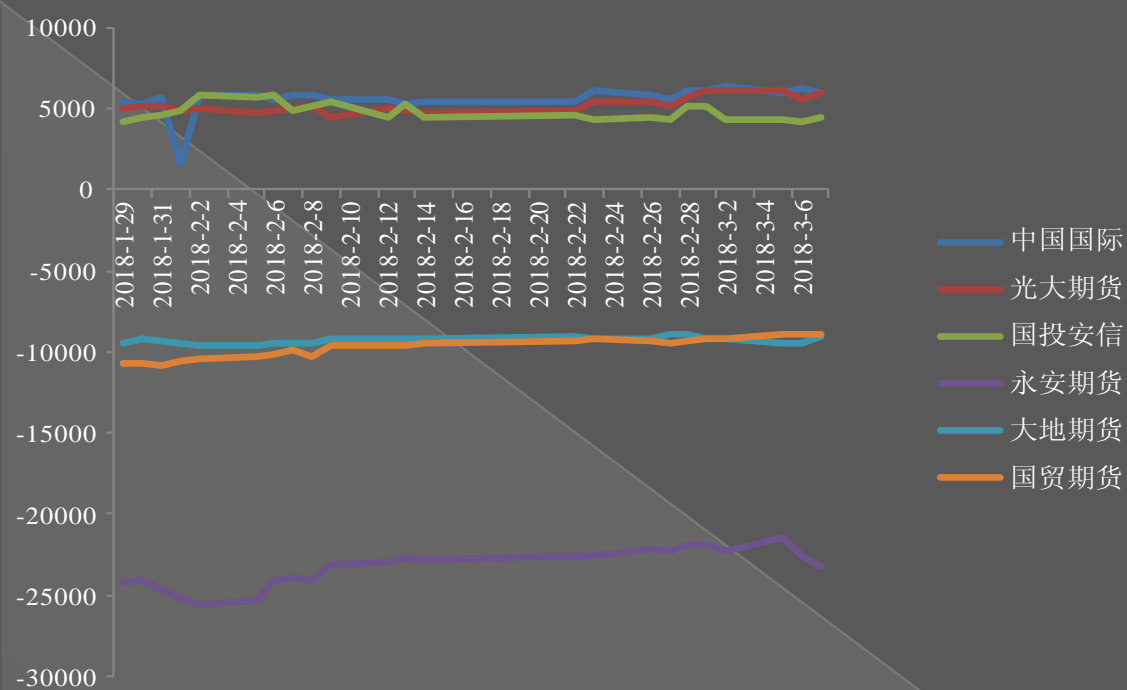
变动幅度		当日	最近5日	平均变化	波动率
ma持仓	多头前3	0.99%	-8.17%	-1.63%	12.84%
	空头前3	14.79%	3.25%	0.65%	
ma涨幅		0.28%	0.16%	0.03%	
震荡幅度	1.60%	1.60%(月均值)	投机度	1.14	1.08(月均值)

化工：PTA



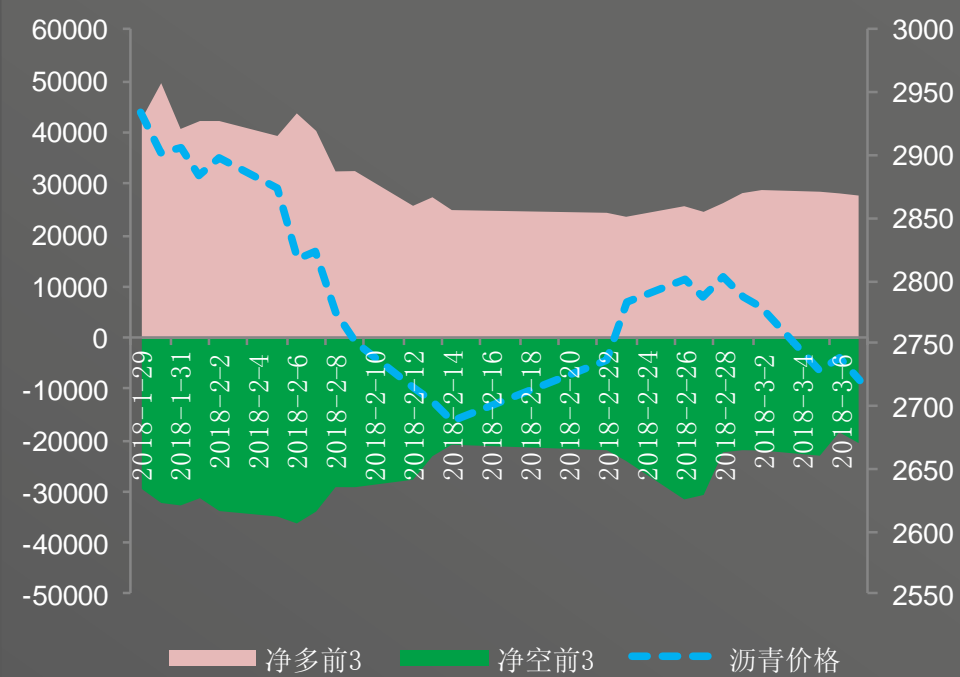
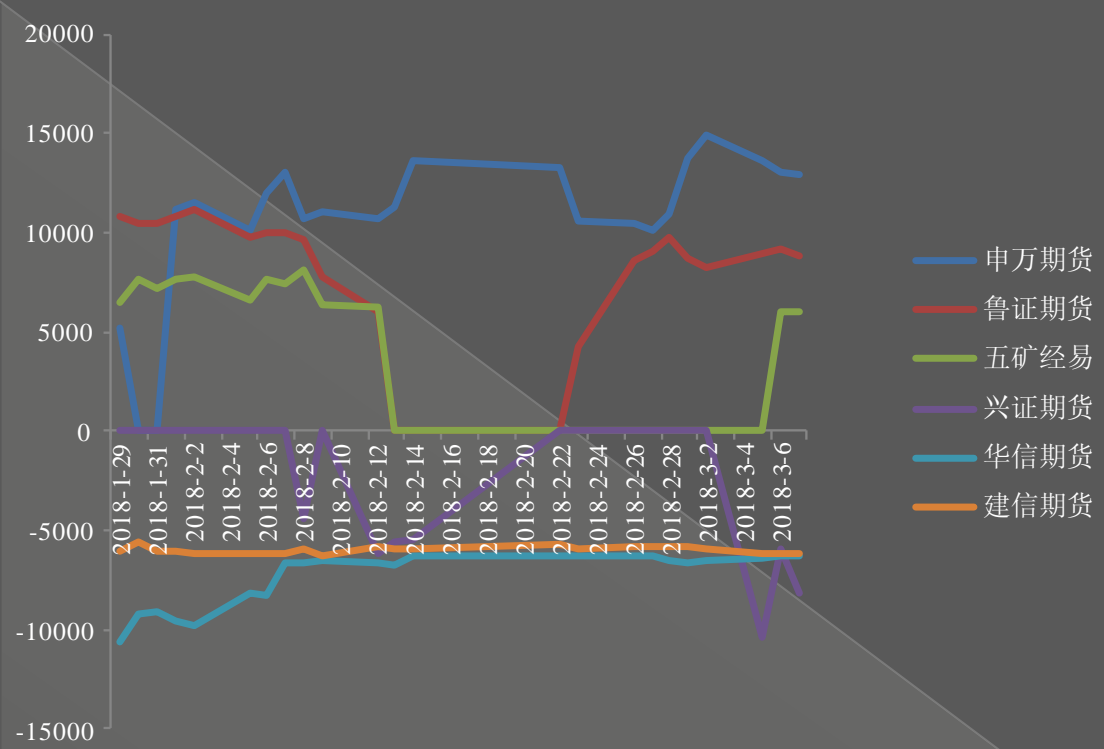
变动幅度		当日	最近5日	平均变化	波动率
pta持仓	多头前3	14.89%	65.86%	13.17%	9.91%
	空头前3	14.46%	17.96%	3.59%	
pta涨幅		-1.16%	-2.31%	-0.46%	
震荡幅度	2.05%	1.28%(月均值)	投机度	0.65	0.46(月均值)

化工：橡胶



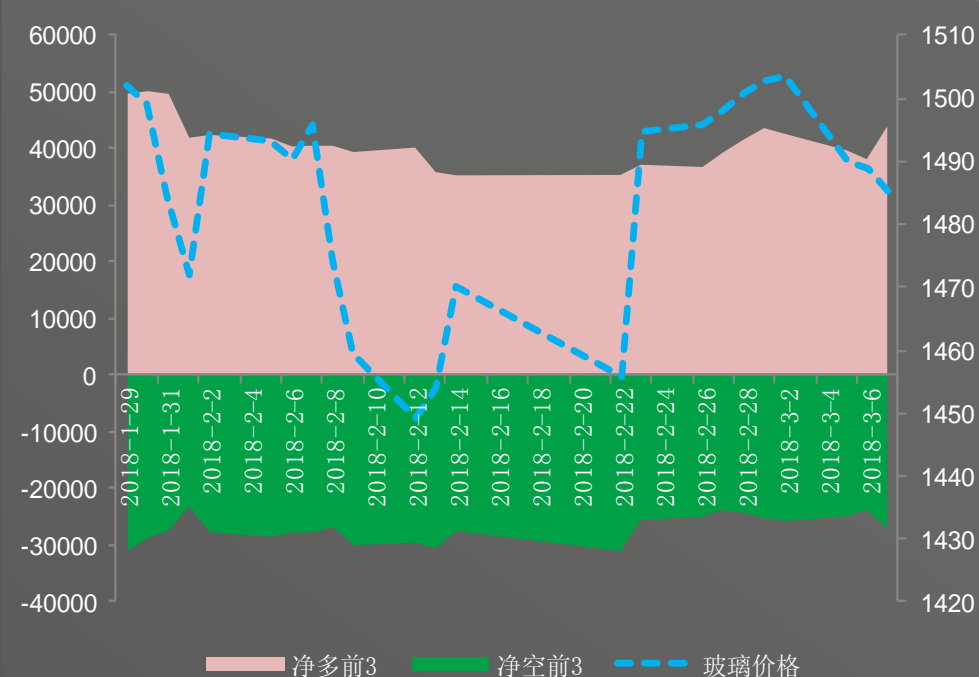
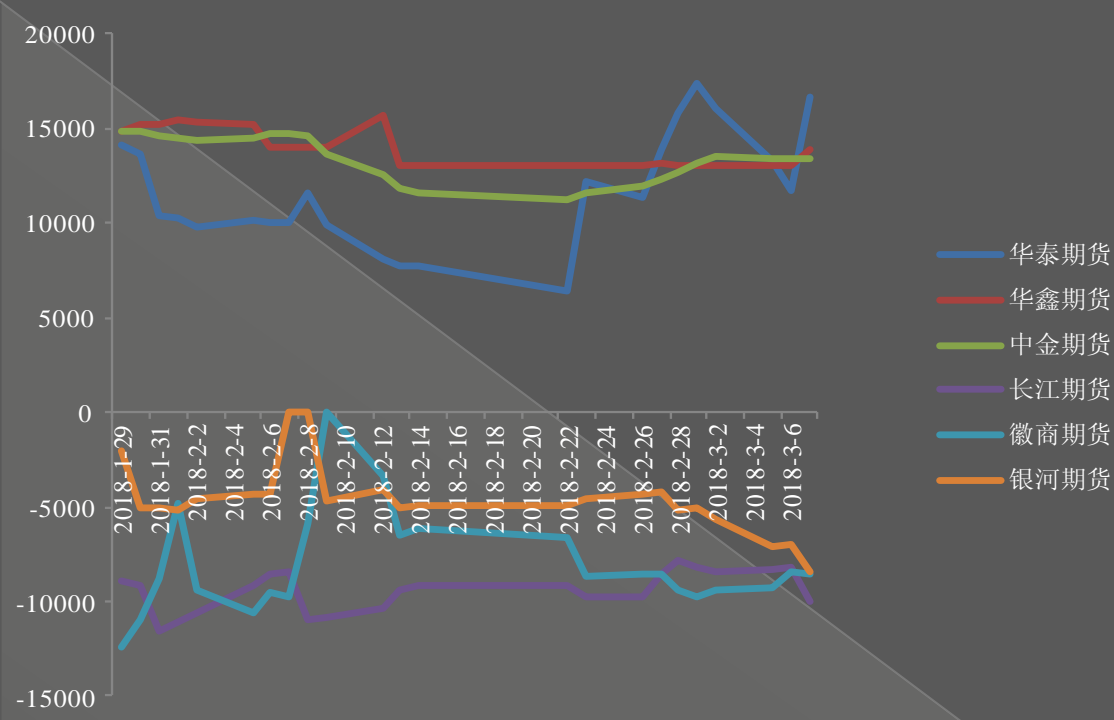
变动幅度		当日	最近5日	平均变化	波动率
ru持仓	多头前3	2.54%	-3.21%	-0.64%	22.15%
	空头前3	0.93%	3.15%	0.63%	
ru涨幅		-0.42%	-1.01%	-0.20%	
震荡幅度	1.12%	2.27%(月均值)	投机度	0.66	0.72(月均值)

化工：沥青



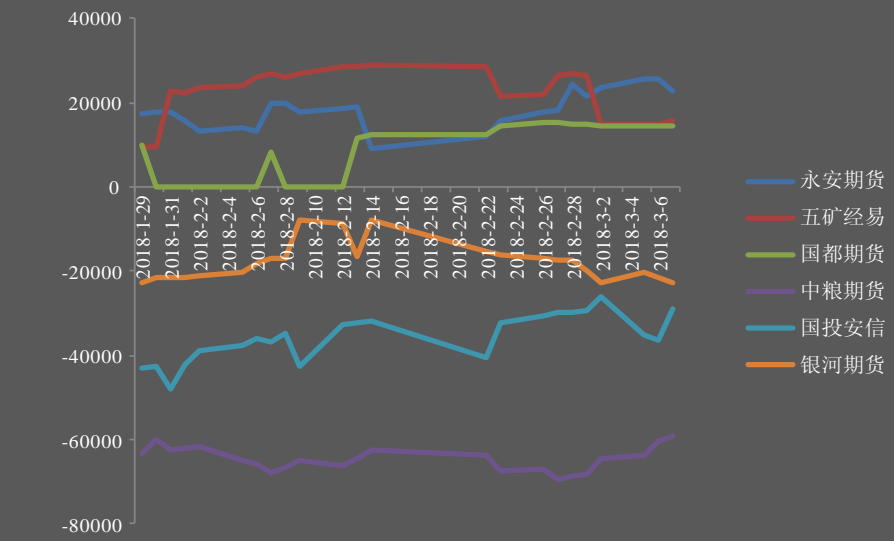
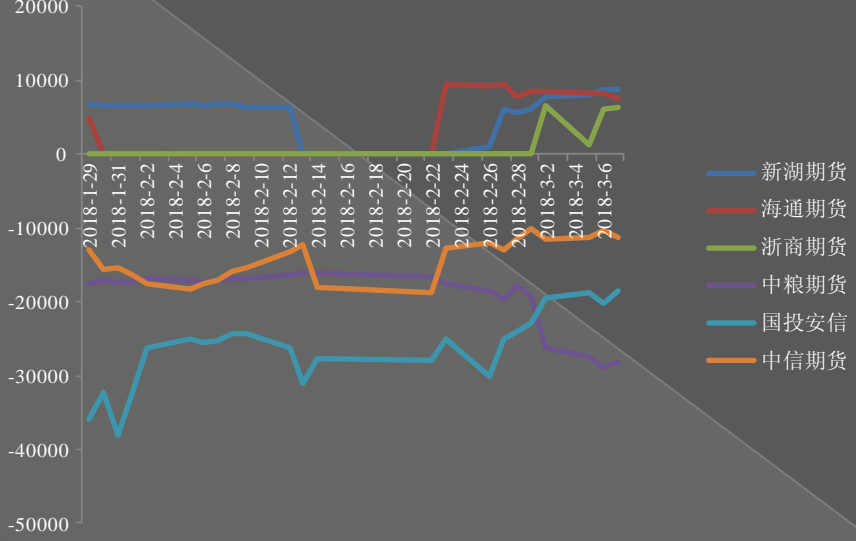
变动幅度		当日	最近5日	平均变化	波动率
bu持仓	多头前3	-1.49%	5.64%	1.13%	16.00%
	空头前3	11.60%	-8.05%	-1.61%	
bu涨幅		-0.67%	-2.93%	-0.59%	
震荡幅度	1.62%	1.80%(月均值)	投机度	0.72	0.78(月均值)

化工：玻璃



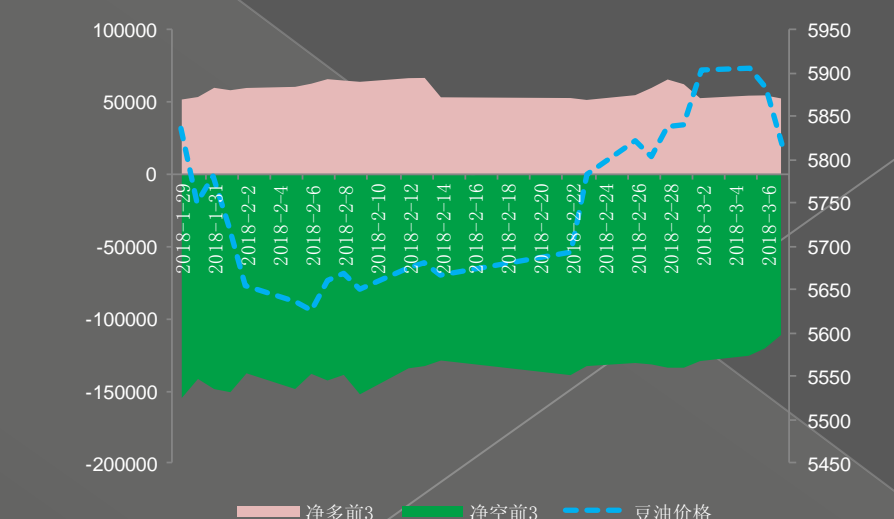
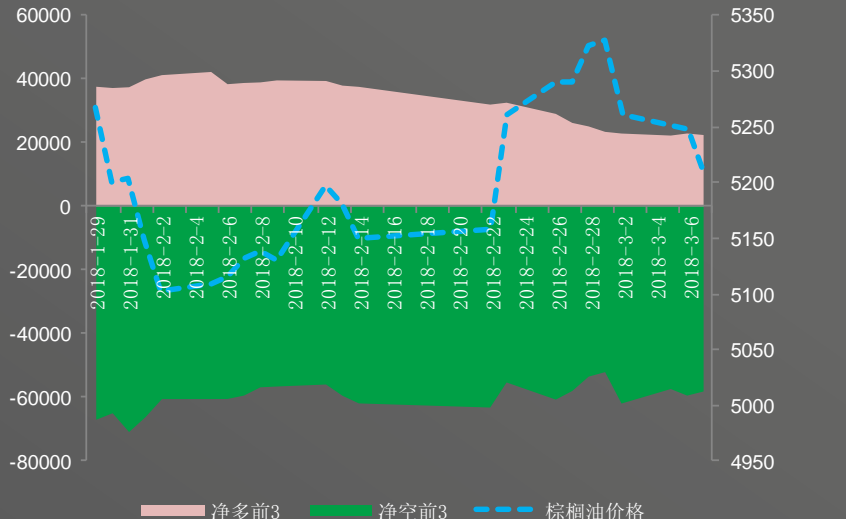
变动幅度		当日	最近5日	平均变化	波动率
fg持仓	多头前3	15.15%	5.63%	1.13%	14.66%
	空头前3	13.99%	11.77%	2.35%	
fg涨幅		-0.24%	-1.07%	-0.21%	
震荡幅度	1.27%	1.47%(月均值)	投机度	0.50	0.50(月均值)

农产品：P & Y



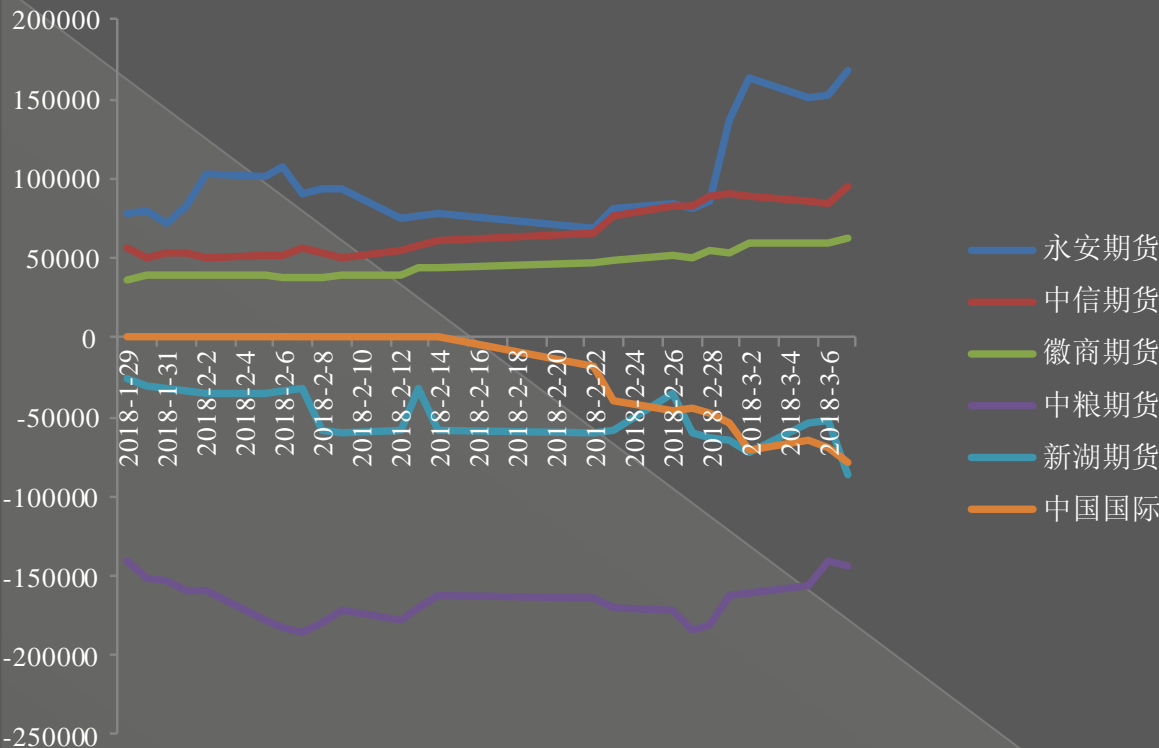
变动幅度		当日	最近5日	平均变化	波动率
p持仓	多头前3	-2.10%	-10.71%	-2.14%	12.39%
	空头前3	-2.20%	8.73%	1.75%	
p涨幅		-0.79%	-2.19%	-0.44%	
震荡幅度	1.42%	1.25%(月均值)	投机度	0.58	0.55(月均值)

变动幅度		当日	最近5日	平均变化	波动率
y持仓	多头前3	-3.81%	-19.76%	-3.95%	11.90%
	空头前3	-7.74%	-16.97%	-3.39%	
y涨幅		-1.09%	-0.33%	-0.07%	
震荡幅度	1.72%	1.24%(月均值)	投机度	0.52	0.36(月均值)



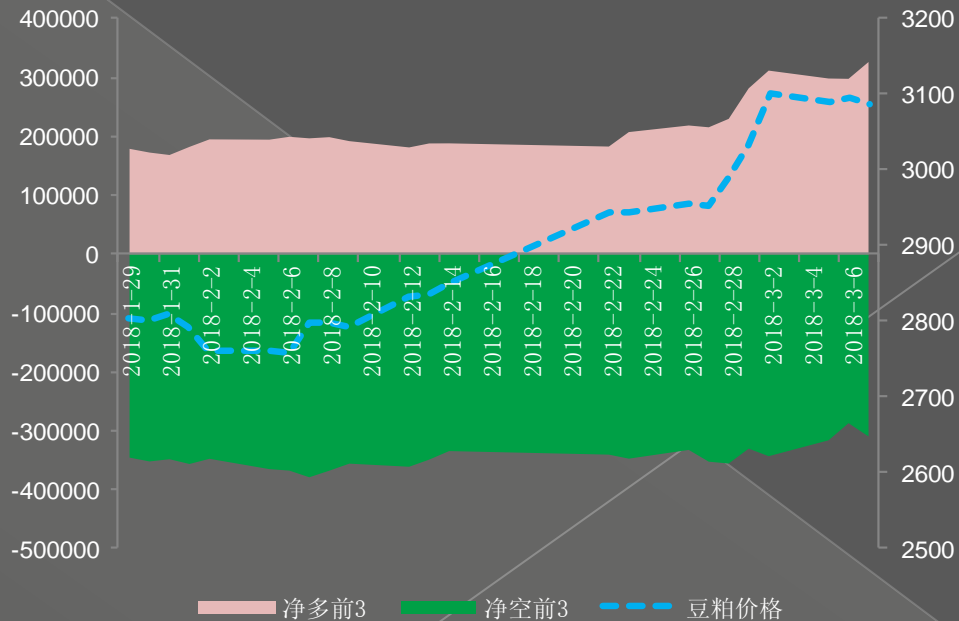
净多前3 净空前3 棕榈油价格

净多前3 净空前3 豆油价格

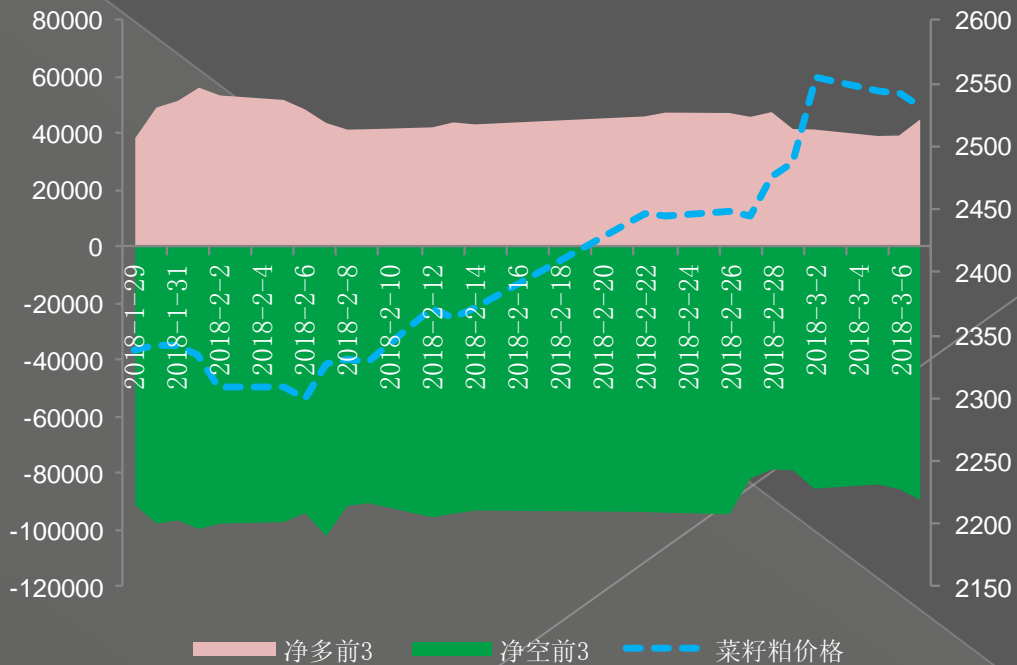
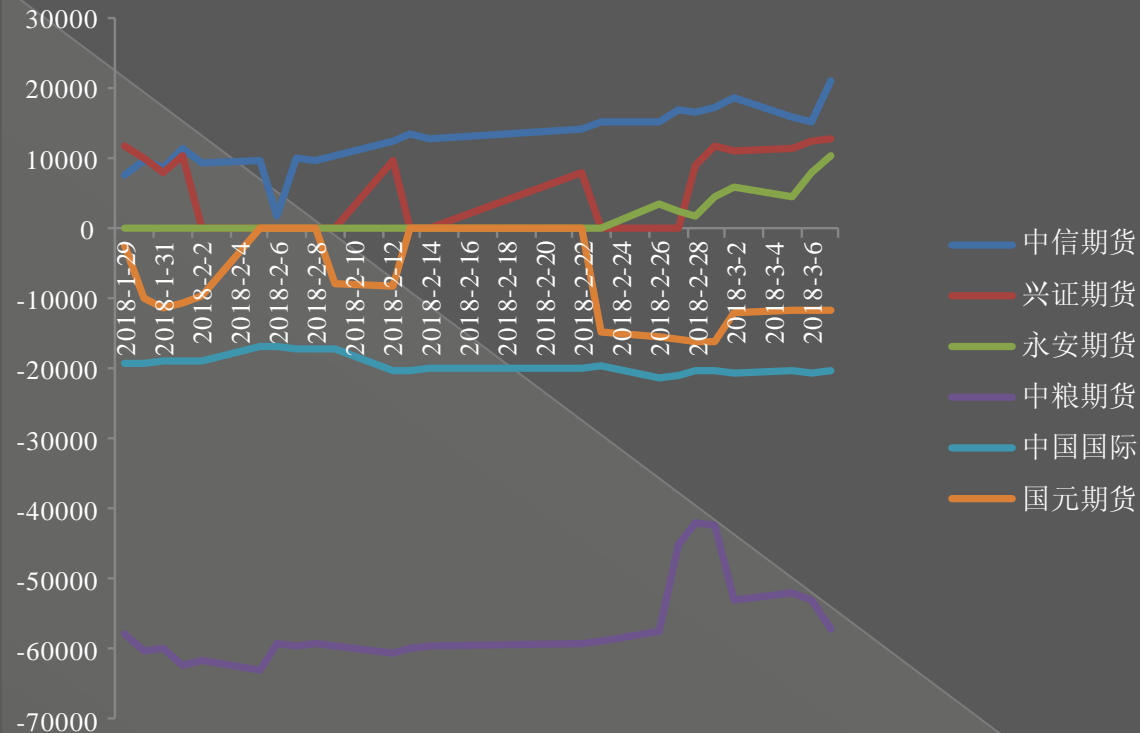


农产品：豆粕

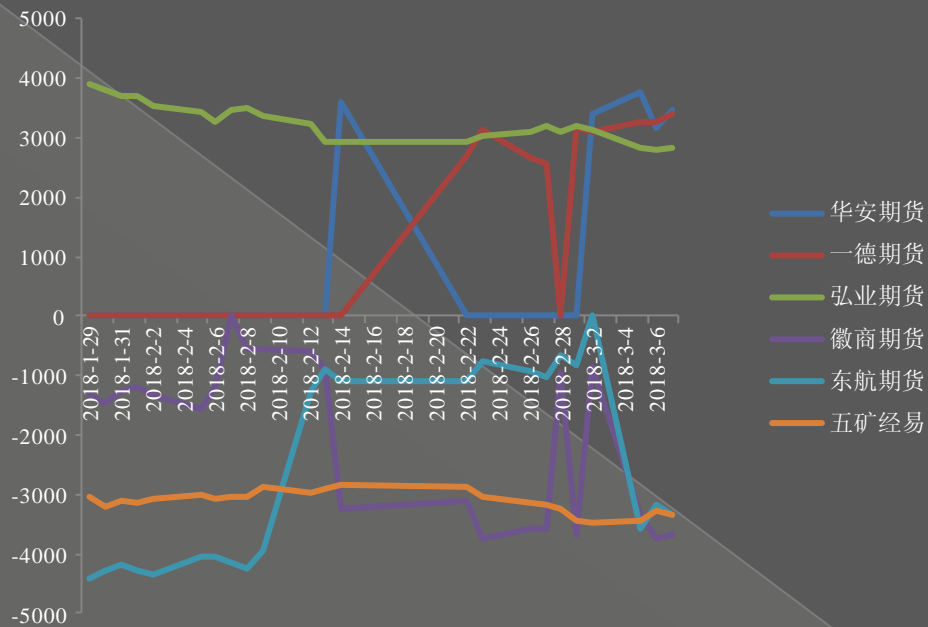
变动幅度		当日	最近5日	平均变化	波动率
m持仓	多头前3	9.57%	41.89%	8.38%	16.11%
	空头前3	7.87%	-12.94%	-2.59%	
m涨幅		-0.21%	3.28%	0.66%	
震荡幅度	1.71%	1.20%(月均值)	投机度	0.88	0.44(月均值)



农产品：菜粕

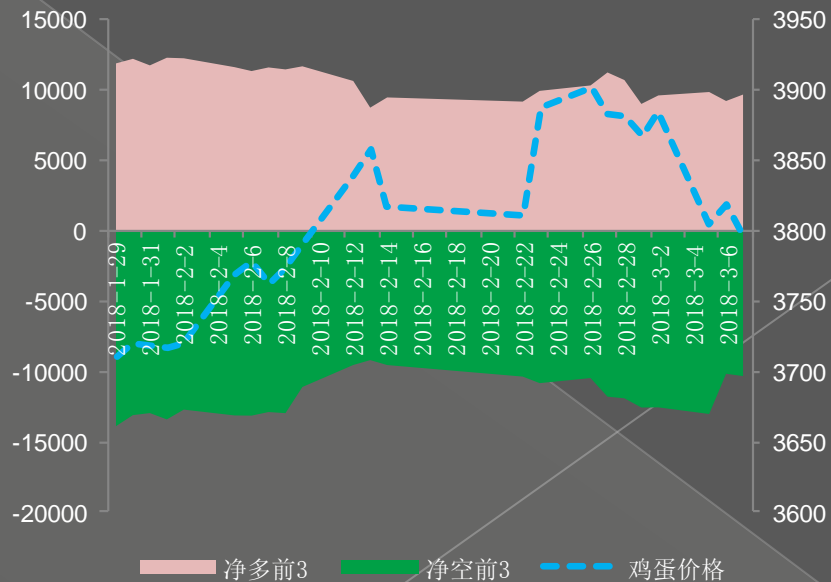


变动幅度		当日	最近5日	平均变化	波动率
rm持仓	多头前3	14.44%	-5.42%	-1.08%	16.52%
	空头前3	4.40%	13.62%	2.72%	
rm涨幅		-0.46%	2.24%	0.45%	
震荡幅度	1.48%	1.20%(月均值)	投机度	0.93	0.56(月均值)

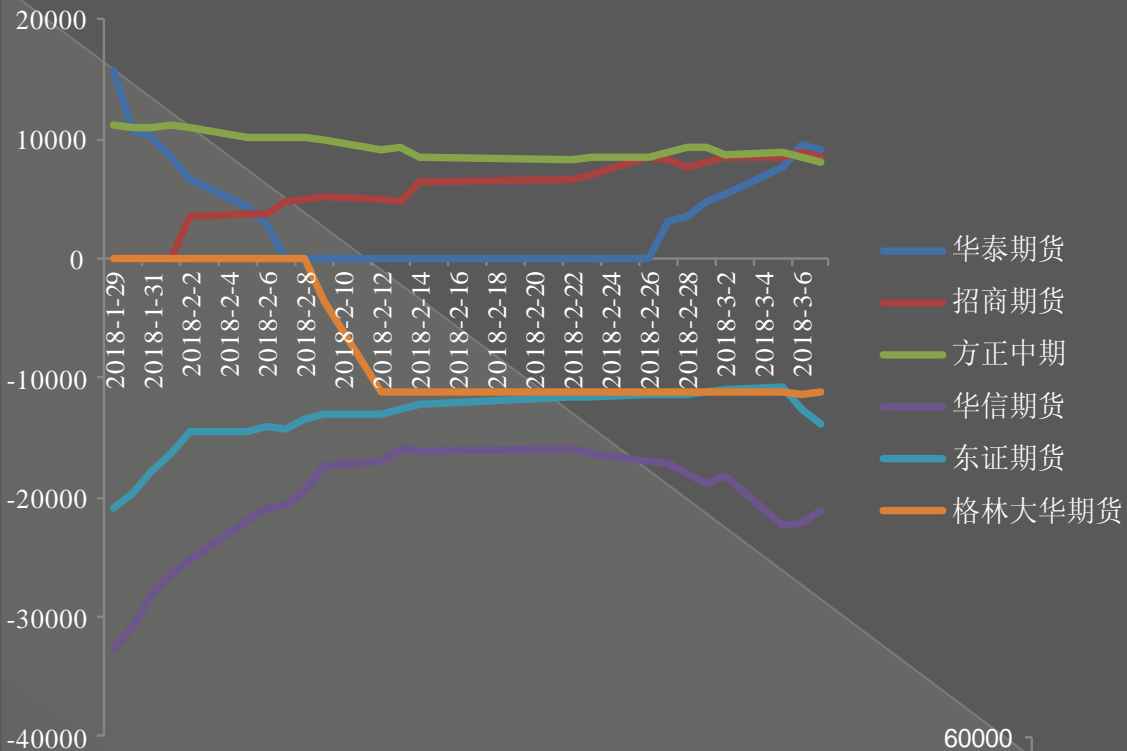


农产品：鸡蛋

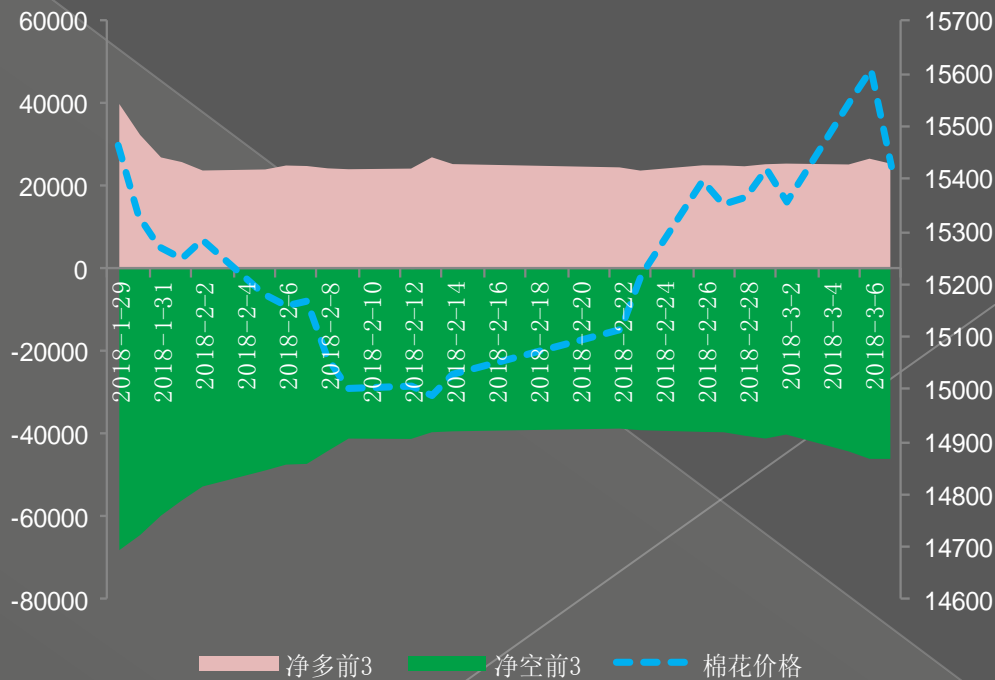
变动幅度		当日	最近5日	平均变化	波动率
jd持仓	多头前3	4.90%	-9.55%	-1.91%	13.19%
	空头前3	1.64%	-13.36%	-2.67%	
jd涨幅		-0.60%	-2.22%	-0.44%	
震荡幅度	1.26%	1.29%(月均值)	投机度	0.38	0.42(月均值)



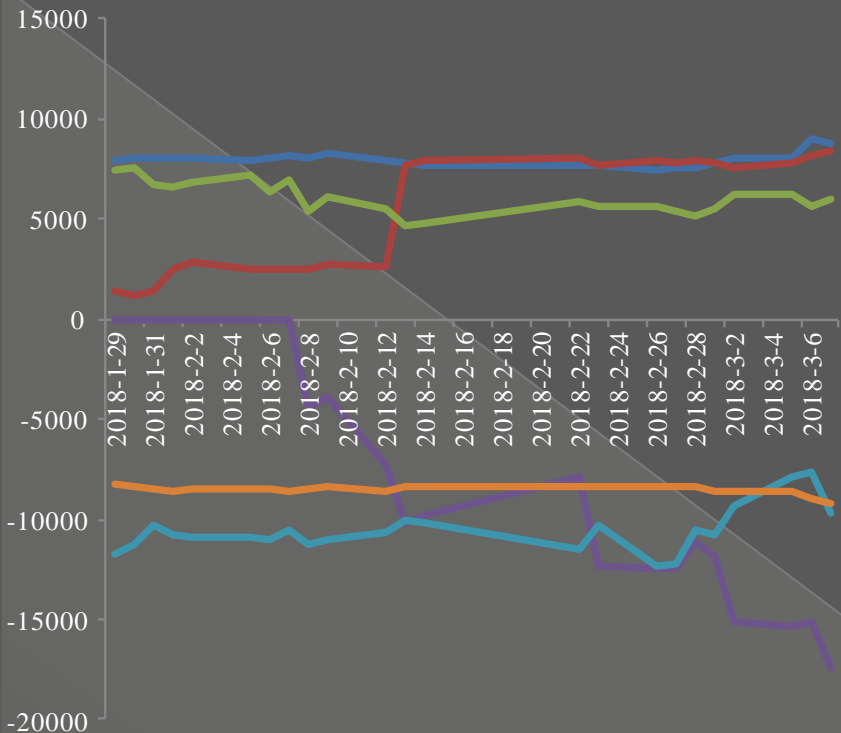
农产品：棉花



变动幅度		当日	最近5日	平均变化	波动率
cf持仓	多头前3	-4.46%	2.60%	0.52%	9.72%
	空头前3	0.04%	13.94%	2.79%	
cf涨幅		-1.19%	0.38%	0.08%	
震荡幅度	2.45%	0.91%(月均值)	投机度	0.53	0.35(月均值)

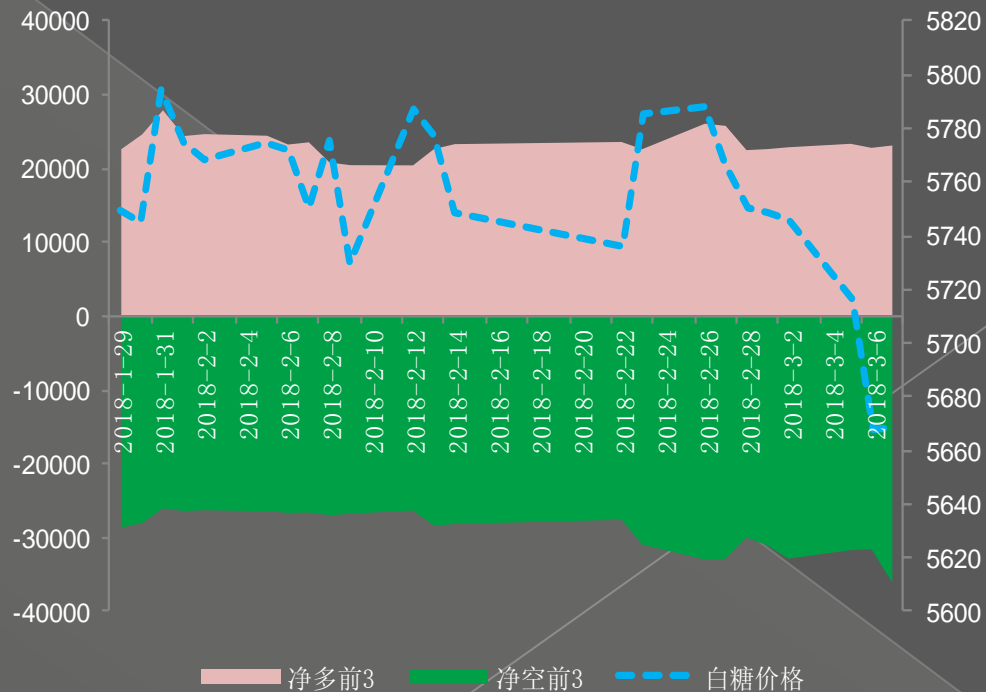


农产品：白糖



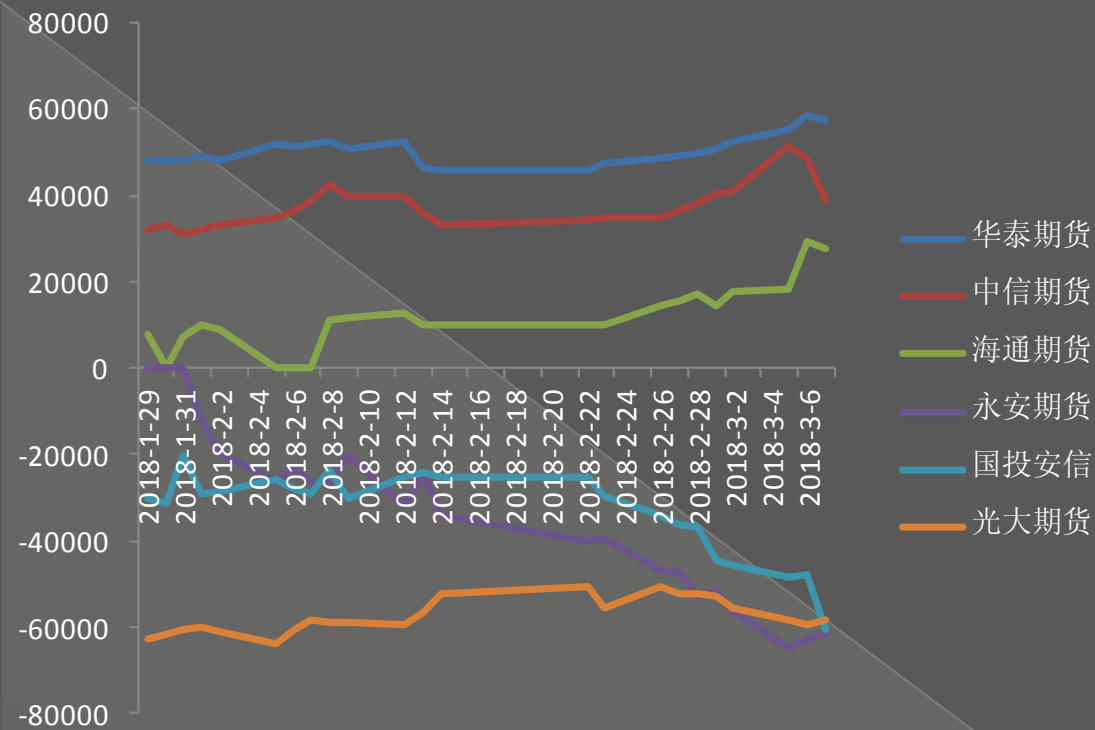
- 一德期货
- 混沌天成期货
- 宏源期货
- 中粮期货
- 中信期货
- 中金期货

变动幅度		当日	最近5日	平均变化	波动率
sr持仓	多头前3	1.41%	2.81%	0.56%	7.75%
	空头前3	14.22%	20.29%	4.06%	
sr涨幅		0.01%	-1.43%	-0.29%	
震荡幅度	0.79%	0.82% (月均值)	投机度	0.77	0.45 (月均值)

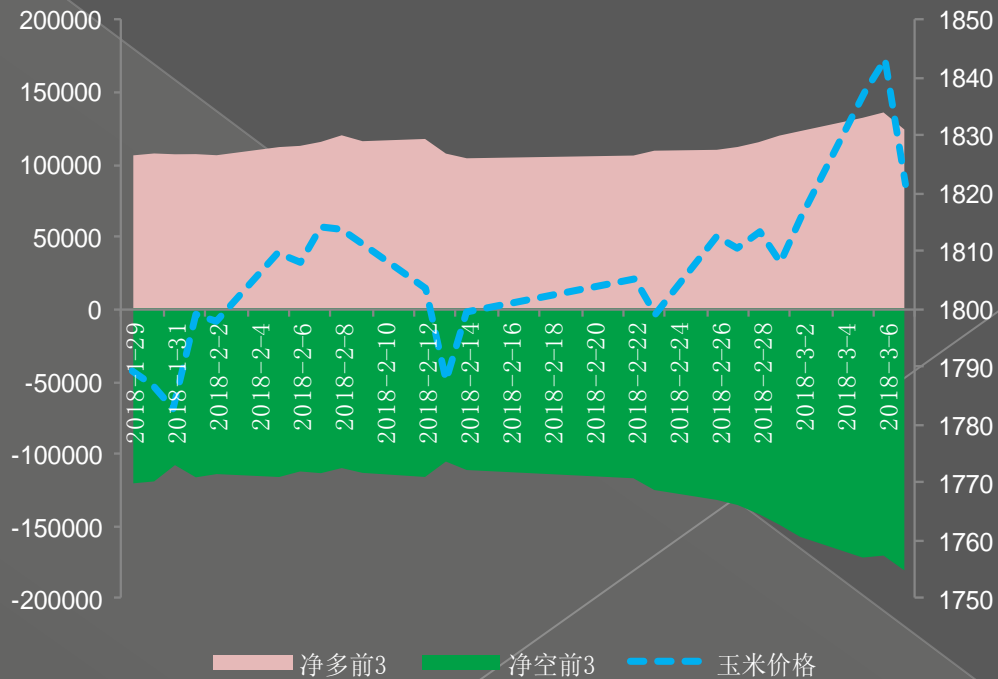


- 净多前3
- 净空前3
- 白糖价格

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	-8.68%	7.67%	1.53%	8.92%
	空头前3	6.00%	27.49%	5.50%	
c涨幅		-1.16%	0.47%	0.09%	
震荡幅度	1.34%	0.79%(月均值)	投机度	0.49	0.40(月均值)



部分机构资金变动表

制表日期：2018年3月7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	42.64	0.02%	-16534.45	-6.72%
南华期货	3350.99	4.43%	-1233.11	-1.54%
混沌天成	-236.74	-0.75%	-1625.42	-4.93%
海通期货	-22776.08	-15.93%	-3596.35	-2.90%
上海大陆	-1384.40	-100.00%	-1731.54	-100.00%
中信期货	-1087.61	-0.45%	-13499.38	-5.34%
新湖期货	-5946.12	-8.20%	-6655.71	-9.09%

中粮期货	10836.91	5.23%	-778.97	-0.36%
中信建投	-3180.80	-6.23%	-5739.53	-10.70%
申银万国	-3941.80	-10.62%	-5500.35	-14.23%
华泰期货	17183.09	14.09%	39574.17	39.74%
光大期货	-12842.79	-15.63%	16961.21	32.39%
一德期货	-2965.80	-3.19%	-12504.56	-12.19%
国投期货	-1706.65	-2.56%	8173.28	14.42%
金瑞期货	10290.58	10.72%	6870.72	6.91%
鲁证期货	46370.77	54.50%	24296.17	22.67%
中国国际	-2601.66	-3.93%	-3540.29	-5.27%

部分机构持仓一览

机构	永安期货					
日期	2018-2-28	2018-3-1	2018-3-2	2018-3-5	2018-3-6	2018-3-7
黄金	4106	3833	3962	4033	3925	3921
白银						
沪铜	19493	18076	20667	20116	20089	19872
沪铝	-5143			1693		646
沪镍	18645	11773	7035	5009	4685	
沪锌	-2848	-2812	-3395	-3590	-3917	-4313
沪铅						
螺纹钢	-21340			-27551		
铁矿石	-17605			-5510		5411
焦煤	-2403	-1052	-1164	-752		
焦炭	2888	3902	1820	1573	4754	3179
豆油	24639	21702	23792	25625	25773	22782
棕榈油	-6096	-5809	-5713	-6451	-6108	-7369
菜籽油	12573	12191	14115	13907	13001	12826
豆粕	85563	136962	162930	151401	152901	167453
菜籽粕	1977	4608	5911	4782	7963	10611
棉花	3695		3452			
白糖	-5977	-6231	-5513	-4150		
玉米	-52617	-52021	-56419	-64825	-62930	-61724
鸡蛋		-743	-710	-410		
PTA	27112	25122	25616			
聚乙烯		6109	8906	10067	13101	14398
聚丙烯	29122	21636	18007	21294	19750	22726
甲醇	23930	27173	23747	23270	19716	20497
玻璃						
橡胶	-21821	-21854	-22269	-21497	-22626	-23234
沥青	-9595	-6661	-6788	-4632	-4490	
动力煤	13933	19482	20584	24175	24475	24204

部分机构持仓一览

机构	南华期货					
日期	2018-2-28	2018-3-1	2018-3-2	2018-3-5	2018-3-6	2018-3-7
黄金	-1177	-1410	-1025	-871	-908	-797
白银				9031	8008	9376
沪铜	4321	4620	4411	4639	4600	4705
沪铝	-10692	-6628	-6802	-9536	-6803	-7537
沪镍						
沪锌	-3045		-2695			
沪铅	-686	-501		-781	-507	
螺纹钢	-25836				24868	-23151
铁矿石						
焦煤						
焦炭	-3108	-3092	-3691	-3543	-3383	-3409
豆油	13612	13038	7395	13065	13245	12022
棕榈油						
菜籽油						
豆粕						
菜籽粕	-7962					
棉花			3487			
白糖			4434	4322	4767	5262
玉米	-16684		-15676		-18281	
鸡蛋	2486	2673		2563	2425	
PTA		15168	16438			13706
聚乙烯	12620	12068	12181	12444	12867	16633
聚丙烯	-13641	-15172	-14795	-14276	-14970	-13783
甲醇	-4548	-4650		-2706		
玻璃	4844	4581				
橡胶	900	700	954	1303		1205
沥青						
动力煤	-4216	-4367	-4567			

部分机构持仓一览

机构	国泰君安					
日期	2018-2-28	2018-3-1	2018-3-2	2018-3-5	2018-3-6	2018-3-7
黄金			3205	3622	3650	3937
白银	-15001	-15737	-16487	-17375	-16050	-15506
沪铜	5331	5880	6186	6545	6409	4789
沪铝	11652	11440	11250	11016	12089	11682
沪镍						
沪锌	-2382	-2254				
沪铅						
螺纹钢	37950	15988			41908	42686
铁矿石	12087	8839	9487	27804	28803	11698
焦煤						
焦炭					-693	
豆油	1887	1960	3635	2464	1744	1288
棕榈油						
菜籽油	36281	36038	36295	36417	36524	35929
豆粕						
菜籽粕	11373	11257	10977	10183	10456	10490
棉花						
白糖	-7086	-7008	-6847	-6982	-7667	-8205
玉米						
鸡蛋	1711	1628	1460	1171	1080	
PTA	25916	14939	17422	19127	21952	
聚乙烯	-6936			-7217		-7070
聚丙烯	7362	6792	7418	7740	7048	7241
甲醇	-8687	-8463	-7668	-8849	-8286	-7888
玻璃						
橡胶	-3568	-3677	-3951		-4150	-4217
沥青						
动力煤				2034		

部分机构持仓一览

机构	混沌天成					
日期	2018-2-28	2018-3-1	2018-3-2	2018-3-5	2018-3-6	2018-3-7
黄金						
白银						
沪铜	-9534	-8456	-8524	-8532	-8442	-8424
沪铝						
沪镍	-7367	-7368	-7493	-7602	-9076	-8982
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	2018-2-28	2018-3-1	2018-3-2	2018-3-5	2018-3-6	2018-3-7
黄金	3497	3641	5228	4835	4641	3218
白银	12462	12255	12965	13198	13354	16081
沪铜	-12154	-12834	-13621	-14839	-14381	-15132
沪铝		-1967	-7636	-8422	-3974	-8572
沪镍	7361	8578	7070	7764	9152	8784
沪锌		3657	3793	3959	2426	
沪铅	1485	1456	1499	1523	1557	1568
螺纹钢			-7541		-13383	
铁矿石		-6290	-8461	-12482	-7316	-9071
焦煤			873	352		
焦炭	1694			1481	1516	557
豆油	8711		11915	9296	7470	
棕榈油	7866	8561	8451	8190	8242	7544
菜籽油	-5266	-5434		-5016	-5189	-5991
豆粕	35893	40051	42524	43200	40107	38676
菜籽粕	17304	9397	10645	10070	10083	8273
棉花	3441	3625		4340		
白糖	-4807	-4760	-5034	-6200	-3738	
玉米	17092	14300	18015	18198	29117	27948
鸡蛋	4001	1320	1697	1471	1652	1136
PTA	30117	28059	30652	29604	28613	20993
聚乙烯	-3955	7011	4637		-4155	
聚丙烯	-8909		8398	6225	15269	14124
甲醇	-9664	-11679	-3320		-5003	1293
玻璃	-5641	-5784				
橡胶						
沥青	3665	3257	3437			
动力煤	-3701				-4216	-3579

部分机构持仓一览

机构	上海大陆					
日期	2018-2-28	2018-3-1	2018-3-2	2018-3-5	2018-3-6	2018-3-7
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						
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	-6179	-5958	-5582	-4977	-5055	
动力煤						

部分机构持仓一览

机构	中粮期货					
日期	2018-2-28	2018-3-1	2018-3-2	2018-3-5	2018-3-6	2018-3-7
黄金						
白银	7664	7751	7685	7946		7978
沪铜	-10488	-11051	-11943	-12143	-10969	-10008
沪铝	-4756	-4945	-5676	-4948	-6552	-6041
沪镍	6483	6809	6586	6727	6527	6839
沪锌	-7475	-7239	-4255	-3594	-3634	-3769
沪铅						
螺纹钢						
铁矿石						
焦煤						
焦炭	-2777	-2664	-2613			2479
豆油	-68675	-68314	-64566	-63555	-60294	-59177
棕榈油	-17855	-19154	-26216	-27318	-28863	-28115
菜籽油	-9922	-9809	-14345	-17819	-18513	-21637
豆粕	-181687	-162549	-161098	-155492	-140455	-143857
菜籽粕	-42008	-42328	-52794	-51735	-53083	-57022
棉花	-10578	-10587	-10331	-10495	-10428	-9667
白糖	-11151	-11844	-15094	-15360	-15128	-17365
玉米	-19077	-15804	-18228	-27234	-31313	-32809
鸡蛋	2756	2570	2622	2661	2699	2645
PTA						
聚乙烯						
聚丙烯						
甲醇	-6029	-5864				-5478
玻璃	-6900	-6859	-6670	-6256	-6489	-4686
橡胶	-6723	-6761	-6936	-6926	-6900	-7225
沥青						
动力煤	-3652	-4569	-4871	-5079	-5428	-5543

部分机构持仓一览

机构	中信期货					
日期	2018-2-28	2018-3-1	2018-3-2	2018-3-5	2018-3-6	2018-3-7
黄金	7475	7378	7885	6508	6451	7195
白银	-36011	-35135	-32372	-32256	-39854	-30306
沪铜	-21681	-21867	-22697	-25025	-23878	-23688
沪铝	-28343	-29106	-29615	-29049	-27797	-27260
沪镍						
沪锌	-5509	-6295	-6612	-7959	-6372	-3379
沪铅	-2643	-2724	-2996	-2875	-2874	-3273
螺纹钢	22949		13087			
铁矿石	-12988	-11517	-18017	-12222	-14946	-19043
焦煤	6971	6744	6924	6366	6645	6472
焦炭	-6425	-5828	-4817	-3612		
豆油	-8441	-9844	-7888	-9289	-9788	-8666
棕榈油	-11543	-10071	-11400	-11299	-10332	-11337
菜籽油	-12245	-12617	-12626	-11272	-10532	-12330
豆粕	88652	89930	88619	86230	83884	95512
菜籽粕	16827	17357	18662	15888	15364	21356
棉花	3341	3594	4130	4855	4008	4170
白糖	-10584	-10725	-9260	-7876	-7662	-9675
玉米	38260	40241	40849	51352	48654	38878
鸡蛋					-145	
PTA	22970	22342	24016	37784	35919	32374
聚乙烯	-4876		-4216	-5059	-6815	-6557
聚丙烯	8790	9696	10497	9546	8789	8258
甲醇	-5559	-8258	-6701	-6286	-6700	-7236
玻璃	12553	12565	12800	12225	11258	11531
橡胶						
沥青				3004		-3869
动力煤						

部分机构持仓一览

机构	中信建投					
日期	2018-2-28	2018-3-1	2018-3-2	2018-3-5	2018-3-6	2018-3-7
黄金						
白银	7439					
沪铜						
沪铝						
沪镍	9407	8729	8235	8168	8124	7939
沪锌	2602					
沪铅						
螺纹钢						
铁矿石	15565		-15986			
焦煤						
焦炭	4871	3195	5823	4277	2739	976
豆油						
棕榈油	9074	4121	-8993	-8975	-8896	-10412
菜籽油						
豆粕	34132	35214	42957	44625	50988	51175
菜籽粕						
棉花					7870	7342
白糖						
玉米					13516	13353
鸡蛋	-640	-775	-735			
PTA						
聚乙烯						
聚丙烯						
甲醇						
玻璃	-5146	-5056	-5598	-5422	-5171	-4540
橡胶						
沥青						5010
动力煤			-3446			

部分机构持仓一览

机构	新湖期货					
日期	2018-2-28	2018-3-1	2018-3-2	2018-3-5	2018-3-6	2018-3-7
黄金		-653	-694	-1078	-1108	-998
白银						
沪铜	-4632	-4767	3648	4266	6451	6322
沪铝						
沪镍		-7168	-7009	-7036	-7095	
沪锌						
沪铅						
螺纹钢	35201	27606				
铁矿石						
焦煤						
焦炭						
豆油	-7737		-7430	-7604	-7172	
棕榈油	5687	6090	7716	8048	8760	8738
菜籽油	-5383	-5188	-5431	-5433	-5608	-5321
豆粕	-63770	-64992	-72626	-54273	-51705	-87045
菜籽粕						
棉花	3442	3340	3525		3706	
白糖						
玉米	27190	29038	29696	21439	19930	27651
鸡蛋					-270	-326
PTA	-22664	-22233	-23666	-24728	-25003	-25348
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

