



# 市场持仓分析

2018/7/25

## 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
沪镍	18.88%	20.08%	15.57%	-11.64%	-5.08%	3.66%	30.52%	☆☆☆☆
焦煤	0.47%	4.28%	-3.10%	-26.64%	-25.67%	-17.31%	27.11%	☆☆☆☆
橡胶	16.03%	6.46%	-4.25%	-8.88%	-6.60%	-9.91%	24.92%	☆☆☆☆
鸡蛋	9.82%	8.44%	3.15%	-8.26%	-8.46%	-4.43%	18.08%	☆☆☆
沥青	9.84%	9.27%	8.50%	-3.33%	-2.49%	-0.73%	13.17%	☆☆☆
沪锌	-2.45%	4.32%	4.53%	-9.42%	-9.31%	3.18%	6.98%	☆☆
沪铜	-1.90%	0.60%	0.50%	-7.98%	-5.43%	-2.10%	6.09%	☆☆
棉花	4.55%	5.83%	12.62%	0.57%	1.99%	3.08%	3.98%	☆
豆油	1.13%	-0.04%	-8.77%	-1.93%	-2.27%	-1.33%	3.07%	☆
豆粕	3.17%	0.71%	-0.66%	0.29%	0.70%	1.04%	2.87%	☆
玻璃	-2.45%	-4.53%	-5.95%	-4.63%	-5.46%	-4.76%	2.18%	☆
玉米	-3.51%	-2.73%	-4.85%	-5.06%	-5.14%	-5.13%	1.55%	☆
动力煤	5.58%	0.49%	0.94%	4.12%	5.17%	5.08%	1.46%	☆
PTA	4.91%	2.68%	-2.89%	5.30%	3.16%	0.71%	-0.39%	☆
菜籽粕	0.54%	0.15%	4.60%	1.03%	0.31%	4.12%	-0.48%	☆
白糖	1.77%	3.40%	1.14%	2.81%	-0.20%	0.25%	-1.04%	☆
沪铝	-3.33%	-3.31%	-0.64%	-1.60%	-1.84%	-7.39%	-1.73%	☆
聚乙烯	-1.19%	-3.96%	-4.14%	1.00%	-0.65%	0.42%	-2.19%	☆
螺纹钢	-0.73%	-1.49%	-1.22%	3.42%	6.07%	3.85%	-4.15%	☆
苹果	-1.46%	0.31%	-2.88%	3.65%	3.34%	2.05%	-5.10%	☆☆
聚丙烯	0.90%	-1.43%	-3.11%	8.36%	8.86%	5.16%	-7.46%	☆☆
棕榈油	-7.24%	-7.01%	-11.73%	2.00%	3.03%	1.62%	-9.24%	☆☆
沪银	-13.84%	-11.61%	-5.64%	-3.76%	-3.18%	-3.53%	-10.09%	☆☆☆
焦炭	0.96%	2.77%	7.52%	12.71%	14.53%	18.50%	-11.75%	☆☆☆
铁矿石	-13.58%	-13.71%	-15.98%	0.30%	2.31%	-2.18%	-13.88%	☆☆☆
甲醇	-20.73%	-17.51%	-9.81%	1.14%	10.72%	37.32%	-21.87%	☆☆☆☆

## 近5日持仓变化

品种	五日变化						近五日头寸变化参考	
	多头前3	多头前5	多头前10	空头前3	空头前5	空头前10	多头前3-空头前3	指标参考
焦炭	65.18%	54.54%	38.41%	-21.41%	-21.26%	-17.90%	86.59%	☆☆☆☆☆
苹果	9.41%	8.18%	0.14%	-63.75%	-60.83%	-57.59%	73.15%	☆☆☆☆
鸡蛋	20.62%	13.17%	9.52%	-17.47%	-15.79%	-10.77%	38.08%	☆☆☆
橡胶	30.80%	21.53%	8.34%	-1.55%	0.40%	-3.57%	32.35%	☆☆☆
铁矿石	10.29%	-1.20%	-8.80%	-5.03%	-0.51%	-6.99%	15.32%	☆☆
沪镍	-4.27%	-12.55%	-14.97%	-18.26%	-7.92%	-0.13%	13.99%	☆☆
聚乙烯	7.72%	4.07%	1.18%	-5.43%	-0.92%	9.51%	13.14%	☆☆
豆粕	0.95%	0.38%	-8.39%	-11.26%	-8.50%	-6.81%	12.20%	☆☆
动力煤	14.87%	8.45%	4.66%	7.00%	5.86%	16.09%	7.87%	☆
玉米	-18.68%	-18.71%	-20.29%	-25.93%	-24.08%	-25.98%	7.26%	☆
甲醇	10.80%	7.16%	10.23%	7.94%	11.99%	50.43%	2.86%	☆
棉花	-2.21%	2.08%	14.56%	-3.69%	-1.31%	0.23%	1.48%	☆
沪铜	-8.38%	-6.84%	-7.19%	-9.57%	-10.40%	-13.96%	1.19%	☆
白糖	-0.76%	2.15%	8.63%	-1.51%	-4.24%	-3.12%	0.75%	☆
聚丙烯	9.46%	0.37%	-0.57%	11.65%	17.30%	17.61%	-2.19%	☆
菜籽粕	1.87%	3.24%	17.71%	4.55%	3.90%	3.38%	-2.68%	☆
玻璃	-3.57%	-9.24%	-11.57%	0.46%	1.36%	2.78%	-4.03%	☆
豆油	-15.63%	-16.92%	-16.87%	-10.44%	-7.03%	-6.42%	-5.19%	☆
沪锌	1.66%	4.51%	4.85%	9.19%	4.84%	-0.36%	-7.53%	☆
沪铝	-10.67%	-10.58%	-11.55%	-2.77%	-0.29%	1.04%	-7.90%	☆
沪银	-14.24%	-15.91%	-12.71%	-3.78%	-2.64%	-6.62%	-10.46%	☆☆
螺纹钢	-10.02%	-5.67%	-4.87%	0.50%	4.95%	-0.68%	-10.52%	☆☆
棕榈油	-5.51%	-8.09%	-11.65%	11.98%	2.25%	-2.79%	-17.50%	☆☆
焦煤	-42.74%	-36.80%	-29.63%	-21.78%	-27.37%	-24.81%	-20.96%	☆☆
沪金	-10.37%	-2.07%	4.22%	17.42%	27.50%	76.78%	-27.80%	☆☆
PTA	17.01%	13.43%	12.55%	46.99%	49.41%	42.74%	-29.98%	☆☆

# 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= $[(\text{今日净多前3持仓量}/\text{昨日净多前3持仓量})-1]*100\%$ ，对于近五日持仓汇总，净多前3变化幅度= $[(\text{今日净多前3持仓量}/\text{前五日净多前3持仓量})-1]*100\%$ ，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 $\geq$ 50%	20% $\leq$ 绝对值 $<$ 50%	10% $\leq$ 绝对值 $<$ 20%	5% $\leq$ 绝对值 $<$ 10%	绝对值 $<$ 5%
☆☆☆☆☆	☆☆☆☆	☆☆☆	☆☆	☆

## 2018年7月25日机构持仓异动表

## 金属

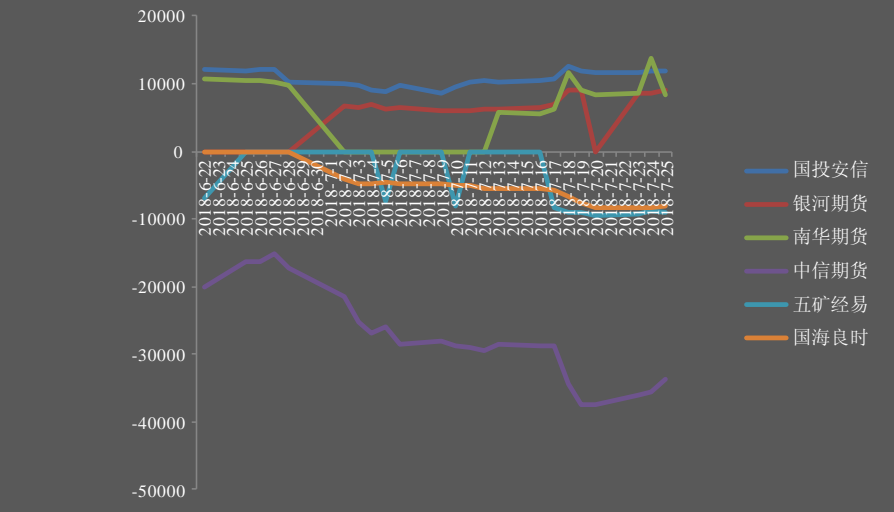
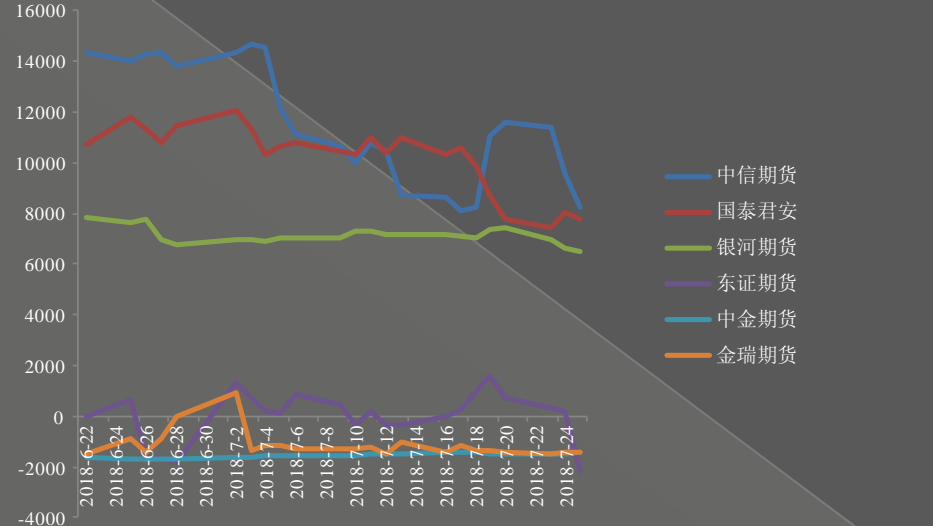
东证期货	黄金净空单变动幅度为：2345手
南华期货	白银净多单变动幅度为：-5189手
南华期货	白银净多单变动幅度为：-5189手
海通期货	沪铝净空单变动幅度为：-8751手
华泰期货	沪镍净多单变动幅度为：1743手
中信期货	沪铅净多单变动幅度为：-1171手
永安期货	沪铅净多单变动幅度为：977手
南华期货	沪铅净空单变动幅度为：901手

## 黑色

光大期货	螺纹钢净空单变动幅度为：21426手
国泰君安	铁矿石净多单变动幅度为：-8030手
申银万国	铁矿石净多单变动幅度为：-7758手
银河期货	铁矿石净多单变动幅度为：3083手
永安期货	焦煤净多单变动幅度为：-3265手
中国国际	焦煤净空单变动幅度为：-4199手
国贸期货	焦煤净多单变动幅度为：643手
方正中期	焦煤净空单变动幅度为：2687手
东证期货	焦炭净空单变动幅度为：3255手

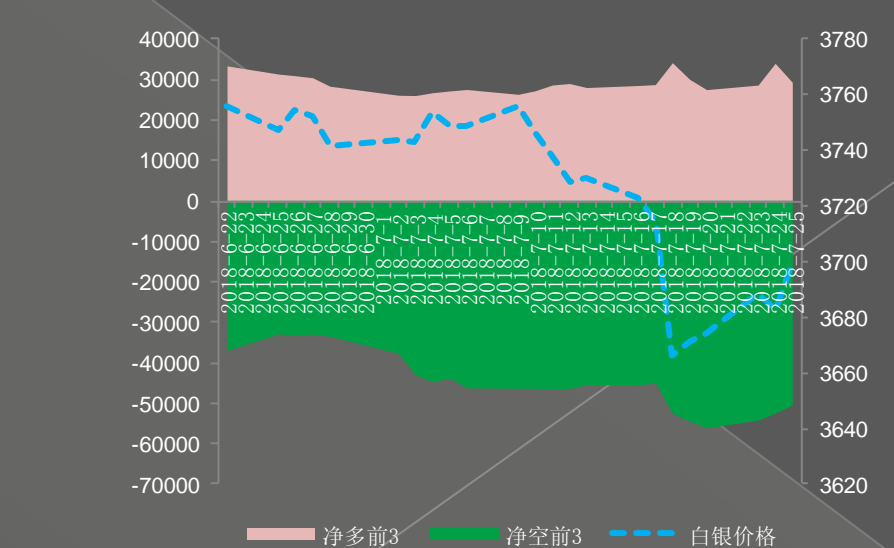
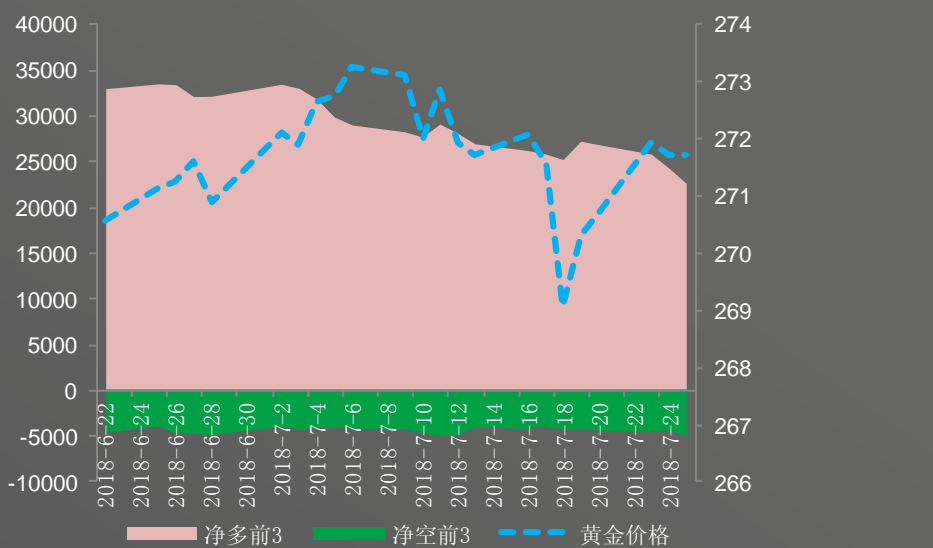


# 金属板块：AU & AG

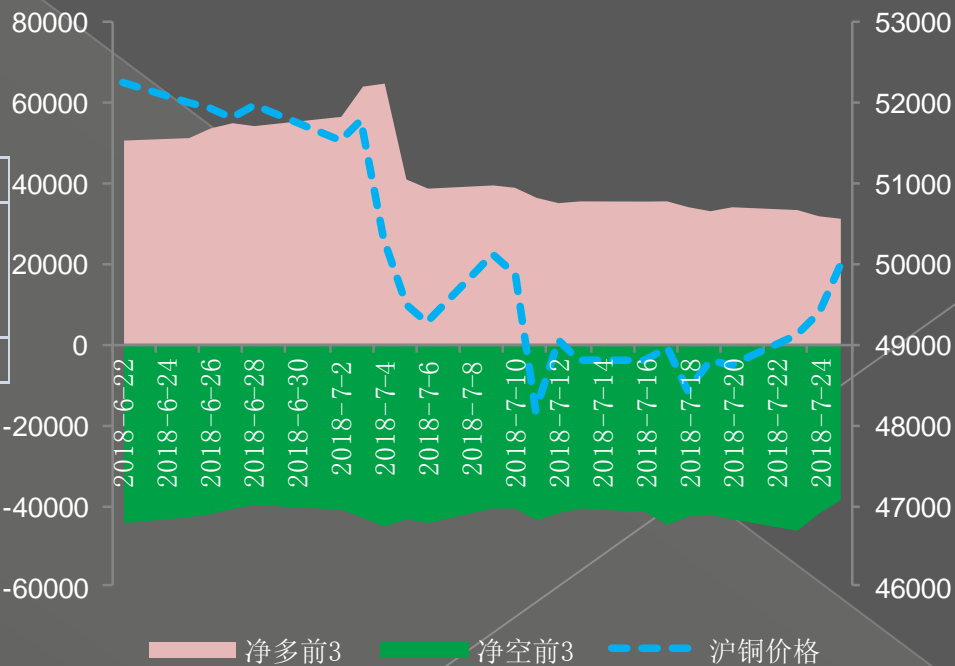
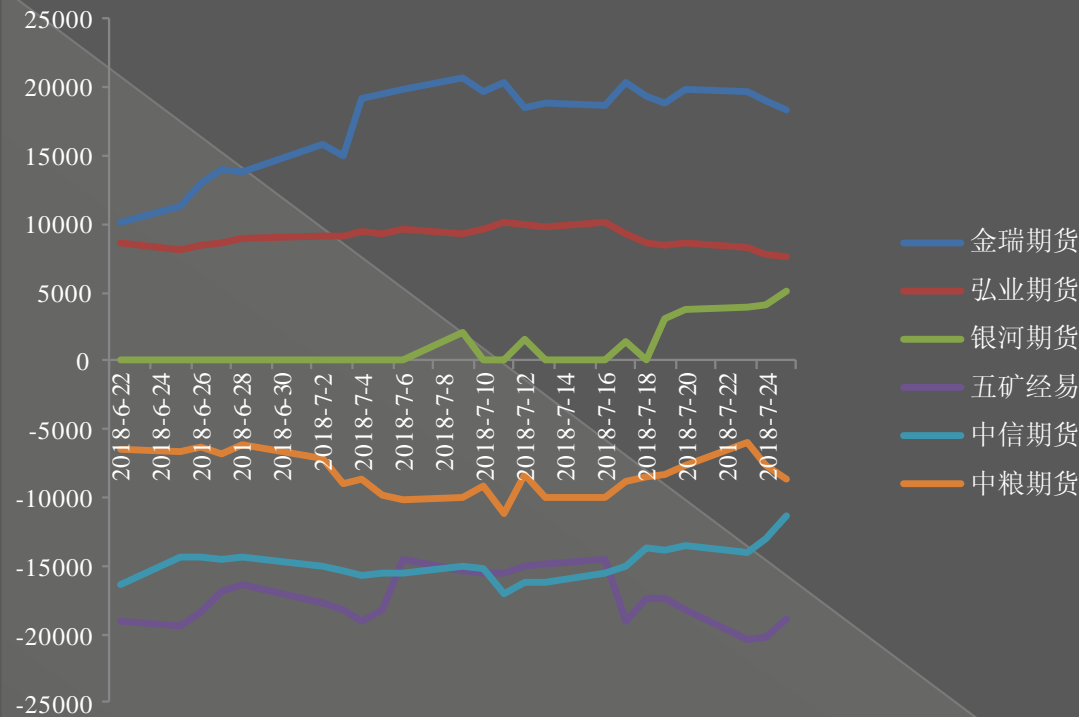


变动幅度		当日	最近5日	平均变化	波动率
au持仓	多头前3	-7.02%	-10.37%	-2.07%	5.31%
	空头前3	15.10%	17.42%	3.48%	
au涨幅		0.00%	0.99%	0.20%	
震荡幅度	0.26%	0.45%(月均值)	投机度	0.22	0.30(月均值)

变动幅度		当日	最近5日	平均变化	波动率
ag持仓	多头前3	-13.84%	-14.24%	-2.85%	5.68%
	空头前3	-3.76%	-3.78%	-0.76%	
ag涨幅		0.46%	0.91%	0.18%	
震荡幅度	0.38%	0.61%(月均值)	投机度	0.34	0.41(月均值)



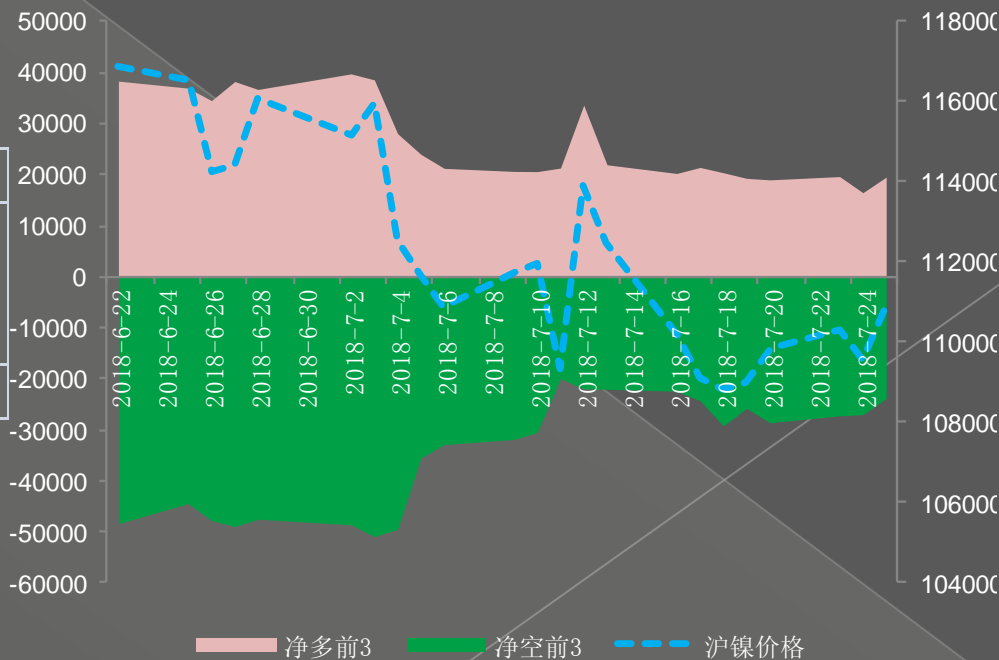
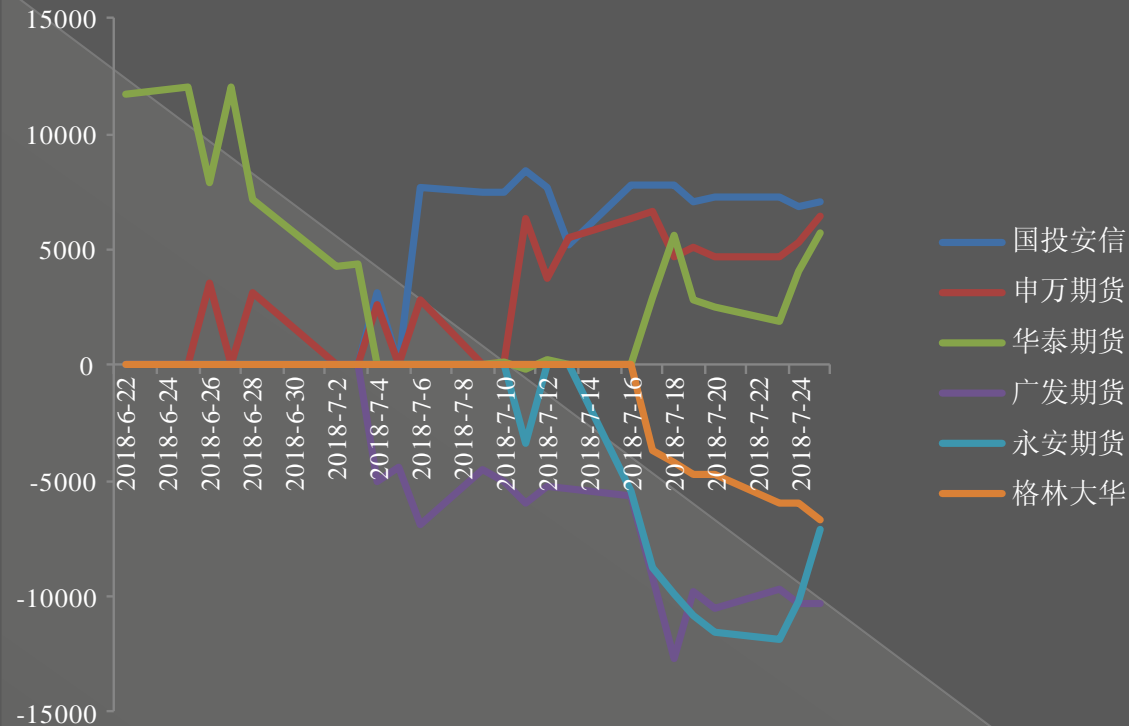
# 金属板块：Cu



变动幅度		当日	最近5日	平均变化	波动率
cu持仓	多头前3	-1.90%	-8.38%	-1.68%	27.72%
	空头前3	-7.98%	-9.57%	-1.91%	
cu涨幅		1.17%	3.17%	0.63%	
震荡幅度	1.18%	1.58%(月均值)	投机度	0.99	0.82(月均值)

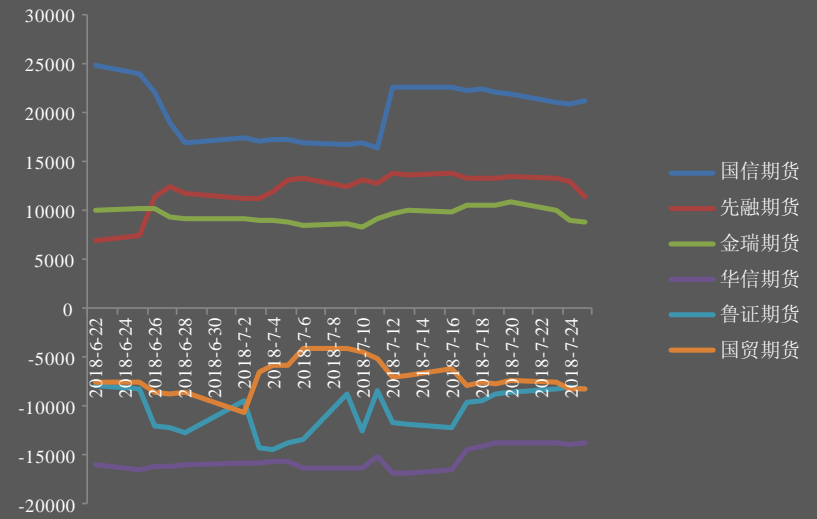
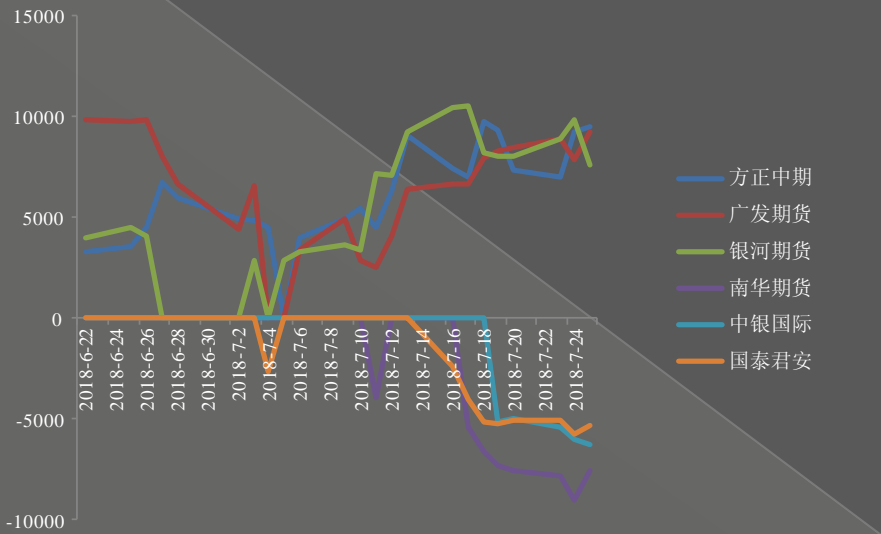


# 金属板块：Ni



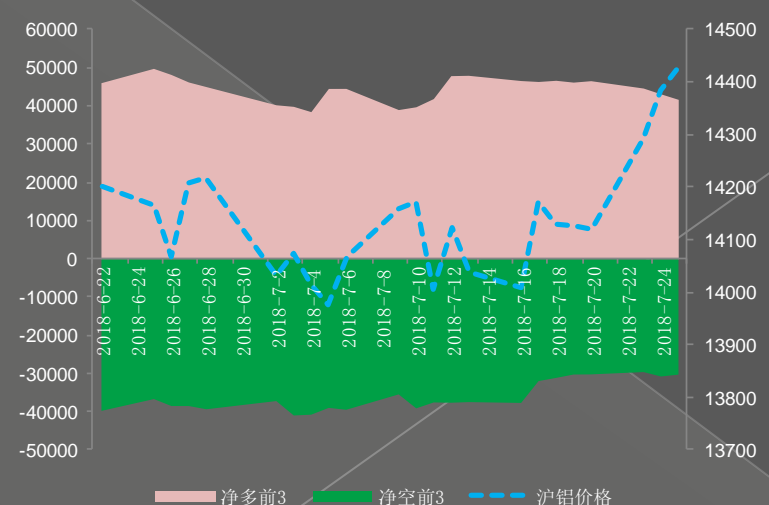
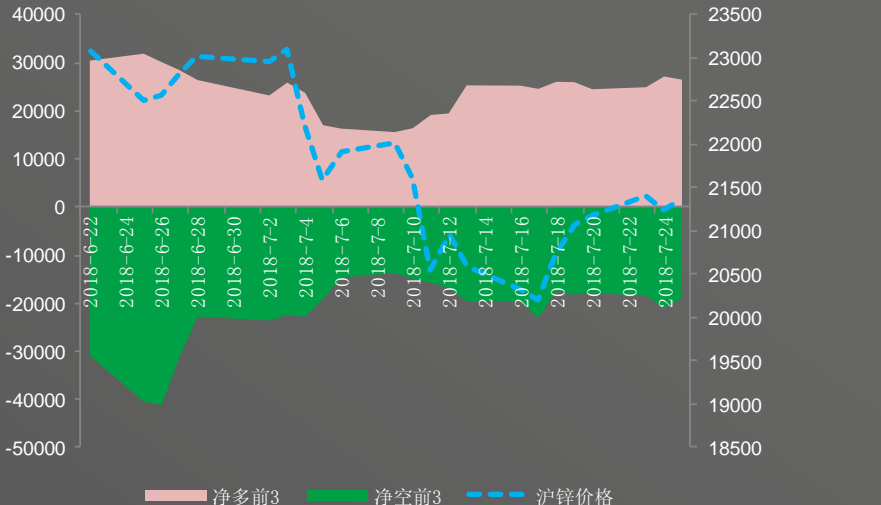
变动幅度		当日	最近5日	平均变化	波动率
ni持仓	多头前3	18.88%	-4.27%	-0.85%	25.56%
	空头前3	-11.64%	-18.26%	-3.65%	
ni涨幅		1.23%	1.87%	0.37%	
震荡幅度	1.47%	2.22%(月均值)	投机度	2.03	1.86(月均值)

# 金属板块：Zn & Al

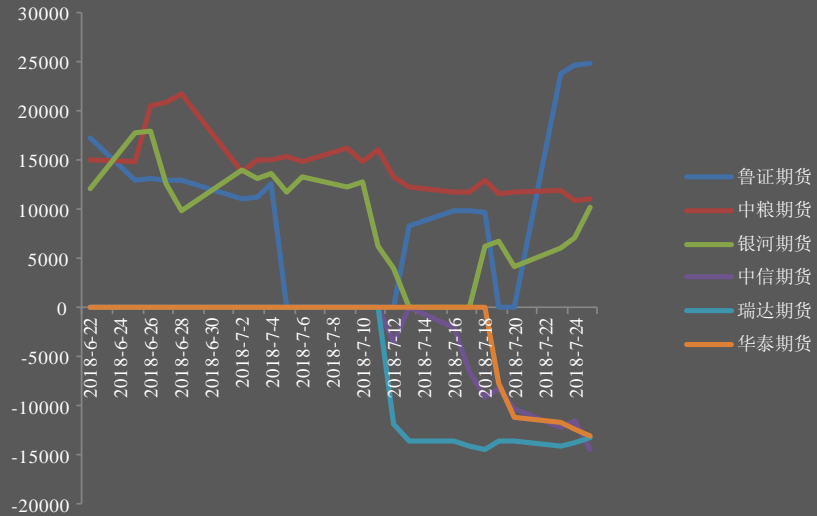
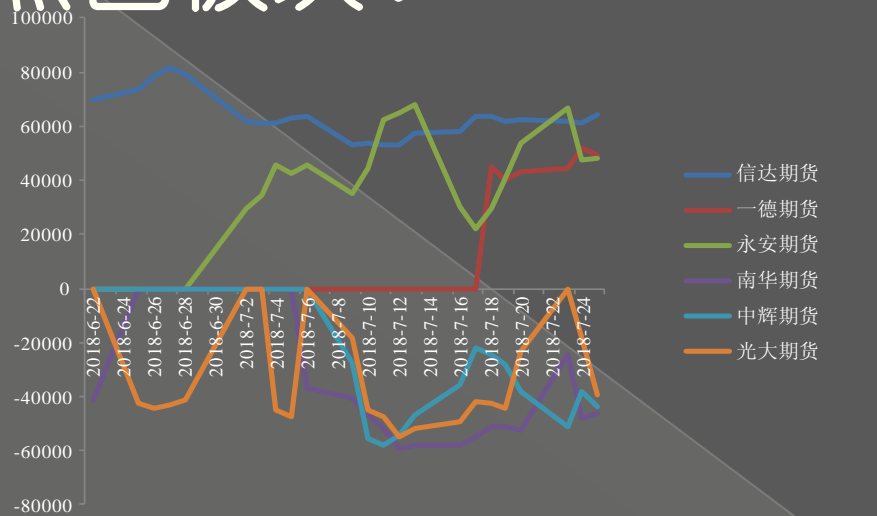


变动幅度		当日	最近5日	平均变化	波动率
zn持仓	多头前3	-2.45%	1.66%	0.33%	50.70%
	空头前3	-9.42%	9.19%	1.84%	
zn涨幅		0.57%	3.11%	0.62%	
震荡幅度	1.73%	2.44%(月均值)	投机度	1.70	2.03(月均值)

变动幅度		当日	最近5日	平均变化	波动率
al持仓	多头前3	-3.33%	-10.67%	-2.13%	20.09%
	空头前3	-1.60%	-2.77%	-0.55%	
al涨幅		0.29%	2.09%	0.42%	
震荡幅度	0.80%	1.07%(月均值)	投机度	0.50	0.47(月均值)

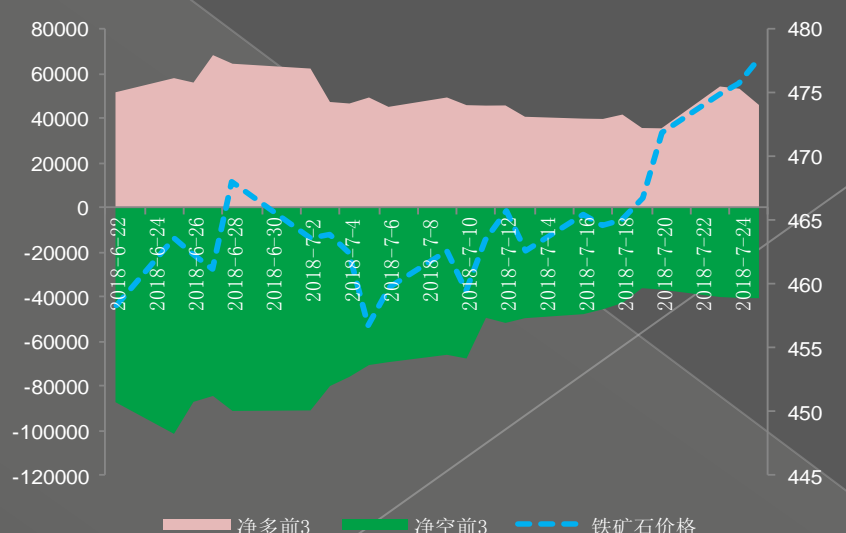
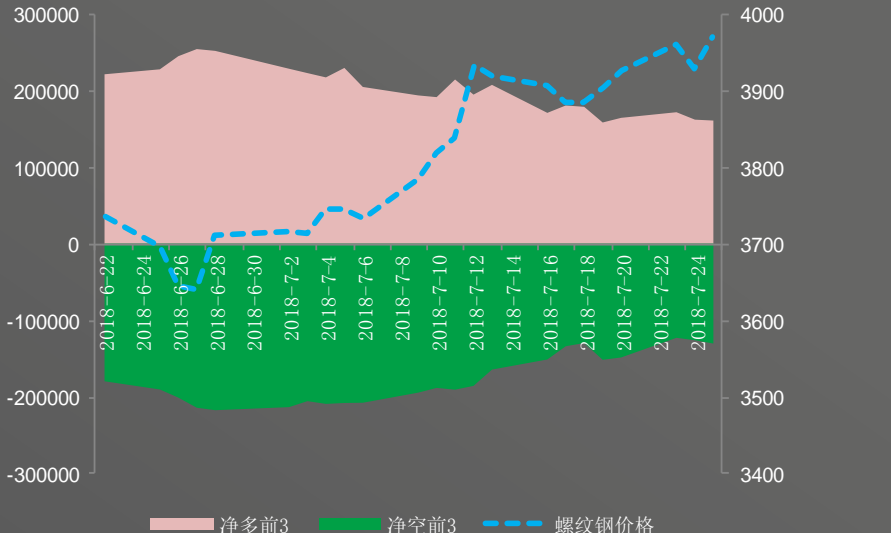


# 黑色板块：Rb & I

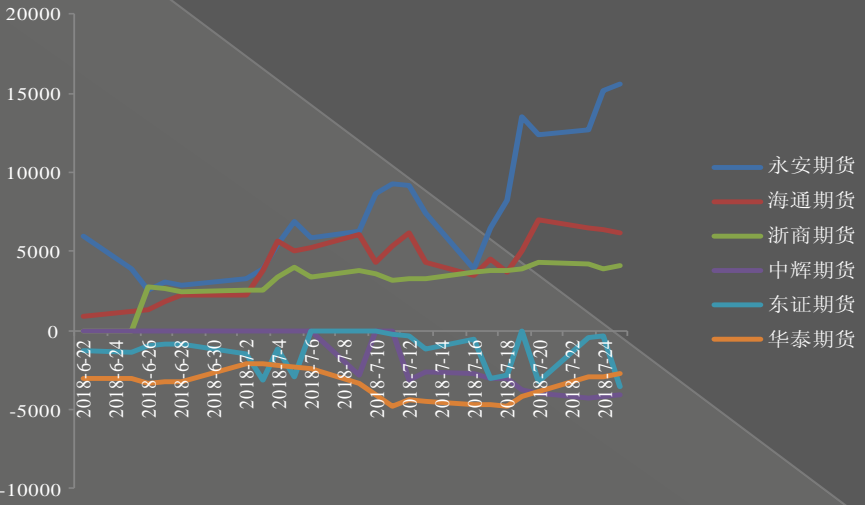


变动幅度		当日	最近5日	平均变化	波动率
rb持仓	多头前3	-0.73%	-10.02%	-2.00%	34.64%
	空头前3	3.42%	0.50%	0.10%	
rb涨幅		1.09%	2.22%	0.44%	
震荡幅度	1.52%	1.66%(月均值)	投机度	0.89	1.03(月均值)

变动幅度		当日	最近5日	平均变化	波动率
I持仓	多头前3	-13.58%	10.29%	2.06%	14.47%
	空头前3	0.30%	-5.03%	-1.01%	
I涨幅		0.38%	2.69%	0.54%	
震荡幅度	1.12%	1.71%(月均值)	投机度	0.81	0.96(月均值)

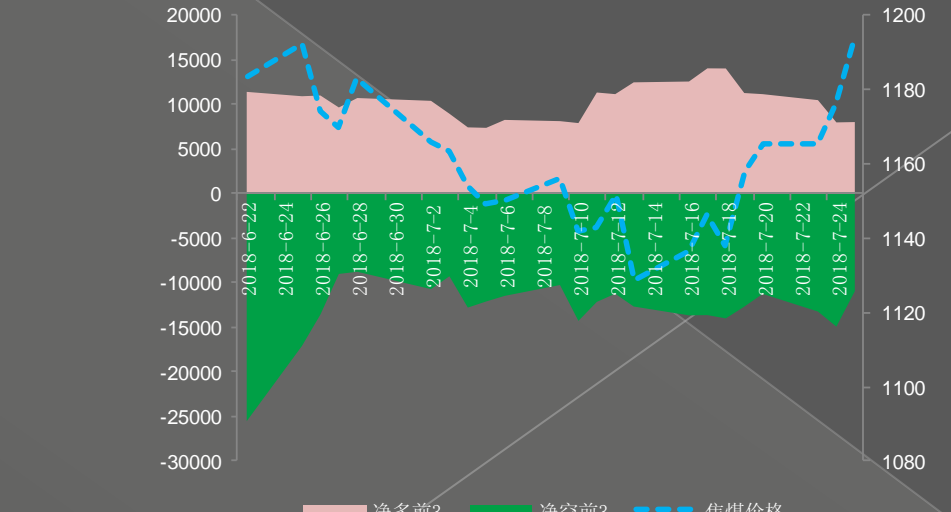
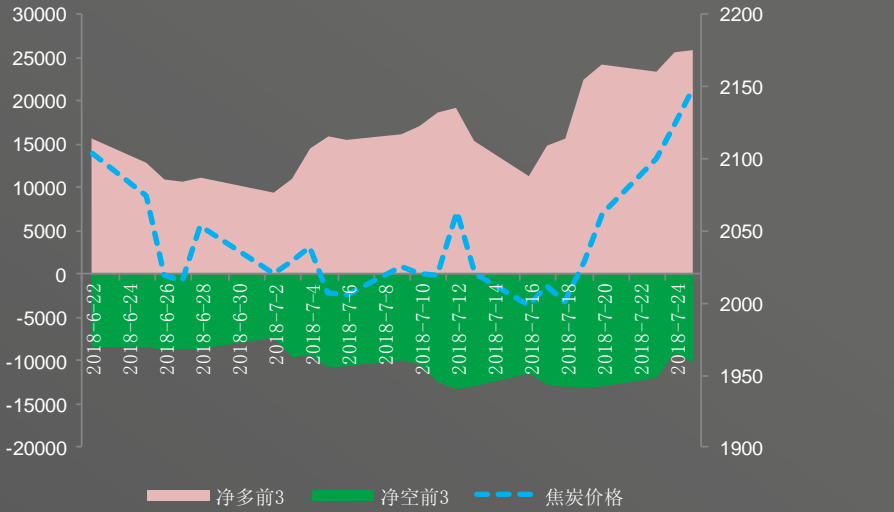


# 黑色板块：J & JM

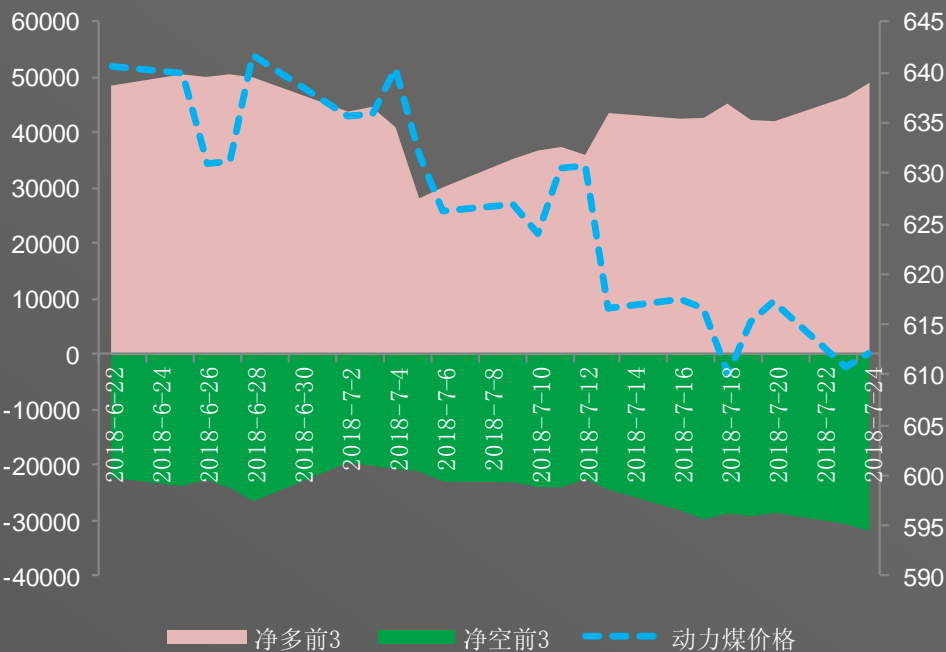
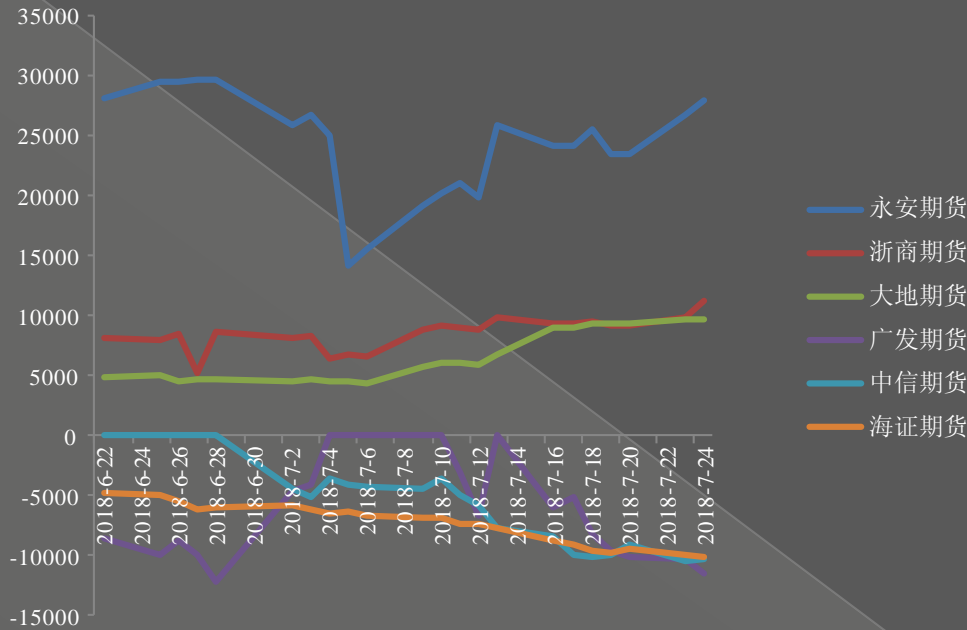


变动幅度		当日	最近5日	平均变化	波动率
j持仓	多头前3	0.96%	65.18%	13.04%	27.05%
	空头前3	12.71%	-21.41%	-4.28%	
j涨幅		1.16%	7.36%	1.47%	
震荡幅度	1.66%	2.55%(月均值)	投机度	1.09	1.40(月均值)

变动幅度		当日	最近5日	平均变化	波动率
jm持仓	多头前3	0.47%	-42.74%	-8.55%	26.16%
	空头前3	-26.64%	-21.78%	-4.36%	
jm涨幅		1.50%	4.89%	0.98%	
震荡幅度	2.49%	2.15%(月均值)	投机度	1.46	1.15(月均值)

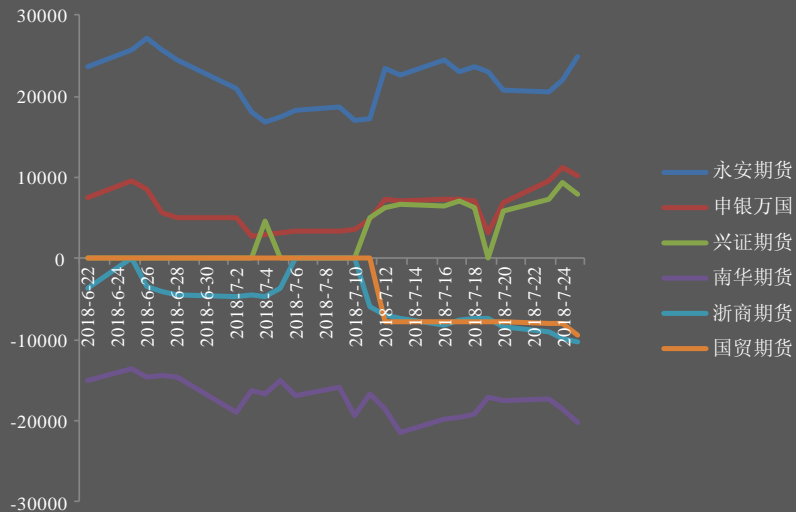
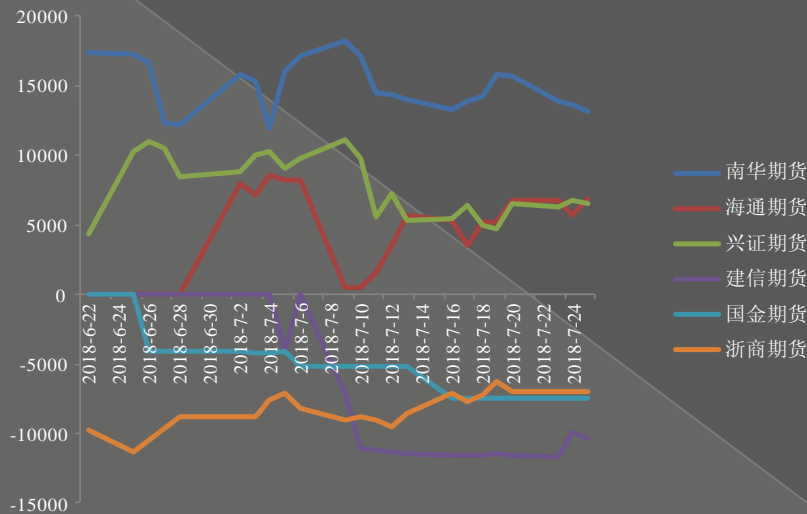


# 黑色：动力煤



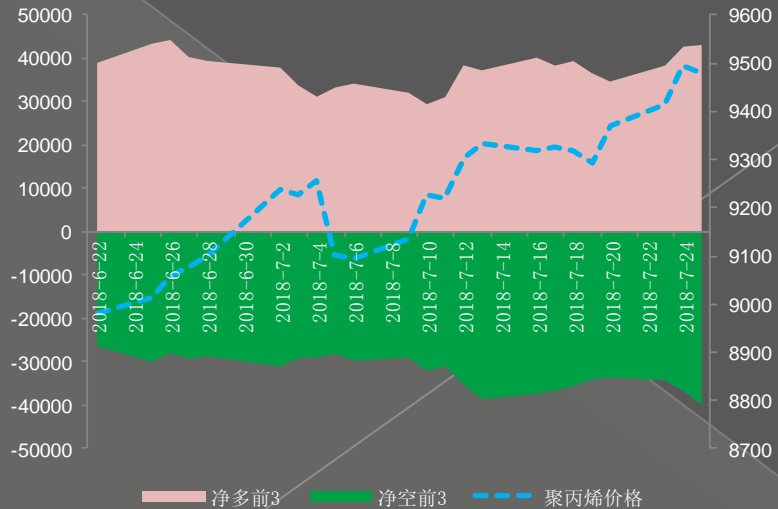
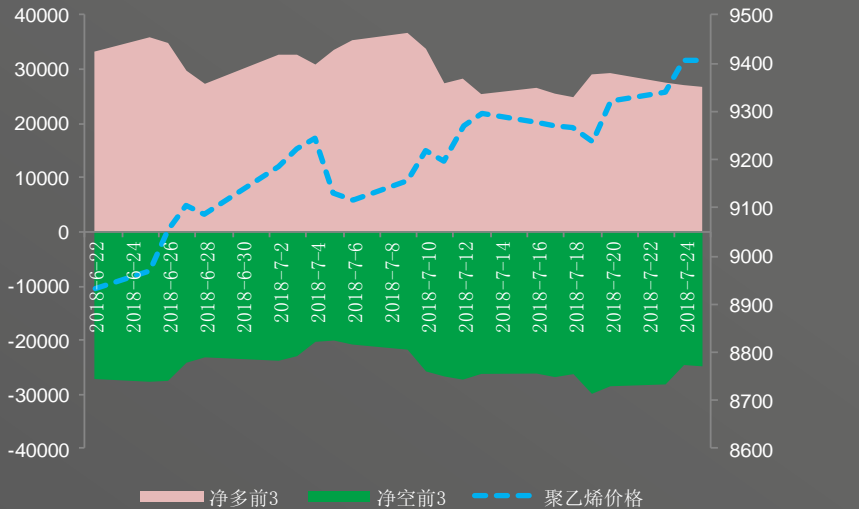
变动幅度		当日	最近5日	平均变化	波动率
zc持仓	多头前3	5.58%	14.87%	2.97%	15.10%
	空头前3	4.12%	7.00%	1.40%	
zc涨幅		0.22%	-0.73%	-0.15%	
震荡幅度	1.01%	1.34% (月均值)	投机度	0.73	0.94 (月均值)

# 化工：塑料 & PP

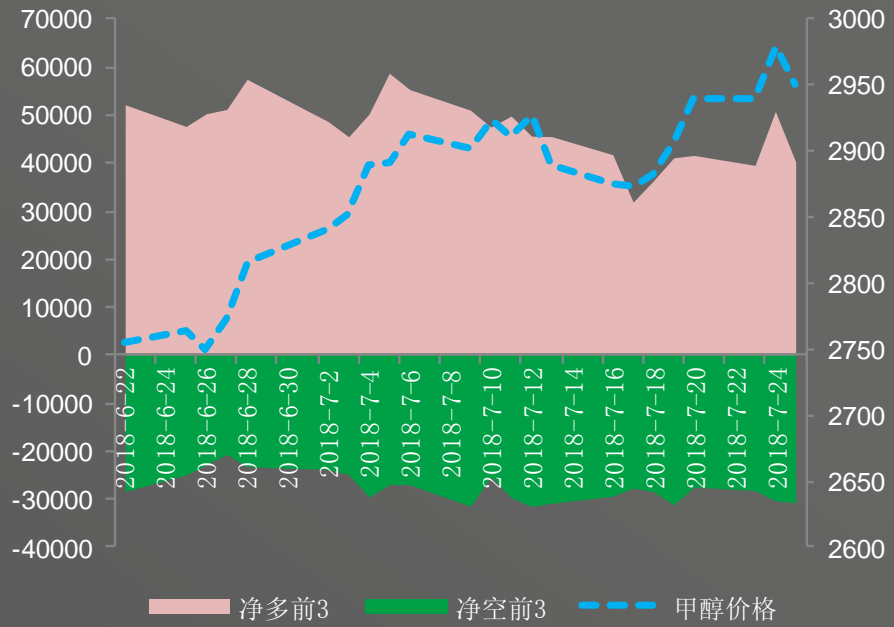
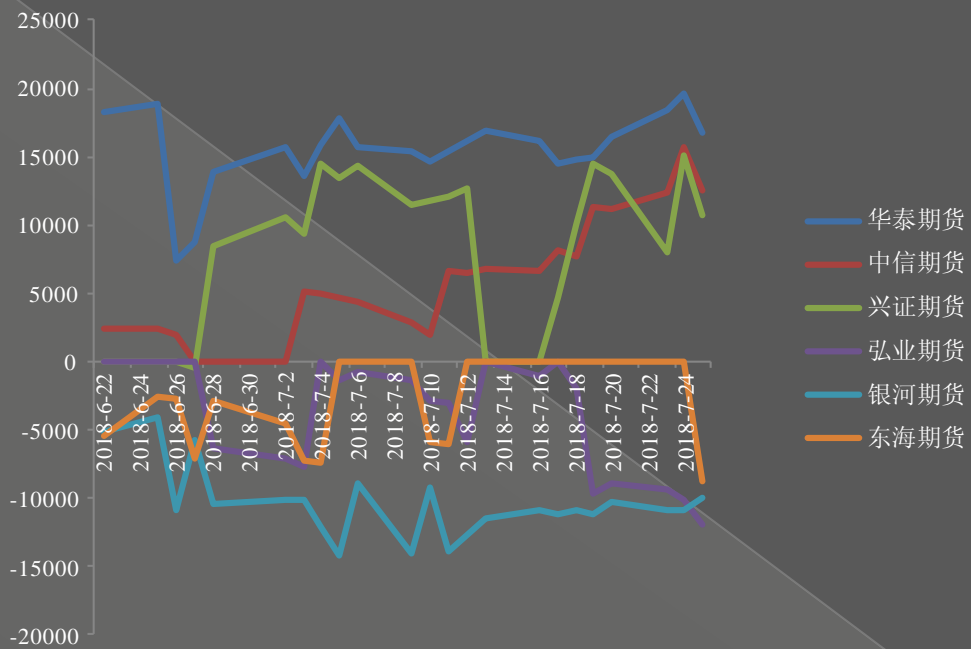


变动幅度		当日	最近5日	平均变化	波动率
I持仓	多头前3	-1.19%	7.72%	1.54%	9.70%
	空头前3	1.00%	-5.43%	-1.09%	
I涨幅		0.02%	1.52%	0.30%	
震荡幅度	0.61%	0.99% (月均值)	投机度	0.35	0.41 (月均值)

变动幅度		当日	最近5日	平均变化	波动率
pp持仓	多头前3	0.90%	9.46%	1.89%	10.90%
	空头前3	8.36%	11.65%	2.33%	
pp涨幅		-0.15%	1.75%	0.35%	
震荡幅度	0.76%	1.07% (月均值)	投机度	0.37	0.52 (月均值)

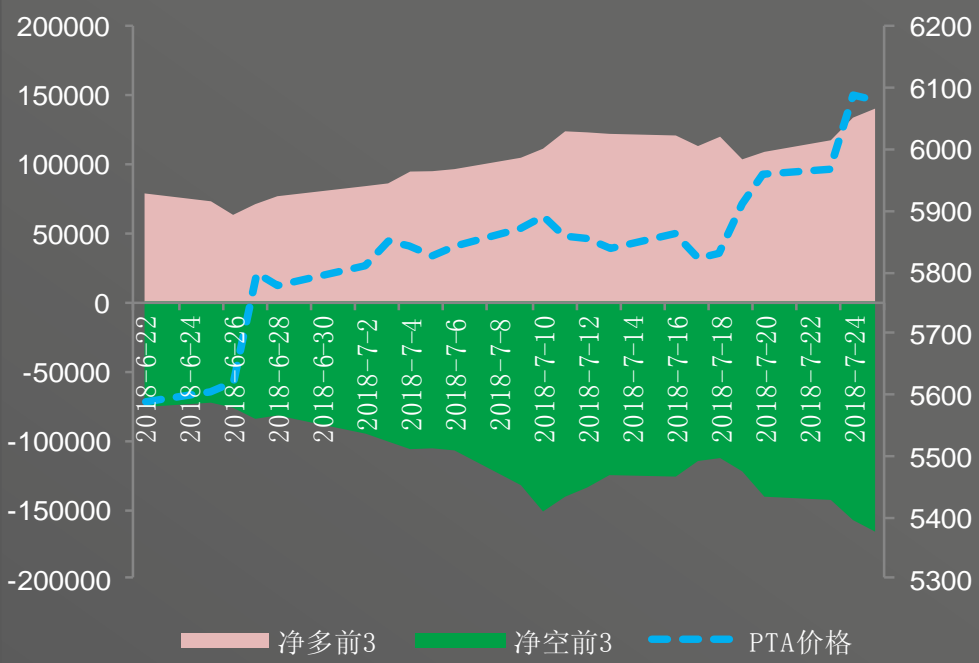
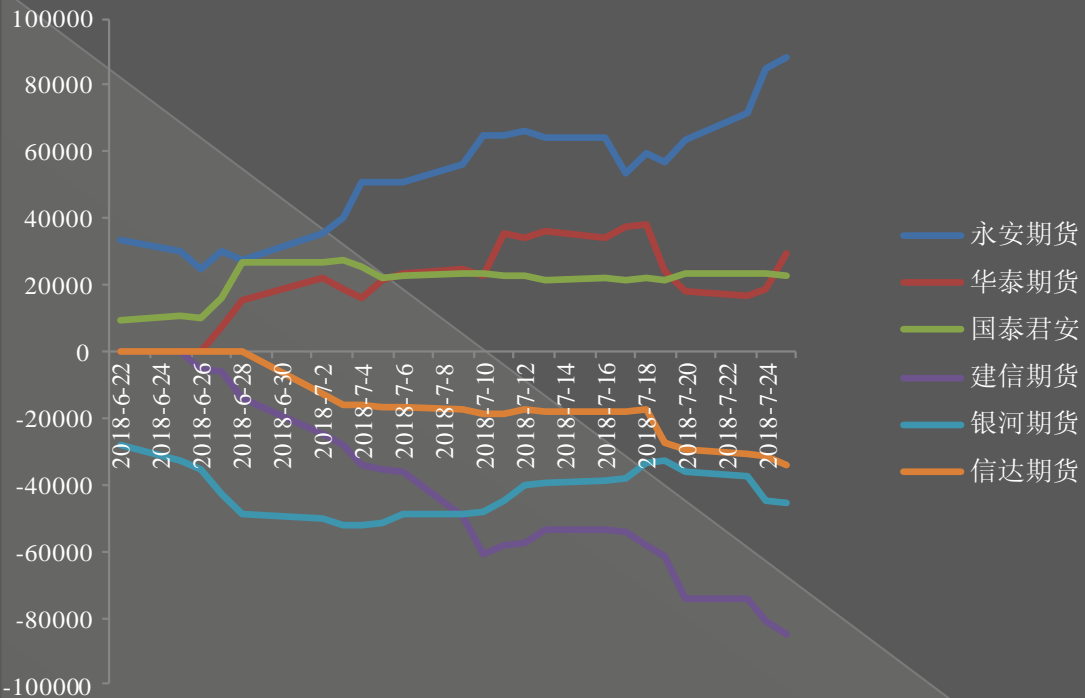


# 化工：甲醇



变动幅度		当日	最近5日	平均变化	波动率
ma持仓	多头前3	-20.73%	10.80%	2.16%	18.35%
	空头前3	1.14%	7.94%	1.59%	
ma涨幅		-0.97%	2.35%	0.47%	
震荡幅度	1.46%	1.54%(月均值)	投机度	0.93	0.92(月均值)

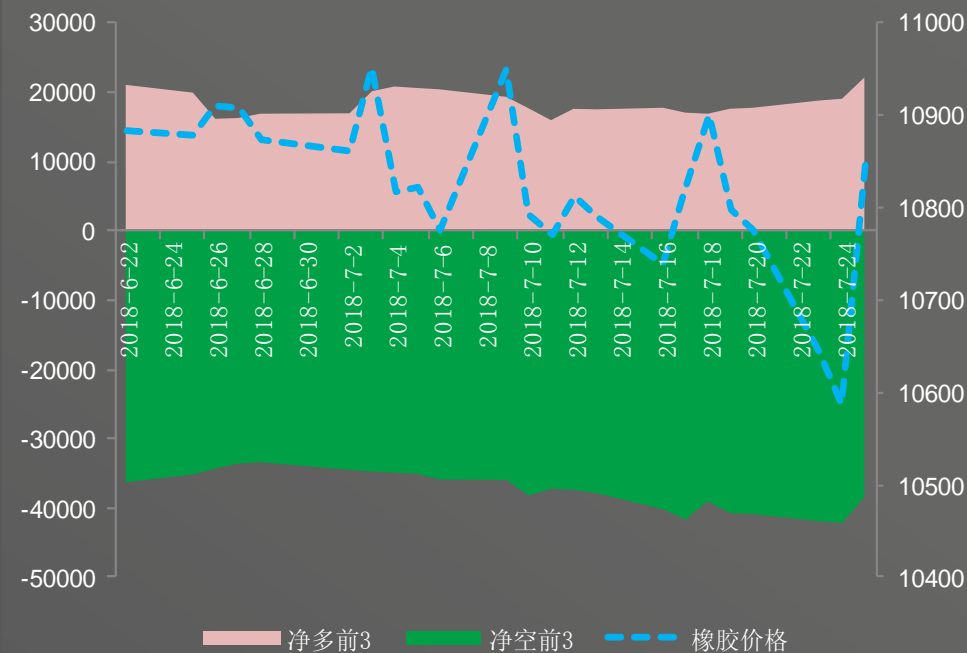
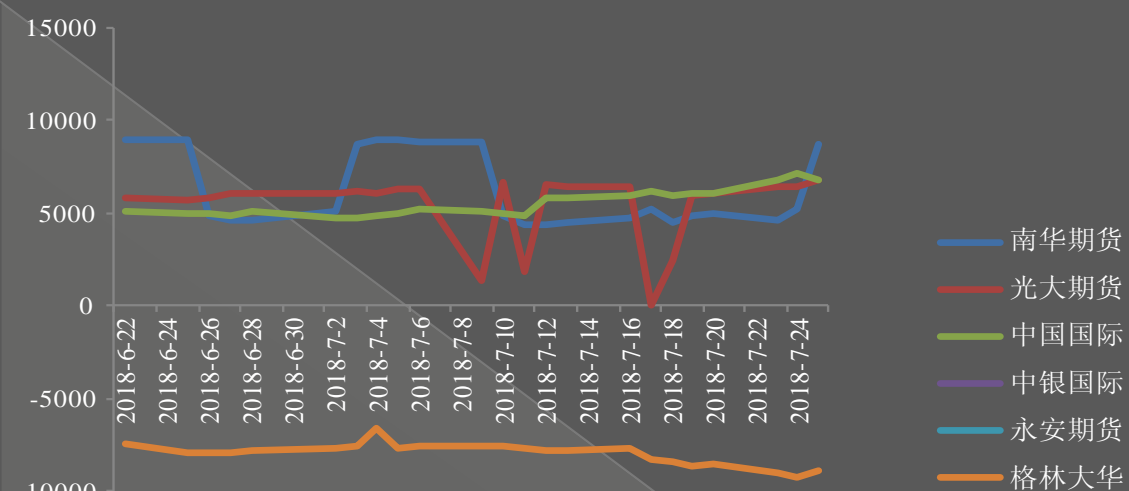
# 化工：PTA



变动幅度		当日	最近5日	平均变化	波动率
pta持仓	多头前3	4.91%	17.01%	3.40%	14.45%
	空头前3	5.30%	46.99%	9.40%	
pta涨幅		-0.10%	4.29%	0.86%	
震荡幅度	0.94%	1.24%(月均值)	投机度	0.64	0.62(月均值)

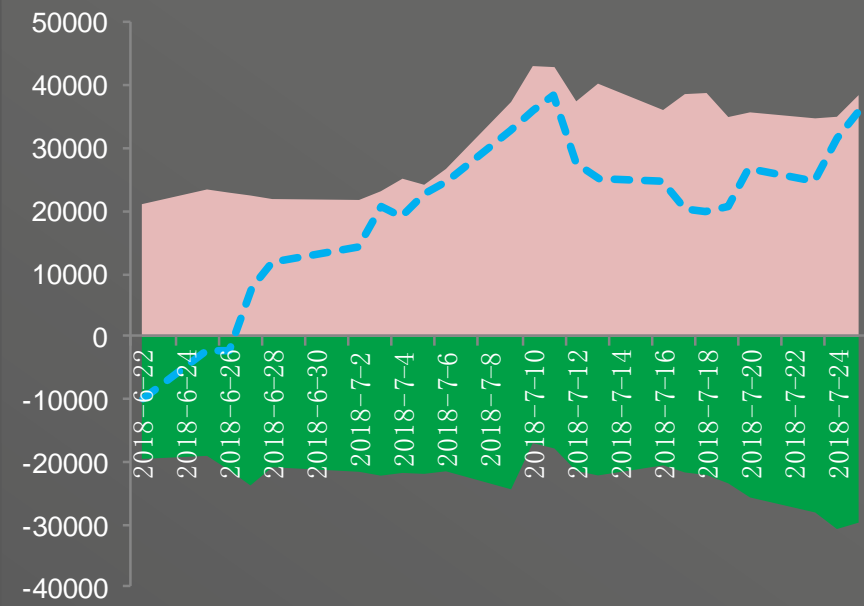
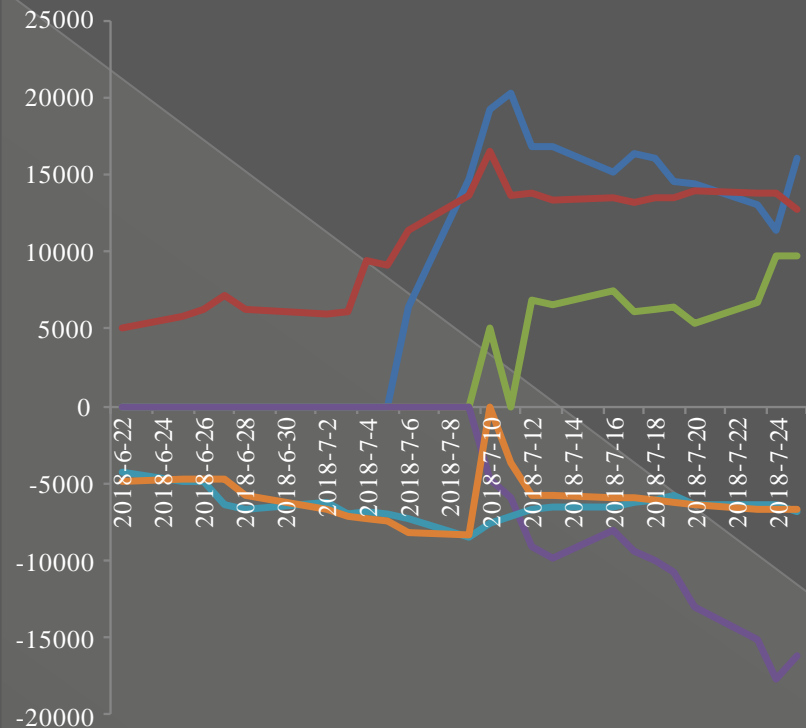


# 化工：橡胶



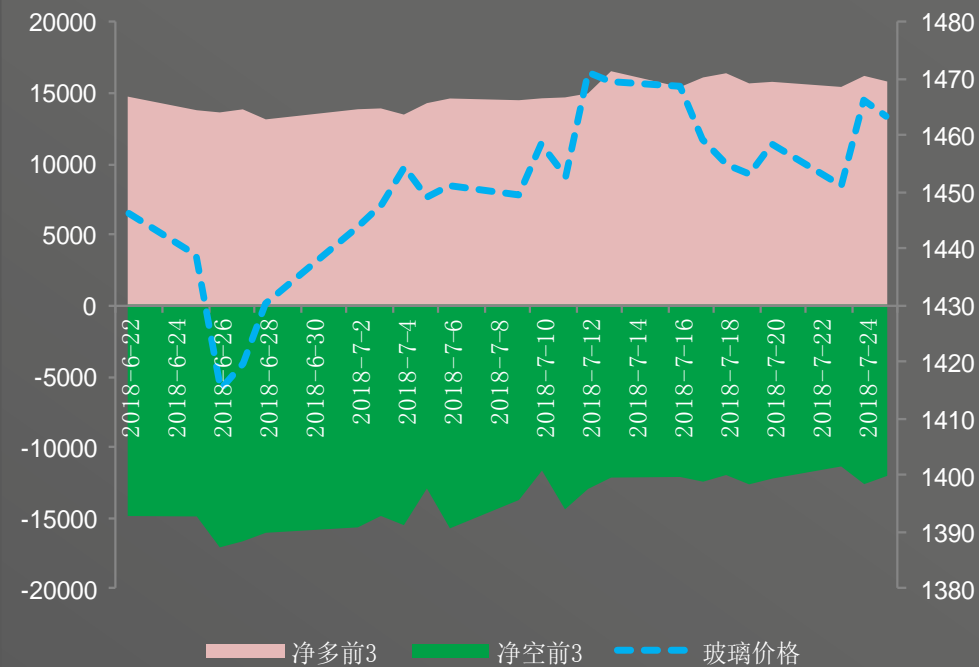
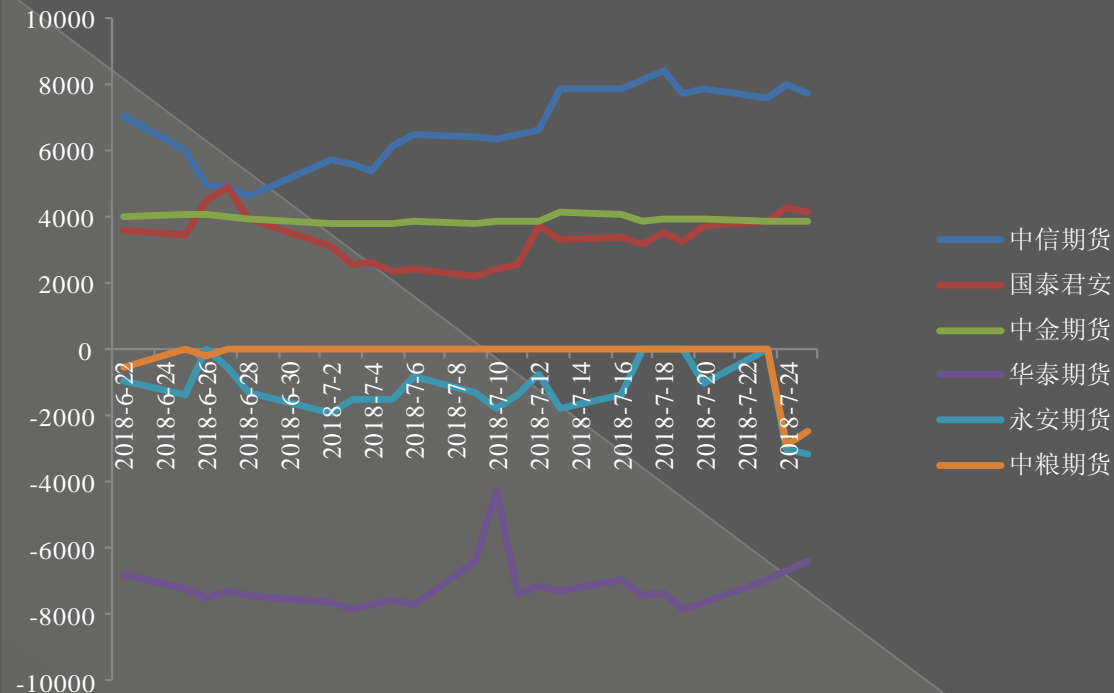
变动幅度		当日	最近5日	平均变化	波动率
ru持仓	多头前3	16.03%	30.80%	6.16%	54.77%
	空头前3	-8.88%	-1.55%	-0.31%	
ru涨幅		2.51%	-0.44%	-0.09%	
震荡幅度	2.71%	2.00%(月均值)	投机度	0.99	0.76(月均值)

# 化工：沥青



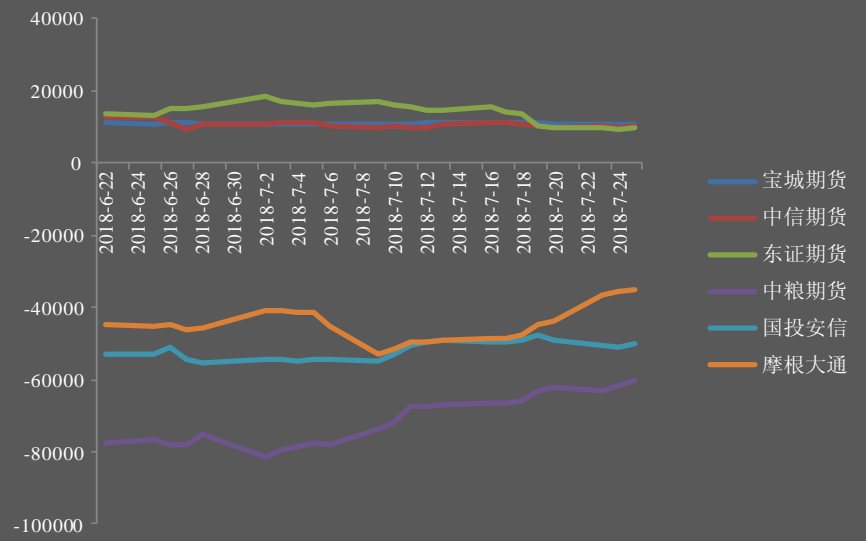
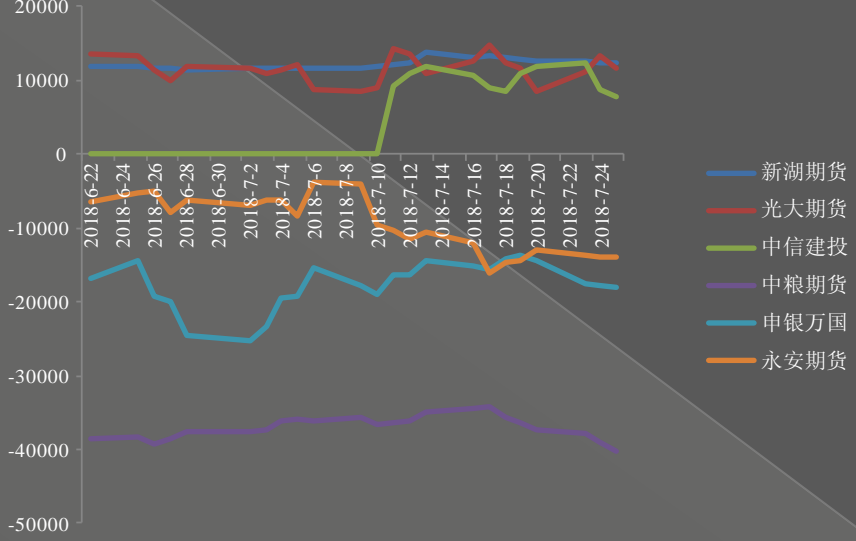
变动幅度		当日	最近5日	平均变化	波动率
bu持仓	多头前3	9.84%	-0.85%	-0.17%	14.17%
	空头前3	-3.33%	34.48%	6.90%	
bu涨幅		0.79%	3.00%	0.60%	
震荡幅度	1.96%	1.69%(月均值)	投机度	0.93	0.94(月均值)

# 化工：玻璃



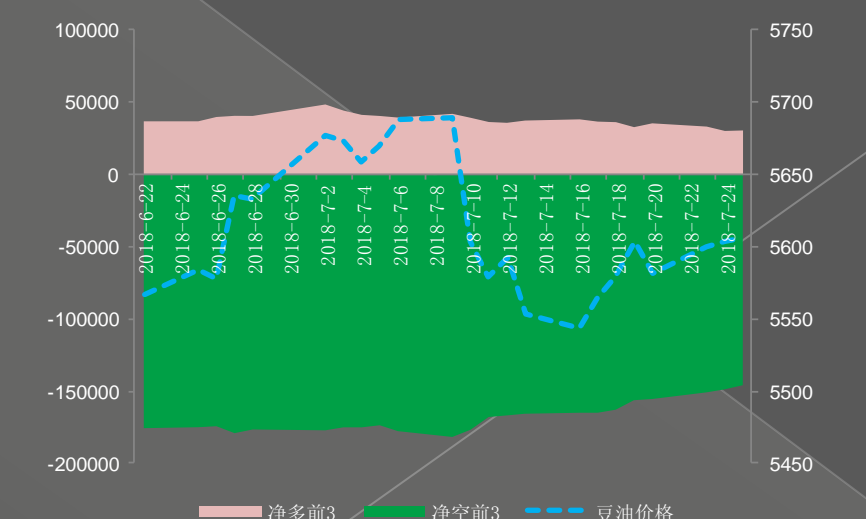
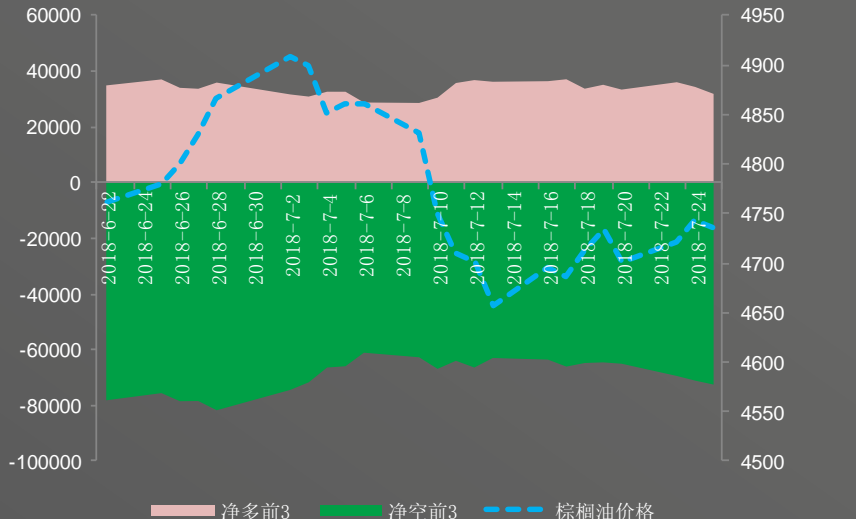
变动幅度		当日	最近5日	平均变化	波动率
fg持仓	多头前3	-2.45%	-3.57%	-0.71%	22.08%
	空头前3	-4.63%	0.46%	0.09%	
fg涨幅		-0.19%	0.58%	0.12%	
震荡幅度	0.57%	1.14%(月均值)	投机度	0.51	0.55(月均值)

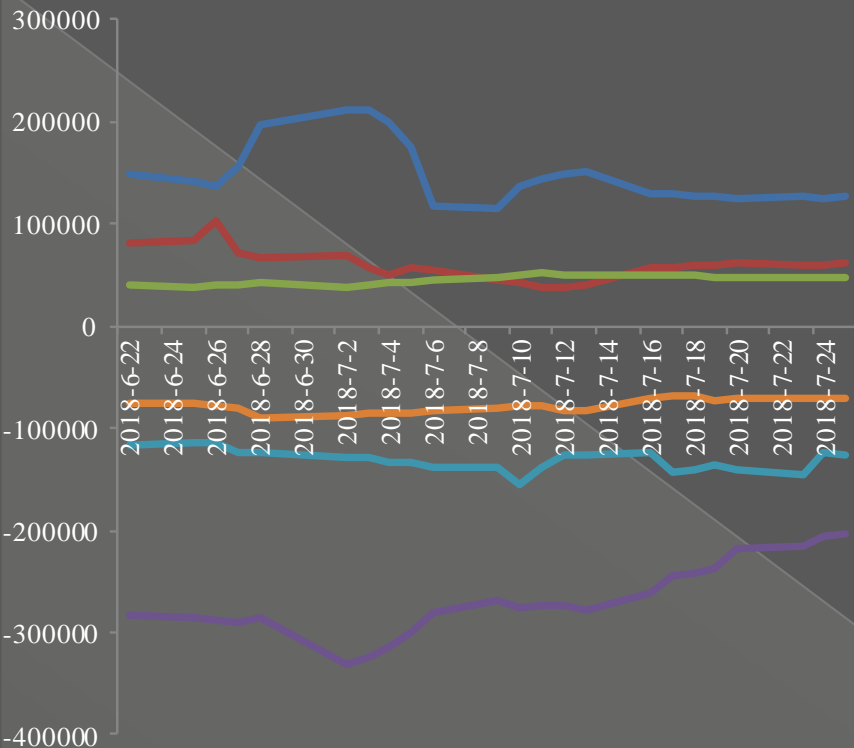
# 农产品：P & Y



变动幅度		当日	最近5日	平均变化	波动率
p持仓	多头前3	-7.24%	-5.51%	-1.10%	31.84%
	空头前3	2.00%	11.98%	2.40%	
p涨幅		-0.14%	0.52%	0.10%	
震荡幅度	0.48%	1.25%(月均值)	投机度	0.32	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	1.13%	-15.63%	-3.13%	16.55%
	空头前3	-1.93%	-10.44%	-2.09%	
y涨幅		0.05%	0.48%	0.10%	
震荡幅度	0.60%	1.04%(月均值)	投机度	0.19	0.30(月均值)

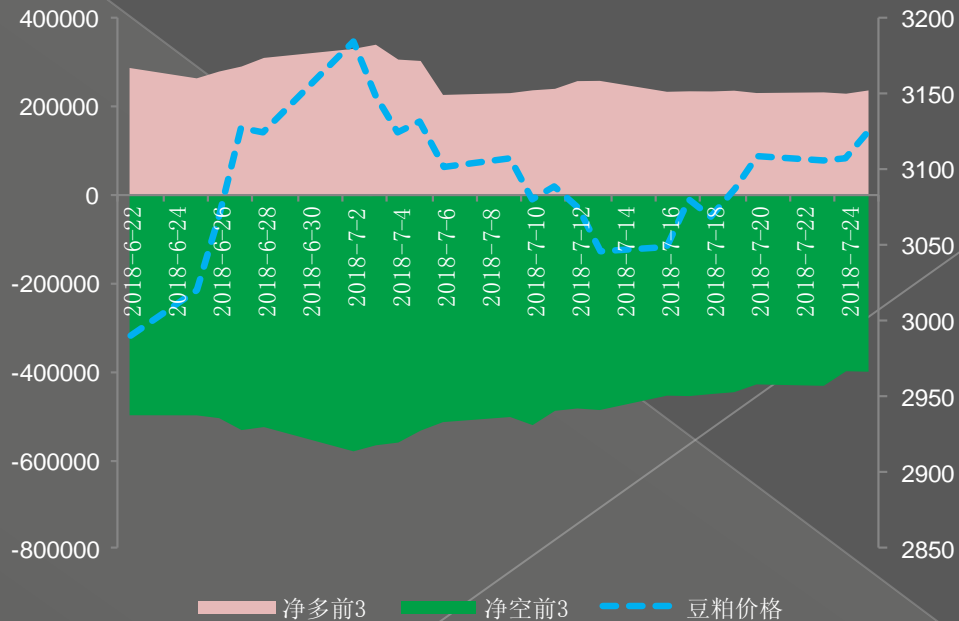




- 永安期货
- 五矿经易
- 华信期货
- 中粮期货
- 摩根大通
- 银河期货

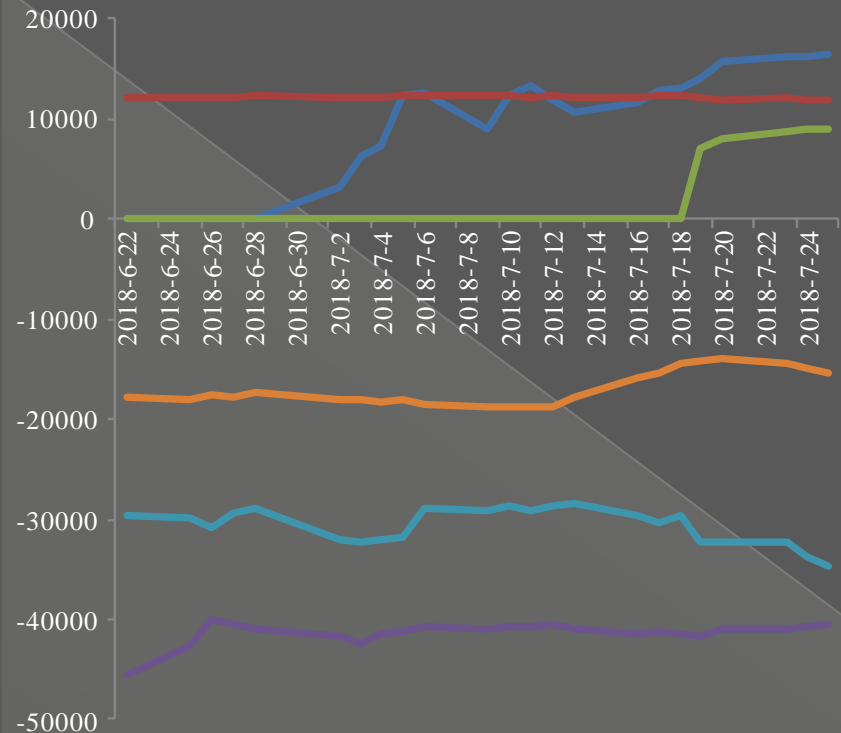
# 农产品：豆粕

变动幅度		当日	最近5日	平均变化	波动率
m持仓	多头前3	3.17%	0.95%	0.19%	20.38%
	空头前3	0.29%	-11.26%	-2.25%	
m涨幅		0.57%	1.82%	0.36%	
震荡幅度	1.25%	1.67%(月均值)	投机度	0.47	0.57(月均值)



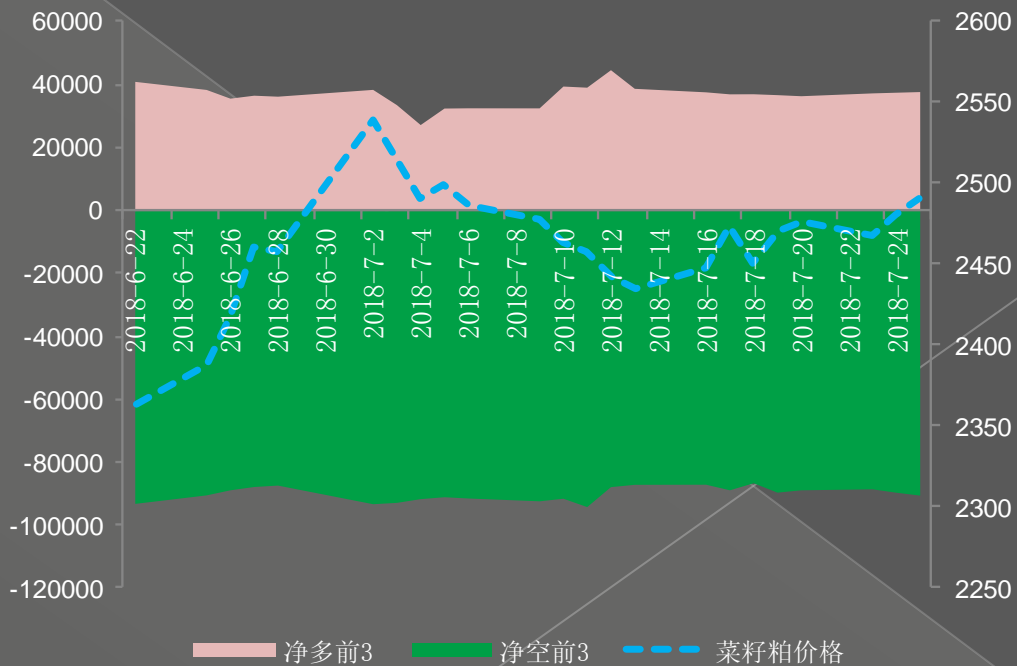
- 净多前3
- 净空前3
- 豆粕价格

# 农产品：菜粕

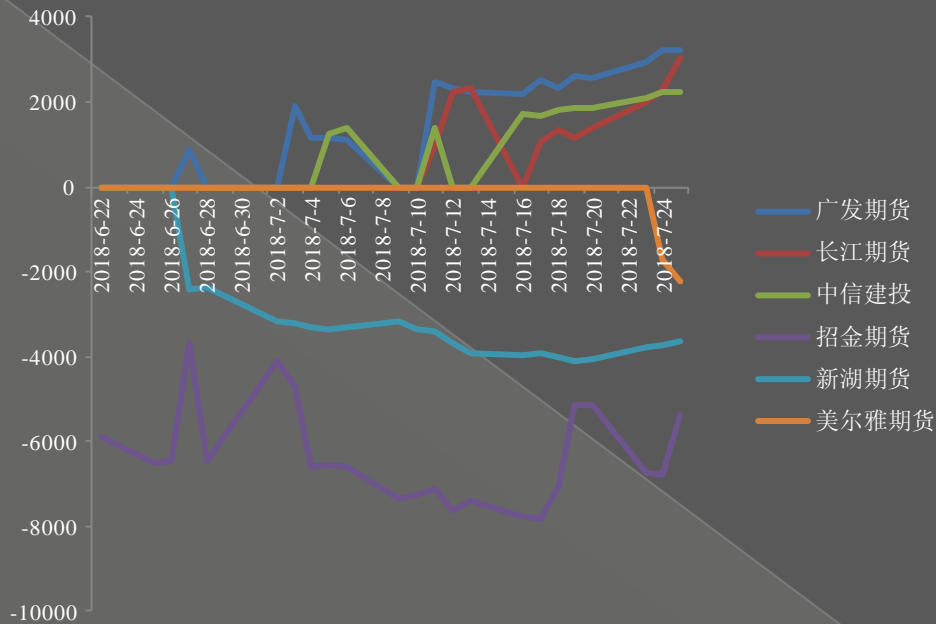


- 华泰期货
- 福能期货
- 中金期货
- 国投安信期货
- 中粮期货
- 中国国际

变动幅度		当日	最近5日	平均变化	波动率
rm持仓	多头前3	0.54%	1.87%	0.37%	15.68%
	空头前3	1.03%	4.55%	0.91%	
rm涨幅		0.40%	1.62%	0.32%	
震荡幅度	1.02%	1.56%(月均值)	投机度	0.89	1.17(月均值)

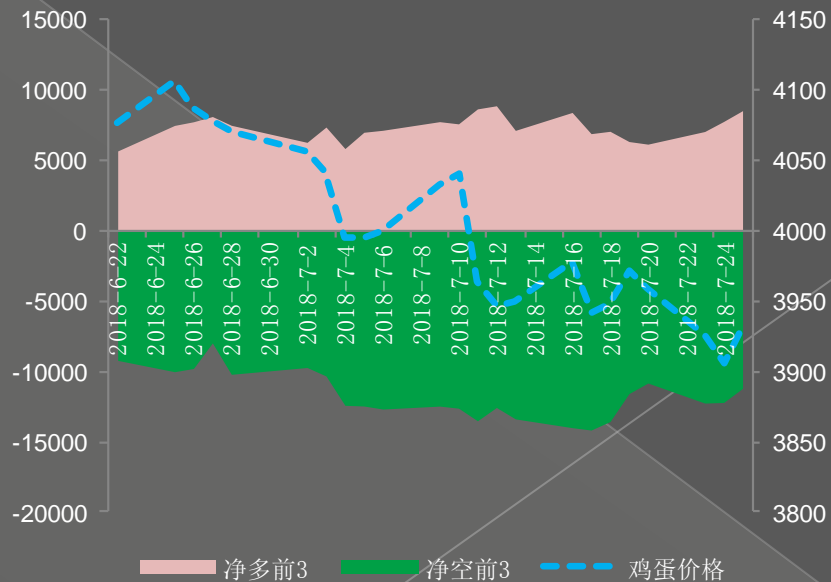


- 净多前3
- 净空前3
- 菜籽粕价格

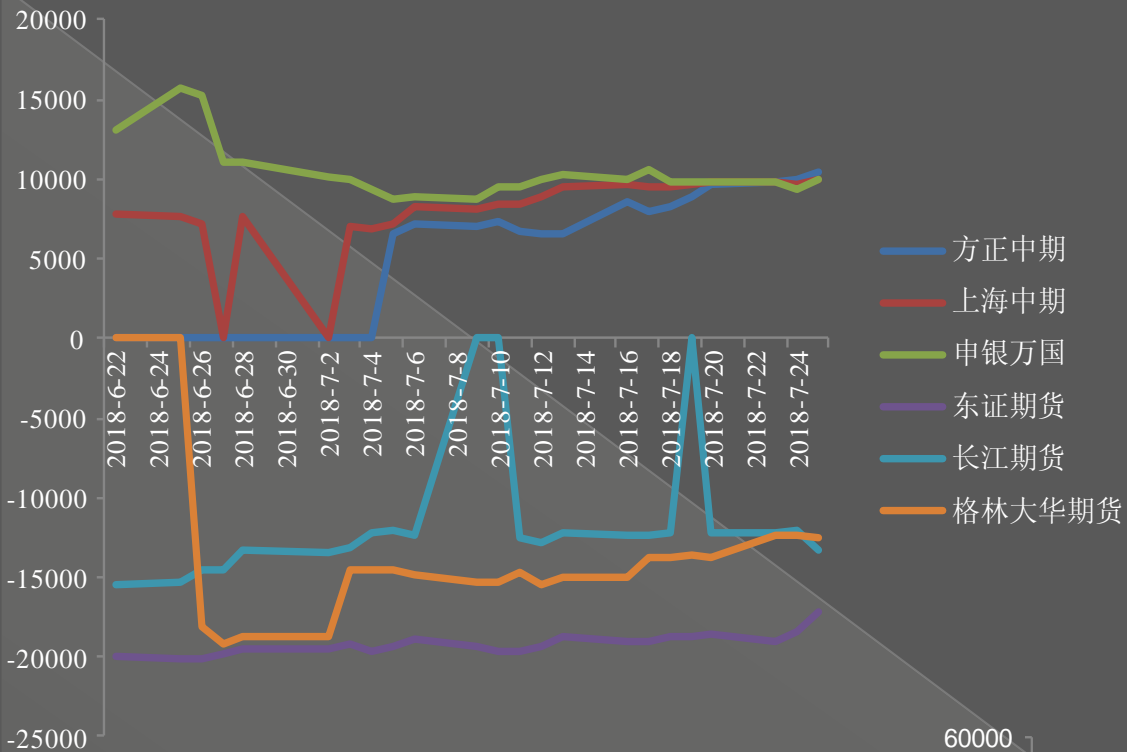


# 农产品：鸡蛋

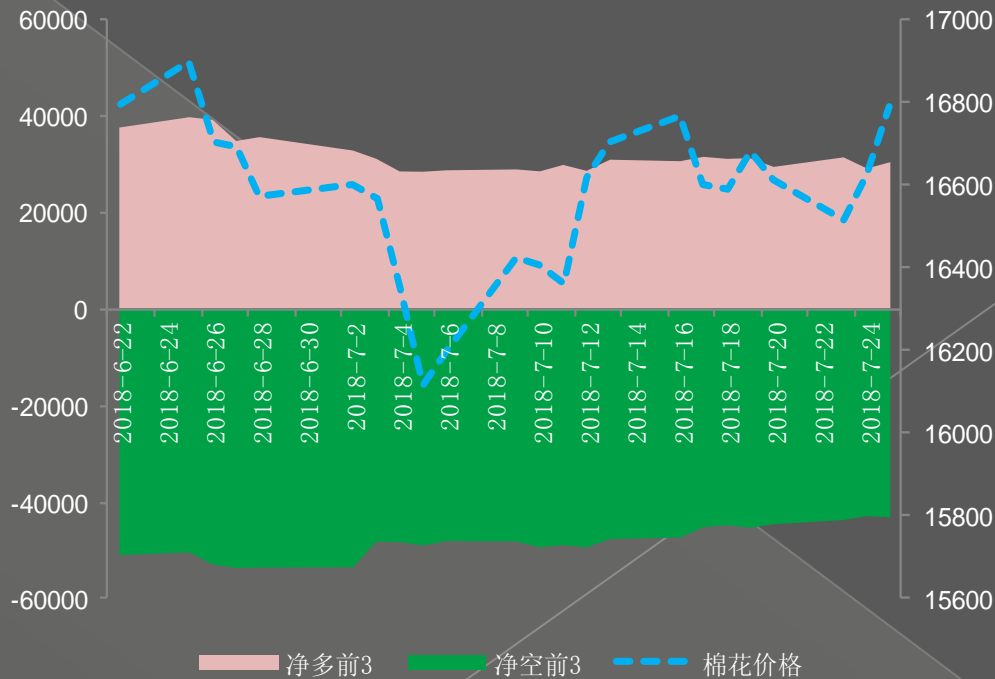
变动幅度		当日	最近5日	平均变化	波动率
jd持仓	多头前3	9.82%	20.62%	4.12%	14.34%
	空头前3	-8.26%	-17.47%	-3.49%	
jd涨幅		0.65%	-0.43%	-0.09%	
震荡幅度	0.76%	1.28%(月均值)	投机度	0.47	0.64(月均值)



# 农产品：棉花

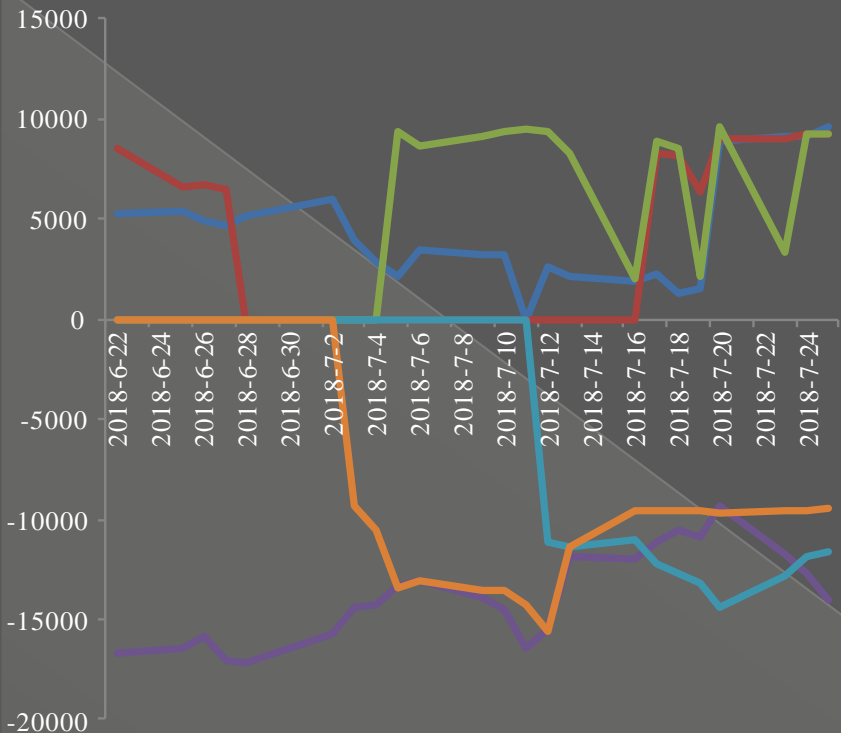


变动幅度		当日	最近5日	平均变化	波动率
cf持仓	多头前3	4.55%	-2.21%	-0.44%	25.94%
	空头前3	0.57%	-3.69%	-0.74%	
cf涨幅		0.98%	1.20%	0.24%	
震荡幅度	1.83%	1.62%(月均值)	投机度	0.60	0.56(月均值)



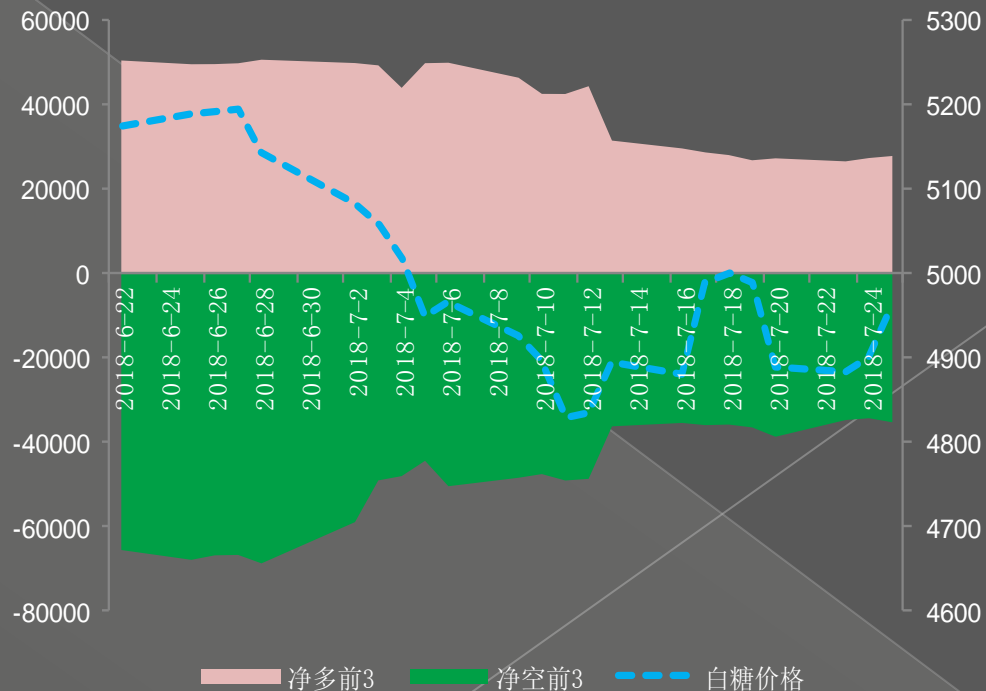


# 农产品：白糖

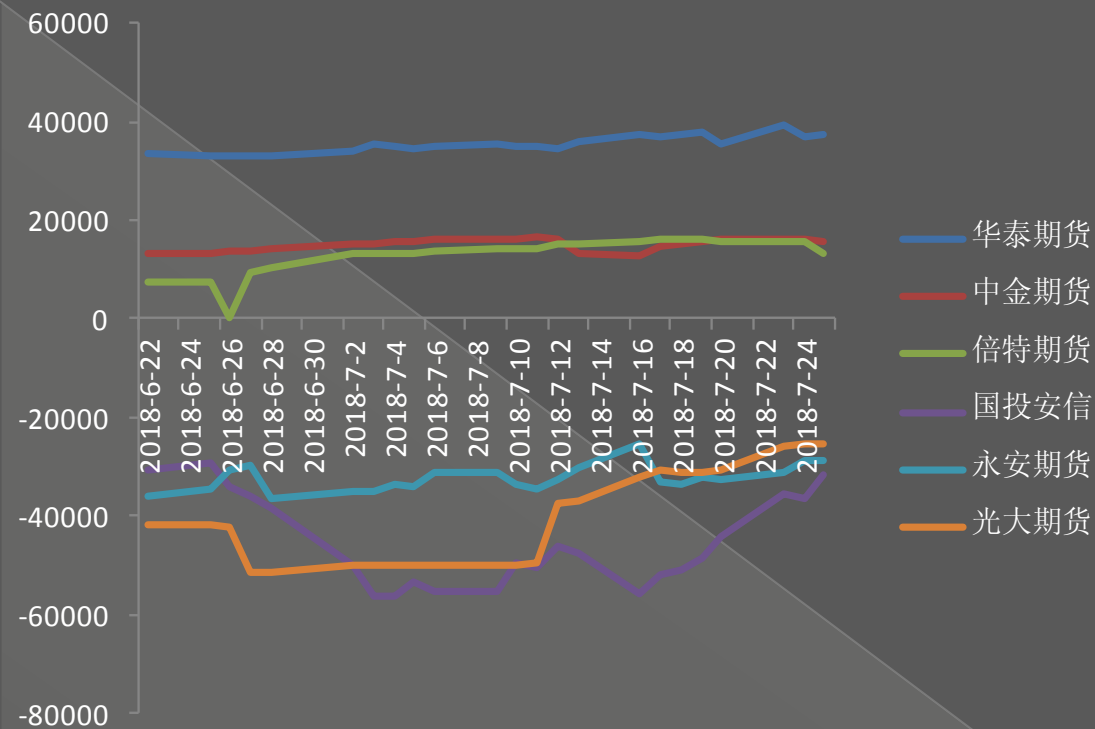


- 光大期货
- 同信久恒
- 广发期货
- 中信期货
- 华信期货
- 创元期货

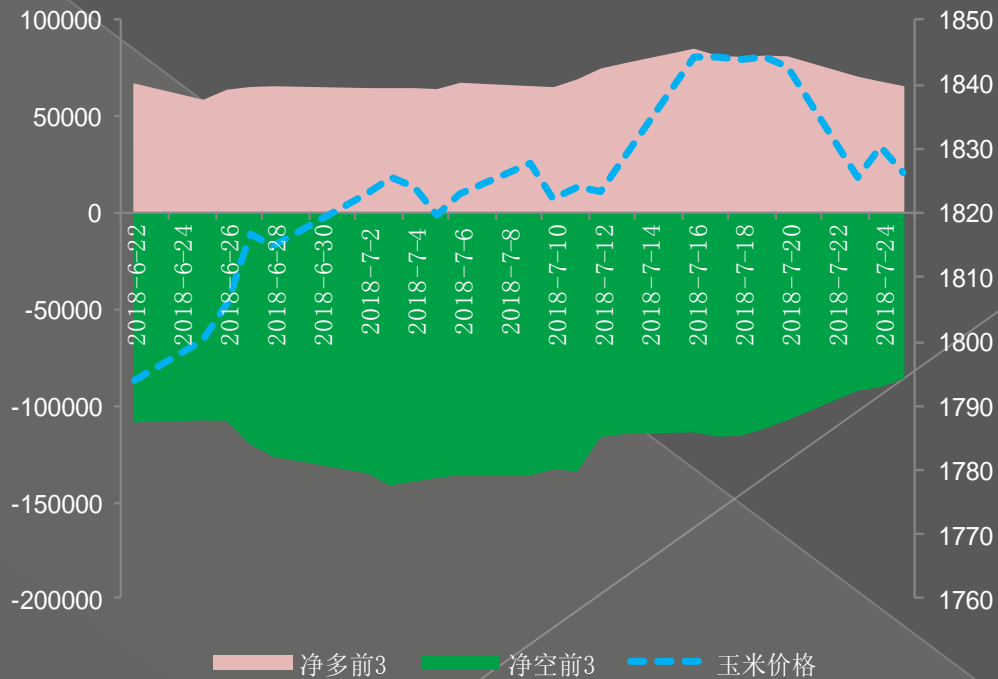
变动幅度		当日	最近5日	平均变化	波动率
sr持仓	多头前3	1.77%	-0.76%	-0.15%	42.95%
	空头前3	2.81%	-1.51%	-0.30%	
sr涨幅		1.21%	-0.83%	-0.17%	
震荡幅度	1.22%	1.23% (月均值)	投机度	1.05	0.79 (月均值)



# 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	-3.51%	-18.68%	-3.74%	10.30%
	空头前3	-5.06%	-25.93%	-5.19%	
c涨幅		-0.24%	-0.97%	-0.19%	
震荡幅度	0.48%	0.64%(月均值)	投机度	0.20	0.30(月均值)



# 部分机构资金变动表

制表日期：2018年7月25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	9121.97	4.09%	23292.27	11.14%
南华期货	8750.47	7.85%	-7217.15	-5.66%
混沌天成	0.00	--	0.00	--
海通期货	-7495.73	-8.25%	4565.64	5.79%
上海大陆	142.89	1.31%	-8673.13	-44.03%
中信期货	-3000.98	-1.76%	3915.35	2.39%
新湖期货	8421.75	16.71%	-3235.73	-5.21%

中粮期货	2138.65	0.90%	-11803.99	-4.67%
中信建投	1651.58	6.67%	1614.43	6.51%
申银万国	-12252.88	-21.01%	-1690.75	-3.54%
华泰期货	11618.83	12.99%	-4944.62	-4.66%
光大期货	4058.75	9.16%	-11971.41	-19.84%
一德期货	-11037.53	-11.80%	-9209.74	-10.04%
国投期货	675.70	0.85%	-12184.81	-13.18%
金瑞期货	-1584.45	-1.96%	-410.60	-0.52%
鲁证期货	-11559.93	-16.26%	-541.39	-0.90%
中国国际	-4645.62	-6.67%	11311.76	21.08%

# 部分机构持仓一览

机构	永安期货					
日期	2018-7-18	2018-7-19	2018-7-20	2018-7-23	2018-7-24	2018-7-25
黄金						
白银	-7245	-6545	-6749	-5662	-7341	-5989
沪铜	-9404	-5757				
沪铝	-6058	-6345	-6583	-6420	-7844	-6597
沪镍	-9917	-10813	-11563	-11809	-10190	-7137
沪锌	-5642	4678	3300	4375		3996
沪铅	2283	2523	2523	2354	2346	3323
螺纹钢	29520	40697	53915	66620	47569	48114
铁矿石	-6603	-5187	-3819	-4921		-2201
焦煤	8523	5615	6102	5302	3265	-2107
焦炭	8237	13519	12433	12758	15169	15633
豆油			-9695			
棕榈油	-14739	-14288	-13015	-13680	-13967	-14033
菜籽油	23867	22833	22684	23610	23114	23667
豆粕	127842	128281	124381	127141	124050	128469
菜籽粕	11407	10215	8224	7614	7671	7184
棉花		-9881			-8412	-9570
白糖				554	717	1110
玉米	-33499	-32340	-32572	-31216	-28569	-28929
鸡蛋	2852	1302	1509	1786	1656	1761
PTA	59440	57147	63570	71469	85099	88120
聚乙烯		-10833	-9433	-8966	-7187	-6368
聚丙烯	23771	23122	20767	20636	22065	24964
甲醇	11135		-1995		5686	-6989
玻璃			-1019		-2992	-3106
橡胶	-12954	-13593	-13734	-13987	-14541	-13317
沥青	15977	14606	14339	13104	11424	15991
动力煤	25641	23578	23547	26860	28089	

# 部分机构持仓一览

机构	南华期货					
日期	2018-7-18	2018-7-19	2018-7-20	2018-7-23	2018-7-24	2018-7-25
黄金	-779	-441		-427		-592
白银	11727	9144	8462	8544	13678	8489
沪铜	6009	5670	5432	5260	4862	4470
沪铝						
沪镍		-930		-568		
沪锌	-6571	-7314	-7533	-7815	-9014	-7510
沪铅	-3204	-1999	-1901	-2255	-2205	-3106
螺纹钢	-51303	-51008	-52551	-24692	-47976	-46237
铁矿石						
焦煤	1529	2059				
焦炭						
豆油	8545	8638	7689	6666	6540	5932
棕榈油	-10740	-10852	-9986	-9180	-9214	-9510
菜籽油	-10160	-9878	-10130	-9819	-10693	-10586
豆粕	-34445	-33456		-19604		-18569
菜籽粕	-11162	-12076	-11074	-11088	-11739	-10842
棉花	8448	8221	8156	7895	7913	9501
白糖						
玉米						
鸡蛋			1192	-452		
PTA						
聚乙烯	14244	15887	15743	13965	13610	13157
聚丙烯	-19085	-17029	-17437	-17256	-18488	-20172
甲醇	-7580	-7581	-8402	-7406	-9434	-8167
玻璃	2718	3093	2761	2384	2053	1858
橡胶	4519	4784	4967	4597	5223	8756
沥青						
动力煤						

# 部分机构持仓一览

机构	国泰君安					
日期	2018-7-18	2018-7-19	2018-7-20	2018-7-23	2018-7-24	2018-7-25
黄金	9874	8732	7762	7442	8026	7779
白银						-4883
沪铜	4033	3350	3206	2617	3407	2807
沪铝						
沪镍		-3034			-3489	-4202
沪锌	-5130	-5233	-5030	-5032	-5696	-5281
沪铅	-1360	-1348	-1704	-1660	-1548	-1758
螺纹钢						-7956
铁矿石	15584	14903	14222	15779	15307	7277
焦煤					-500	
焦炭	-583	-548	-835	-596		
豆油	-12094	-16861	-18556	-16769	-18653	-17347
棕榈油						
菜籽油	14321	14472	15269	15456	15437	15596
豆粕			-22394		-17869	-21799
菜籽粕	8505	7948	8326	8266	7902	8263
棉花	8117	8372	7963	8774	8095	8320
白糖		5834	6245	6692	6593	6420
玉米						
鸡蛋	-1127	-1041	-1136			
PTA	21989	21581	23112	23125	23390	22519
聚乙烯	5242	4103		4451		
聚丙烯						
甲醇	6624	6477	6722	5957	4526	
玻璃	3563	3289	3792	3895	4316	4143
橡胶	-2594					
沥青	9323	5697				
动力煤	-5441	-5888	-5953	-6421	-6360	

## 部分机构持仓一览

机构	混沌天成					
日期	2018-7-18	2018-7-19	2018-7-20	2018-7-23	2018-7-24	2018-7-25
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						
动力煤						



## 部分机构持仓一览

机构	海通期货					
日期	2018-7-18	2018-7-19	2018-7-20	2018-7-23	2018-7-24	2018-7-25
黄金	3008		3220	3688	3562	3818
白银						6279
沪铜	-11793	-11167	-11803	-11958	-7792	-7161
沪铝					-8751	
沪镍	5337	5167	3593	5409	3001	2388
沪锌		-4049	-3769	-2717	-3809	-4683
沪铅	-1475	-1504	-1528	-1515	-1427	-1412
螺纹钢	-16300	-22102	-23008		-13229	
铁矿石					6852	7998
焦煤			-2367	-2152		-1874
焦炭	3673	5081	7066	6492	6388	6145
豆油						
棕榈油	4744	4100			4936	4588
菜籽油	-4949	-5091	-5424	-4414	-5058	-4579
豆粕	19323	23866	23682	27935	27745	29551
菜籽粕	-661	4220	2585		3168	1802
棉花						
白糖	2728	2433	-39		36	
玉米	16891	17122	19619	11775	13428	12937
鸡蛋						
PTA						
聚乙烯	5244	5267	6778	6803	5658	6934
聚丙烯						
甲醇		3767	5738			
玻璃	1675	1510	1250		2004	2117
橡胶						
沥青			6087	4804	4912	
动力煤					4895	

## 部分机构持仓一览

机构	上海大陆					
日期	2018-7-18	2018-7-19	2018-7-20	2018-7-23	2018-7-24	2018-7-25
黄金						
白银						
沪铜	3643	3036	4072	3182	3014	3029
沪铝						
沪镍						
沪锌						
沪铅						
螺纹钢						
铁矿石	-15782					
焦煤						
焦炭						
豆油						
棕榈油	7497	7436	7584	7253	7246	7294
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	中粮期货					
日期	2018-7-18	2018-7-19	2018-7-20	2018-7-23	2018-7-24	2018-7-25
黄金						
白银	9935	7586	7523	5401		5601
沪铜	-8416	-8295	-7691	-5988	-7705	-8577
沪铝	-6253	-6580	-5892	-6583	-6344	-6696
沪镍	-5456	-5441	-6064	-5447	-5297	-5720
沪锌	4934	4890	3727	3727	4012	3908
沪铅	-1114			-781	-782	847
螺纹钢						
铁矿石	12988	11659	11865	12028	11015	11044
焦煤				-1989	-2239	-2051
焦炭						
豆油	-66033	-63283	-62255	-63294	-61469	-59991
棕榈油	-35714	-36398	-37365	-37930	-39059	-40180
菜籽油	-37887	-38134	-38126	-38459	-38210	-38501
豆粕	-241959	-237364	-218088	-216489	-204821	-203608
菜籽粕	-29624	-32306	-32233	-32335	-33742	-34715
棉花	-11535	-12819	-11493	-11383	-10764	-11539
白糖	-4528	-6345	-6638	-6543	-5873	
玉米				11550	12142	12201
鸡蛋						
PTA	17897	22395	19045	18032	19733	14800
聚乙烯	-3360		-5879	-5957	-6316	-6411
聚丙烯	7581	5930	3699		3770	3743
甲醇	-10000	-10531	-6386		-5788	
玻璃					-2891	-2476
橡胶	-8145	-8193	-8157	-8531	-8387	-8601
沥青						
动力煤						

# 部分机构持仓一览

机构	中信期货					
日期	2018-7-18	2018-7-19	2018-7-20	2018-7-23	2018-7-24	2018-7-25
黄金	8244	11096	11627	11394	9603	8253
白银	-34354	-37548	-37501	-35950	-35548	-33600
沪铜	-13611	-13865	-13511	-13976	-13033	-11360
沪铝	-7437	-6555	-7898	-5920		-5708
沪镍	-6838	-5101	-6709	-5902	-6780	-6551
沪锌		-4124	-4376			-3838
沪铅	3420	2939	2936	2428	2380	1209
螺纹钢	-24202	-27383	-26284	-26573	-29229	-15460
铁矿石	-9033	-8185	-10250	-12240	-11442	-14391
焦煤				458		1833
焦炭	2174	3142	3600	2844	2859	2939
豆油	10715	10406	9868	10090	9866	10185
棕榈油	-7907	-7159	-6532	-7159	-7284	-6899
菜籽油	-9620	-9951	-10974	-10163	-10746	-10747
豆粕						
菜籽粕	550	1115		-1047	-700	-1091
棉花	4228	4586	3991	5053	5841	7482
白糖	-10585	-10829	-9304	-11711	-12690	-13984
玉米	26657	26710	26237	15900	11162	8601
鸡蛋	1105	1752	1249	1815	1687	1542
PTA	18814	20462	22061	22573	25102	21603
聚乙烯						
聚丙烯	-4834	-3726	-4146	-3906		
甲醇	7657	11375	11138	12387	15760	12490
玻璃	8456	7746	7865	7649	8040	7770
橡胶	-7986	-9347	-9417	-10180	-10244	-8860
沥青	-3872	-3292	-3078			-3300
动力煤	-10080	-9974	-9137	-10472	-10219	

## 部分机构持仓一览

机构	中信建投					
日期	2018-7-18	2018-7-19	2018-7-20	2018-7-23	2018-7-24	2018-7-25
黄金		3506	3506	4154		3636
白银						
沪铜	-3381	-3474	-3587	-3368	-3367	
沪铝					4134	
沪镍						
沪锌						
沪铅						
螺纹钢		-25870	-21280	-22765	-21457	-22241
铁矿石						
焦煤						
焦炭	-2532					
豆油	6327					
棕榈油	8465	10882	11994	12452	8771	7886
菜籽油						
豆粕						
菜籽粕						
棉花						
白糖						
玉米						
鸡蛋	1819	1854	1869	2095	2242	2236
PTA						
聚乙烯						
聚丙烯						
甲醇						
玻璃						
橡胶	3029					2836
沥青						
动力煤						

## 部分机构持仓一览

机构	新湖期货					
日期	2018-7-18	2018-7-19	2018-7-20	2018-7-23	2018-7-24	2018-7-25
黄金	-1478	-1407	-1461	-1453	-1470	-1434
白银			-4082		-4578	
沪铜						
沪铝						
沪镍	6830	6906	6772	6750	2721	4401
沪锌						
沪铅	2054	1881	1877	1944	1880	1841
螺纹钢	34410	33537	34267			28182
铁矿石						
焦煤						
焦炭						
豆油	-12368	-12528	-10243	-10382	-9738	-9902
棕榈油	13149	12853	12716	12603	12453	12481
菜籽油			-5415	-5399	-5196	-4864
豆粕	-28463	-28271	-28180	-25283	-23964	-24007
菜籽粕						
棉花						
白糖						
玉米						
鸡蛋	-4015	-4087	-4056	-3792	-3709	-3611
PTA	-13827	-25896	-26444	-26992	-28088	-26783
聚乙烯						
聚丙烯						
甲醇						
玻璃						
橡胶	-6080	-6111	-6016	-6093	-5751	-5059
沥青	-4077	-4434	-3000	-3067	-2877	
动力煤					-7317	

# 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

