


商品期货市场资金情况

中粮期货董事总经理 颜兆阳

2017年1月15日

 中粮
COFCO
中粮期货有限公司
中粮集团成员企业

资金情况

选取商品期货市场成交量靠前的20大品种（更新至1月13日）



数据来源: wind资讯



资金情况

针对选取的20个商品品种自2014年3月持仓及对应市值的变化

持仓量:

增58% (上周51.8%)

2014.3.31: 1280万手

2011.1.13: 2022万手

持仓市值:

增35.2% (上周25.44%)

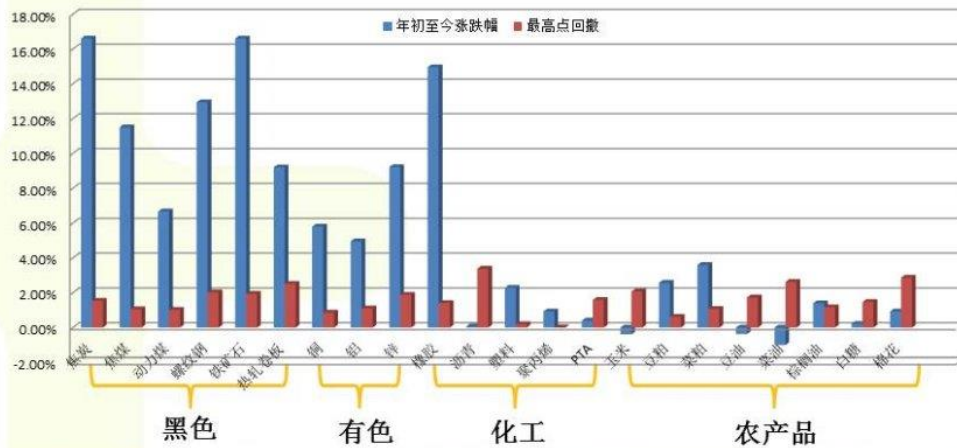
2014.3.31: 6124亿元

2016.1.13: 8280亿元



年内走势

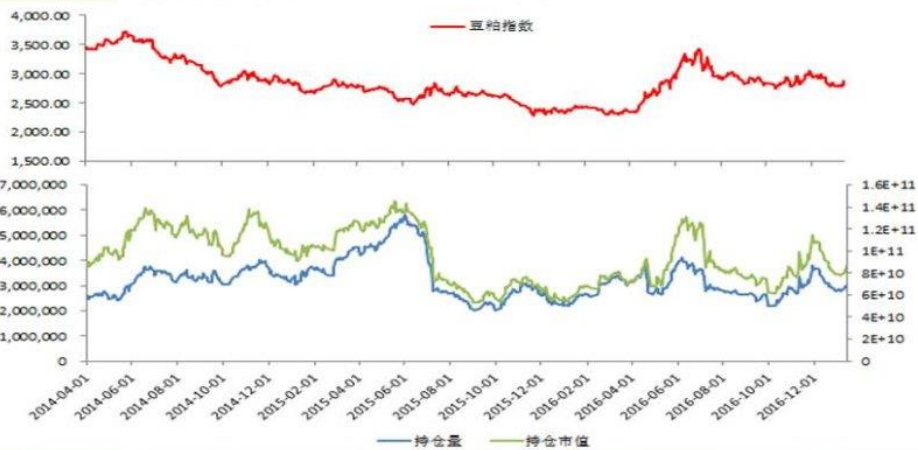
商品市场主要品种年初至今涨幅及当前从年内最高点回撤





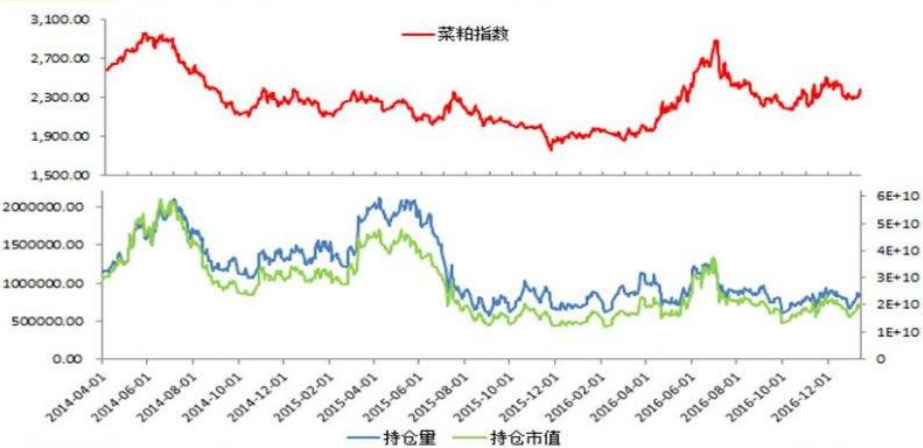
豆粕资金变化

- 1月13日：持仓量298万手；持仓市值859亿；指数收盘2874。
- 14年4月以来**最高持仓**：583.8万（2015-6-1）；**最高市值**：1451亿（2015-5-19）；**指数最高点**：3721（2014-5-26）；



菜粕资金变化

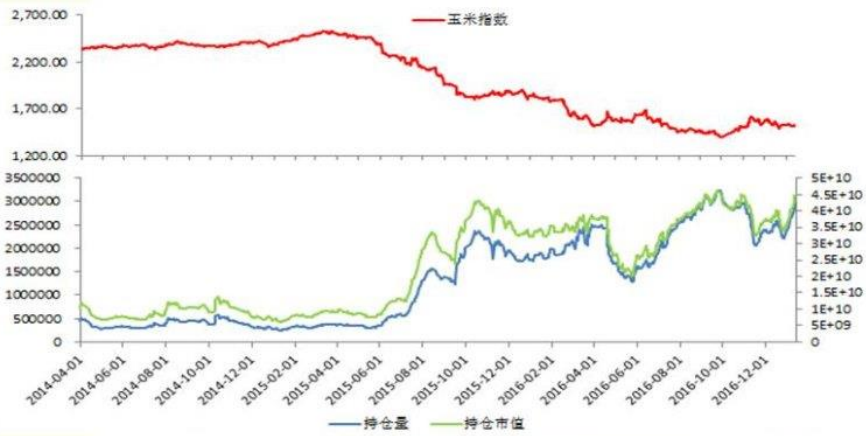
- 1月13日：持仓量86万手；持仓市值205亿；指数收盘2380。
- 14年4月以来**最高持仓**：212万（2015-4-8）；**最高市值**：588.7亿（2014-6-18）；**指数最高点**：2958（2014-5-26）；





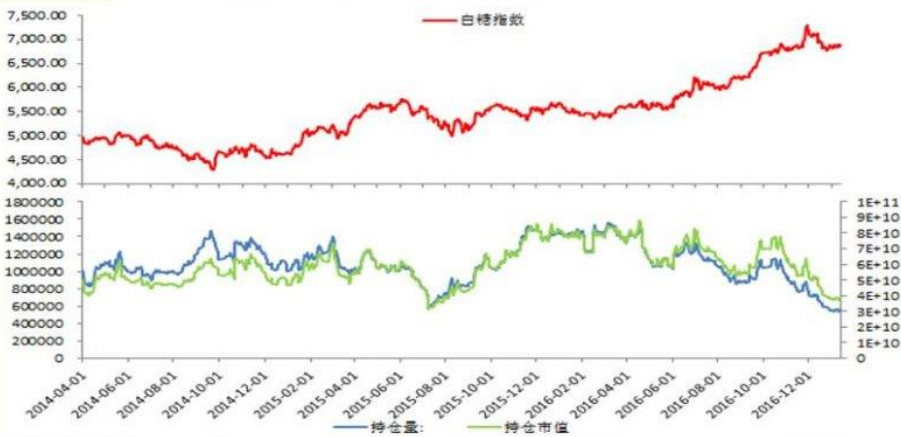
玉米资金变化

- 1月13日：持仓量293万手；持仓市值447亿；指数收盘1523。
- 14年4月以来**最高持仓**：323万（2016-9-26）；**最高市值**：459.8亿（2016-9-23）；**指数最高点**：2529（2015-3-29）；



白糖资金变化

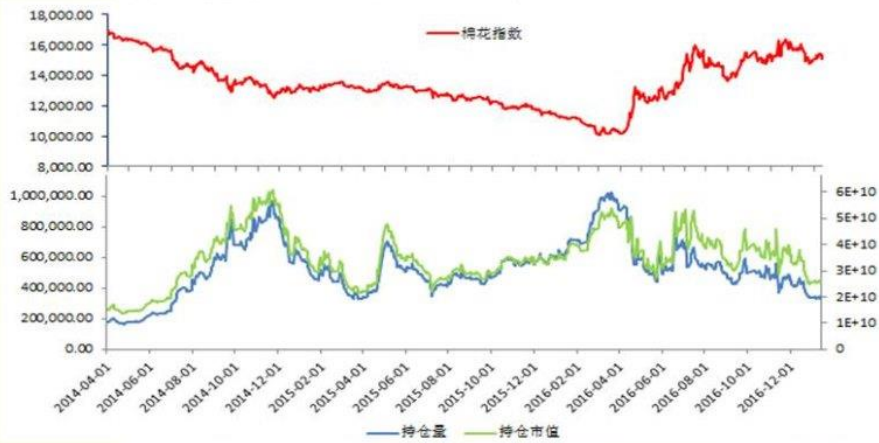
- 1月13日：持仓量56万手；持仓市值385亿；指数收盘6850。
- 14年4月以来**最高持仓**：155.6万（2016-3-7）；**最高市值**：884亿（2016-4-18）；**指数最高点**：7297（2016-11-29）；





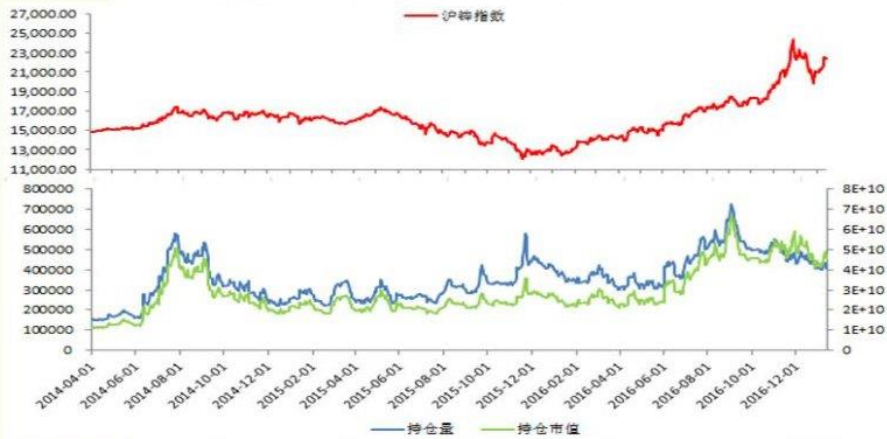
棉花资金变化

- 1月13日：持仓量34万手；持仓市值257亿；指数收盘15075。
- 14年4月以来**最高持仓**：102万（2016-3-21）；**最高市值**：608亿（2014-11-24）；**指数最高点**：16920（2014-4-1）；



锌资金变化

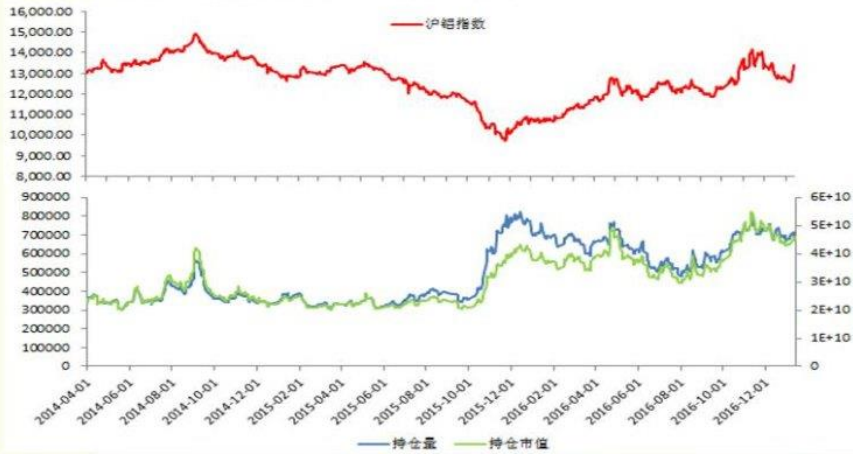
- 1月13日：持仓量40万手；持仓市值454亿；指数收盘22380。
- 14年4月以来**最高持仓**：72.6万（2016-9-2）；**最高市值**：672亿（2016-9-21）；**指数最高点**：24410（2016-11-28）；





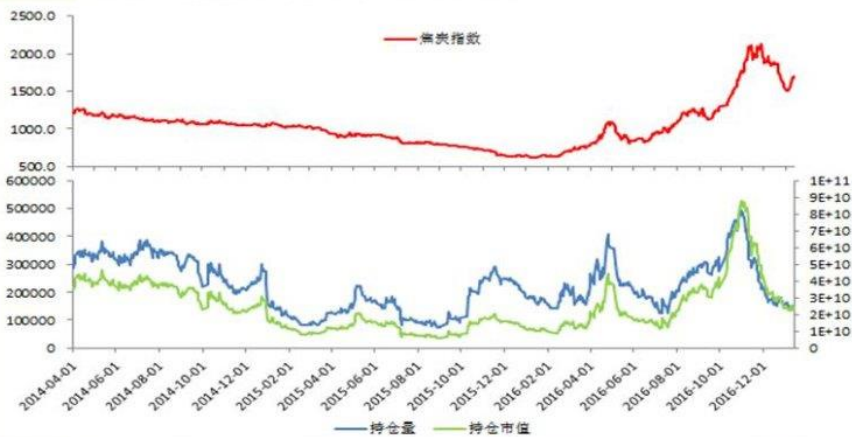
铝资金变化

- 1月13日：持仓量69万手；持仓市值460亿；指数收盘13405。
- 14年4月以来**最高持仓**：82.5万（2015-12-15）；**最高市值**：550.4亿（2016-11-10）；**指数最高点**：14905（2014-9-5）；



焦炭资金变化

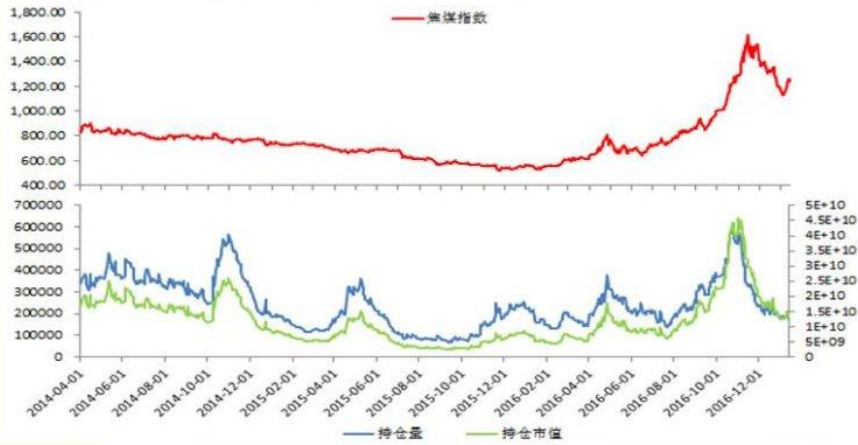
- 1月13日：持仓量14万手；持仓市值234亿；指数收盘1693。
- 14年4月以来**最高持仓**：46万（2016-10-24）；**最高市值**：724亿（2016-10-24）；**指数最高点**：2137（2016-11-28）；





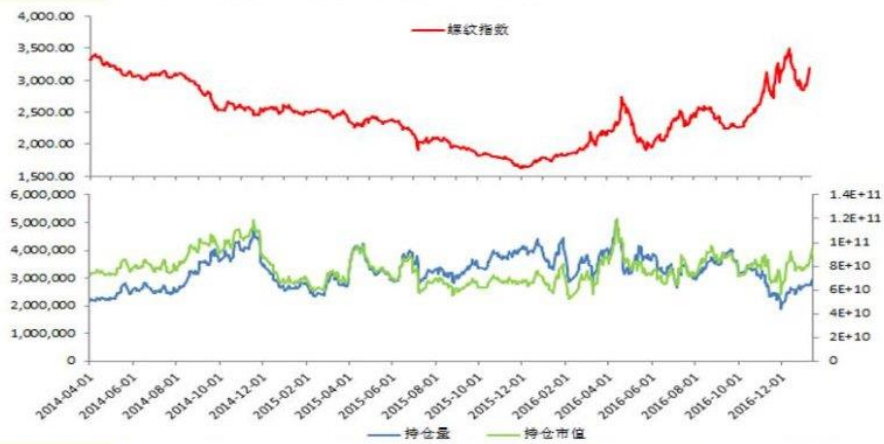
焦煤资金变化

- 1月13日：持仓量17.6万手；持仓市值133亿；指数收盘1258。
- 14年4月以来**最高持仓**：59万（2016-11-1）；**最高市值**：457亿（2016-11-11）；
指数最高点：1610（2016-11-14）；



螺纹钢资金变化

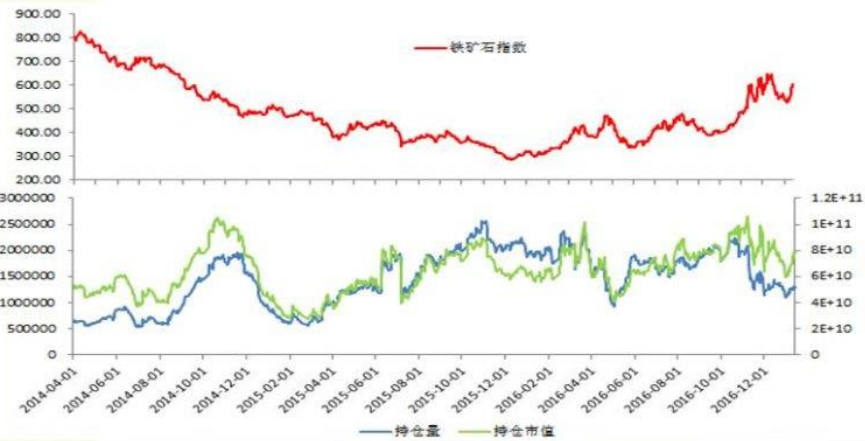
- 1月13日：持仓量284万手；持仓市907值亿；指数收盘3186。
- 14年4月以来**最高持仓**：510万（2016-4-12）；**最高市值**：1197亿（2016-4-12）；
指数最高点：3495（2016-12-14）；





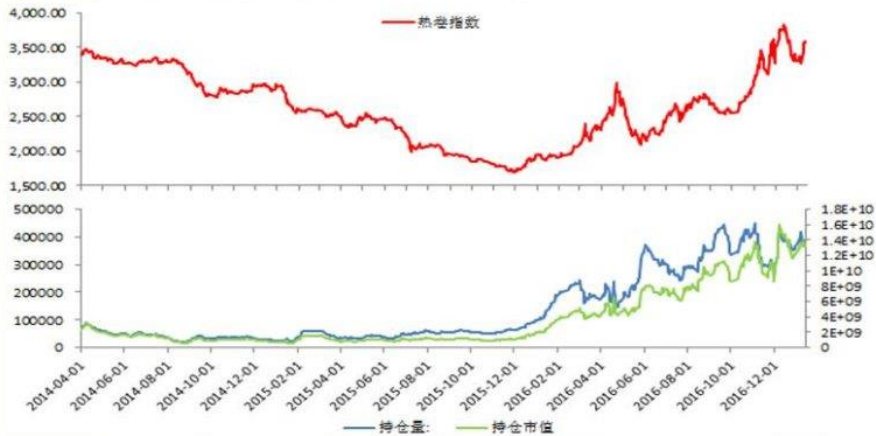
铁矿石资金变化

- 1月13日：持仓量130万手；持仓市值781亿；指数收盘600。
- 14年4月以来**最高持仓**：256.5万（2015-10-29）；**最高市值**：1060亿（2016-11-7）；**指数最高点**：824（2014-4-8）；



热卷资金变化

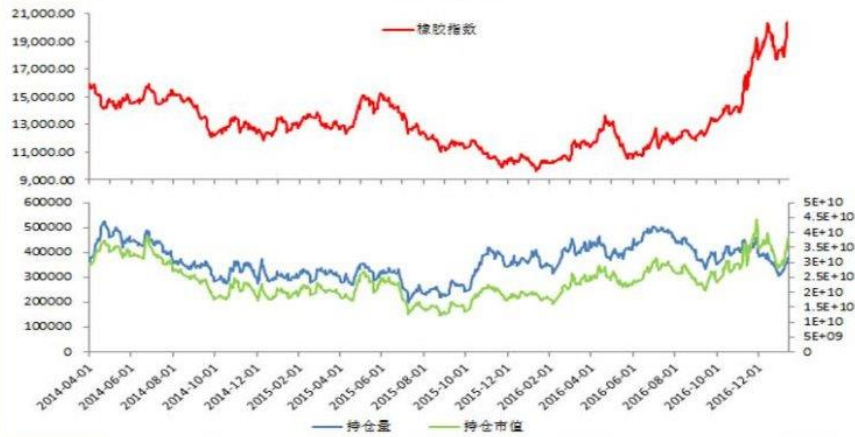
- 1月13日：持仓量37万手；持仓市值133亿；指数收盘3565。
- 14年4月以来**最高持仓**：44.4万（2016-9-21）；**最高市值**：161亿（2016-12-7）；**指数最高点**：3828（2016-12-18）；





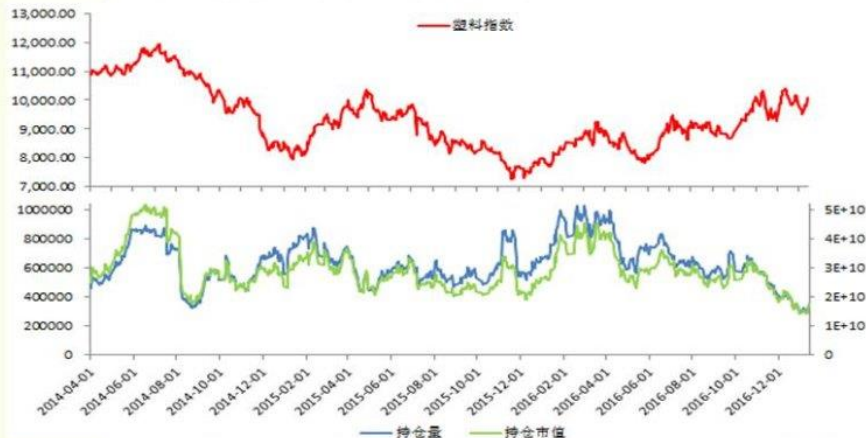
天然橡胶资金变化

- 1月13日：持仓量37万手；持仓市值384亿；指数收盘20360。
- 14年4月以来**最高持仓**：52.6万（2014-4-23）；**最高市值**：442亿（2016-11-28）；**指数最高点**：20360（2017-1-13）；



塑料 (L) 资金变化

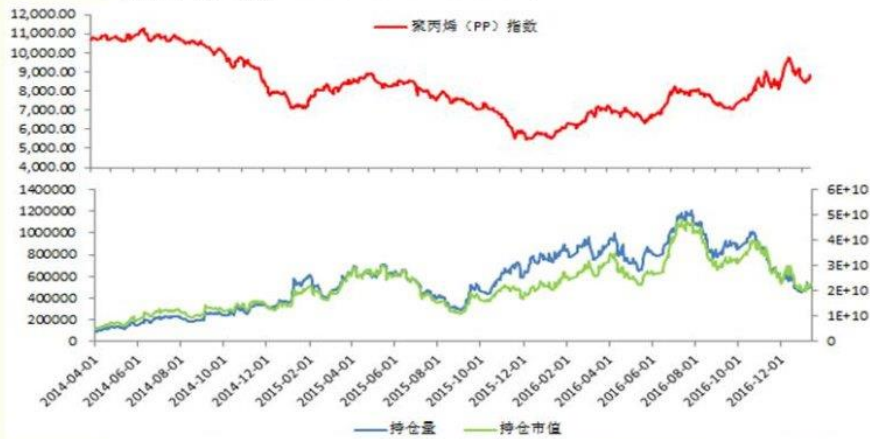
- 1月13日：持仓量35万手；持仓市值175亿；指数收盘10080。
- 14年4月以来**最高持仓**：103万（2016-2-19）；**最高市值**：518亿（2014-6-17）；**指数最高点**：11930（2014-7-7）；





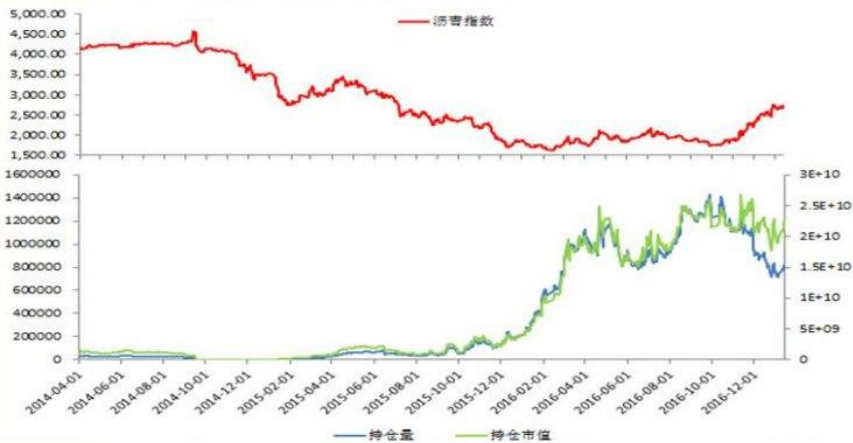
聚丙烯 (PP) 资金变化

- 1月13日：持仓量50万手；持仓市值221亿；指数收盘8865。
- 14年4月以来**最高持仓**：120.8万（2016-7-26）；**最高市值**：480亿（2016-7-12）；**指数最高点**：11263（2014-6-16）；



沥青资金变化

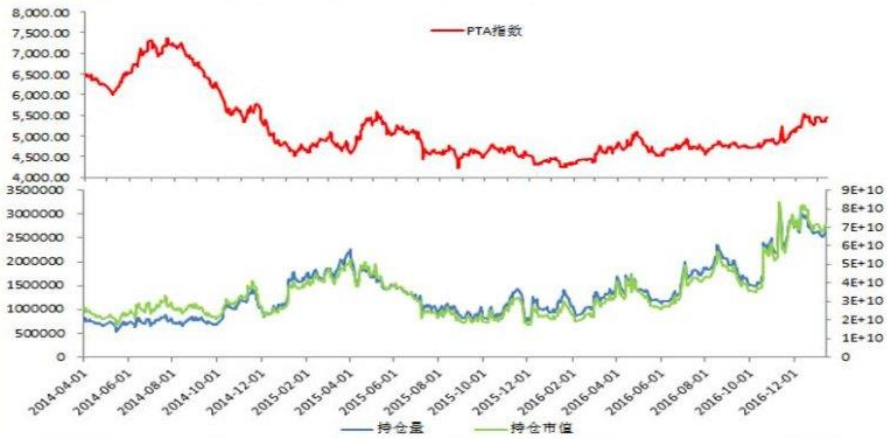
- 1月13日：持仓量82万手；持仓市值225亿；指数收盘2746。
- 14年4月以来**最高持仓**：143万（2016-9-27）；**最高市值**：261亿（2016-11-28）；**指数最高点**：4564（2014-9-12）；





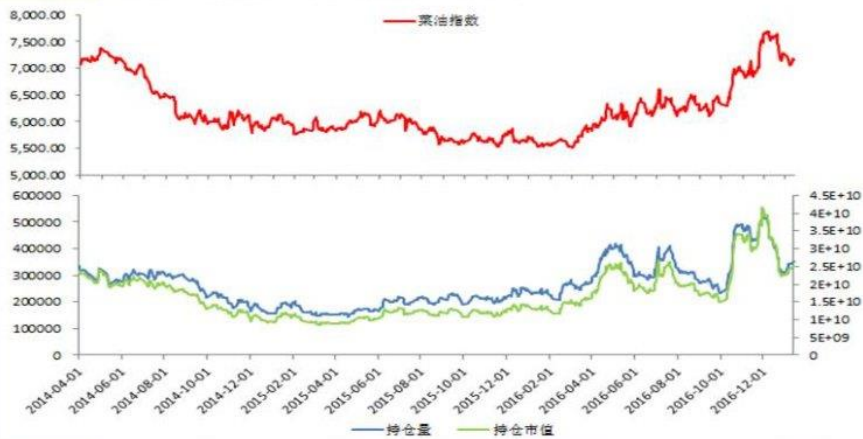
PTA资金变化

- 1月13日：持仓量262万手； 持仓市值716亿； 指数收盘5460。
- 14年4月以来**最高持仓**： 303万（2016-12-9）； **最高市值**： 189亿（2016-12-12）；
指数最高点： 7364（2014-7-22）；



菜籽油资金变化

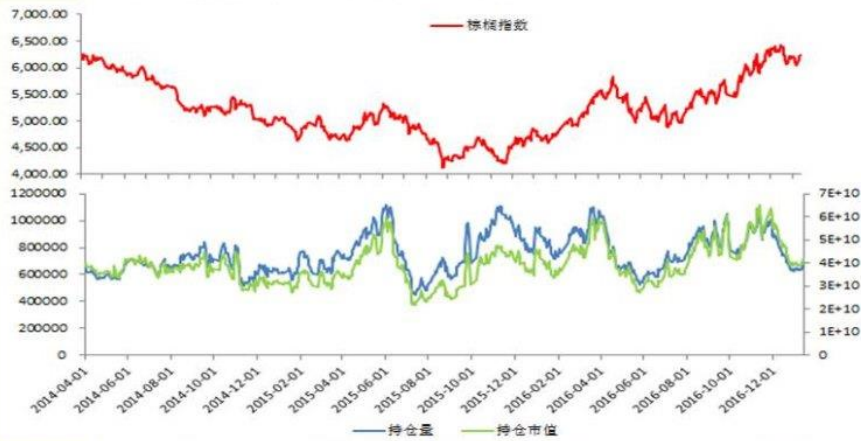
- 1月13日：持仓量35万手； 持仓市值250亿； 指数收盘7156。
- 14年4月以来**最高持仓**： 54.7万（2016-11-30）； **最高市值**： 417亿（2016-11-30）；
指数最高点： 7697（2016-12-7）；





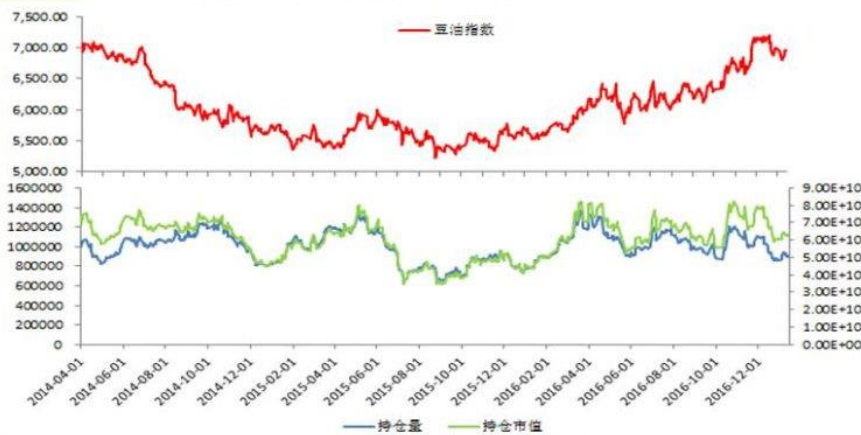
棕榈油资金变化

- 1月13日：持仓量67万手；持仓市值417亿；指数收盘6232。
- 14年4月以来**最高持仓**：112万（2015-6-2）；**最高市值**：651.3亿（2016-11-11）；**指数最高点**：6423（2016-12-15）；



豆油资金变化

- 1月13日：持仓量91万手；持仓市值633亿；指数收盘6952。
- 14年4月以来**最高持仓**：136.7万（2016-3-21）；**最高市值**：823亿（2016-3-21）；**指数最高点**：7192（2016-12-12）；



最后：

- ◎我们是一群打死不退的交易员；
- ◎17年交易经验+4.3亿人民币做资产配置；

- 从台湾到国际市场再到北京；
- 分享与协助是我们成立期权先生的宗旨；
- 关注我们，期权先生与投资者一同成长！

如果您对我们的策略感兴趣，欢迎关注我们的微博、微信公众号，也可以加入我们的投资交流群！



期权先生微信交流群



微信公众号：颜兆阳投资团队