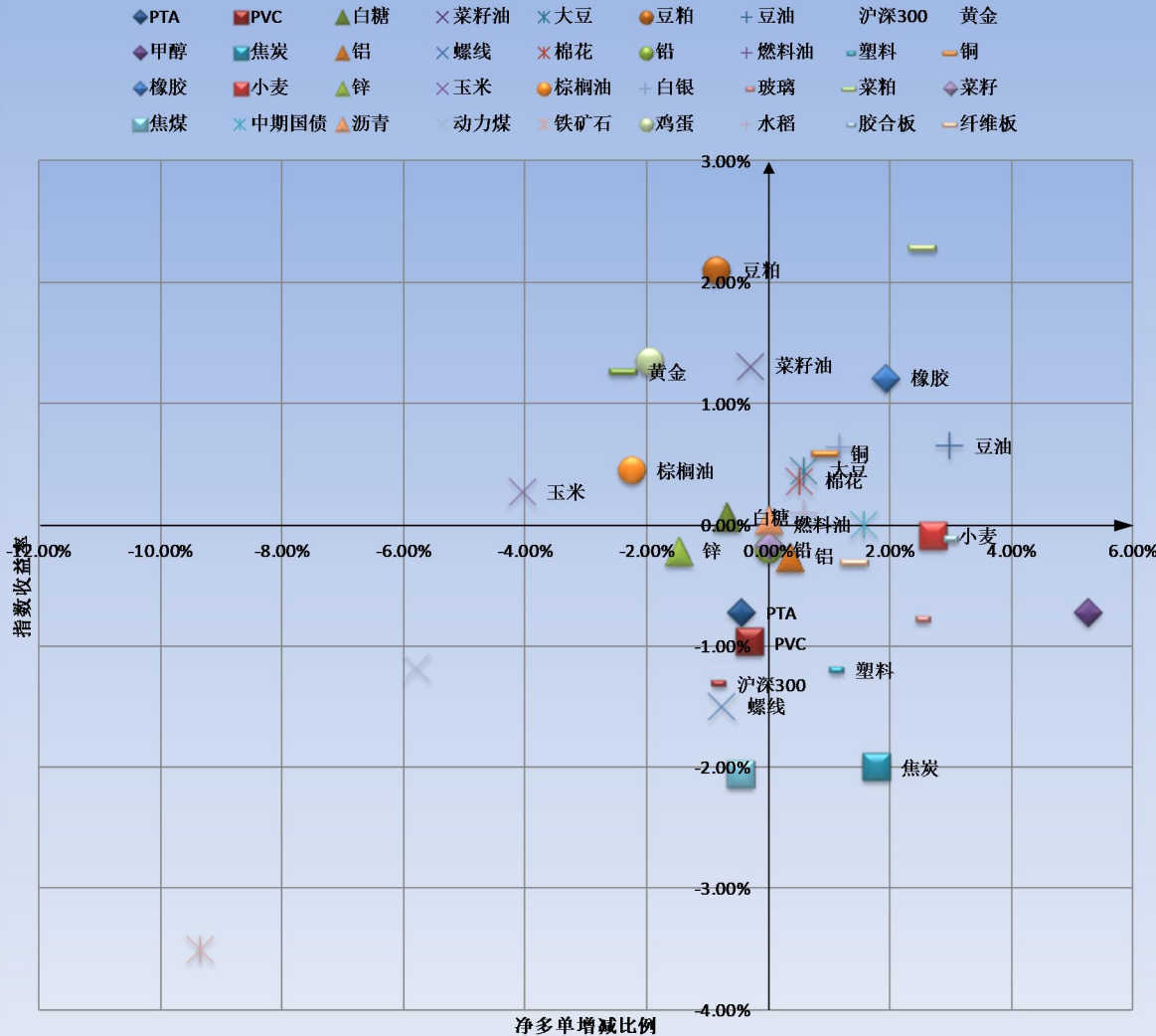


期货市场多空前5名会员持仓统计

净多单变化与指数涨跌



排名	品种	指数收益率	净多单 Chg.%	保证金 Chg.%	持仓量 Chg.%	成交量 Chg.%
1	甲醇	-0.73%	5.25%	-8.03%	-6.95%	-23.22%
2	豆油	0.65%	2.97%	-1.17%	-1.70%	11.03%
3	胶合板	-0.12%	2.91%	-7.36%	-5.85%	18.77%
4	小麦	-0.09%	2.71%	-3.97%	1.63%	65.70%
5	菜粕	2.28%	2.54%	-2.77%	-4.80%	22.10%
6	玻璃	-0.78%	2.44%	6.06%	7.93%	47.49%
7	橡胶	1.21%	1.93%	-0.29%	-1.24%	24.86%
8	焦炭	-2.01%	1.77%	-8.19%	-6.09%	38.42%
9	中期国债	0.01%	1.55%	-5.61%	-5.61%	-11.81%
10	纤维板	-0.32%	1.40%	-5.73%	-4.10%	27.41%
11	白银	0.65%	1.17%	0.06%	-0.58%	-34.86%
12	塑料	-1.20%	1.02%	-4.49%	-2.90%	-40.38%
13	铜	0.58%	0.95%	-1.47%	0.38%	-35.29%
14	大豆	0.45%	0.59%	2.51%	2.58%	-46.19%
15	水稻	0.10%	0.58%	-11.29%	-10.89%	5.33%
16	棉花	0.37%	0.51%	-0.62%	6.07%	168.96%
17	铝	-0.26%	0.36%	-0.60%	0.03%	-30.84%
18	铅	-0.21%	0.00%	-0.73%	0.35%	-37.10%
19	燃料油	0.00%	0.00%	16.15%	0.00%	0.00%
20	菜籽	-0.17%	0.00%	7.61%	7.79%	-15.94%
21	沥青	0.04%	0.00%	0.71%	0.67%	56.11%
22	菜籽油	1.31%	-0.30%	-0.93%	-2.31%	115.96%
23	PVC	-0.97%	-0.31%	5.80%	7.62%	188.18%
24	焦煤	-2.06%	-0.46%	3.11%	5.37%	15.47%
25	PTA	-0.72%	-0.46%	4.18%	-2.25%	30.86%
26	白糖	0.06%	-0.70%	-1.49%	-1.02%	6.35%
27	螺线	-1.50%	-0.77%	1.73%	3.48%	27.67%
28	豆粕	2.10%	-0.85%	-0.45%	-2.98%	10.26%
29	沪深300	-1.32%	-0.92%	3.96%	5.35%	-15.10%
30	锌	-0.21%	-1.49%	-4.02%	-3.84%	-8.79%
31	鸡蛋	1.35%	-1.95%	8.57%	7.17%	45.10%
32	棕榈油	0.44%	-2.25%	0.04%	0.23%	6.69%
33	黄金	1.26%	-2.40%	0.74%	-0.51%	-30.42%
34	玉米	0.27%	-4.06%	-3.14%	-2.64%	-22.15%
35	动力煤	-1.18%	-5.79%	8.42%	10.49%	76.25%
36	铁矿石	-3.50%	-9.37%	1.13%	4.79%	134.98%

日期	2014年4月28日		持仓量	持仓量	成交量	成交量	保证金	保证金	前5多单	前5空单	前5持仓/总持仓	前5净多单	净多单价值	净多单/单边持仓	净多单 Chg.	净多单 Chg.%
品种	指数	收益率	Chg.%	Chg.%	Chg.%	Chg.%	Chg.%	Chg.%								
PTA	6,231	-0.72%	661,248	-2.25%	311,706	30.86%	14.58	-4.18%	121,129	142,234	39.83%	-21,105	-6.58	-6.38%	-1,083	-0.46%
PVC	6,110	-0.97%	39,226	7.62%	13,700	188.18%	0.62	5.80%	8,436	10,455	48.16%	-2,019	-0.61	-10.29%	-199	-0.31%
白糖	4,945	0.06%	1,068,554	-1.02%	627,372	6.35%	32.58	-1.49%	164,214	206,649	34.71%	-42,435	-21.07	-7.94%	-3,332	-0.70%
菜籽油	7,297	1.31%	277,102	-2.31%	168,314	115.96%	10.51	-0.93%	40,717	81,451	44.09%	-40,734	-29.74	-29.40%	536	-0.30%
大豆	4,434	0.45%	424,274	2.58%	171,180	-46.19%	9.60	2.51%	76,835	104,215	42.67%	-27,380	-12.13	-12.91%	524	0.99%
豆粕	3,570	2.10%	2,664,296	-2.98%	1,970,240	10.26%	60.68	-0.45%	436,046	587,527	38.42%	-151,481	-53.44	-11.37%	-7,014	-0.85%
豆油	7,054	0.65%	858,664	-1.70%	553,122	11.03%	30.58	-1.17%	107,634	202,948	36.17%	-95,314	-67.29	-22.20%	14,621	2.97%
沪深300	2,133	-1.32%	277,162	5.35%	1,353,956	-15.10%	212.87	3.96%	46,977	70,513	42.39%	-23,536	-150.27	-16.98%	-2,406	-0.92%
黄金	262.11	1.26%	208,470	-0.51%	251,708	-30.42%	38.25	0.74%	32,987	21,661	26.21%	11,326	29.67	10.87%	-2,571	-2.40%
甲醇	2,733	-0.73%	31,396	-6.95%	45,042	-23.22%	2.70	-8.03%	4,358	5,367	30.98%	-1,009	-1.37	-6.43%	961	5.25%
焦炭	1,183	-2.01%	310,640	-6.09%	738,216	38.42%	32.67	-8.19%	42,657	48,298	29.28%	-5,641	-6.62	-3.63%	3,286	1.77%
铝	13,529	-0.26%	339,200	0.03%	100,058	-30.84%	13.12	-0.60%	53,141	97,148	44.31%	-44,007	-25.23	-25.95%	603	0.36%
螺线	3,233	-1.50%	2,308,022	3.48%	2,088,398	27.67%	45.28	1.73%	308,702	429,679	31.99%	-120,977	-39.06	-10.48%	-12,614	-0.77%
棉花	16,399	0.37%	176,146	6.07%	46,578	168.96%	2.75	-0.62%	35,921	39,353	42.73%	-3,432	-2.24	-3.90%	226	0.51%
铅	13,976	-0.21%	17,242	0.35%	1,404	-37.10%	0.89	-0.73%	0	0	0.00%	0	0.00	0.00%	0	0.00%
燃料油	3,796	0.00%	28	0.00%	0	0.00%	0.01	6.15%	0	0	0.00%	0	0.00	0.00%	0	0.00%
塑料	10,922	-1.20%	521,472	-2.90%	309,740	-40.38%	19.88	-4.49%	89,526	92,078	34.83%	-2,552	-1.14	-0.98%	2,802	1.02%
铜	47,935	0.58%	810,204	0.38%	693,914	-35.29%	192.06	-1.47%	134,817	113,528	30.65%	21,289	44.12	5.25%	3,911	0.95%
橡胶	14,405	1.21%	495,138	-1.24%	1,233,400	24.86%	77.58	-0.29%	56,607	69,361	25.44%	-12,754	-18.82	-5.15%	4,993	1.93%
小麦	2,782	-0.09%	75,956	1.63%	23,814	65.70%	4.09	-3.97%	17,059	18,507	46.82%	-1,448	-0.83	-3.81%	989	2.71%
锌	15,136	-0.21%	169,310	-3.84%	45,200	-8.79%	8.26	-4.02%	29,741	38,931	40.56%	-9,190	-6.70	-10.86%	-946	-1.49%
玉米	2,363	0.27%	304,518	-2.64%	47,452	-22.15%	3.77	-3.14%	71,307	61,116	43.49%	10,191	2.42	6.69%	-6,633	-4.06%
棕榈油	6,212	0.44%	573,334	0.23%	481,756	6.69%	23.73	0.04%	90,228	125,156	37.57%	-34,928	-21.69	-12.18%	-6,512	-2.25%
白银	4,110	0.65%	521,404	-0.58%	1,578,244	-34.86%	25.76	0.06%	63,168	61,545	23.92%	1,623	1.14	0.62%	3,051	1.17%
玻璃	1,217	-0.78%	430,338	7.93%	363,120	47.49%	6.41	6.06%	82,630	74,976	36.62%	7,654	1.88	3.55%	5,425	2.44%
菜粕	2,740	2.28%	1,276,222	-4.80%	2,749,750	22.10%	17.94	-2.77%	182,644	214,099	31.09%	-31,455	-8.30	-4.93%	18,578	2.54%
菜籽	4,798	-0.17%	1,052	7.79%	232	-15.94%	0.03	7.61%	1	1	0.19%	0	0.00	0.00%	0	0.00%
焦煤	830	-2.06%	367,636	5.37%	858,334	15.47%	12.89	3.11%	57,184	57,541	31.21%	-357	-0.09	-0.19%	-817	-0.46%
中期国债	93	0.01%	7,770	-5.61%	1,254	-11.81%	1.44	-5.61%	1,724	2,196	50.45%	-472	-4.37	-12.15%	92	1.55%
沥青	4,201	0.04%	26,428	0.67%	10,672	56.11%	0.67	0.71%	0	0	0.00%	0	0.00	0.00%	0	0.00%
动力煤	533	-1.18%	41,258	10.49%	46,608	76.25%	2.26	8.42%	8,774	8,744	42.46%	30	0.03	0.15%	-1,078	-5.79%
铁矿石	766	-3.50%	599,438	4.79%	992,078	134.98%	32.28	1.13%	105,207	125,443	38.48%	-20,236	-15.27	-6.75%	-27,713	-9.37%
鸡蛋	4,885	1.35%	241,762	7.17%	270,214	45.10%	4.73	8.57%	27,238	22,252	20.47%	4,986	1.21	4.12%	-1,867	-1.95%
水稻	2,373	0.10%	8,724	-10.89%	2,372	5.33%	0.24	-1.29%	629	1,156	20.46%	-527	-0.12	-12.08%	93	0.58%
胶合板	141	-0.12%	66,202	-5.85%	209,754	18.77%	3.50	-7.36%	8,548	9,587	27.39%	-1,039	-0.70	-3.14%	1,086	2.91%
纤维板	63	-0.32%	96,020	-4.10%	129,322	27.41%	2.28	-5.73%	11,631	19,751	32.68%	-8,120	-2.57	-16.91%	1,050	1.40%

**报告编制目的:**

通过主力会员持仓净头寸变动方向与规模,判断市场方向和品种/板块热点,辅助分析行情的持续性。

**相关指标计算公式:**

为了更好地反映持仓变动情况,将强麦、硬麦、普麦合并为小麦;豆一、豆二合并为大豆;螺纹钢、线材合并为螺线;早籼稻、粳稻合并为水稻

保证金(单位:亿元)=各合约结算价×持仓量(股指乘2)×交易所保证金×合约单位

前5多单=当日交易所公布的会员持仓多单前5名多单总和

前5空单=当日交易所公布的会员持仓空单前5名空单总和

前5持仓/总持仓=(前5多单+前5空单)/品种总持仓(双边计算)

前5净多单=前5多单-前5空单

净多单价值=前5净多单×各合约结算价×交易所保证金比例×合约单位

净多单/单边持仓=净多单/品种单边持仓

净多单增减比例=今日净多单/单边持仓-昨日净多单/单边持仓

**报告解读:**

根据相关统计,多空前20名会员持仓总和达到品种持仓总量80%左右,多空前10名会员持仓总和达到品种持仓总量60%以上,期货市场已经相当集中。因此,为了更好地反应市场“主力”的多空方向,统计多空前5名会员持仓及其变动情况;净多单的变动重要性高于其绝对值。同时,净多单价值可以衡量该品种的套保盘规模。

**银河期货研究中心市场监测系列日报:**

- 1、《期货市场资金流向报告》
- 2、《期货市场多空前5名会员持仓统计》
- 3、《期货价格趋势评价报告》
- 4、《商品期货跨品种比价监测报告》
- 5、《商品期货跨期价差监测报告》(1、5价差,5、9价差,9、1价差监测)

**银河期货研究中心市场监测系列周报与月报:**

- 1、《期货市场资金流向(周报)》
- 2、《期货市场行情统计(周报)》
- 3、《全国期货市场成交情况统计(月报)》

**■免责声明■期货市场风险莫测,交易务请谨慎从事**

本报告版权归银河期货研究中心所有。未获得银河期货研究中心书面授权,任何人不得对本报告进行任何形式的发布、复制。本报告基于银河期货研究中心及其研究员认为可信的公开资料,但我公司对这些信息的准确性和完整性均不作任何保证,也不承担任何投资者因使用本报告而产生的任何责任。在银河期货研究中心及其研究员知情的范围内,银河期货研究中心及

分析师：宋 阳

电话：010-58363403

邮箱：songyang@chinastock.com.cn

北京市西城区复兴门外大街 A2 号中化大厦 8 层（100045） / [www.yhqh.com.cn](http://www.yhqh.com.cn)