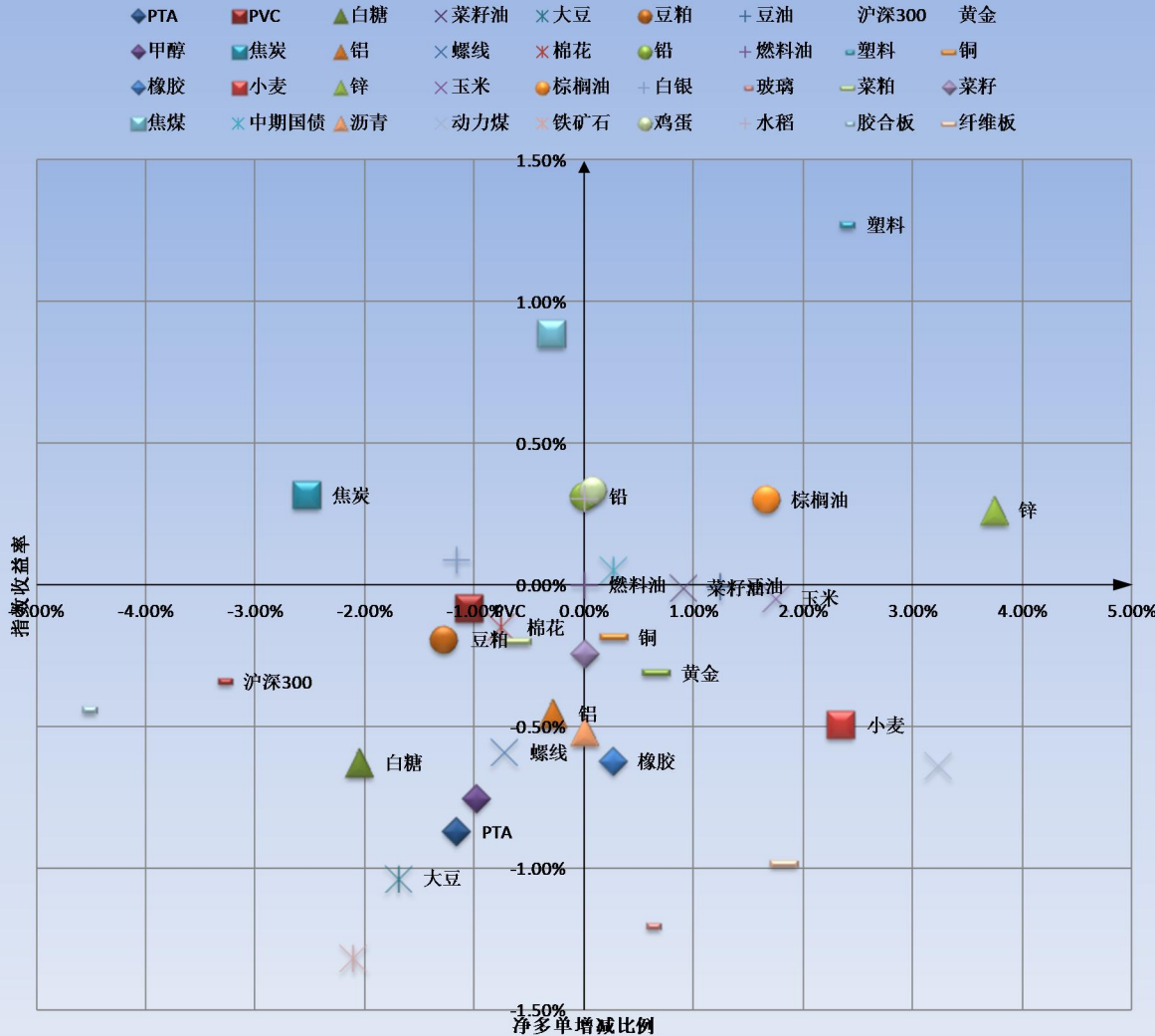


期货市场多空前5名会员持仓统计

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	锌	0.26%	3.74%	1.55%	3.39%	9.96%
2	动力煤	-0.64%	3.23%	-1.65%	-1.06%	-6.50%
3	塑料	1.27%	2.35%	5.77%	4.99%	29.51%
4	小麦	-0.49%	2.35%	-4.67%	-2.73%	257.63%
5	纤维板	-0.98%	1.83%	-9.23%	-8.10%	-30.28%
6	玉米	-0.05%	1.74%	-1.57%	-0.11%	-56.95%
7	棕榈油	0.30%	1.66%	-2.63%	-2.39%	-0.04%
8	豆油	0.00%	1.24%	1.66%	1.71%	-23.05%
9	菜籽油	-0.01%	0.89%	-0.44%	0.26%	-40.84%
10	黄金	-0.31%	0.66%	-2.54%	-1.68%	-18.82%
11	玻璃	-1.21%	0.58%	11.75%	13.15%	63.29%
12	铜	-0.19%	0.27%	-3.05%	1.04%	-2.26%
13	中期国债	0.05%	0.27%	3.26%	3.21%	-38.38%
14	橡胶	-0.62%	0.25%	0.03%	1.07%	15.94%
15	鸡蛋	0.33%	0.09%	4.88%	4.54%	52.61%
16	水稻	0.30%	0.00%	1.19%	0.63%	-28.13%
17	铅	0.31%	0.00%	0.81%	1.02%	-28.81%
18	燃料油	0.00%	0.00%	0.00%	0.00%	0.00%
19	菜籽	-0.24%	0.00%	2.19%	2.44%	-55.29%
20	沥青	-0.52%	0.00%	-0.36%	0.60%	-12.71%
21	铝	-0.46%	-0.28%	0.40%	2.19%	5.92%
22	焦煤	0.89%	-0.30%	8.74%	8.69%	103.80%
23	菜粕	-0.20%	-0.61%	3.44%	3.67%	-13.59%
24	螺线	-0.59%	-0.73%	1.75%	2.60%	70.78%
25	棉花	-0.15%	-0.76%	1.53%	0.51%	-39.92%
26	甲醇	-0.76%	-0.99%	0.17%	0.93%	3.75%
27	PVC	-0.09%	-1.05%	0.85%	1.39%	-20.01%
28	PTA	-0.87%	-1.17%	-0.33%	1.04%	42.00%
29	白银	0.09%	-1.18%	-2.85%	-2.35%	-15.52%
30	豆粕	-0.19%	-1.27%	0.82%	1.00%	-23.15%
31	大豆	-1.04%	-1.70%	0.59%	1.65%	-46.68%
32	白糖	-0.63%	-2.06%	-5.79%	-5.23%	-24.55%
33	铁矿石	-1.32%	-2.11%	-0.68%	0.53%	80.02%
34	焦炭	0.32%	-2.53%	28.26%	2.20%	40.86%
35	沪深300	-0.34%	-3.33%	1.42%	1.77%	-9.33%
36	胶合板	-0.44%	-4.57%	-9.08%	-8.83%	31.55%

日期	2014年5月7日		持仓量	持仓量 Chg.%	成交量	成交量 Chg.%	保证金	保证金 Chg.%	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														
PTA	6,036	-0.87%	741,938	1.04%	489,524	42.00%	16.28	-0.33%	127,279	146,355	36.88%	-19,076	-5.77	-5.14%	-4,487	-1.17%
PVC	6,094	-0.09%	40,760	1.39%	7,330	-20.01%	0.65	0.85%	8,691	11,009	48.33%	-2,318	-0.71	-11.37%	-242	-1.05%
白糖	4,830	-0.63%	1,060,512	-5.23%	665,846	-24.55%	31.37	-5.79%	163,152	199,425	34.19%	-36,273	-17.43	-6.84%	-9,507	-2.06%
菜籽油	7,309	-0.01%	309,652	0.26%	96,726	-40.84%	11.71	-0.44%	48,026	86,185	43.34%	-38,159	-27.82	-24.65%	1,284	0.89%
大豆	4,342	-1.04%	496,574	1.65%	187,044	-46.68%	10.96	0.59%	80,845	118,854	40.22%	-38,009	-16.57	-15.31%	-4,772	-1.70%
豆粕	3,511	-0.19%	2,626,446	1.00%	1,003,706	-23.15%	59.41	0.82%	434,232	627,214	40.41%	-192,982	-67.14	-14.70%	-18,441	-1.27%
豆油	6,869	0.00%	870,494	1.71%	312,922	-23.05%	30.31	1.66%	110,058	207,431	36.47%	-97,373	-67.00	-22.37%	3,671	1.24%
沪深300	2,132	-0.34%	289,140	1.77%	1,234,320	-9.33%	221.92	1.42%	46,267	72,389	41.04%	-26,122	-166.81	-18.07%	-5,191	-3.33%
黄金	263.39	-0.31%	196,818	-1.68%	120,964	-18.82%	43.30	-2.54%	28,932	18,940	24.32%	9,992	26.31	10.15%	485	0.66%
甲醇	2,657	-0.76%	39,974	0.93%	59,320	3.75%	3.30	0.17%	5,198	5,151	25.89%	47	0.06	0.24%	-196	-0.99%
焦炭	1,188	0.32%	344,124	2.20%	699,812	40.86%	35.07	28.26%	49,803	53,556	30.04%	-3,753	-4.47	-2.18%	-4,344	-2.53%
铝	13,126	-0.46%	348,682	2.19%	70,176	5.92%	16.70	0.40%	56,621	100,614	45.09%	-43,993	-24.46	-25.23%	-1,416	-0.28%
螺线	3,210	-0.59%	2,315,746	2.60%	2,721,230	70.78%	44.91	1.75%	305,261	421,197	31.37%	-115,936	-37.20	-10.01%	-11,167	-0.73%
棉花	16,280	-0.15%	179,750	0.51%	17,320	-39.92%	2.81	1.53%	34,820	39,034	41.09%	-4,214	-4.29	-4.69%	-700	-0.76%
铅	13,936	0.31%	18,008	1.02%	1,542	-28.81%	1.30	0.81%	0	0	0.00%	0	0.00	0.00%	0	0.00%
燃料油	3,914	0.00%	18	0.00%	0	0.00%	0.00	0.00%	0	0	0.00%	0	0.00	0.00%	0	0.00%
塑料	11,142	1.27%	643,992	4.99%	621,774	29.51%	23.80	5.77%	122,373	110,569	36.17%	11,804	6.68	3.67%	7,760	2.35%
铜	47,366	-0.19%	814,684	1.04%	394,166	-2.26%	193.63	-3.05%	136,686	110,738	30.37%	25,948	58.57	6.37%	1,357	0.27%
橡胶	14,311	-0.62%	487,896	1.07%	762,726	15.94%	76.07	0.03%	53,472	70,503	25.41%	-17,031	-24.70	-6.98%	432	0.25%
小麦	2,775	-0.49%	77,426	-2.73%	25,184	257.63%	4.60	-4.67%	16,932	19,000	46.41%	-2,068	-1.22	-5.34%	992	2.35%
锌	15,143	0.26%	176,114	3.39%	43,878	9.96%	9.81	1.55%	38,244	38,757	43.72%	-513	-0.14	-0.58%	3,169	3.74%
玉米	2,367	-0.05%	285,944	-0.11%	25,608	-56.95%	3.51	-1.57%	67,162	55,634	42.94%	11,528	2.74	8.06%	2,478	1.74%
棕榈油	6,029	0.30%	585,758	-2.39%	361,906	-0.04%	24.13	-2.63%	100,097	113,209	36.42%	-13,112	-7.87	-4.48%	5,300	1.66%
白银	4,111	0.09%	483,502	-2.35%	579,840	-15.52%	27.29	-2.85%	59,399	63,851	25.49%	-4,452	-2.62	-1.84%	-2,803	-1.18%
玻璃	1,210	-1.21%	491,120	13.15%	429,392	63.29%	7.15	11.75%	86,211	82,871	34.43%	3,340	0.82	1.36%	1,646	0.58%
菜粕	2,758	-0.20%	1,489,050	3.67%	1,815,732	-13.59%	21.00	3.44%	191,923	252,260	29.83%	-60,337	-16.36	-8.10%	-6,481	-0.61%
菜籽	4,920	-0.24%	2,186	2.44%	304	-55.29%	0.05	2.19%	1	1	0.09%	0	0.00	0.00%	0	0.00%
焦煤	850	0.89%	396,004	8.69%	1,138,356	103.80%	13.76	8.74%	64,710	72,858	34.74%	-8,148	-4.08	-4.12%	-1,197	-0.30%
中期国债	93	0.05%	8,304	3.21%	2,074	-38.38%	1.55	3.26%	1,838	1,957	45.70%	-119	-1.11	-2.87%	7	0.27%
沥青	4,216	-0.52%	24,230	0.60%	4,836	-12.71%	0.88	-0.36%	0	0	0.00%	0	0.00	0.00%	0	0.00%
动力煤	527	-0.64%	53,736	-1.06%	37,320	-6.50%	2.86	-1.65%	9,924	8,565	34.41%	1,359	1.43	5.06%	862	3.23%
铁矿石	756	-1.32%	637,794	0.53%	766,378	80.02%	24.71	-0.68%	113,007	107,044	34.50%	5,963	4.74	1.87%	-6,652	-2.11%
鸡蛋	4,979	0.33%	307,700	4.54%	363,980	52.61%	6.13	4.88%	34,731	28,498	20.55%	6,233	1.49	4.05%	400	0.09%
水稻	2,380	0.30%	7,646	0.63%	1,068	-28.13%	0.21	1.19%	673	677	17.66%	-4	0.00	-0.10%	0	0.00%
胶合板	144	-0.44%	101,108	-8.83%	369,048	31.55%	5.12	-9.08%	10,149	12,792	22.69%	-2,643	-1.90	-5.23%	-2,279	-4.57%
纤维板	63	-0.98%	81,788	-8.10%	95,562	-30.28%	1.87	-9.23%	10,395	11,637	26.94%	-1,242	-0.39	-3.04%	923	1.83%

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