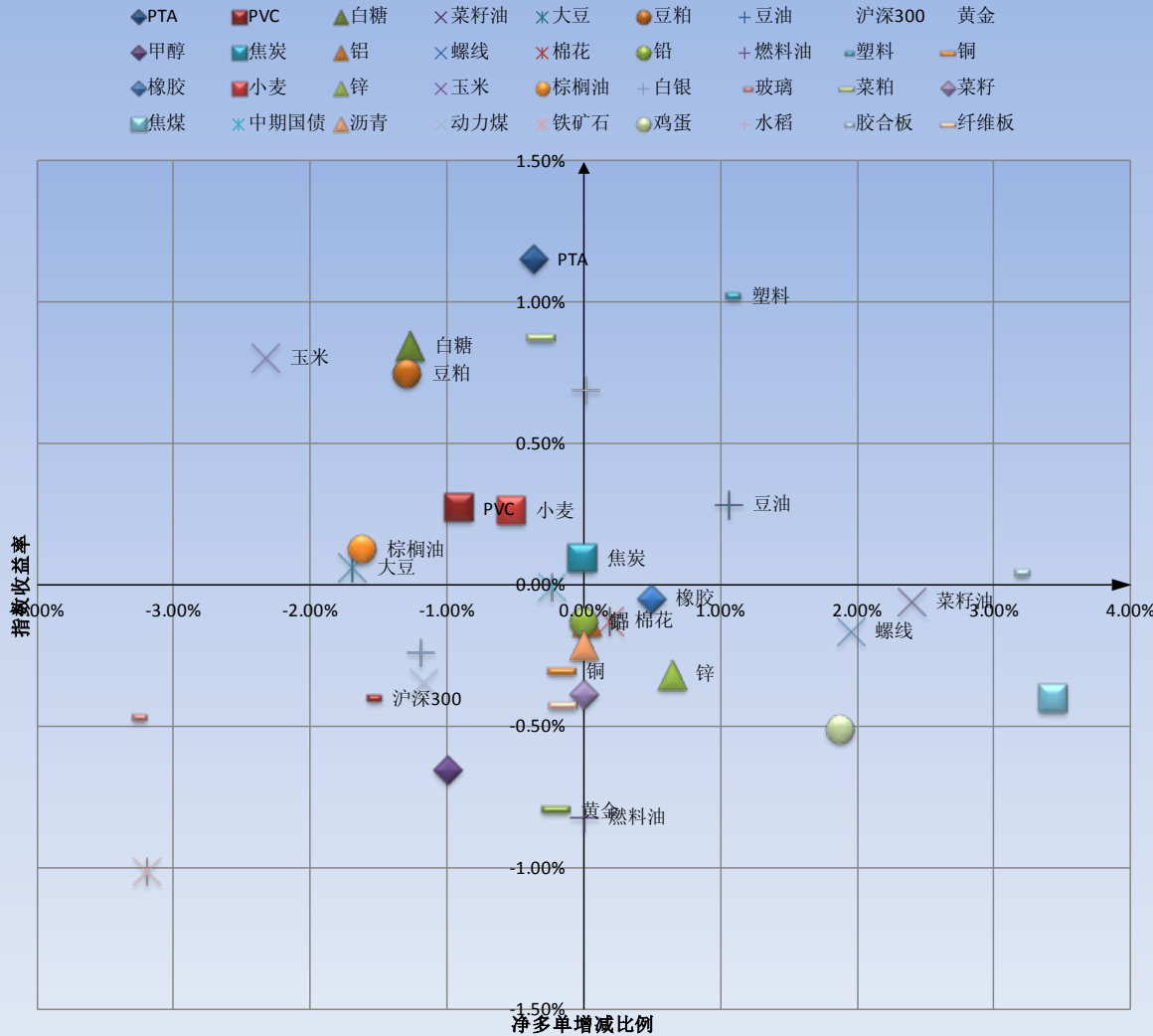


期货市场多空前5名会员持仓统计

净多单变化与指数涨跌



排名	品种	净多单变动百分比 收益率	净多单 Chg.%	保证金 Chg.%	持仓量 Chg.%	成交量 Chg.%
1	焦煤	-0.40%	3.43%	-2.67%	-2.43%	-14.78%
2	胶合板	0.04%	3.16%	-1.01%	-1.04%	9.87%
3	菜籽油	-0.06%	2.40%	-1.67%	-1.61%	-39.95%
4	螺线	-0.16%	1.95%	-1.64%	-1.48%	-29.74%
5	鸡蛋	-0.51%	1.87%	-2.58%	-2.08%	-32.43%
6	豆油	0.29%	1.05%	0.95%	0.66%	-33.40%
7	塑料	1.02%	1.04%	-10.94%	5.17%	93.60%
8	锌	-0.31%	0.64%	-4.60%	-3.92%	139.23%
9	橡胶	-0.05%	0.49%	8.30%	2.63%	16.79%
10	棉花	-0.13%	0.19%	-0.55%	0.33%	-53.43%
11	铝	-0.13%	0.02%	-1.85%	-1.30%	-9.28%
12	水稻	0.69%	0.01%	0.16%	-0.48%	-60.32%
13	铅	-0.13%	0.00%	1.83%	2.34%	-9.51%
14	燃料油	-0.82%	0.00%	-0.74%	0.00%	15.38%
15	菜籽	-0.38%	0.00%	-0.29%	0.09%	53.19%
16	沥青	-0.21%	0.00%	6.37%	8.08%	-5.35%
17	焦炭	0.09%	-0.01%	-2.80%	-2.91%	-12.37%
18	纤维板	-0.43%	-0.15%	6.35%	6.81%	-6.28%
19	铜	-0.31%	-0.16%	-0.86%	-0.27%	14.08%
20	黄金	-0.80%	-0.20%	5.89%	7.24%	-21.55%
21	中期国债	-0.01%	-0.24%	-0.30%	0.21%	2.11%
22	菜粕	0.88%	-0.32%	1.45%	0.57%	-26.13%
23	PTA	1.16%	-0.37%	7.05%	5.84%	37.16%
24	小麦	0.26%	-0.53%	1.80%	1.54%	61.91%
25	PVC	0.27%	-0.91%	3.88%	3.60%	-22.86%
26	甲醇	-0.65%	-1.00%	-4.17%	-3.54%	-44.28%
27	动力煤	-0.35%	-1.18%	1.98%	2.33%	-18.38%
28	白银	-0.24%	-1.19%	0.59%	1.73%	-2.63%
29	白糖	0.85%	-1.27%	2.00%	1.14%	-24.11%
30	豆粕	0.75%	-1.29%	3.87%	3.09%	-34.88%
31	沪深300	-0.40%	-1.57%	-0.33%	0.08%	-30.95%
32	棕榈油	0.13%	-1.62%	-2.19%	-1.82%	-29.11%
33	大豆	0.06%	-1.69%	-1.12%	-1.18%	-53.62%
34	玉米	0.80%	-2.33%	7.91%	7.05%	491.26%
35	铁矿石	-1.01%	-3.20%	5.21%	6.30%	6.69%
36	玻璃	-0.47%	-3.80%	1.24%	1.73%	-2.14%

日期	2014年5月29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	6,549	1.16%	716,238	5.84%	849,068	37.16%	14.08	7.05%	116,627	118,515	32.83%	-1,888	-0.59	-0.53%	-1,341	-0.37%
PVC	6,156	0.27%	34,790	3.60%	13,754	-22.86%	0.54	3.88%	7,016	10,557	50.51%	-3,541	-1.09	-20.36%	-276	-0.91%
白糖	5,000	0.85%	1,076,684	1.14%	581,982	-24.11%	32.30	2.00%	164,955	225,013	36.22%	-60,058	-29.83	-11.16%	-7,460	-1.27%
菜籽油	7,161	-0.06%	277,796	-1.61%	55,142	-39.95%	9.95	-1.67%	49,018	81,203	46.88%	-32,185	-22.74	-23.17%	3,909	2.40%
大豆	4,629	0.06%	754,842	-1.18%	447,692	-53.62%	17.47	-1.12%	117,498	164,952	37.42%	-47,454	-21.89	-12.57%	-5,901	-1.69%
豆粕	3,699	0.75%	2,632,484	3.09%	1,516,820	-34.88%	48.68	3.87%	428,023	594,732	38.85%	-166,709	-60.94	-12.67%	-21,490	-1.29%
豆油	6,869	0.29%	950,720	0.66%	302,614	-33.40%	32.65	0.95%	128,809	238,102	38.59%	-109,293	-75.15	-22.99%	4,256	1.05%
沪深300	2,152	-0.40%	324,188	0.08%	1,188,386	-30.95%	251.19	-0.33%	50,567	83,712	41.42%	-33,145	-213.92	-20.45%	-2,576	-1.57%
黄金	254.13	-0.80%	238,954	7.24%	227,336	-21.55%	43.54	5.89%	32,949	19,085	21.78%	13,864	35.22	11.60%	710	-0.20%
甲醇	2,616	-0.65%	49,002	-3.54%	37,956	-44.28%	3.84	-4.17%	5,140	6,814	24.39%	-1,674	-2.18	-6.83%	-192	-1.00%
焦炭	1,175	0.09%	314,810	-2.91%	677,780	-12.37%	24.75	2.80%	40,172	54,209	29.98%	-14,037	-16.54	-8.92%	402	-0.01%
铝	13,437	-0.13%	330,826	-1.30%	99,540	-9.28%	12.59	-1.85%	57,997	103,065	48.68%	-45,068	-24.05	-27.25%	627	0.02%
螺线	3,115	-0.16%	2,444,816	-1.48%	1,725,658	-29.74%	45.70	-1.64%	281,300	447,579	29.81%	-166,279	-51.80	-13.60%	26,647	1.95%
棉花	15,973	-0.13%	215,842	0.33%	18,300	-53.43%	2.96	-0.55%	36,036	38,479	34.52%	-2,443	-3.97	-2.16%	196	0.19%
铅	14,016	-0.13%	15,654	2.34%	2,036	-9.51%	0.75	1.83%	0	0	0.00%	0	0.00	0.00%	0	0.00%
燃料油	3,880	-0.82%	28	0.00%	2	15.38%	0.00	-0.74%	0	0	0.00%	0	0.00	0.00%	0	0.00%
塑料	11,133	1.02%	863,156	5.17%	599,576	93.60%	29.97	-10.94%	148,770	161,800	35.98%	-13,030	-7.28	-3.02%	3,644	1.04%
铜	48,796	-0.31%	766,510	-0.27%	437,938	14.08%	143.56	-0.86%	137,360	102,867	31.34%	34,493	80.27	9.00%	-705	-0.16%
橡胶	14,820	-0.05%	460,762	2.63%	800,218	16.79%	76.88	8.30%	47,166	64,401	24.21%	-17,235	-26.29	-7.48%	654	0.49%
小麦	2,603	0.26%	57,352	1.54%	10,022	61.91%	1.49	1.80%	9,554	9,890	33.90%	-336	-0.17	-1.17%	-156	-0.53%
锌	15,182	-0.31%	165,588	-3.92%	58,400	139.23%	7.92	-4.60%	31,427	34,081	39.56%	-2,654	-0.99	-3.21%	661	0.64%
玉米	2,380	0.80%	325,510	7.05%	181,362	491.26%	3.87	7.91%	79,404	63,414	43.88%	15,990	3.80	9.82%	-2,484	-2.33%
棕榈油	5,985	0.13%	665,990	-1.82%	330,940	-29.11%	24.86	-2.19%	130,960	165,527	44.52%	-34,567	-20.64	-10.38%	-4,849	-1.62%
白银	4,066	-0.24%	584,376	1.73%	1,012,202	-2.63%	29.68	0.59%	75,825	69,443	24.86%	6,382	4.38	2.18%	-3,313	-1.19%
玻璃	1,137	-0.47%	524,294	1.73%	369,506	-2.14%	7.16	1.24%	62,162	88,449	28.73%	-26,287	-5.91	-10.03%	-8,957	-3.30%
菜粕	2,883	0.88%	1,596,230	0.57%	2,782,410	-26.13%	23.01	1.45%	210,724	249,389	28.82%	-38,665	-10.17	-4.84%	-2,735	-0.32%
菜籽	4,908	-0.38%	2,142	0.09%	432	53.19%	0.05	-0.29%	1	1	0.09%	0	0.00	0.00%	0	0.00%
焦煤	830	-0.40%	370,192	-2.43%	614,198	-14.78%	12.23	-2.67%	62,986	69,917	35.90%	-6,931	-3.35	-3.74%	6,676	3.43%
中期国债	94	-0.01%	13,574	0.21%	7,164	2.11%	2.70	-0.30%	225	201	3.14%	24	0.23	0.35%	-16	-0.24%
沥青	4,153	-0.21%	30,118	8.08%	6,190	-5.35%	0.88	6.37%	0	0	0.00%	0	0.00	0.00%	0	0.00%
动力煤	518	-0.35%	64,860	2.33%	17,768	-18.38%	3.36	1.98%	12,986	11,121	37.17%	1,865	1.92	5.75%	-331	-1.18%
铁矿石	700	-1.01%	777,470	6.30%	875,632	6.69%	27.26	5.21%	123,552	155,208	35.85%	-31,656	-22.17	-8.14%	-13,570	-3.20%
鸡蛋	4,943	-0.51%	329,754	-2.08%	386,238	-32.43%	6.52	-2.58%	35,346	34,717	21.25%	629	0.15	0.38%	3,139	1.87%
水稻	2,338	0.69%	9,916	-0.48%	1,772	-60.32%	0.24	0.16%	517	795	13.23%	-278	-0.06	-5.61%	2	0.01%
胶合板	136	0.04%	66,038	-1.04%	183,208	9.87%	3.15	-1.01%	10,572	7,671	27.63%	2,901	1.99	8.79%	1,025	3.16%
纤维板	59	-0.43%	153,466	6.81%	100,394	-6.28%	3.18	6.35%	22,308	25,572	31.20%	-3,264	-0.96	-4.25%	-319	-0.15%

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)》

■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

3、《全国期货市场成交情况统计（月报）》

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