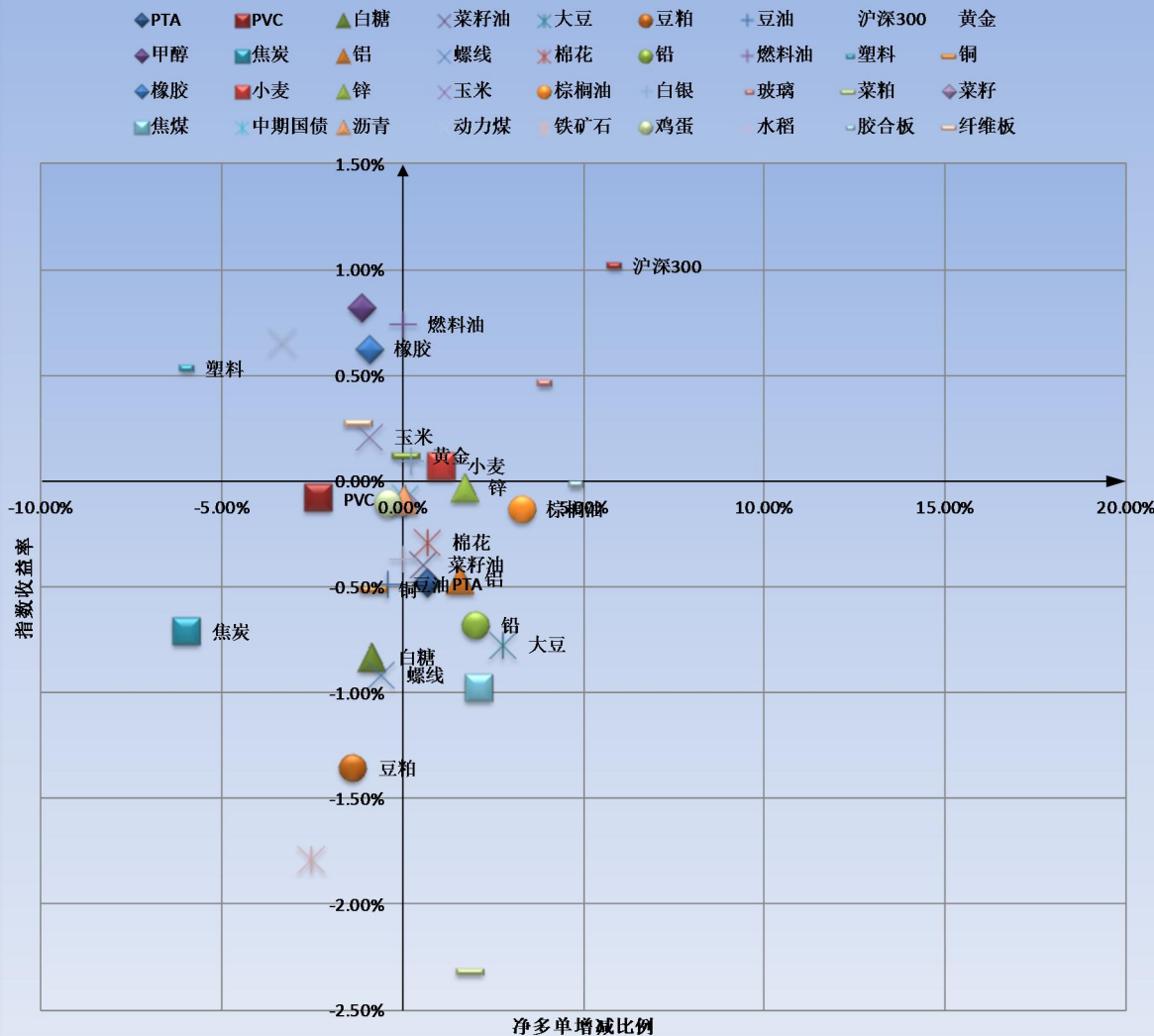


期货市场多空前5名会员持仓统计

净多单变化与指数涨跌



排名	品种	净多单变动百分比 Chg.%	指数收益率 Chg.%	净多单 Chg.%	保证金 Chg.%	持仓量 Chg.%	成交量 Chg.%
1	沪深300	1.02%	5.68%	5.59%	4.53%	-5.43%	
2	胶合板	-0.02%	4.61%	8.08%	8.30%	52.65%	
3	玻璃	0.46%	3.75%	2.80%	2.49%	-14.02%	
4	棕榈油	-0.13%	3.28%	2.35%	2.57%	-9.15%	
5	大豆	-0.77%	2.77%	-5.14%	-2.74%	15.17%	
6	焦煤	-0.98%	2.08%	-11.49%	-10.87%	66.86%	
7	铅	-0.68%	2.04%	-1.71%	0.38%	-31.67%	
8	菜粕	-2.32%	1.86%	-3.21%	0.38%	35.18%	
9	锌	-0.03%	1.70%	-4.97%	7.41%	-15.07%	
10	铝	-0.46%	1.59%	0.09%	1.25%	-31.55%	
11	小麦	0.07%	1.09%	-1.73%	-1.51%	47.63%	
12	棉花	-0.29%	0.67%	0.39%	4.21%	-25.57%	
13	PTA	-0.48%	0.65%	-0.52%	0.11%	-17.49%	
14	菜籽油	-0.39%	0.55%	-1.07%	-1.01%	-2.10%	
15	白银	0.10%	0.21%	1.28%	1.20%	-51.58%	
16	黄金	0.12%	0.11%	-1.06%	-1.18%	-38.81%	
17	中期国债	-0.08%	0.05%	1.55%	2.12%	-29.87%	
18	燃料油	0.74%	0.00%	34.32%	33.33%	240.00%	
19	菜籽	-0.10%	0.00%	-0.27%	-0.55%	8.00%	
20	水稻	-0.37%	0.00%	-0.93%	2.63%	-61.04%	
21	沥青	-0.08%	0.00%	-4.69%	-4.54%	-41.82%	
22	鸡蛋	-0.11%	-0.41%	-5.74%	-5.63%	-27.22%	
23	豆油	-0.49%	-0.44%	-3.06%	-2.23%	-1.13%	
24	螺线	-0.91%	-0.60%	-1.77%	-0.76%	1.11%	
25	铜	-0.51%	-0.80%	-1.83%	-0.05%	0.02%	
26	白糖	-0.83%	-0.84%	-0.56%	0.30%	-27.48%	
27	玉米	0.21%	-0.93%	0.57%	0.36%	42.68%	
28	橡胶	0.63%	-0.95%	-2.93%	-3.47%	-21.47%	
29	甲醇	0.82%	-1.13%	4.08%	12.12%	-9.02%	
30	纤维板	0.27%	-1.21%	-2.99%	-3.01%	26.38%	
31	豆粕	-1.36%	-1.37%	3.24%	4.84%	75.20%	
32	PVC	-0.08%	-2.32%	-1.70%	-1.68%	-40.04%	
33	铁矿石	-1.79%	-2.53%	-7.25%	-5.61%	-16.65%	
34	动力煤	0.67%	-3.37%	3.22%	2.83%	112.40%	
35	焦炭	-0.71%	-5.96%	-4.52%	-3.56%	28.68%	
36	塑料	0.53%	-6.15%	4.38%	4.52%	16.82%	

品种	2014年9月4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.%
	指数	收益率														
PTA	6,663	-0.48%	826,768	0.11%	864,982	-17.49%	18.31	-0.52%	179,166	86,422	32.12%	92,744	30.87	22.44%	2,798	0.65%
PVC	6,056	-0.08%	20,316	-1.68%	5,364	-40.04%	0.32	-1.70%	4,595	7,472	59.40%	-2,877	-0.87	-28.32%	-190	-2.32%
白糖	4,589	-0.83%	1,469,716	0.30%	651,614	-27.48%	40.95	-0.56%	258,308	306,186	38.41%	-47,878	-22.23	-6.52%	-6,319	-0.84%
菜籽油	6,110	-0.39%	282,910	-1.01%	68,916	-2.10%	10.01	-1.07%	38,448	91,246	45.84%	-52,798	-32.24	-37.32%	1,324	0.55%
大豆	4,599	-0.77%	635,386	-2.74%	290,864	15.17%	14.67	-5.14%	114,601	101,799	34.06%	12,802	5.87	4.03%	8,682	2.77%
豆粕	3,216	-1.36%	1,605,344	4.84%	1,386,094	75.20%	36.46	3.24%	238,816	256,893	30.88%	-18,077	-5.80	-2.25%	-11,339	-1.37%
豆油	6,016	-0.49%	789,338	-2.23%	374,072	-1.13%	24.98	-3.06%	108,590	137,434	31.17%	-28,844	-17.30	-7.31%	-1,124	-0.44%
沪深300	2,442	1.02%	342,924	4.53%	1,598,316	-5.43%	251.22	5.59%	52,206	72,054	36.24%	-19,848	-145.65	-11.58%	8,462	5.68%
黄金	252.45	0.12%	207,688	-1.18%	78,686	-38.81%	41.95	-1.06%	31,899	21,048	25.49%	10,851	30.07	10.45%	-17	0.11%
甲醇	2,782	0.82%	116,806	12.12%	62,542	-9.02%	9.10	4.08%	13,678	19,554	28.45%	-5,876	-6.24	-10.06%	-1,222	-1.13%
焦炭	1,099	-0.71%	261,648	-3.56%	628,198	28.68%	20.39	-4.52%	36,634	47,136	32.02%	-10,502	-11.56	-8.03%	-7,702	-5.96%
铝	14,827	-0.46%	563,112	1.25%	300,216	-31.55%	26.07	0.09%	129,238	125,262	45.20%	3,976	14.53	1.41%	4,465	1.59%
螺线	2,846	-0.91%	3,008,168	-0.76%	3,969,356	1.11%	44.60	-1.77%	285,015	491,363	25.81%	-206,348	-58.75	-13.72%	-7,546	-0.60%
棉花	14,077	-0.29%	613,968	4.21%	354,328	-25.57%	5.80	0.39%	90,897	95,769	30.40%	-4,872	0.35	-1.59%	1,767	0.67%
铅	14,400	-0.68%	39,036	0.38%	15,746	-31.67%	2.38	-1.71%	7,132	7,935	38.60%	-803	-0.85	-4.11%	394	2.04%
燃料油	3,267	0.74%	16	33.33%	12	240.00%	0.00	34.32%	0	0	0.00%	0	0.00	0.00%	0	0.00%
塑料	10,923	0.53%	369,708	4.52%	385,508	16.82%	10.78	4.38%	52,477	55,560	29.22%	-3,083	-1.69	-1.67%	-11,011	-6.15%
铜	49,543	-0.51%	574,350	-0.05%	461,804	0.02%	121.41	-1.83%	130,644	86,060	37.73%	44,584	103.44	15.53%	-2,319	-0.80%
橡胶	14,269	0.63%	290,628	-3.47%	376,304	-21.47%	48.90	-2.93%	34,602	44,720	27.29%	-10,118	-15.43	-6.96%	-1,068	-0.95%
小麦	2,727	0.07%	33,284	-1.51%	3,546	47.63%	1.28	-1.73%	7,202	11,196	55.28%	-3,994	-2.20	-24.00%	245	1.09%
锌	17,041	-0.03%	533,162	7.41%	684,132	-15.07%	31.57	-4.97%	89,887	94,192	34.53%	-4,305	-1.68	-1.61%	3,921	1.70%
玉米	2,388	0.21%	277,788	0.36%	48,518	42.68%	3.32	0.57%	61,899	55,535	42.27%	6,364	1.52	4.58%	-1,262	-0.93%
棕榈油	5,199	-0.13%	614,766	2.57%	431,846	-9.15%	29.53	2.35%	107,940	162,879	44.05%	-54,939	-28.57	-17.37%	8,446	3.28%
白银	4,109	0.10%	525,784	1.20%	291,784	-51.58%	26.04	1.28%	76,018	70,769	27.92%	5,249	3.62	2.00%	619	0.21%
玻璃	984	0.46%	848,264	2.49%	907,444	-14.02%	10.03	2.80%	125,958	170,964	35.00%	-45,006	-8.45	-10.61%	14,420	3.75%
菜粕	2,263	-2.32%	1,257,350	0.38%	2,761,568	35.18%	14.84	-3.21%	155,559	183,680	26.98%	-28,121	-6.36	-4.47%	11,545	1.86%
菜籽	4,667	-0.10%	362	-0.55%	54	8.00%	0.02	-0.27%	48	48	26.52%	0	0.00	0.00%	0	0.00%
焦煤	790	-0.98%	250,540	-10.87%	817,354	66.86%	8.55	-11.49%	29,178	40,343	27.75%	-11,165	-5.30	-8.91%	4,292	2.08%
中期国债	93	-0.08%	19,066	2.12%	3,568	-29.87%	3.78	1.55%	361	379	3.88%	-18	-0.17	-0.19%	4	0.05%
沥青	4,290	-0.08%	16,958	-4.54%	1,138	-41.82%	1.08	-4.69%	0	0	0.00%	0	0.00	0.00%	0	0.00%
动力煤	512	0.67%	105,798	2.83%	84,102	112.40%	5.91	3.22%	15,134	18,656	31.94%	-3,522	-3.61	-6.66%	-1,830	-3.37%
铁矿石	602	-1.79%	773,620	-5.61%	1,017,760	-16.65%	32.89	-7.25%	139,607	168,413	39.82%	-28,806	-17.34	-7.45%	-8,642	-2.53%
鸡蛋	4,526	-0.11%	209,906	-5.63%	194,896	-27.22%	3.80	-5.74%	20,668	18,925	18.86%	1,743	0.40	1.66%	-558	-0.41%
水稻	2,331	-0.37%	4,908	2.63%	872	-61.04%	0.18	-0.93%	446	446	18.17%	0	0.00	0.00%	0	0.00%
胶合板	135	-0.02%	39,896	8.30%	32,050	52.65%	2.79	8.08%	9,731	8,016	44.48%	1,715	1.16	8.60%	980	4.61%
纤维板	59	0.27%	33,158	-3.01%	13,508	26.38%	0.74	-2.99%	7,102	8,060	45.73%	-958	-0.26	-5.78%	-177	-1.21%

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