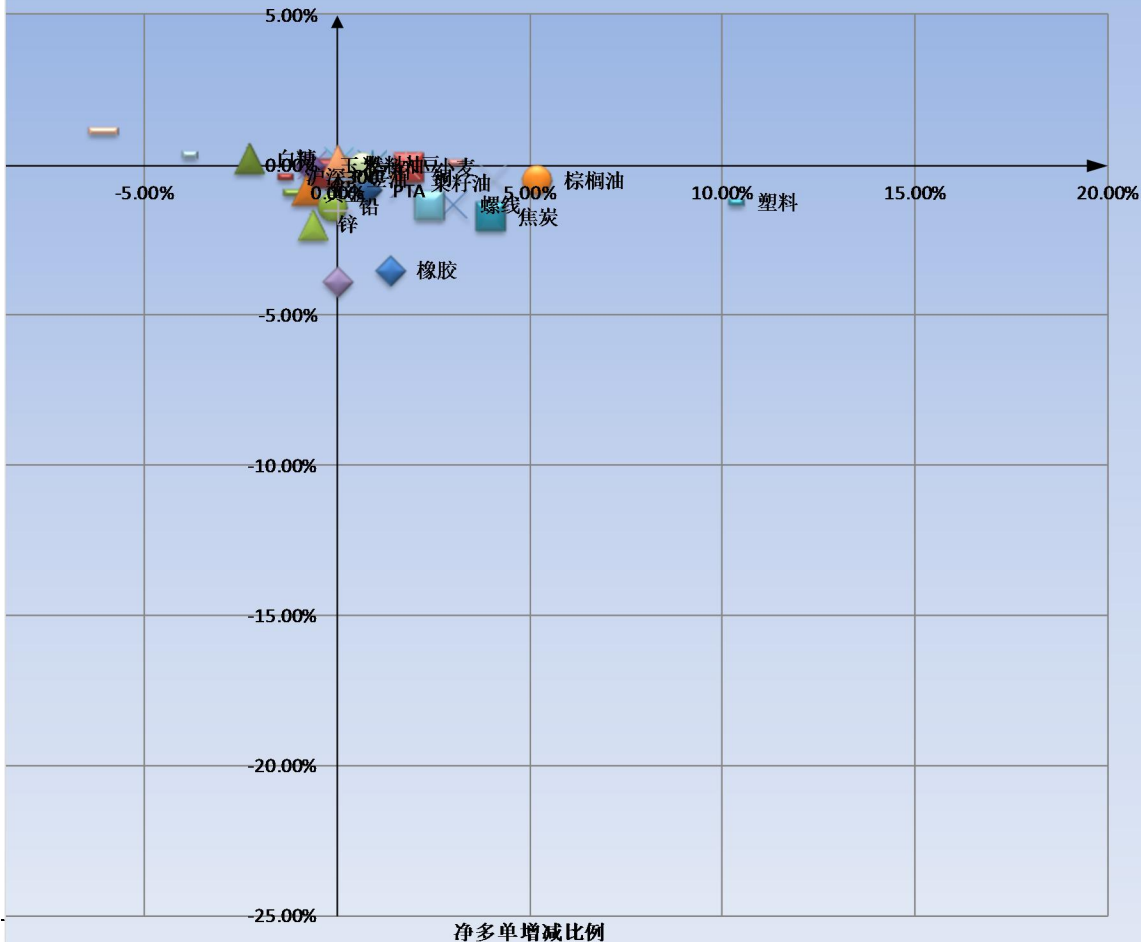


森RBS
期货

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

- ◆ PTA
- PVC
- ▲ 白糖
- × 菜籽油
- × 大豆
- 豆粕
- + 豆油
- 沪深300
- 黄金
- ◆ 甲醇
- 焦炭
- ▲ 铝
- × 螺线
- × 棉花
- 铅
- + 燃料油
- 塑料
- 铜
- ◆ 橡胶
- 小麦
- ▲ 锌
- × 玉米
- 棕榈油
- 白银
- 玻璃
- 菜粕
- ◆ 菜籽
- 焦煤
- × 中期国债
- ▲ 沥青
- 动力煤
- 铁矿石
- 鸡蛋
- 水稻
- 胶合板
- 纤维板



排名	品种	净多单变动百分比	指数收益率	净多单 Chg.%	保证金 Chg.%	持仓量 Chg.%	成交量 Chg.%
1	棉花	-21.46%	113.92%	1907.56%	#####	#DIV/0!	
2	塑料	-1.24%	10.20%	20.74%	23.70%	35.39%	
3	棕榈油	-0.53%	5.20%	-3.23%	-2.77%	-62.43%	
4	动力煤	-0.39%	4.04%	0.41%	0.81%	44.75%	
5	焦炭	-1.73%	3.98%	6.73%	8.73%	14.87%	
6	螺线	-1.33%	3.01%	2.29%	4.10%	24.43%	
7	玻璃	0.06%	2.90%	-0.31%	-0.37%	-40.38%	
8	焦煤	-1.38%	2.40%	-3.53%	-2.20%	-39.48%	
9	小麦	-0.08%	1.85%	-1.75%	-1.33%	-14.33%	
10	铁矿石	0.01%	1.79%	-4.39%	-4.43%	-41.00%	
11	铜	-0.43%	1.78%	4.69%	7.39%	-16.10%	
12	菜籽油	-0.61%	1.74%	-0.61%	0.09%	17.38%	
13	橡胶	-3.50%	1.36%	-2.91%	0.76%	-7.63%	
14	大豆	0.01%	0.93%	-1.58%	-1.44%	7.73%	
15	PTA	-0.81%	0.74%	3.37%	6.19%	50.84%	
16	鸡蛋	-0.07%	0.68%	-3.08%	-3.01%	-42.54%	
17	菜粕	-0.24%	0.37%	-0.62%	-0.31%	-26.26%	
18	白银	-0.49%	0.18%	0.02%	0.54%	-69.36%	
19	豆粕	-0.19%	0.14%	-3.05%	-2.82%	-45.33%	
20	豆油	-0.49%	0.07%	1.00%	2.00%	0.01%	
21	中期国债	0.11%	0.04%	4.93%	5.21%	-29.96%	
22	燃料油	0.00%	0.00%	0.00%	0.00%	0.00%	
23	菜籽	-3.88%	0.00%	26.14%	68.06%	523.53%	
24	水稻	-1.54%	0.00%	-19.50%	-13.26%	7.88%	
25	沥青	0.18%	0.00%	-2.74%	-2.65%	212.50%	
26	铅	-1.40%	-0.11%	-4.07%	-1.95%	-12.92%	
27	PVC	-0.33%	-0.27%	1.64%	2.04%	-35.15%	
28	玉米	0.00%	-0.64%	-0.66%	-0.66%	-43.66%	
29	锌	-1.97%	-0.65%	-16.75%	-13.49%	1.42%	
30	甲醇	-0.02%	-0.73%	2.89%	2.59%	13.27%	
31	铝	-0.82%	-0.82%	-3.79%	-2.73%	-14.05%	
32	黄金	-0.95%	-1.03%	1.03%	2.00%	-63.55%	
33	沪深300	-0.40%	-1.50%	-1.99%	-1.60%	-29.72%	
34	白糖	0.21%	-2.29%	1.32%	1.14%	-15.67%	
35	胶合板	0.32%	-4.02%	-4.90%	-5.06%	-16.27%	
36	纤维板	1.13%	-6.05%	-6.53%	-5.93%	91.48%	

品种	2014年9月9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	6,606	-0.81%	830,784	6.19%	942,118	50.84%	17.95	3.37%	184,219	88,362	32.81%	95,857	31.64	23.08%	8,502	0.74%
PVC	6,006	-0.33%	21,094	2.04%	3,070	-35.15%	0.33	1.64%	4,669	7,921	59.69%	-3,252	-0.98	-30.83%	-93	-0.27%
白糖	4,526	0.21%	1,488,560	1.14%	832,746	-15.67%	40.82	1.32%	252,063	304,584	37.39%	-52,521	-24.04	-7.06%	-17,426	-2.29%
菜籽油	6,080	-0.61%	281,452	0.09%	82,798	17.38%	9.93	-0.61%	38,205	87,958	44.83%	-49,753	-30.21	-35.35%	2,401	1.74%
大豆	4,584	0.01%	618,304	-1.44%	339,352	7.73%	14.19	-1.58%	108,807	101,556	34.02%	7,251	3.31	2.35%	2,817	0.93%
豆粕	3,153	-0.19%	1,523,866	-2.82%	734,702	-45.33%	33.90	-3.05%	241,785	238,764	31.53%	3,021	0.95	0.40%	1,032	0.14%
豆油	5,997	-0.49%	780,328	2.00%	412,354	0.01%	24.32	1.00%	111,260	133,077	31.31%	-21,817	-13.04	-5.59%	-142	0.07%
沪深300	2,462	-0.40%	359,662	-1.60%	1,259,528	-29.72%	265.66	-1.99%	51,148	82,173	37.07%	-31,025	-229.36	-17.25%	-2,230	-1.50%
黄金	249.85	-0.95%	209,616	2.00%	59,662	-63.55%	41.90	1.03%	30,348	20,538	24.28%	9,810	27.16	9.36%	-868	-1.03%
甲醇	2,776	-0.02%	121,808	2.59%	73,808	13.27%	9.47	2.89%	14,668	20,718	29.05%	-6,050	-6.62	-9.93%	-583	-0.73%
焦炭	1,072	-1.73%	290,108	8.73%	510,516	14.87%	22.01	6.73%	45,077	49,569	32.62%	-4,492	-4.83	-3.10%	4,950	3.98%
铝	14,761	-0.82%	543,226	-2.73%	192,704	-14.05%	24.87	-3.79%	130,549	128,258	47.64%	2,291	13.22	0.84%	-2,367	-0.82%
螺线	2,796	-1.33%	3,072,396	4.10%	4,225,318	24.43%	44.50	2.29%	311,624	442,593	24.55%	-130,969	-36.62	-8.53%	39,261	3.01%
棉花	13,697	-21.46%	588,390	#####	624,534	#DIV/0!	5.97	1907.56%	89,064	89,546	30.36%	-482	3.71	-0.16%	166	113.92%
铅	14,251	-1.40%	39,014	-1.95%	14,370	-12.92%	2.31	-4.07%	6,366	7,372	35.21%	-1,006	-0.98	-5.16%	-1	-0.11%
燃料油	3,267	0.00%	16	0.00%	0	0.00%	0.00	0.00%	0	0	0.00%	0	0.00	0.00%	0	0.00%
塑料	10,693	-1.24%	481,592	23.70%	598,756	35.39%	13.53	20.74%	94,558	57,070	31.48%	37,488	20.03	15.57%	27,037	10.20%
铜	49,591	-0.43%	608,776	7.39%	357,362	-16.10%	125.87	4.69%	134,442	83,784	35.85%	50,658	118.59	16.64%	8,543	1.78%
橡胶	13,524	-3.50%	299,128	0.76%	556,360	-7.63%	47.62	-2.91%	37,060	44,583	27.29%	-7,523	-11.17	-5.03%	1,957	1.36%
小麦	2,727	-0.08%	32,244	-1.33%	2,546	-14.33%	1.22	-1.75%	7,188	10,495	54.84%	-3,307	-1.82	-20.51%	347	1.85%
锌	16,847	-1.97%	455,804	-13.49%	621,372	1.42%	29.01	-16.75%	76,679	86,059	35.70%	-9,380	-5.94	-4.12%	-240	-0.65%
玉米	2,379	0.00%	275,842	-0.66%	39,748	-43.66%	3.28	-0.66%	60,304	54,850	41.75%	5,454	1.30	3.95%	-924	-0.64%
棕榈油	5,211	-0.53%	617,690	-2.77%	172,560	-62.43%	36.03	-3.23%	116,562	150,670	43.26%	-34,108	-17.77	-11.04%	17,483	5.20%
白银	4,095	-0.49%	522,854	0.54%	190,126	-69.36%	25.80	0.02%	75,138	70,922	27.94%	4,216	2.97	1.61%	489	0.18%
玻璃	968	0.06%	827,666	-0.37%	980,244	-40.38%	9.63	-0.31%	118,039	137,657	30.89%	-19,618	-3.13	-4.74%	12,120	2.90%
菜粕	2,232	-0.24%	1,180,570	-0.31%	1,519,784	-26.26%	13.78	-0.62%	159,592	191,037	29.70%	-31,445	-7.01	-5.33%	2,280	0.37%
菜籽	4,481	-3.88%	642	68.06%	424	523.53%	0.03	26.14%	55	55	17.13%	0	0.00	0.00%	0	0.00%
焦煤	778	-1.38%	270,570	-2.20%	376,496	-39.48%	9.03	-3.53%	39,485	44,518	31.05%	-5,033	-2.35	-3.72%	3,436	2.40%
中期国债	93	0.11%	21,032	5.21%	2,796	-29.96%	4.13	4.93%	344	359	3.34%	-15	-0.14	-0.14%	3	0.04%
沥青	4,297	0.18%	15,288	-2.65%	4,950	212.50%	0.97	-2.74%	0	0	0.00%	0	0.00	0.00%	0	0.00%
动力煤	510	-0.39%	101,558	0.81%	68,726	44.75%	5.18	0.41%	14,450	13,254	27.28%	1,196	1.22	2.36%	2,045	4.04%
铁矿石	589	0.01%	857,020	-4.43%	598,820	-41.00%	35.61	-4.39%	171,106	165,617	39.29%	5,489	3.23	1.28%	7,764	1.79%
鸡蛋	4,471	-0.07%	197,998	-3.01%	145,146	-42.54%	3.54	-3.08%	20,322	17,030	18.86%	3,292	0.74	3.33%	592	0.68%
水稻	2,253	-1.54%	4,226	-13.26%	2,300	7.88%	0.14	-19.50%	313	313	14.81%	0	0.00	0.00%	0	0.00%
胶合板	135	0.32%	37,564	-5.06%	28,438	-16.27%	2.64	-4.90%	9,238	7,509	44.58%	1,729	1.18	9.21%	-888	-4.02%
纤维板	60	1.13%	31,236	-5.93%	33,218	91.48%	0.68	-6.53%	6,476	8,186	46.94%	-1,710	-0.49	-10.95%	-896	-6.05%

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