

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	指数收益率	净多单 Chg.%	保证金 Chg.%	持仓量 Chg.%	成交量 Chg.%
1	棉花	-21.21%	113.80%	1879.23%	#####	#DIV/0!	
2	沪深300	-1.00%	15.76%	-15.43%	-14.58%	-10.21%	
3	小麦	-0.78%	14.79%	-17.43%	-11.77%	51.08%	
4	塑料	-2.97%	9.09%	67.32%	27.12%	2.72%	
5	铜	-2.83%	5.62%	10.02%	12.66%	50.65%	
6	玉米	-0.42%	5.54%	-2.82%	-2.41%	-25.42%	
7	菜粕	-1.73%	5.08%	-2.85%	0.96%	55.38%	
8	焦煤	-1.84%	4.09%	-12.05%	-8.83%	-69.05%	
9	菜籽油	-1.24%	3.76%	-3.88%	0.49%	164.67%	
10	PVC	-1.72%	3.13%	5.71%	7.80%	16.10%	
11	橡胶	-4.62%	3.02%	-2.09%	2.19%	-26.37%	
12	棕榈油	-1.14%	2.81%	5.66%	7.03%	23.01%	
13	玻璃	1.22%	2.73%	5.48%	4.22%	-34.20%	
14	胶合板	-1.44%	2.00%	28.77%	32.82%	52.56%	
15	鸡蛋	0.24%	1.60%	-4.80%	-5.01%	7.46%	
16	动力煤	-0.76%	1.46%	0.50%	1.27%	-55.61%	
17	铅	-3.45%	1.44%	-0.21%	2.31%	-9.67%	
18	螺线	-2.30%	1.44%	-5.10%	-2.10%	17.86%	
19	PTA	-3.38%	1.06%	-6.08%	-1.21%	-6.85%	
20	铁矿石	0.02%	0.75%	-11.86%	-11.93%	-42.62%	
21	甲醇	-0.58%	0.30%	6.77%	9.33%	35.49%	
22	中期国债	0.07%	0.18%	-0.81%	4.58%	-65.28%	
23	白糖	-1.22%	0.12%	9.12%	10.62%	-7.40%	
24	燃料油	-0.09%	0.00%	-0.09%	0.00%	0.00%	
25	菜籽	-4.56%	0.00%	25.31%	68.59%	117.65%	
26	水稻	0.32%	0.00%	-26.81%	-15.44%	-53.47%	
27	沥青	2.87%	0.00%	20.71%	-11.30%	-82.45%	
28	纤维板	2.87%	-0.13%	-3.86%	-3.89%	145.86%	
29	豆粕	-1.27%	-0.92%	-33.65%	-6.28%	-0.85%	
30	黄金	-2.40%	-0.94%	0.05%	2.51%	21.34%	
31	焦炭	-1.81%	-1.06%	6.08%	8.26%	-43.31%	
32	大豆	0.35%	-1.83%	10.24%	10.03%	80.96%	
33	豆油	-1.47%	-2.20%	-4.55%	-1.87%	23.89%	
34	白银	-1.44%	-3.45%	10.38%	11.85%	62.04%	
35	锌	-5.00%	-3.93%	-50.10%	-31.15%	53.83%	
36	铝	-2.65%	-4.68%	-14.70%	-13.37%	0.64%	

2014年9月12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	收益率														
PTA	6,435	-3.38%	772,844	-1.21%	581,792	-6.85%	16.31	-6.08%	170,735	80,325	32.49%	90,410	29.07	23.40%	3,055	1.06%
PVC	5,922	-1.72%	22,284	7.80%	5,496	16.10%	0.34	5.71%	4,839	7,896	57.15%	-3,057	-0.90	-27.44%	102	3.13%
白糖	4,462	-1.22%	1,628,096	10.62%	914,370	-7.40%	43.97	9.12%	290,124	327,980	37.96%	-37,856	-17.10	-4.65%	-2,761	0.12%
菜籽油	6,041	-1.24%	282,560	0.49%	186,700	164.67%	9.60	-3.88%	39,272	86,367	44.46%	-47,095	-28.43	-33.33%	5,059	3.76%
大豆	4,600	0.35%	690,274	10.03%	570,032	80.96%	15.90	10.24%	113,422	114,845	33.07%	-1,423	-0.65	-0.41%	-5,857	-1.83%
豆粕	3,119	-1.27%	1,469,612	-6.28%	1,332,298	-0.85%	23.20	-33.65%	213,248	218,138	29.35%	-4,890	-1.52	-0.67%	-6,879	-0.92%
豆油	5,937	-1.47%	750,730	-1.87%	510,814	23.89%	22.99	-4.55%	99,967	129,487	30.56%	-29,520	-17.52	-7.86%	-7,845	-2.20%
沪深300	2,447	-1.00%	312,206	-14.58%	1,609,284	-10.21%	229.22	-15.43%	0	0	0.00%	0	0.00	0.00%	28,795	15.76%
黄金	246.20	-2.40%	210,662	2.51%	198,610	21.34%	41.49	0.05%	30,591	20,633	24.32%	9,958	27.12	9.45%	-720	-0.94%
甲醇	2,760	-0.58%	129,816	9.33%	88,288	35.49%	9.83	6.77%	15,682	21,464	28.61%	-5,782	-5.82	-8.91%	-315	0.30%
焦炭	1,071	-1.81%	288,860	8.26%	251,950	-43.31%	21.87	6.08%	43,215	54,965	33.99%	-11,750	-12.59	-8.14%	-2,308	-1.06%
铝	14,488	-2.65%	483,814	-13.37%	225,620	0.64%	22.05	-14.70%	117,480	124,762	50.07%	-7,282	6.04	-3.01%	-11,940	-4.68%
螺线	2,768	-2.30%	2,889,224	-2.10%	4,002,152	17.86%	41.28	-5.10%	313,168	459,031	26.73%	-145,863	-40.38	-10.10%	24,367	1.44%
棉花	13,741	-21.21%	621,546	#####	448,668	#DIV/0!	5.88	1879.23%	89,965	90,846	29.09%	-881	0.43	-0.28%	-233	113.80%
铅	13,955	-3.45%	40,706	2.31%	14,906	-9.67%	2.40	-0.21%	6,522	7,257	33.85%	-735	-0.77	-3.61%	270	1.44%
燃料油	3,264	-0.09%	16	0.00%	0	0.00%	0.00	-0.09%	0	0	0.00%	0	0.00	0.00%	0	0.00%
塑料	10,507	-2.97%	494,922	27.12%	454,286	2.72%	18.76	67.32%	101,291	65,519	33.70%	35,772	18.79	14.46%	25,321	9.09%
铜	48,398	-2.83%	638,628	12.66%	641,702	50.65%	132.27	10.02%	141,702	76,306	34.14%	65,396	151.42	20.48%	23,281	5.62%
橡胶	13,367	-4.62%	303,374	2.19%	443,454	-26.37%	48.02	-2.09%	39,372	44,472	27.64%	-5,100	-7.74	-3.36%	4,380	3.02%
小麦	2,708	-0.78%	28,832	-11.77%	4,490	51.08%	1.02	-17.43%	6,811	7,902	51.03%	-1,091	-0.60	-7.57%	2,563	14.79%
锌	16,326	-5.00%	362,740	-31.15%	942,488	53.83%	17.39	-50.10%	57,114	70,534	35.19%	-13,420	-9.04	-7.40%	-4,280	-3.93%
玉米	2,369	-0.42%	270,980	-2.41%	52,616	-25.42%	3.21	-2.82%	68,567	54,835	45.54%	13,732	3.25	10.14%	7,354	5.54%
棕榈油	5,178	-1.14%	679,990	7.03%	564,980	23.01%	39.34	5.66%	119,358	165,038	41.82%	-45,680	-23.66	-13.44%	5,911	2.81%
白银	4,056	-1.44%	581,670	11.85%	1,005,562	62.04%	28.47	10.38%	80,342	86,199	28.63%	-5,857	-3.18	-2.01%	-9,584	-3.45%
玻璃	979	1.22%	865,798	4.22%	1,081,882	-34.20%	10.19	5.48%	129,876	151,125	32.46%	-21,249	-3.53	-4.91%	10,489	2.73%
菜粕	2,199	-1.73%	1,195,552	0.96%	3,202,264	55.38%	13.47	-2.85%	168,983	172,663	28.58%	-3,680	-0.78	-0.62%	30,045	5.08%
菜籽	4,449	-4.56%	644	68.59%	148	117.65%	0.03	25.31%	55	55	17.08%	0	0.00	0.00%	0	0.00%
焦煤	774	-1.84%	252,236	-8.83%	192,528	-69.05%	8.23	-12.05%	38,351	40,911	31.42%	-2,560	-1.19	-2.03%	5,909	4.09%
中期国债	93	0.07%	20,906	4.58%	1,386	-65.28%	3.91	-0.81%	0	0	0.00%	0	0.00	0.00%	18	0.18%
沥青	4,413	2.87%	13,930	-11.30%	278	-82.45%	1.20	20.71%	0	0	0.00%	0	0.00	0.00%	0	0.00%
动力煤	508	-0.76%	102,024	1.27%	21,076	-55.61%	5.18	0.50%	14,002	14,116	27.56%	-114	-0.12	-0.22%	735	1.46%
铁矿石	589	0.02%	789,790	-11.93%	582,398	-42.62%	32.83	-11.86%	162,055	161,090	40.92%	965	0.57	0.24%	3,240	0.75%
鸡蛋	4,485	0.24%	193,912	-5.01%	271,420	7.46%	3.48	-4.80%	20,671	16,558	19.20%	4,113	0.93	4.24%	1,413	1.60%
水稻	2,295	0.32%	4,120	-15.44%	992	-53.47%	0.13	-26.81%	218	218	10.58%	0	0.00	0.00%	0	0.00%
胶合板	133	-1.44%	52,552	32.82%	51,814	52.56%	3.57	28.77%	12,911	8,910	41.52%	4,001	2.66	15.23%	1,384	2.00%
纤维板	61	2.87%	31,914	-3.89%	42,652	145.86%	0.70	-3.86%	5,688	6,491	38.16%	-803	-0.23	-5.03%	11	-0.13%

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