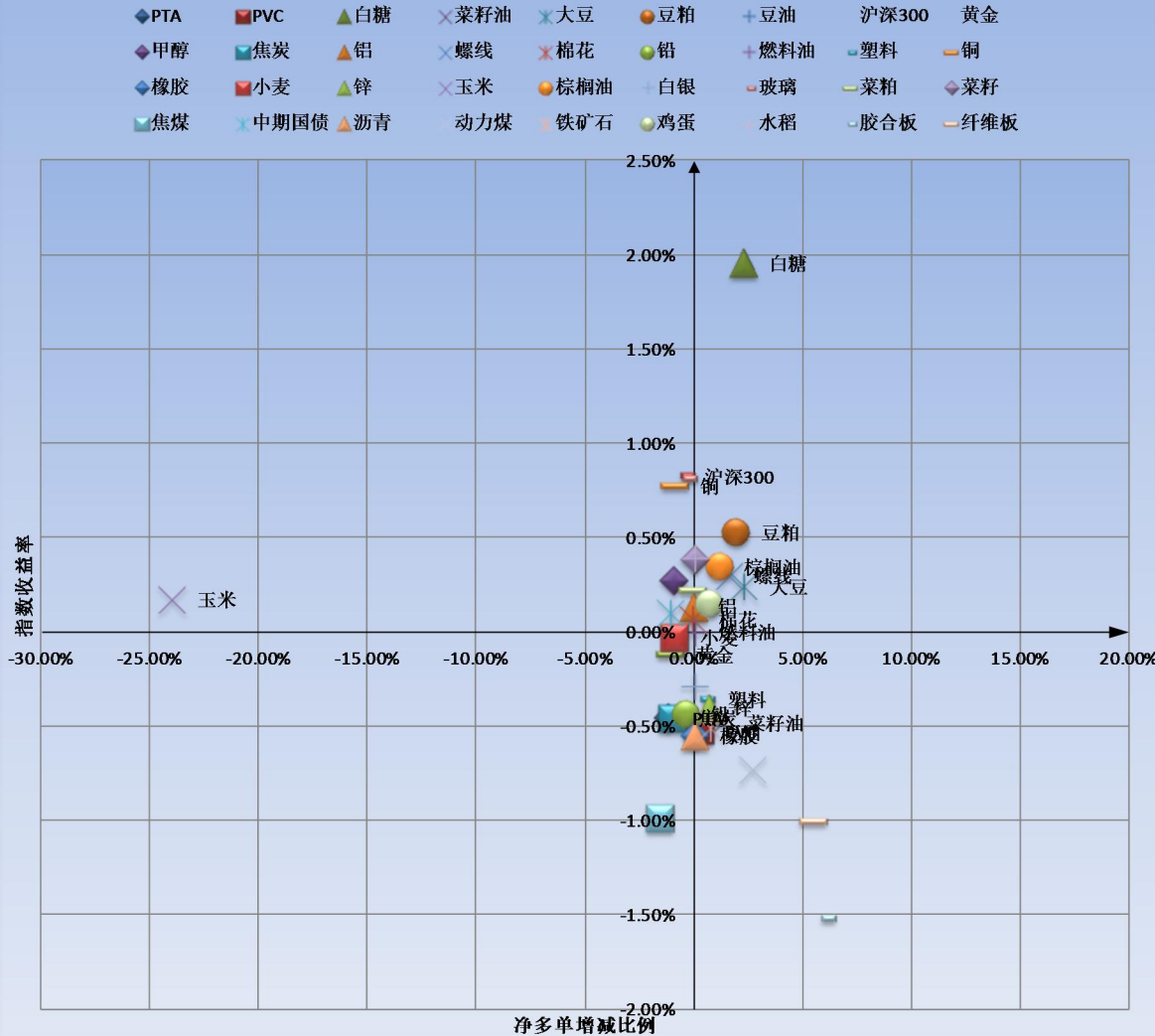


期货市场多空前5名会员持仓统计

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	胶合板	-1.52%	5.90%	-10.27%	-8.91%	135.59%	
2	纤维板	-1.01%	5.52%	-9.10%	-8.75%	48.74%	
3	动力煤	-0.73%	2.66%	3.34%	4.10%	62.26%	
4	大豆	0.24%	2.31%	-6.11%	-6.34%	-47.01%	
5	白糖	1.95%	2.27%	3.05%	1.08%	176.18%	
6	豆粕	0.52%	1.94%	0.81%	0.28%	-36.31%	
7	螺线	0.30%	1.58%	-3.04%	-3.31%	6.59%	
8	菜籽油	-0.48%	1.27%	-1.17%	-0.69%	-17.04%	
9	棕榈油	0.34%	1.16%	-3.98%	-4.31%	91.01%	
10	铁矿石	-0.51%	0.81%	2.67%	3.20%	31.46%	
11	鸡蛋	0.14%	0.71%	-2.43%	-2.57%	-13.36%	
12	锌	-0.40%	0.68%	-0.73%	0.93%	111.64%	
13	塑料	-0.36%	0.39%	-11.98%	-11.66%	69.16%	
14	PVC	-0.52%	0.31%	1.78%	2.32%	-22.44%	
15	豆油	-0.54%	0.16%	-0.17%	0.36%	-24.31%	
16	橡胶	-0.55%	0.04%	2.94%	3.47%	6.41%	
17	白银	-0.29%	0.03%	8.79%	9.12%	41.58%	
18	燃料油	0.00%	0.00%	0.00%	0.00%	0.00%	
19	菜籽	0.39%	0.00%	-1.63%	-2.26%	-13.89%	
20	水稻	0.39%	0.00%	-1.29%	-1.73%	-71.87%	
21	沥青	-0.55%	0.00%	2.90%	3.46%	-56.63%	
22	菜粕	0.22%	-0.01%	0.81%	0.62%	-48.39%	
23	铝	0.13%	-0.02%	-2.45%	-0.20%	-13.92%	
24	棉花	0.07%	-0.02%	-0.30%	2.64%	0.32%	
25	铅	-0.44%	-0.37%	-0.67%	2.03%	150.27%	
26	玻璃	0.81%	-0.42%	2.15%	1.33%	-51.58%	
27	沪深300	0.82%	-0.61%	-3.53%	-4.31%	20.95%	
28	铜	0.77%	-0.85%	1.39%	1.36%	3.38%	
29	小麦	-0.03%	-0.87%	1.60%	1.62%	-7.95%	
30	甲醇	0.28%	-0.93%	-3.53%	-3.64%	-30.87%	
31	焦炭	-0.46%	-0.97%	0.04%	0.50%	-1.65%	
32	黄金	-0.12%	-1.10%	2.46%	2.58%	42.94%	
33	中期国债	0.10%	-1.10%	-0.64%	-0.74%	-20.52%	
34	PTA	-0.45%	-1.23%	-4.62%	-4.19%	11.82%	
35	焦煤	-0.99%	-1.52%	8.90%	9.99%	32.43%	
36	玉米	0.17%	-23.97%	-4.28%	-4.45%	-31.80%	

2014年10月15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	5,600	-0.45%	1,065,986	-4.19%	1,570,924	11.82%	17.91	-4.62%	200,212	170,413	34.77%	29,799	8.36	5.59%	-8,167	-1.23%
PVC	5,685	-0.52%	29,692	2.32%	6,658	-22.44%	0.42	1.78%	6,231	7,005	44.58%	-774	-0.22	-5.21%	27	0.31%
白糖	4,705	1.95%	1,578,382	1.08%	2,206,868	176.18%	44.57	3.05%	275,822	324,987	38.06%	-49,165	-23.74	-6.23%	17,213	2.27%
菜籽油	6,018	-0.48%	234,220	-0.69%	71,622	-17.04%	7.05	-1.17%	31,465	67,839	42.40%	-36,374	-21.85	-31.06%	1,749	1.27%
大豆	4,424	0.24%	620,568	-6.34%	430,140	-47.01%	13.73	-6.11%	115,599	89,138	32.99%	26,461	11.72	8.53%	5,865	2.31%
豆粕	3,063	0.52%	1,048,566	0.28%	743,756	-36.31%	16.06	0.81%	190,652	205,952	37.82%	-15,300	-4.69	-2.92%	10,076	1.94%
豆油	5,944	-0.54%	691,158	0.36%	342,776	-24.31%	20.54	-0.17%	82,267	151,163	33.77%	-68,896	-40.95	-19.94%	308	0.16%
沪深300	2,461	0.82%	328,730	-4.31%	2,046,280	20.95%	242.70	-3.53%	52,203	72,917	38.06%	-20,714	-152.86	-12.60%	-108	-0.61%
黄金	244.35	-0.12%	184,350	2.58%	143,484	42.94%	27.05	2.46%	31,783	17,083	26.51%	14,700	38.50	15.95%	-614	-1.10%
甲醇	2,688	0.28%	121,304	-3.64%	92,574	-30.87%	8.48	-3.53%	22,037	21,936	36.25%	101	0.63	0.17%	-590	-0.93%
焦炭	1,085	-0.46%	226,938	0.50%	254,628	-1.65%	12.31	0.04%	34,330	42,086	33.67%	-7,756	-8.42	-6.84%	-1,128	-0.97%
铝	13,817	0.13%	343,214	-0.20%	113,940	-13.92%	14.96	-2.45%	99,551	104,028	59.32%	-4,477	6.46	-2.61%	-20	-0.02%
螺线	2,651	0.30%	2,178,270	-3.31%	3,643,070	6.59%	63.49	-3.04%	264,048	441,612	32.40%	-177,564	-47.08	-16.30%	23,845	1.58%
棉花	13,724	0.07%	670,384	2.64%	785,126	0.32%	8.22	-0.30%	119,873	94,063	31.91%	25,810	1.80	7.70%	596	-0.02%
铅	13,743	-0.44%	33,842	2.03%	7,368	150.27%	2.48	-0.67%	4,875	5,350	30.21%	-475	-0.58	-2.81%	-70	-0.37%
燃料油	2,912	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	9,675	-0.36%	435,504	-11.66%	955,966	69.16%	10.53	-11.98%	92,538	46,563	31.94%	45,975	22.24	21.11%	-5,106	0.39%
铜	48,246	0.77%	609,980	1.36%	565,896	3.38%	135.34	1.39%	143,305	99,346	39.78%	43,959	103.10	14.41%	-1,960	-0.85%
橡胶	12,493	-0.55%	213,326	3.47%	637,654	6.41%	31.72	2.94%	28,260	34,622	29.48%	-6,362	-8.70	-5.96%	-177	0.04%
小麦	2,694	-0.03%	25,806	1.62%	3,912	-7.95%	0.70	1.60%	5,215	6,598	45.78%	-1,383	-0.74	-10.72%	-133	-0.87%
锌	16,747	-0.40%	335,322	0.93%	769,416	111.64%	20.13	-0.78%	69,940	82,133	45.35%	-12,193	-8.19	-7.27%	1,022	0.68%
玉米	2,349	0.17%	219,658	-4.45%	27,786	-31.80%	2.58	-4.28%	0	0	0.00%	0	0.00	0.00%	-27,547	-23.97%
棕榈油	5,256	0.34%	630,120	-4.31%	1,282,778	91.01%	16.56	-3.98%	95,307	196,848	46.36%	-101,541	-53.37	-32.23%	8,398	1.16%
白银	3,828	-0.29%	589,938	9.12%	948,042	41.58%	23.75	8.79%	76,870	77,018	26.09%	-148	0.27	-0.05%	75	0.03%
玻璃	967	0.81%	915,600	1.33%	898,564	-51.58%	10.63	2.15%	146,829	174,326	35.08%	-27,497	-5.00	-6.01%	-2,266	-0.42%
菜粕	2,174	0.22%	1,073,374	0.62%	1,434,020	-48.39%	11.87	0.81%	167,815	185,206	32.89%	-17,391	-3.74	-3.24%	-174	-0.01%
菜籽	4,499	0.39%	432	-2.26%	62	-13.89%	0.01	-1.63%	17	17	7.87%	0	0.00	0.00%	0	0.00%
焦煤	799	-0.99%	401,268	9.99%	529,386	32.43%	9.62	8.90%	40,222	73,376	28.31%	-33,154	-15.89	-16.52%	-5,785	-1.52%
中期国债	95	0.10%	20,918	-0.74%	9,240	-20.52%	3.99	-0.64%	3,819	7,097	52.18%	-3,278	-31.24	-31.34%	-91	-1.10%
沥青	4,082	-0.55%	538	3.46%	72	-56.63%	0.01	2.90%	0	0	0.00%	0	0.00	0.00%	0	0.00%
动力煤	520	-0.73%	138,674	4.10%	74,024	62.26%	7.21	3.34%	24,044	30,180	39.10%	-6,136	-6.38	-8.85%	1,532	2.66%
铁矿石	583	-0.51%	892,396	3.20%	1,102,092	31.46%	26.01	2.67%	204,089	193,272	44.53%	10,817	6.31	2.42%	3,824	0.81%
鸡蛋	4,738	0.14%	199,112	-2.57%	196,746	-13.36%	3.77	-2.43%	22,757	19,234	21.09%	3,523	0.84	3.54%	633	0.71%
水稻	2,303	0.39%	3,064	-1.73%	202	-71.87%	0.07	-1.29%	5	5	0.33%	0	0.00	0.00%	0	0.00%
胶合板	134	-1.52%	41,640	-8.91%	42,684	135.59%	2.81	-10.27%	9,724	8,657	44.14%	1,067	0.72	5.12%	1,244	5.90%
纤维板	61	-1.01%	25,204	-8.75%	22,332	48.74%	0.58	-9.10%	5,070	4,740	38.92%	330	0.11	2.62%	731	5.52%

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