

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	玉米	24.31%	0.21%	-10.68%	-10.87%	43.64%	
2	纤维板	8.19%	-0.27%	5.23%	5.89%	31.86%	
3	棕榈油	4.68%	-0.91%	-5.95%	-5.08%	-49.25%	
4	焦炭	4.21%	-1.11%	-4.73%	-3.67%	14.67%	
5	菜籽油	2.79%	-0.84%	-4.79%	-3.98%	30.77%	
6	豆油	2.79%	-1.28%	0.49%	1.79%	17.26%	
7	螺线	2.69%	-0.37%	-14.39%	-13.86%	25.30%	
8	焦煤	1.93%	-1.25%	-10.74%	-9.61%	-30.74%	
9	玻璃	1.77%	-0.68%	-1.46%	-0.79%	2.69%	
10	橡胶	1.68%	-1.26%	-2.28%	-0.92%	-2.67%	
11	大豆	1.07%	-0.36%	7.86%	8.25%	5.66%	
12	PVC	1.06%	-0.35%	0.79%	1.15%	-2.10%	
13	白银	1.02%	0.49%	-6.39%	-6.74%	70.08%	
14	沪深300	0.97%	-0.20%	2.51%	2.72%	17.25%	
15	动力煤	0.84%	-0.46%	-1.83%	-1.37%	-40.42%	
16	PTA	0.77%	-0.83%	2.09%	2.95%	4.77%	
17	铁矿石	0.65%	-2.74%	-8.65%	-6.07%	3.14%	
18	中期国债	0.61%	0.17%	1.59%	1.42%	-6.84%	
19	豆粕	0.54%	-0.20%	-2.88%	-2.69%	-4.48%	
20	菜粕	0.47%	0.12%	1.28%	1.27%	47.17%	
21	小麦	0.27%	0.03%	-2.09%	-2.15%	-5.21%	
22	鸡蛋	0.19%	0.19%	4.68%	4.48%	35.03%	
23	甲醇	0.16%	-0.12%	-3.69%	-4.42%	11.54%	
24	铝	0.16%	-0.74%	-13.33%	-3.66%	15.66%	
25	燃料油	0.00%	-1.34%	13.78%	12.50%	-200.00%	
26	菜籽	0.00%	-0.03%	-24.70%	-12.50%	-12.90%	
27	水稻	0.00%	-0.72%	1.24%	2.02%	80.20%	
28	沥青	0.00%	-0.13%	1.72%	1.86%	-80.56%	
29	黄金	-0.31%	0.66%	-0.91%	-1.48%	107.80%	
30	铅	-0.63%	-1.23%	-46.92%	-18.38%	110.61%	
31	胶合板	-0.91%	-1.58%	-2.78%	-1.22%	-18.07%	
32	棉花	-1.04%	-0.13%	1.89%	1.07%	-0.37%	
33	白糖	-1.19%	-0.33%	1.91%	2.25%	-54.06%	
34	塑料	-1.54%	0.00%	-1.89%	-1.89%	-5.63%	
35	锌	-2.32%	-2.04%	-16.45%	-5.97%	20.62%	
36	铜	-3.17%	-1.42%	1.72%	8.03%	55.84%	

2014年10月16日			持仓量	持仓量	成交量	成交量	保证金	保证金	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	Chg.%	Chg.%	Chg.%	Chg.%	Chg.%	Chg.%								
PTA	5,553	-0.83%	1,097,402	2.95%	1,645,902	4.77%	18.28	2.09%	202,085	167,174	33.65%	34,911	9.72	6.36%	5,112	0.77%
PVC	5,665	-0.35%	30,032	1.15%	6,518	-2.10%	0.43	0.79%	6,278	6,902	43.89%	-624	-0.18	-4.16%	150	1.06%
白糖	4,690	-0.33%	1,613,856	2.25%	1,013,822	-54.06%	45.42	1.91%	279,483	339,321	38.34%	-59,838	-28.62	-7.42%	-10,673	-1.19%
菜籽油	5,967	-0.84%	224,906	-3.98%	93,660	30.77%	6.71	-4.79%	30,509	62,295	41.26%	-31,786	-18.92	-28.27%	4,588	2.79%
大豆	4,408	-0.36%	671,754	8.25%	454,498	5.66%	14.81	7.86%	134,659	102,427	35.29%	32,232	14.22	9.60%	5,771	1.07%
豆粕	3,057	-0.20%	1,020,354	-2.69%	710,462	-4.48%	15.60	-2.88%	189,606	201,723	38.35%	-12,117	-3.70	-2.38%	3,183	0.54%
豆油	5,868	-1.28%	703,546	1.79%	401,938	17.26%	20.64	0.49%	84,714	145,028	32.65%	-60,314	-35.39	-17.15%	8,582	2.79%
沪深300	2,456	-0.20%	337,656	2.72%	2,399,290	17.25%	248.79	2.51%	52,883	72,518	37.14%	-19,635	-144.62	-11.63%	1,079	0.97%
黄金	245.95	0.66%	181,616	-1.48%	298,166	107.80%	26.80	-0.91%	31,595	17,390	26.97%	14,205	37.47	15.64%	-495	-0.31%
甲醇	2,685	-0.12%	115,938	-4.42%	103,260	11.54%	8.17	-3.69%	20,461	20,273	35.13%	188	0.56	0.32%	87	0.16%
焦炭	1,073	-1.11%	218,614	-3.67%	291,990	14.67%	11.73	-4.73%	33,322	36,188	31.80%	-2,866	-3.08	-2.62%	4,890	4.21%
铝	13,715	-0.74%	330,666	-3.66%	131,778	15.66%	12.97	-13.33%	99,462	103,517	61.38%	-4,055	5.46	-2.45%	422	0.16%
螺线	2,642	-0.37%	1,876,414	-13.86%	4,564,656	25.30%	54.35	-14.39%	245,081	372,814	32.93%	-127,733	-33.33	-13.61%	49,831	2.69%
棉花	13,706	-0.13%	677,590	1.07%	782,220	-0.37%	8.37	1.89%	119,766	97,197	32.02%	22,569	0.98	6.66%	-3,241	-1.04%
铅	13,574	-1.23%	27,622	-18.38%	15,518	110.61%	1.32	-46.92%	4,875	5,350	37.02%	-475	0.00	-3.44%	0	-0.63%
燃料油	2,872	-1.34%	18	12.50%	2	-200.00%	0.00	13.78%	0	0	0.00%	0	0.00	0.00%	0	0.00%
塑料	9,675	0.00%	427,258	-1.89%	902,146	-5.63%	10.33	-1.89%	88,335	46,529	31.57%	41,806	20.22	19.57%	-4,169	-1.54%
铜	47,561	-1.42%	658,990	8.03%	881,908	55.84%	137.67	1.72%	148,216	111,171	39.36%	37,045	82.18	11.24%	-6,914	-3.17%
橡胶	12,336	-1.26%	211,368	-0.92%	620,608	-2.67%	30.99	-2.28%	30,038	34,565	30.56%	-4,527	-6.31	-4.28%	1,835	1.68%
小麦	2,695	0.03%	25,252	-2.15%	3,708	-5.21%	0.68	-2.09%	5,174	6,493	46.20%	-1,319	-0.71	-10.45%	64	0.27%
锌	16,406	-2.04%	315,316	-5.97%	928,092	20.62%	16.82	-16.45%	65,119	80,238	46.10%	-15,119	-11.51	-9.59%	-2,926	-2.32%
玉米	2,354	0.21%	195,772	-10.87%	39,912	43.64%	2.30	-10.68%	63,666	39,870	52.89%	23,796	5.60	24.31%	23,796	24.31%
棕榈油	5,208	-0.91%	598,100	-5.08%	650,986	-49.25%	15.57	-5.95%	93,039	175,418	44.88%	-82,379	-42.90	-27.55%	19,162	4.68%
白银	3,847	0.49%	550,202	-6.74%	1,612,400	70.08%	22.23	-6.39%	74,053	71,378	26.43%	2,675	1.90	0.97%	2,823	1.02%
玻璃	961	-0.68%	908,368	-0.79%	922,706	2.69%	10.47	-1.46%	149,629	168,879	35.06%	-19,250	-3.30	-4.24%	8,247	1.77%
菜粕	2,176	0.12%	1,087,006	1.27%	2,110,378	47.17%	12.02	1.28%	169,477	184,559	32.57%	-15,082	-3.23	-2.77%	2,309	0.47%
菜籽	4,497	-0.03%	378	-12.50%	54	-12.90%	0.01	-24.70%	0	0	0.00%	0	0.00	0.00%	0	0.00%
焦煤	789	-1.25%	362,718	-9.61%	366,646	-30.74%	8.59	-10.74%	41,858	68,329	30.38%	-26,471	-12.53	-14.60%	6,683	1.93%
中期国债	95	0.17%	21,214	1.42%	8,608	-6.84%	4.05	1.59%	3,870	7,130	51.85%	-3,260	-31.12	-30.73%	18	0.61%
沥青	4,077	-0.13%	548	1.86%	14	-80.56%	0.01	1.72%	0	0	0.00%	0	0.00	0.00%	0	0.00%
动力煤	518	-0.46%	136,772	-1.37%	44,106	-40.42%	7.08	-1.83%	24,955	30,435	40.50%	-5,480	-5.67	-8.01%	656	0.84%
铁矿石	567	-2.74%	838,186	-6.07%	1,136,692	3.14%	23.76	-8.65%	195,396	182,501	45.09%	12,895	7.31	3.08%	2,078	0.65%
鸡蛋	4,748	0.19%	208,034	4.48%	265,664	35.03%	3.95	4.68%	23,559	19,682	20.79%	3,877	0.92	3.73%	354	0.19%
水稻	2,287	-0.72%	3,126	2.02%	364	80.20%	0.08	1.24%	5	5	0.32%	0	0.00	0.00%	0	0.00%
胶合板	132	-1.58%	41,130	-1.22%	34,972	-18.07%	2.73	-2.78%	9,945	9,079	46.25%	866	0.57	4.21%	-201	-0.91%
纤维板	61	-0.27%	26,688	5.89%	29,446	31.86%	0.61	5.23%	6,218	4,776	41.19%	1,442	0.45	10.81%	1,112	8.19%

### 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)》

#### ■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

- 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）》

分析师：宋 阳

电话：010-58363403

邮箱：[songyang@chinastock.com.cn](mailto: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](http://www.yhqh.com.cn)