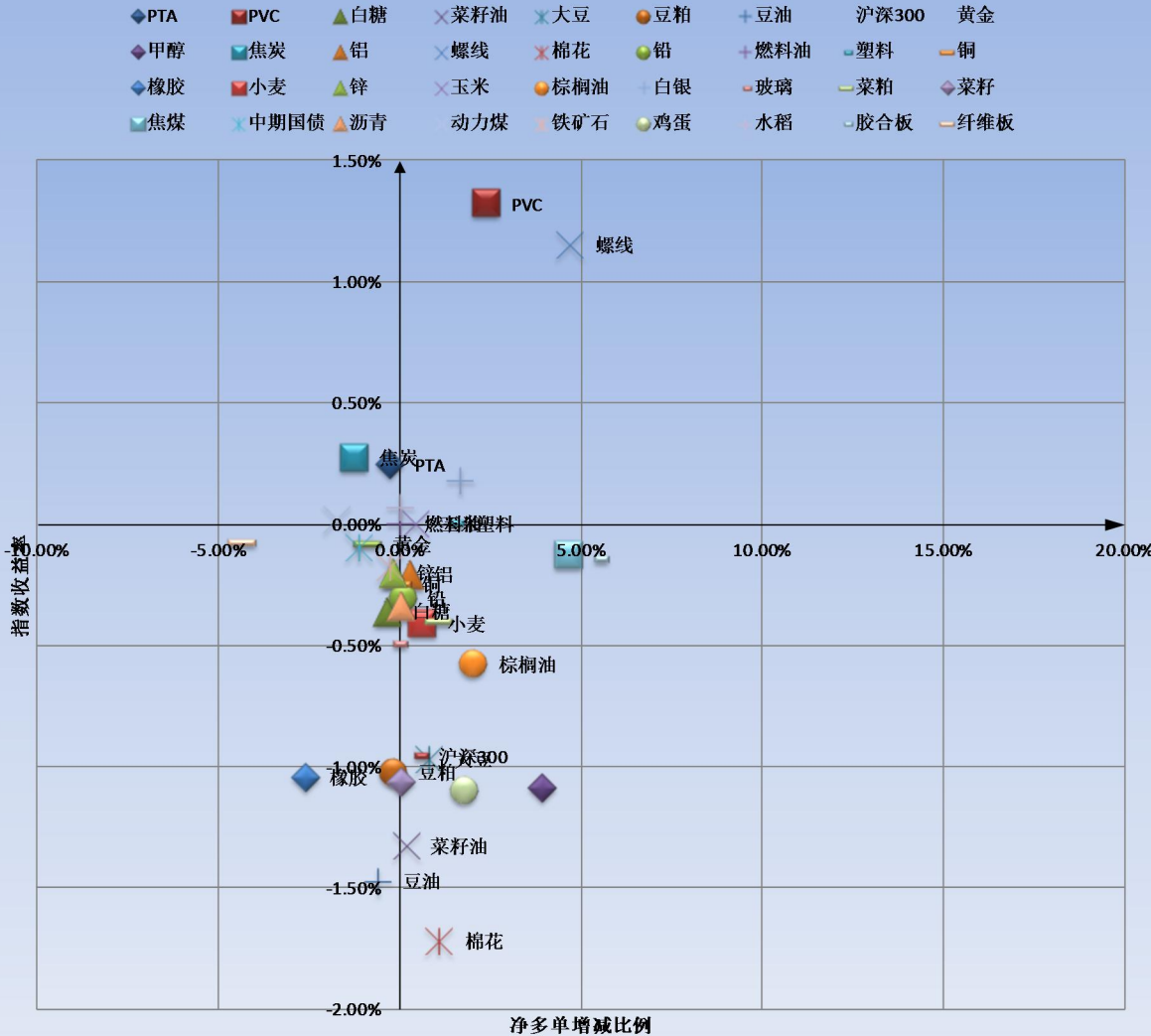


期货市场多空前5名会员持仓统计

净多单变化与指数涨跌



排名	品种	指数收益率	净多单 Chg.%	保证金 Chg.%	持仓量 Chg.%	成交量 Chg.%
1	胶合板	-0.15%	5.39%	8.51%	8.66%	-37.10%
2	螺线	1.15%	4.69%	-25.45%	-5.33%	-8.21%
3	焦煤	-0.13%	4.64%	-3.71%	-3.59%	-45.16%
4	甲醇	-1.09%	3.91%	8.36%	5.16%	18.87%
5	PVC	1.32%	2.40%	-38.88%	-39.68%	-19.96%
6	棕榈油	-0.58%	2.04%	-7.90%	-7.37%	-35.52%
7	鸡蛋	-1.10%	1.77%	-9.29%	-8.30%	38.54%
8	白银	0.18%	1.65%	0.01%	-0.17%	-7.99%
9	塑料	0.00%	1.40%	2.91%	2.91%	-13.46%
10	棉花	-1.72%	1.10%	28.86%	18.03%	109.29%
11	菜粕	-0.40%	1.09%	3.29%	3.83%	-28.25%
12	大豆	-0.97%	0.80%	2.34%	3.34%	-33.68%
13	小麦	-0.41%	0.61%	-0.02%	0.37%	169.61%
14	玉米	0.00%	0.44%	-3.37%	-3.38%	-43.38%
15	沪深300	-0.96%	0.40%	1.34%	2.32%	14.94%
16	铝	-0.21%	0.27%	-0.43%	-0.31%	-33.59%
17	菜籽油	-1.33%	0.16%	0.14%	1.49%	-17.95%
18	铅	-0.31%	0.08%	0.48%	2.13%	16.09%
19	燃料油	0.00%	0.00%	0.00%	0.00%	0.00%
20	菜籽	-1.06%	0.00%	-1.06%	0.00%	225.00%
21	水稻	0.07%	0.00%	0.67%	0.66%	-18.52%
22	沥青	-0.34%	0.00%	-1.43%	-1.09%	-18.18%
23	铜	-0.25%	-0.06%	14.54%	3.69%	-1.94%
24	玻璃	-0.50%	-0.17%	-1.18%	-0.68%	-48.18%
25	豆粕	-1.02%	-0.20%	-2.47%	-1.47%	-53.92%
26	锌	-0.20%	-0.20%	-4.56%	-4.39%	-7.65%
27	铁矿石	-0.18%	-0.29%	-5.20%	-5.03%	-59.97%
28	PTA	0.25%	-0.29%	-2.77%	-3.01%	-39.79%
29	白糖	-0.36%	-0.36%	-1.57%	-1.21%	-3.12%
30	豆油	-1.47%	-0.62%	1.24%	2.75%	-35.33%
31	黄金	-0.08%	-0.89%	-4.16%	-4.08%	-40.40%
32	中期国债	-0.10%	-1.14%	-3.07%	-2.98%	-47.41%
33	焦炭	0.27%	-1.26%	-15.79%	-16.03%	-29.36%
34	动力煤	0.02%	-1.75%	4.90%	4.88%	-41.91%
35	橡胶	-1.04%	-2.64%	-6.77%	-5.78%	24.81%
36	纤维板	-0.08%	-4.33%	-3.70%	-5.24%	-16.18%

2014年10月27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	5,688	0.25%	1,007,678	-3.01%	909,330	-39.79%	17.20	-2.77%	213,225	145,354	35.58%	67,871	19.32	13.47%	-3,641	0.29%
PVC	5,745	1.32%	51,102	-39.68%	93,954	-19.96%	0.73	-3.88%	11,198	9,499	40.50%	1,699	0.49	6.65%	-101	2.40%
白糖	4,712	-0.36%	1,822,180	-1.21%	1,461,538	-3.12%	51.55	-1.57%	324,172	393,135	39.37%	-68,963	-32.85	-7.57%	-2,513	0.36%
菜籽油	5,885	-1.33%	217,758	1.49%	56,650	-17.95%	6.41	0.14%	31,663	59,546	41.89%	-27,883	-16.35	-25.61%	-239	0.16%
大豆	4,418	-0.97%	676,884	3.34%	236,490	-33.68%	14.95	2.34%	145,445	110,811	37.86%	34,634	15.24	10.23%	3,738	0.80%
豆粕	3,097	-1.02%	905,342	-1.47%	303,064	-53.92%	14.02	-2.47%	165,910	170,397	37.15%	-4,487	-1.39	-0.99%	-836	0.20%
豆油	5,754	-1.47%	621,156	2.75%	241,602	-35.33%	17.87	1.24%	77,922	140,732	35.20%	-62,810	-36.14	-20.22%	-3,568	0.62%
沪深300	2,381	-0.96%	371,464	2.32%	1,509,262	14.94%	265.35	1.34%	59,827	80,308	37.73%	-20,481	-146.25	-11.03%	271	0.40%
黄金	243.50	-0.08%	150,786	-4.08%	86,956	-40.40%	22.03	-4.16%	24,502	13,645	25.30%	10,857	28.94	14.40%	-1,158	0.89%
甲醇	2,654	-1.09%	110,842	5.16%	133,212	18.87%	7.32	8.36%	18,029	13,888	28.80%	4,141	3.63	7.47%	2,266	3.91%
焦炭	1,101	0.27%	199,514	-16.03%	315,028	-29.36%	10.98	-15.79%	30,515	26,131	28.39%	4,384	4.83	4.39%	-2,332	1.26%
铝	13,806	-0.21%	347,412	-0.31%	65,944	-33.59%	13.32	-0.43%	95,461	99,505	56.12%	-4,044	5.50	-2.33%	490	0.27%
螺线	2,634	1.15%	1,319,496	-5.33%	933,698	-8.21%	24.30	-25.45%	191,800	263,736	34.52%	-71,936	-18.53	-10.90%	36,770	4.69%
棉花	13,513	-1.72%	858,694	18.03%	882,370	109.29%	16.43	28.86%	157,710	126,517	33.10%	31,193	9.68	7.27%	8,759	1.10%
铅	13,618	-0.31%	26,188	2.13%	2,944	16.09%	1.13	0.48%	4,875	5,350	39.04%	-475	0.00	-3.63%	0	0.08%
燃料油	2,975	0.00%	28	0.00%	0	0.00%	0.00	0.00%	0	0	0.00%	0	0.00	0.00%	0	0.00%
塑料	9,905	0.00%	362,988	2.91%	557,618	-13.46%	8.99	2.91%	57,292	35,389	25.53%	21,903	10.85	12.07%	3,088	1.40%
铜	47,301	-0.25%	710,142	3.69%	438,642	-1.94%	182.53	14.54%	151,981	116,979	37.87%	35,002	92.07	9.86%	1,054	-0.06%
橡胶	13,054	-1.04%	196,224	-5.78%	582,640	24.81%	30.52	-6.77%	24,159	35,885	30.60%	-11,726	-16.14	-11.95%	-2,025	2.64%
小麦	2,636	-0.41%	26,458	0.37%	4,578	169.61%	0.70	-0.02%	5,987	6,558	47.41%	-571	-0.30	-4.32%	78	0.61%
锌	16,572	-0.20%	314,866	-4.39%	400,732	-7.65%	16.60	-4.56%	61,755	71,954	42.47%	-10,199	-7.56	-6.48%	131	0.20%
玉米	2,341	0.00%	146,212	-3.38%	17,578	-43.38%	1.71	-3.37%	47,795	31,260	54.07%	16,535	3.87	22.62%	-244	0.44%
棕榈油	5,152	-0.58%	430,780	-7.37%	289,718	-35.52%	11.10	-7.90%	70,341	111,222	42.15%	-40,881	-21.06	-18.98%	7,999	2.04%
白银	3,800	0.18%	534,722	-0.17%	685,022	-7.99%	21.34	0.01%	70,469	72,770	26.79%	-2,301	-0.96	-0.86%	4,432	1.65%
玻璃	954	-0.50%	926,210	-0.68%	300,758	-48.18%	10.60	-1.18%	152,616	173,601	35.22%	-20,985	-3.51	-4.53%	-657	0.17%
菜粕	2,249	-0.40%	1,193,514	3.83%	1,812,038	-28.25%	13.78	3.29%	168,212	212,759	31.92%	-44,547	-9.96	-7.46%	4,621	1.09%
菜籽	4,452	-1.06%	370	0.00%	52	225.00%	0.01	-1.06%	0	0	0.00%	0	0.00	0.00%	0	0.00%
焦煤	777	-0.13%	349,876	-3.59%	168,444	-45.16%	8.16	-3.71%	43,750	62,547	30.38%	-18,797	-8.76	-10.74%	9,116	4.64%
中期国债	96	-0.10%	20,602	-2.98%	3,978	-47.41%	3.94	-3.07%	3,751	7,104	52.69%	-3,353	-32.04	-32.55%	-18	1.14%
沥青	4,080	-0.34%	544	-1.09%	18	-18.18%	0.01	-1.43%	0	0	0.00%	0	0.00	0.00%	0	0.00%
动力煤	519	0.02%	156,638	4.88%	46,326	-41.91%	8.13	4.90%	30,338	38,966	44.24%	-8,628	-9.01	-11.02%	-1,709	1.75%
铁矿石	570	-0.18%	534,290	-5.03%	218,854	-59.97%	15.23	-5.20%	111,954	103,759	40.37%	8,195	4.67	3.07%	-1,244	0.29%
鸡蛋	4,763	-1.10%	186,666	-8.30%	252,082	38.54%	3.56	-9.29%	22,214	17,070	21.05%	5,144	1.23	5.51%	1,340	1.77%
水稻	2,306	0.07%	3,054	0.66%	308	-18.52%	0.07	0.67%	0	0	0.00%	0	0.00	0.00%	0	0.00%
胶合板	131	-0.15%	47,684	8.66%	19,792	-37.10%	3.12	8.51%	9,353	8,027	36.45%	1,326	0.87	5.56%	1,289	5.39%
纤维板	62	-0.08%	29,304	-5.24%	21,908	-16.18%	0.65	-3.70%	5,004	7,591	42.98%	-2,587	-0.79	-17.66%	-526	4.33%

**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](http://www.yhqh.com.cn)