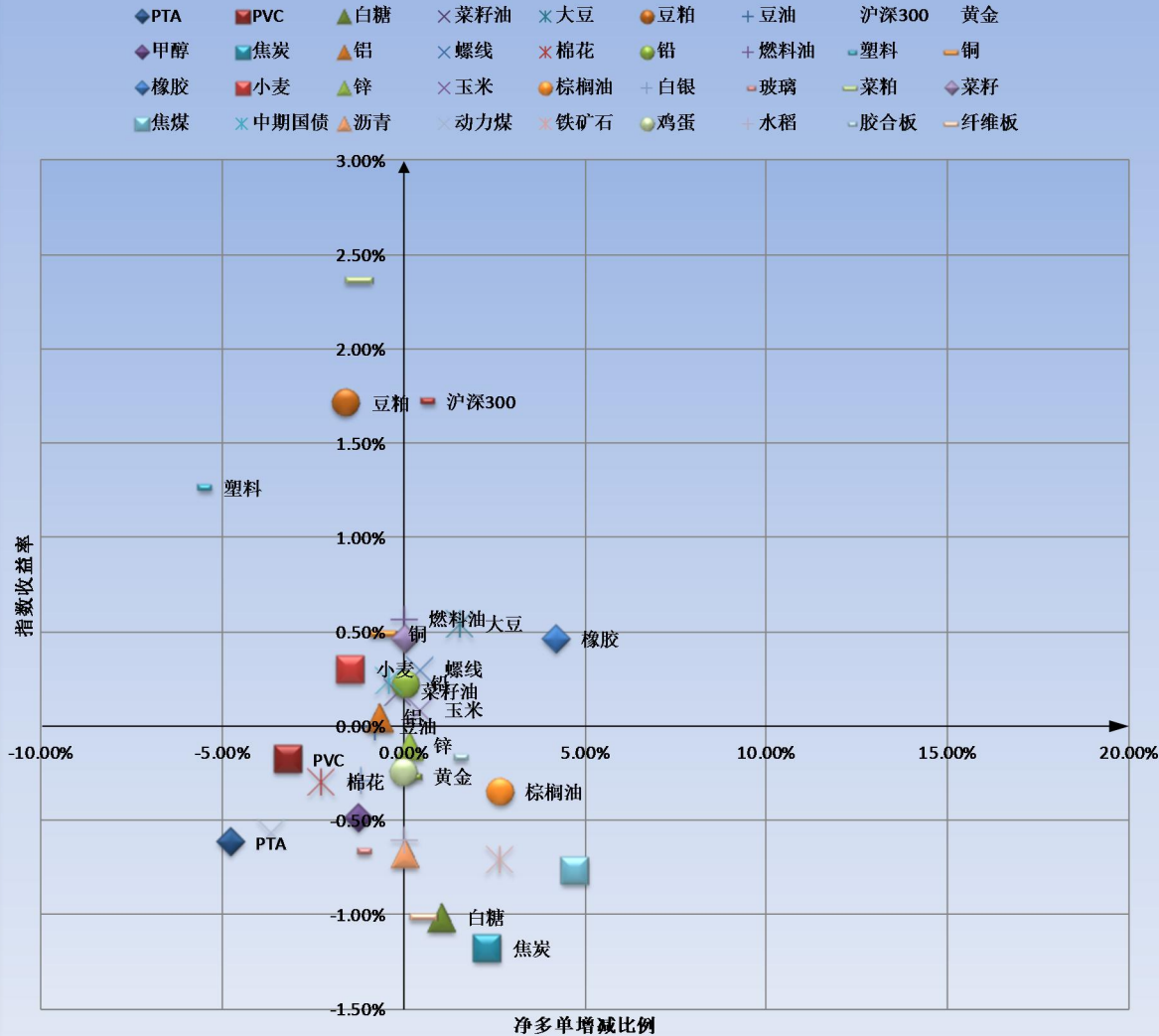


期货市场多空前5名会员持仓统计

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	净多单 Chg.%	保证金 Chg.%	持仓量 Chg.%	成交量 Chg.%
1	焦煤	-0.77%	4.75%	-3.73%	-2.98%	12.66%	
2	橡胶	0.46%	4.18%	6.80%	6.26%	-6.00%	
3	棕榈油	-0.35%	2.66%	-2.48%	-2.14%	-4.05%	
4	铁矿石	-0.70%	2.63%	-1.14%	-0.44%	-37.74%	
5	焦炭	-1.18%	2.31%	-6.53%	-5.41%	-22.12%	
6	大豆	0.54%	1.54%	-1.46%	-1.99%	10.19%	
7	胶合板	-0.17%	1.42%	-2.18%	-2.02%	36.95%	
8	白糖	-1.01%	1.03%	-0.18%	0.85%	-0.88%	
9	纤维板	-1.01%	0.55%	-11.35%	-10.51%	-40.03%	
10	沪深300	1.72%	0.51%	1.01%	-0.70%	4.16%	
11	螺线	0.30%	0.43%	-5.91%	-6.18%	-20.66%	
12	玉米	0.09%	0.42%	-4.30%	-4.38%	-18.32%	
13	锌	-0.10%	0.15%	-3.32%	-3.14%	-37.28%	
14	黄金	-0.27%	0.13%	-3.64%	-3.38%	19.90%	
15	铅	0.22%	0.06%	0.93%	1.69%	64.54%	
16	燃料油	0.57%	0.00%	6.87%	7.14%	-1000.00%	
17	菜籽	0.47%	0.00%	0.47%	0.00%	-73.08%	
18	水稻	-0.60%	0.00%	-0.65%	-0.07%	-43.51%	
19	沥青	-0.68%	0.00%	-0.68%	0.00%	-33.33%	
20	鸡蛋	-0.25%	-0.01%	2.28%	2.53%	-23.28%	
21	菜籽油	0.18%	-0.21%	-1.54%	-1.72%	-30.05%	
22	中期国债	0.24%	-0.44%	2.23%	1.98%	87.93%	
23	铜	0.49%	-0.55%	0.34%	-1.39%	3.26%	
24	铝	0.05%	-0.68%	-0.80%	-0.82%	21.76%	
25	豆油	0.00%	-0.83%	0.35%	0.35%	14.70%	
26	白银	-0.29%	-1.17%	-6.64%	-6.37%	0.38%	
27	菜粕	2.36%	-1.23%	2.84%	0.55%	5.16%	
28	甲醇	-0.49%	-1.26%	-0.73%	0.08%	-32.12%	
29	玻璃	-0.67%	-1.28%	-1.04%	-0.38%	51.27%	
30	小麦	0.30%	-1.46%	-6.92%	-7.23%	-31.45%	
31	豆粕	1.71%	-1.58%	-2.87%	-4.51%	51.74%	
32	棉花	-0.29%	-2.29%	-2.91%	-2.03%	-27.76%	
33	PVC	-0.17%	-3.18%	-15.37%	-15.22%	-69.35%	
34	动力煤	-0.56%	-3.69%	1.14%	1.71%	25.01%	
35	PTA	-0.61%	-4.79%	6.49%	7.15%	49.11%	
36	塑料	1.26%	-5.68%	-3.05%	-4.26%	41.63%	

2014年10月28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	5,654	-0.61%	1,079,756	7.15%	1,355,858	49.11%	18.31	6.49%	207,441	160,578	34.08%	46,863	13.24	8.68%	-21,008	-4.79%
PVC	5,735	-0.17%	43,324	-15.22%	28,800	-69.35%	0.62	-15.37%	9,897	9,146	43.95%	751	0.22	3.47%	-948	-3.18%
白糖	4,664	-1.01%	1,837,656	0.85%	1,448,622	-0.88%	51.46	-0.18%	336,799	396,869	39.92%	-60,070	-28.38	-6.54%	8,893	1.03%
菜籽油	5,896	0.18%	214,020	-1.72%	39,626	-30.05%	6.31	-1.54%	31,403	59,029	42.25%	-27,626	-16.23	-25.82%	257	-0.21%
大豆	4,442	0.54%	663,392	-1.99%	260,578	10.19%	14.74	-1.46%	143,242	104,197	37.30%	39,045	17.33	11.77%	4,411	1.54%
豆粕	3,150	1.71%	864,516	-4.51%	459,876	51.74%	13.62	-2.87%	153,805	164,918	36.87%	-11,113	-3.50	-2.57%	-6,626	-1.58%
豆油	5,754	0.00%	623,338	0.35%	277,108	14.70%	17.93	0.35%	79,038	144,641	35.88%	-65,603	-37.75	-21.05%	-2,793	-0.83%
沪深300	2,422	1.72%	368,876	-0.70%	1,571,978	4.16%	268.03	1.01%	59,960	79,359	37.77%	-19,399	-140.93	-10.52%	1,082	0.51%
黄金	242.85	-0.27%	145,692	-3.38%	104,262	19.90%	21.23	-3.64%	23,989	13,407	25.67%	10,582	28.20	14.53%	-275	0.13%
甲醇	2,641	-0.49%	110,934	0.08%	90,418	-32.12%	7.26	-0.73%	18,422	14,975	30.11%	3,447	2.66	6.21%	-694	-1.26%
焦炭	1,088	-1.18%	188,720	-5.41%	245,330	-22.12%	10.27	-6.53%	33,513	27,185	32.16%	6,328	6.88	6.71%	1,944	2.31%
铝	13,812	0.05%	344,570	-0.82%	80,296	21.76%	13.21	-0.80%	94,173	99,354	56.16%	-5,181	4.72	-3.01%	-1,137	-0.68%
螺线	2,642	0.30%	1,237,970	-6.18%	740,766	-20.66%	22.86	-5.91%	184,414	249,259	35.03%	-64,845	-16.71	-10.48%	7,091	0.43%
棉花	13,473	-0.29%	841,266	-2.03%	637,414	-27.76%	15.95	-2.91%	151,761	130,816	33.59%	20,945	5.43	4.98%	-10,248	-2.29%
铅	13,649	0.22%	26,630	1.69%	4,844	64.54%	1.14	0.93%	4,875	5,350	38.40%	-475	0.00	-3.57%	0	0.06%
燃料油	2,992	0.57%	30	7.14%	10	-1000.00%	0.00	6.87%	0	0	0.00%	0	0.00	0.00%	0	0.00%
塑料	10,030	1.26%	347,534	-4.26%	789,756	41.63%	8.71	-3.05%	47,769	36,660	24.29%	11,109	5.57	6.39%	-10,794	-5.68%
铜	47,532	0.49%	700,306	-1.39%	452,936	3.26%	183.15	0.34%	150,806	118,211	38.41%	32,595	77.64	9.31%	-2,407	-0.55%
橡胶	13,114	0.46%	208,506	6.26%	547,686	-6.00%	32.59	6.80%	26,973	35,072	29.76%	-8,099	-11.42	-7.77%	3,627	4.18%
小麦	2,644	0.30%	24,546	-7.23%	3,138	-31.45%	0.65	-6.92%	5,761	6,470	49.83%	-709	-0.37	-5.78%	-138	-1.46%
锌	16,555	-0.10%	304,992	-3.14%	251,334	-37.28%	16.05	-3.32%	60,919	70,573	43.11%	-9,654	-7.10	-6.33%	545	0.15%
玉米	2,343	0.09%	139,808	-4.38%	14,358	-18.32%	1.64	-4.30%	47,413	31,308	56.31%	16,105	3.77	23.04%	-430	0.42%
棕榈油	5,134	-0.35%	421,554	-2.14%	277,970	-4.05%	10.82	-2.48%	71,990	106,389	42.31%	-34,399	-17.66	-16.32%	6,482	2.66%
白银	3,789	-0.29%	500,638	-6.37%	687,650	0.38%	19.92	-6.64%	66,397	71,490	27.54%	-5,093	-2.55	-2.03%	-2,792	-1.17%
玻璃	948	-0.67%	922,704	-0.38%	454,968	51.27%	10.49	-1.04%	150,483	177,305	35.52%	-26,822	-4.72	-5.81%	-5,837	-1.28%
菜粕	2,302	2.36%	1,200,118	0.55%	1,905,544	5.16%	14.17	2.84%	173,644	225,844	33.29%	-52,200	-11.96	-8.70%	-7,653	-1.23%
菜籽	4,473	0.47%	370	0.00%	14	-73.08%	0.01	0.47%	0	0	0.00%	0	0.00	0.00%	0	0.00%
焦煤	771	-0.77%	339,452	-2.98%	189,766	12.66%	7.85	-3.73%	44,578	54,760	29.26%	-10,182	-4.71	-6.00%	8,615	4.75%
中期国债	96	0.24%	21,010	1.98%	7,476	87.93%	4.03	2.23%	3,761	7,227	52.30%	-3,466	-33.20	-32.99%	-113	-0.44%
沥青	4,052	-0.68%	544	0.00%	12	-33.33%	0.01	-0.68%	0	0	0.00%	0	0.00	0.00%	0	0.00%
动力煤	516	-0.56%	159,316	1.71%	57,910	25.01%	8.22	1.14%	30,994	42,707	46.26%	-11,713	-12.15	-14.70%	-3,085	-3.69%
铁矿石	566	-0.70%	531,926	-0.44%	136,258	-37.74%	15.05	-1.14%	113,791	98,634	39.94%	15,157	8.58	5.70%	6,962	2.63%
鸡蛋	4,752	-0.25%	191,396	2.53%	193,404	-23.28%	3.64	2.28%	22,734	17,468	21.00%	5,266	1.25	5.50%	122	-0.01%
水稻	2,292	-0.60%	3,052	-0.07%	174	-43.51%	0.07	-0.65%	0	0	0.00%	0	0.00	0.00%	0	0.00%
胶合板	131	-0.17%	46,722	-2.02%	27,106	36.95%	3.05	-2.18%	9,454	7,823	36.98%	1,631	1.07	6.98%	305	1.42%
纤维板	62	-1.01%	26,224	-10.51%	13,138	-40.03%	0.58	-11.35%	4,584	6,827	43.51%	-2,243	-0.68	-17.11%	344	0.55%

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