

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	塑料	-1.27%	8.10%	6.98%	8.36%	28.49%
2	中期国债	-0.30%	3.66%	-24.22%	-23.99%	51.03%
3	焦煤	-0.13%	3.43%	-8.05%	-7.93%	-13.64%
4	菜粕	-1.30%	1.93%	-0.92%	0.35%	-12.03%
5	菜籽油	-0.15%	1.78%	1.08%	1.23%	-16.53%
6	螺线	-0.60%	1.36%	-1.24%	-0.74%	-36.58%
7	动力煤	-0.23%	1.25%	-1.09%	-0.87%	35.09%
8	沪深300	-0.36%	0.70%	-0.86%	-0.50%	26.02%
9	鸡蛋	0.44%	0.68%	2.74%	2.29%	-46.35%
10	橡胶	-0.37%	0.45%	-1.65%	-1.26%	16.17%
11	小麦	-0.19%	0.39%	0.27%	0.46%	-40.00%
12	豆油	-0.31%	0.37%	-2.38%	-2.08%	-40.39%
13	甲醇	0.60%	0.35%	-1.98%	-1.14%	-11.83%
14	锌	0.30%	0.31%	0.24%	0.32%	-26.67%
15	棉花	-0.59%	0.26%	2.64%	0.20%	28.46%
16	铜	-0.33%	0.16%	0.64%	0.45%	-27.56%
17	白糖	0.58%	0.11%	6.50%	5.90%	55.45%
18	纤维板	0.16%	0.05%	1.35%	1.46%	1.01%
19	铝	0.01%	0.05%	1.15%	1.50%	8.60%
20	燃料油	0.00%	0.00%	0.00%	0.00%	0.00%
21	菜籽	0.00%	0.00%	0.00%	0.00%	#DIV/0!
22	水稻	-0.98%	0.00%	5.24%	6.61%	196.63%
23	沥青	-0.18%	0.00%	4.93%	-4.30%	-60.00%
24	棕榈油	1.07%	0.00%	4.27%	-5.29%	-16.82%
25	大豆	-0.64%	-0.15%	0.50%	1.15%	28.44%
26	玻璃	0.05%	-0.19%	0.41%	0.36%	-45.62%
27	白银	0.44%	-0.60%	4.54%	-4.93%	-65.46%
28	铝	-0.57%	-0.83%	5.36%	-2.05%	2.76%
29	豆粕	-0.70%	-1.24%	5.15%	-4.48%	-0.24%
30	PVC	-0.17%	-1.32%	7.05%	-6.89%	2.75%
31	黄金	-0.09%	-1.39%	9.48%	-9.40%	-67.33%
32	玉米	0.04%	-1.64%	3.95%	-3.99%	12.01%
33	铁矿石	0.19%	-1.86%	6.85%	-7.02%	-11.71%
34	焦炭	-0.28%	-2.16%	0.45%	0.73%	2.38%
35	PTA	0.07%	-2.28%	25.82%	-2.23%	-15.80%
36	胶合板	0.63%	-3.60%	8.14%	-8.74%	201.25%

2014年11月11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	5,590	0.07%	1,149,336	-2.23%	1,459,484	-15.80%	24.79	25.82%	229,424	191,684	36.64%	37,740	10.53	6.57%	-14,242	-2.28%
PVC	5,785	-0.17%	23,932	-6.89%	4,340	2.75%	0.35	-7.05%	5,430	6,258	48.84%	-828	-0.24	-6.92%	-108	-1.32%
白糖	4,723	0.58%	2,089,380	5.90%	2,589,130	55.45%	59.25	6.50%	361,582	435,474	38.15%	-73,892	-35.28	-7.07%	-3,036	0.11%
菜籽油	6,095	-0.15%	184,868	1.23%	88,790	-16.53%	5.63	1.08%	29,286	54,002	45.05%	-24,716	-15.06	-26.74%	1,326	1.78%
大豆	4,431	-0.64%	706,772	1.15%	326,888	28.44%	15.66	0.50%	154,472	105,467	36.78%	49,005	21.84	13.87%	30	-0.15%
豆粕	3,129	-0.70%	681,550	-4.48%	316,892	-0.24%	10.66	-5.15%	106,438	154,683	38.31%	-48,245	-15.10	-14.16%	-2,176	-1.24%
豆油	5,856	-0.31%	358,676	-2.08%	71,532	-40.39%	10.50	-2.38%	55,156	84,674	38.99%	-29,518	-17.29	-16.46%	1,299	0.37%
沪深300	2,550	-0.36%	398,764	-0.50%	3,081,164	26.02%	305.08	-0.86%	69,751	84,576	38.70%	-14,825	-113.44	-7.44%	1,470	0.70%
黄金	228.95	-0.09%	62,660	-9.40%	68,254	-67.33%	14.34	-9.48%	12,195	9,021	33.86%	3,174	9.62	10.13%	-809	-1.39%
甲醇	2,558	0.60%	144,636	-1.14%	103,130	-11.83%	8.25	-1.98%	27,858	22,420	34.76%	5,438	5.92	7.52%	193	0.35%
焦炭	1,069	-0.28%	134,356	0.73%	135,756	2.38%	7.18	0.45%	27,800	22,947	37.77%	4,853	5.19	7.22%	-1,406	-2.16%
铝	13,752	-0.57%	350,184	-2.05%	131,888	2.76%	15.64	-5.36%	105,998	109,222	61.46%	-3,224	6.06	-1.84%	-1,423	-0.83%
螺线	2,646	-0.60%	906,672	-0.74%	427,260	-36.58%	12.05	-1.24%	162,730	178,709	37.66%	-15,979	-3.81	-3.52%	6,351	1.36%
棉花	13,339	-0.59%	839,150	0.20%	422,998	28.46%	16.02	2.64%	146,984	136,916	33.83%	10,068	10.81	2.40%	1,126	0.26%
铅	13,485	0.01%	31,358	1.50%	4,624	8.60%	1.70	1.15%	4,875	5,350	32.61%	-475	0.00	-3.03%	0	0.05%
燃料油	3,028	0.00%	24	0.00%	0	0.00%	0.00	0.00%	0	0	0.00%	0	0.00	0.00%	0	0.00%
塑料	10,095	-1.27%	335,184	8.36%	713,324	28.49%	8.46	6.98%	62,251	39,397	30.33%	22,854	11.54	13.64%	14,285	8.10%
铜	47,212	-0.33%	673,162	0.45%	311,132	-27.56%	203.56	0.64%	153,486	114,251	39.77%	39,235	136.84	11.66%	710	0.16%
橡胶	12,602	-0.37%	176,452	-1.26%	453,800	16.17%	26.80	-1.65%	25,891	34,264	34.09%	-8,373	-11.36	-9.49%	506	0.45%
小麦	2,591	-0.19%	22,658	0.46%	1,308	-40.00%	0.59	0.27%	5,920	6,024	52.71%	-104	-0.05	-0.92%	44	0.39%
锌	16,747	0.30%	285,192	0.32%	290,068	-26.67%	16.99	0.24%	62,994	73,185	47.75%	-10,191	-7.63	-7.15%	407	0.31%
玉米	2,360	0.04%	103,690	-3.99%	7,796	12.01%	1.22	-3.95%	33,947	26,680	58.47%	7,267	1.72	14.02%	-1,189	-1.64%
棕榈油	5,294	1.07%	203,704	-5.29%	275,684	-16.82%	5.39	4.27%	29,694	28,946	28.79%	748	0.40	0.73%	-42	0.00%
白银	3,369	0.44%	280,380	-4.93%	584,610	-65.46%	14.08	4.54%	48,091	47,634	34.14%	457	0.54	0.33%	-909	-0.60%
玻璃	953	0.05%	892,552	0.36%	331,842	-45.62%	10.21	0.41%	149,811	181,059	37.07%	-31,248	-6.08	-7.00%	-969	-0.19%
菜粕	2,268	-1.30%	1,332,042	0.35%	2,330,048	-12.03%	15.55	-0.92%	215,850	209,942	31.97%	5,908	1.43	0.89%	12,826	1.93%
菜籽	4,492	0.00%	334	0.00%	0	#DIV/0!	0.01	0.00%	0	0	0.00%	0	0.00	0.00%	0	0.00%
焦煤	768	-0.13%	245,578	-7.93%	141,032	-13.64%	5.66	-8.05%	39,548	40,639	32.65%	-1,091	-0.50	-0.89%	4,675	3.43%
中期国债	97	-0.30%	4,746	-23.99%	3,954	51.03%	0.92	-24.22%	1,012	1,648	56.05%	-636	-6.16	-26.80%	315	3.66%
沥青	3,996	-0.18%	356	-4.30%	20	-60.00%	0.01	-4.93%	0	0	0.00%	0	0.00	0.00%	0	0.00%
动力煤	493	-0.23%	190,100	-0.87%	51,878	35.09%	9.38	-1.09%	40,181	44,890	44.75%	-4,709	-4.62	-4.95%	1,239	1.25%
铁矿石	536	0.19%	265,872	-7.02%	125,704	-11.71%	7.13	-6.85%	61,322	48,761	41.40%	12,561	6.73	9.45%	-3,612	-1.86%
鸡蛋	4,610	0.44%	120,492	2.29%	133,968	-46.35%	2.22	2.74%	12,617	10,563	19.24%	2,054	0.47	3.41%	447	0.68%
水稻	2,254	-0.98%	3,160	6.61%	1,234	196.63%	0.08	5.24%	0	0	0.00%	0	0.00	0.00%	0	0.00%
胶合板	131	0.63%	41,688	-8.74%	50,098	201.25%	2.73	-8.14%	7,744	8,183	38.21%	-439	-0.29	-2.11%	-780	-3.60%
纤维板	60	0.16%	29,784	1.46%	15,598	1.01%	0.64	1.35%	4,643	5,485	34.00%	-842	-0.25	-5.65%	-5	0.05%

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