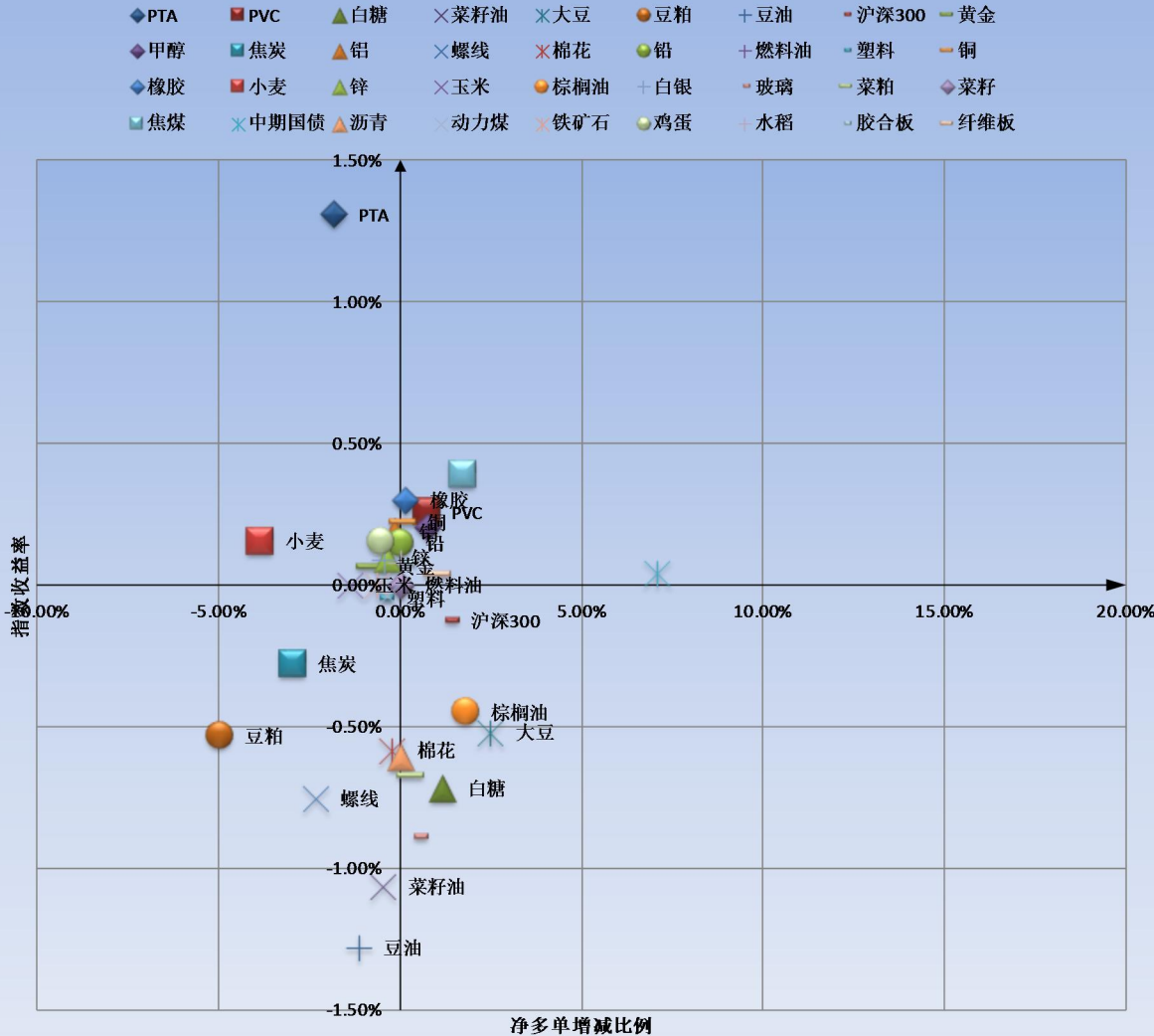


期货市场多空前5名会员持仓统计

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	中期国债	7.09%	0.04%	-1.15%	-15.15%	-15.18%	-16.12%
2	大豆	2.49%	-0.52%	-2.44%	-1.93%	-15.41%	
3	棕榈油	1.81%	-0.45%	-4.02%	-3.59%	-2.07%	
4	焦煤	1.73%	0.39%	0.10%	-0.29%	-5.13%	
5	沪深300	1.28%	-0.13%	-2.01%	-1.89%	7.78%	
6	白糖	1.15%	-0.72%	-4.25%	-3.55%	-22.48%	
7	纤维板	1.02%	0.04%	0.01%	0.12%	-38.29%	
8	甲醇	0.74%	0.20%	-0.06%	0.43%	-41.61%	
9	PVC	0.73%	0.26%	-2.52%	-2.77%	130.85%	
10	玻璃	0.42%	-0.89%	-3.90%	-3.04%	-54.54%	
11	菜粕	0.28%	-0.68%	5.09%	5.97%	-31.53%	
12	胶合板	0.13%	0.08%	-2.32%	-2.42%	10.05%	
13	橡胶	0.13%	0.30%	0.73%	-0.26%	-35.42%	
14	铜	0.08%	0.22%	0.85%	-0.81%	-6.10%	
15	铅	0.02%	0.15%	1.44%	0.78%	39.31%	
16	燃料油	0.00%	0.00%	21.42%	0.00%	0.00%	
17	菜籽	0.00%	0.00%	0.00%	0.00%	-100.00%	
18	水稻	0.00%	0.08%	-1.91%	-2.09%	-62.82%	
19	沥青	0.00%	-0.61%	-0.33%	-8.43%	-76.22%	
20	铝	-0.14%	0.19%	5.59%	1.40%	4.62%	
21	棉花	-0.24%	-0.58%	-0.74%	0.14%	11.01%	
22	锌	-0.36%	0.10%	-2.11%	-3.38%	-7.05%	
23	动力煤	-0.38%	-0.04%	1.35%	1.39%	-44.51%	
24	白银	-0.43%	0.09%	-3.38%	-3.53%	-22.85%	
25	菜籽油	-0.47%	-1.07%	1.45%	2.54%	-8.81%	
26	鸡蛋	-0.52%	0.15%	1.90%	1.75%	-34.43%	
27	塑料	-0.52%	-0.05%	4.79%	4.84%	19.88%	
28	铁矿石	-0.63%	0.00%	7.58%	-7.58%	-40.25%	
29	黄金	-0.80%	0.07%	2.17%	-2.23%	-48.70%	
30	豆油	-1.16%	-1.28%	3.12%	-1.87%	-36.01%	
31	玉米	-1.38%	0.00%	1.81%	-1.81%	-66.66%	
32	PTA	-1.86%	1.31%	9.72%	8.30%	33.38%	
33	螺线	-2.35%	-0.75%	2.72%	-2.16%	-18.63%	
34	焦炭	-2.96%	-0.28%	5.01%	-4.74%	-8.06%	
35	小麦	-3.86%	0.15%	3.97%	-4.14%	19.96%	
36	豆粕	-4.98%	-0.53%	4.85%	-4.34%	-49.57%	

2014年11月13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	5,693	1.31%	1,339,530	8.30%	2,220,426	33.38%	22.88	9.72%	246,004	213,481	34.30%	32,523	9.18	4.86%	-8,981	-1.86%
PVC	5,800	0.26%	22,556	-2.77%	6,884	130.85%	0.33	-2.52%	5,489	6,081	51.29%	-592	-0.17	-5.25%	102	0.73%
白糖	4,787	-0.72%	2,122,084	-3.55%	1,918,948	-22.48%	60.99	-4.25%	368,803	443,333	38.27%	-74,530	-36.01	-7.02%	15,392	1.15%
菜籽油	6,123	-1.07%	195,940	2.54%	89,168	-8.81%	6.00	1.45%	30,712	55,120	43.81%	-24,408	-14.95	-24.91%	-1,052	-0.47%
大豆	4,407	-0.52%	667,044	-1.93%	354,812	-15.41%	14.70	-2.44%	163,503	110,697	41.11%	52,806	23.40	15.83%	7,434	2.49%
豆粕	3,169	-0.53%	623,918	-4.34%	180,522	-49.57%	9.89	-4.85%	92,978	147,365	38.52%	-54,387	-17.24	-17.43%	-13,767	-4.98%
豆油	5,854	-1.28%	320,300	-1.87%	76,404	-36.01%	9.38	-3.12%	48,328	72,686	37.78%	-24,358	-14.26	-15.21%	-1,423	-1.16%
沪深300	2,579	-0.13%	396,412	-1.89%	2,420,118	7.78%	306.67	-2.01%	67,506	82,349	37.80%	-14,843	-114.79	-7.49%	2,879	1.28%
黄金	230.20	0.07%	55,848	-2.23%	36,966	-48.70%	12.85	-2.17%	10,947	8,665	35.12%	2,282	7.62	8.17%	-281	-0.80%
甲醇	2,600	0.20%	144,590	0.43%	79,542	-41.61%	8.25	-0.06%	28,389	22,488	35.19%	5,901	6.69	8.16%	560	0.74%
焦炭	1,066	-0.28%	119,392	-4.74%	85,004	-8.06%	6.37	-5.01%	23,972	23,252	39.55%	720	0.77	1.21%	-1,889	-2.96%
铝	13,770	0.19%	357,628	1.40%	97,976	4.62%	16.32	5.59%	107,125	110,320	60.80%	-3,195	6.08	-1.79%	-294	-0.14%
螺线	2,621	-0.75%	855,834	-2.16%	333,526	-18.63%	11.30	-2.72%	146,262	173,664	37.38%	-27,402	-6.76	-6.40%	-9,652	-2.35%
棉花	13,313	-0.58%	845,978	0.14%	343,256	11.01%	16.27	-0.74%	145,714	137,813	33.51%	7,901	8.64	1.87%	-989	-0.24%
铅	13,505	0.15%	32,074	0.78%	4,876	39.31%	1.91	1.44%	4,875	5,350	31.88%	-475	0.00	-2.96%	0	0.02%
燃料油	3,028	0.00%	24	0.00%	0	0.00%	0.00	21.42%	0	0	0.00%	0	0.00	0.00%	0	0.00%
塑料	10,090	-0.05%	359,664	4.84%	660,962	19.88%	9.07	4.79%	69,061	42,490	31.02%	26,571	13.41	14.78%	332	-0.52%
铜	47,324	0.22%	671,068	-0.81%	335,322	-6.10%	208.10	0.85%	148,780	113,814	39.13%	34,966	112.57	10.42%	-14	0.08%
橡胶	12,984	0.30%	184,852	-0.26%	375,926	-35.42%	29.10	0.73%	26,991	33,448	32.70%	-6,457	-9.24	-6.99%	136	0.13%
小麦	2,607	0.15%	20,668	-4.14%	4,592	19.96%	0.54	-3.97%	5,429	6,215	56.34%	-786	-0.41	-7.61%	-382	-3.86%
锌	16,769	0.10%	268,394	-3.38%	306,822	-7.05%	16.03	-2.11%	61,367	71,011	49.32%	-9,644	-7.19	-7.19%	-169	-0.36%
玉米	2,365	0.00%	95,786	-1.81%	4,326	-66.66%	1.13	-1.81%	31,439	26,138	60.11%	5,301	1.25	11.07%	-772	-1.38%
棕榈油	5,308	-0.45%	178,370	-3.59%	231,290	-2.07%	4.73	-4.02%	27,517	26,685	30.39%	832	0.44	0.93%	1,645	1.81%
白银	3,398	0.09%	255,342	-3.53%	277,460	-22.85%	12.94	-3.38%	48,371	46,733	37.25%	1,638	1.15	1.28%	-626	-0.43%
玻璃	958	-0.89%	948,626	-3.04%	497,048	-54.54%	10.91	-3.90%	146,398	187,084	35.15%	-40,686	-7.72	-8.58%	3,350	0.42%
菜粕	2,310	-0.68%	1,310,964	5.97%	1,664,850	-31.53%	15.58	5.09%	214,361	209,820	32.36%	4,541	1.09	0.69%	1,989	0.28%
菜籽	4,531	0.00%	96	0.00%	0	-100.00%	0.00	0.00%	0	0	0.00%	0	0.00	0.00%	0	0.00%
焦煤	776	0.39%	230,108	-0.29%	99,108	-5.13%	5.36	0.10%	42,828	38,962	35.54%	3,866	1.80	3.36%	1,982	1.73%
中期国债	97	0.04%	2,838	-15.18%	2,206	-16.12%	0.55	-5.15%	838	1,030	65.82%	-192	-1.85	-13.53%	153	7.09%
沥青	3,990	-0.61%	304	-8.43%	88	-76.22%	0.01	-10.33%	0	0	0.00%	0	0.00	0.00%	0	0.00%
动力煤	497	-0.04%	188,708	1.39%	27,154	-44.51%	9.38	1.35%	40,429	45,290	45.42%	-4,861	-4.82	-5.15%	-419	-0.38%
铁矿石	535	0.00%	227,522	-7.58%	57,092	-40.25%	6.09	-7.58%	54,546	40,457	41.76%	14,089	7.54	12.38%	-1,932	-0.63%
鸡蛋	4,611	0.15%	120,450	1.75%	116,950	-34.43%	2.22	1.90%	12,407	10,360	18.90%	2,047	0.47	3.40%	-270	-0.52%
水稻	2,252	0.08%	3,180	-2.09%	232	-62.82%	0.08	-1.91%	0	0	0.00%	0	0.00	0.00%	0	0.00%
胶合板	130	0.08%	40,840	-2.42%	17,630	10.05%	2.66	-2.32%	7,792	8,015	38.70%	-223	-0.14	-1.09%	33	0.13%
纤维板	60	0.04%	28,450	0.12%	7,948	-38.29%	0.61	0.01%	4,719	5,257	35.07%	-538	-0.16	-3.78%	144	1.02%

**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)