

概述

1、主力持有收益：

品种	持有收益 (%)	排序	品种	变化%
鸡蛋	89.08	1	鸡蛋	6.61
焦炭	58.79	2	铁矿石	2.85
胶合板	38.92	3	橡胶	2.65
玻璃	-51.83	-1	菜粕	-7.45
强麦	-43.99	-2	甲醇	-7.37
纤维板	-38.66	-3	豆粕	-6.83

2、主力价格：

排序	品种	结算价格 (%)	排序	品种	结算价格 (%)
1	白糖	0.89	-1	菜粕	-1.66
2	玻璃	0.67	-2	豆粕	-1.50
3	橡胶	0.63	-3	甲醇	-0.70
4	锌	0.62	-4	PVC	-0.66
5	铁矿石	0.60	-5	棉花	-0.58
6	焦炭	0.44	-6	PTA	-0.48

3、持仓量：

品种	持仓变化%	排序	品种	周均变化%
胶合板	7.51	1	菜粕	14.09
锌	5.42	2	甲醇	13.31
鸡蛋	4.66	3	PTA	10.96
焦煤	-4.27	-1	沥青	-16.22
LLDPE	-3.30	-2	焦煤	-13.41
铁矿石	-2.66	-3	铝	-12.33

4、成交量：

品种	成交变化%	排序	品种	周均变化%
白糖	163.92	1	甲醇	133.98
棉花	102.24	2	菜油	68.59
锌	78.68	3	棉花	59.93
PVC	-63.51	-1	铝	-71.62
玉米	-61.85	-2	沥青	-62.12
甲醇	-58.38	-3	动力煤	-50.23

注：以上变化若未特别指明，均是指日变化。

详表

持有收益表 主力合约

品种	现货	期货	持有收益 (%)	期货到期日	持有收益 较上日变 化%	期货价格 较上日变 化%
玉米	2550.00	2395	-26.54	2014/9/15	-1.37	-0.25
大豆	4306.84	4488	6.98	2015/1/15	-0.11	-0.09
豆粕	3920.00	3669	-28.06	2014/9/15	-6.83	-1.50
菜粕	3220.00	3025	-26.44	2014/9/15	-7.45	-1.66
豆油	6686.67	6848	4.08	2015/1/15	0.46	0.26
棕榈油	5750.00	5800	3.54	2014/9/15	1.43	0.35
菜油	7312.50	6926	-9.65	2015/1/15	0.75	0.44
菜籽	5100.00	4919	-15.09	2014/9/15	-1.70	-0.36
强麦	2880.00	2601	-43.99	2014/9/15	0.03	0.12
早灿稻	2600.00	2417	-31.05	2014/9/15	0.02	0.08
鸡蛋	4027.50	5145	89.08	2014/9/15	6.61	-0.21
胶合板	121.38	134.1	38.92	2014/9/15	0.43	0.00
纤维板	65.00	59.4	-38.66	2014/9/15	0.69	0.25
LLDPE	12200.00	11855	-11.93	2014/9/15	-1.19	-0.25
PVC	6140.00	6055	-5.76	2014/9/15	-2.76	-0.66
PTA	7300.00	7048	-14.66	2014/9/15	-1.03	-0.48
甲醇	2685.00	2682	-0.46	2014/9/15	-7.37	-0.70
玻璃	1187.20	1054	-51.83	2014/9/15	2.37	0.67
橡胶	13700.00	14345	18.44	2014/9/15	2.65	0.63
焦炭	980.00	1144	58.79	2014/9/15	2.18	0.44
焦煤	830.00	807	-11.69	2014/9/15	0.91	0.25
螺纹钢	3160.00	3014	-14.86	2014/10/15	0.41	0.17
铁矿石	662.25	667	2.92	2014/9/15	2.85	0.60
动力煤	515.00	504	-10.08	2014/9/5	0.06	0.04
铝	13280.00	13445	7.72	2014/8/15	-0.32	-0.15
铜	49300.00	48170	-14.76	2014/8/15	-0.18	0.06
锌	15450.00	15515	2.64	2014/8/15	0.63	0.62
铅	13950.00	14025	3.37	2014/8/15	2.48	0.39
黄金	253.99	255.2	0.96	2014/12/15	-1.04	-0.31
白银	4116.00	4129	0.64	2014/12/15	-0.63	-0.05
棉花	17373.00	15455	-21.47	2015/1/15	-1.19	-0.58
白糖	4645.00	4990	11.96	2015/1/15	1.13	0.89
沥青	4208.00	4252	4.24	2014/9/15	0.05	0.00

注：持有收益是指持有期货主力合约空头头寸，且假设期货价格最终收敛于现货价格时此头寸所获得的年化收益率，未考虑费用。

部分现货价格来源说明：玻璃(全国浮法玻璃均价); 鸡蛋(四大主产区均价); 焦炭(山西一级冶金焦); 焦煤(邢台主焦煤); 大豆(全国均价); 动力煤(秦皇岛港平仓价); 纤维板(廊坊中纤板)

持仓/仓单 近月合约

品种	仓单	有效预报	持仓	持仓/仓单	仓单变化
玉米	1277		10	0.01	0
大豆	8132		4	0.00	0
豆粕	7580		1868	0.25	-130
菜粕	1		990	990.00	0
豆油	1655		8	0.00	0
棕榈油	0		0	-	0
菜油	0	0	2	-	0
菜籽	0	0	2	-	0
强麦	10432	127	14	0.00	-226
早灿稻	776	0	1448	1.87	-58
鸡蛋	0		301712	-	0
胶合板	126		184	1.46	0
纤维板	326		446	1.37	-7
LLDPE	164		0	0.00	0
PVC	0		0	-	0
PTA	12121		264	0.02	-120
甲醇	0		2	-	0
玻璃	250		20	0.08	0
橡胶	121510		1480	0.01	-110
焦炭	10		26	2.60	0
焦煤	0		6	-	0
螺纹	9505		864	0.09	0
铁矿石	400		42	0.11	200
动力煤	0		0	-	0
铝	233890		53122	0.23	-5546
铜	8749		121910	13.93	0
锌	48739		22670	0.47	-26
铅	48140		2596	0.05	-50
黄金	2016		38	0.02	0
白银	268212		1738	0.01	349
棉花	119		28	0.24	0
白糖	9572		658	0.07	-8
沥青	76230		2	0.00	0

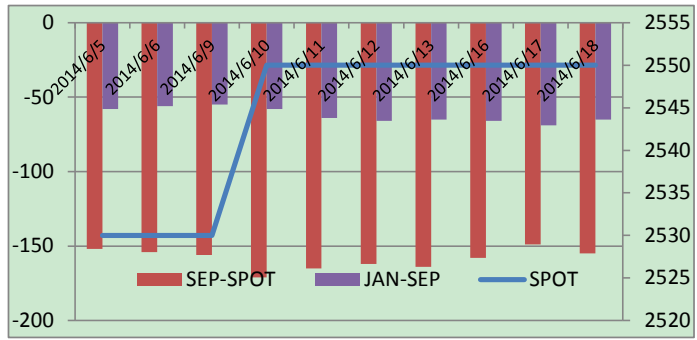
注：持仓量统计的是该品种近月合约持仓量，仓单是交易所仓单数量。当持仓/仓单比大于20则存在逼仓风险

持仓&成交

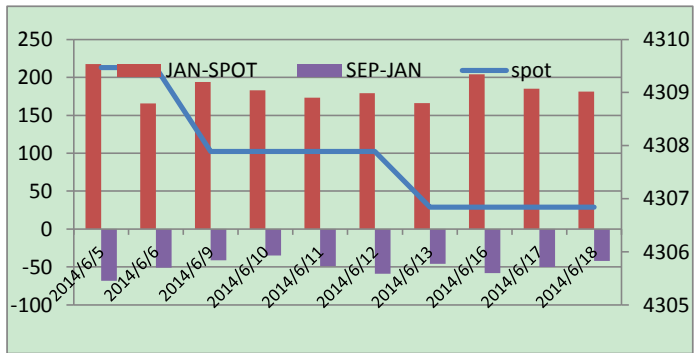
品种

品种	成交量	持仓量	成交变化%	持仓变化%	成交 周均变化%	持仓 周均变化%
玉米	30720	295078	-61.85	-1.17	36.62	-1.72
大豆	177204	618352	-19.42	0.41	0.79	0.12
豆粕	2458158	3758062	-30.17	1.03	24.86	6.81
菜粕	5774672	2039252	-11.27	2.31	24.35	14.09
豆油	505826	1054662	-15.47	-1.44	56.28	-1.55
棕榈油	570706	734486	-1.02	2.22	59.84	2.57
菜油	125150	318742	2.42	-1.02	68.59	7.76
菜籽	364	1660	18.18	0.12	13.50	-7.04
强麦	8440	71562	69.96	2.19	-41.36	4.18
早籼稻	1174	10092	15.78	1.65	-41.92	-0.72
鸡蛋	308916	393780	-45.03	4.66	-16.60	-2.60
胶合板	111208	80474	-13.77	7.51	-35.42	2.81
纤维板	73018	153396	-25.67	-1.33	-30.26	9.29
LLDPE	914696	860740	39.62	-3.30	41.67	2.08
PVC	7252	36076	-63.51	-0.25	-4.61	-12.07
PTA	1100856	766250	-6.05	1.47	10.15	10.96
甲醇	131342	69648	-58.38	2.54	133.98	13.31
玻璃	1033554	615692	69.50	3.26	41.85	-3.09
橡胶	681794	421622	2.12	-1.53	-9.99	-2.24
焦炭	383374	314344	-26.19	-0.90	-5.73	1.28
焦煤	383804	346678	-45.61	-4.27	5.59	-13.41
螺纹	1619322	2810676	-33.72	-1.06	-2.78	9.06
铁矿石	551478	810556	-18.91	-2.66	-6.01	-5.58
动力煤	5142	71764	-55.14	-0.84	-50.23	3.79
铝	87100	336158	23.14	-1.74	-71.62	-12.33
铜	357136	713028	-4.74	1.16	-35.61	-3.44
锌	156434	241844	78.68	5.42	-47.10	-0.40
铅	1764	14280	33.84	1.10	-39.13	-4.90
黄金	128970	212854	-15.36	-0.55	10.16	-7.02
白银	702762	440304	-18.45	0.95	35.99	-2.41
棉花	49412	236982	102.24	1.19	59.93	1.02
白糖	1033414	1050266	163.92	2.25	8.66	1.85
沥青	1092	27016	-12.22	-0.88	-62.12	-16.22

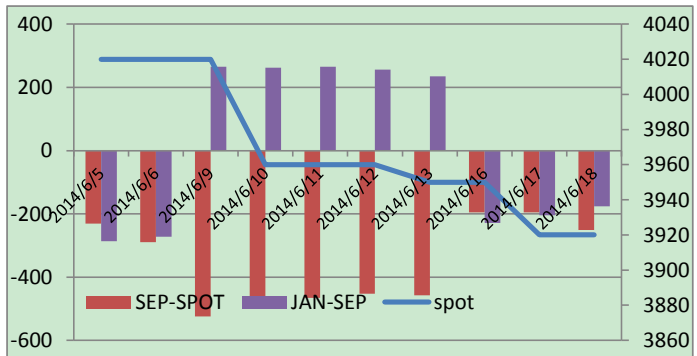
玉米



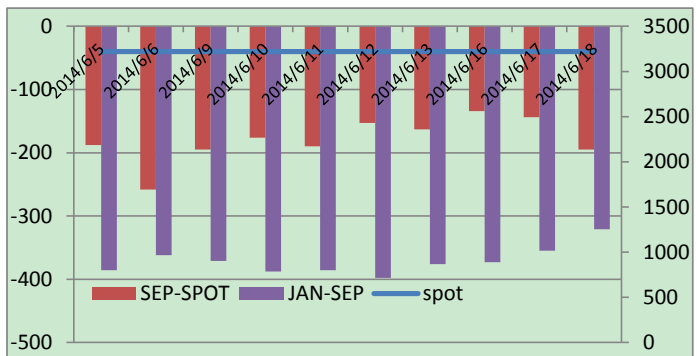
大豆



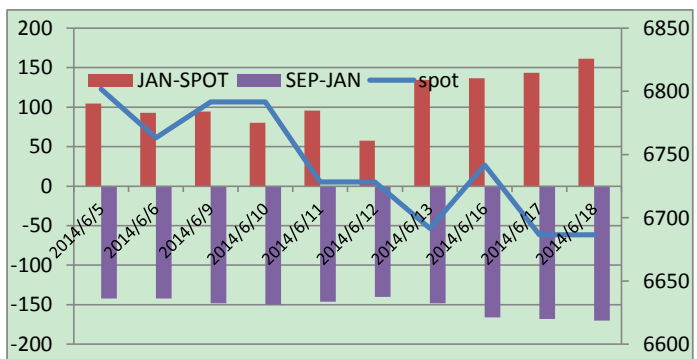
豆粕



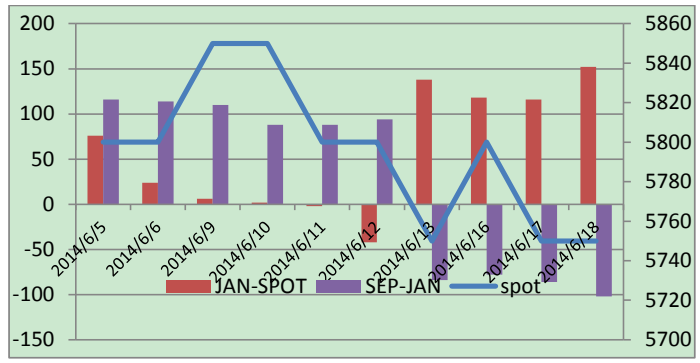
菜粕



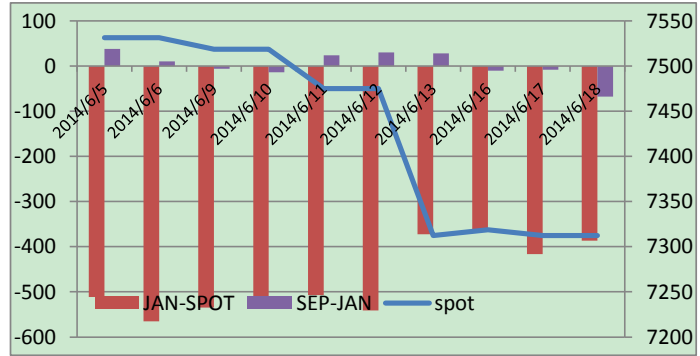
豆油



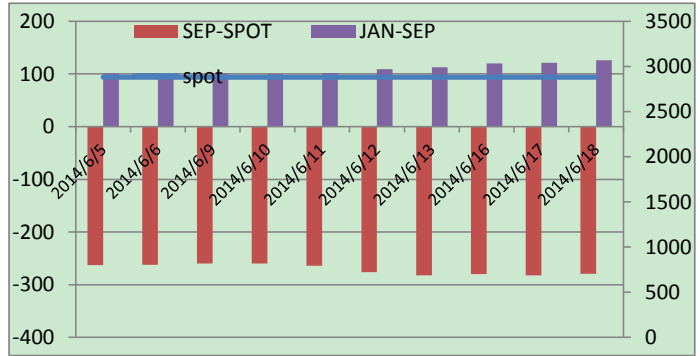
棕榈油



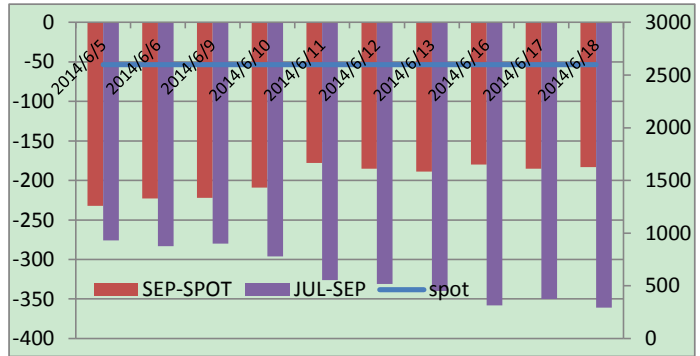
菜油



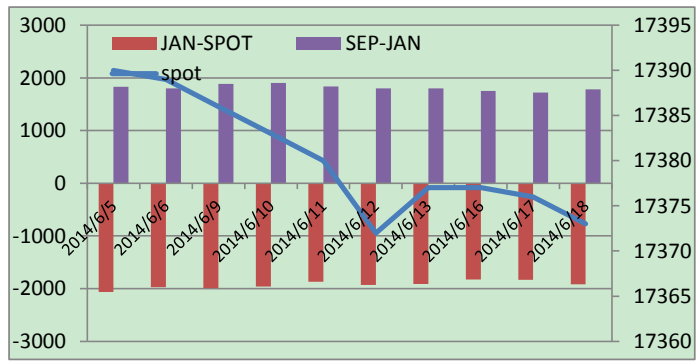
强麦



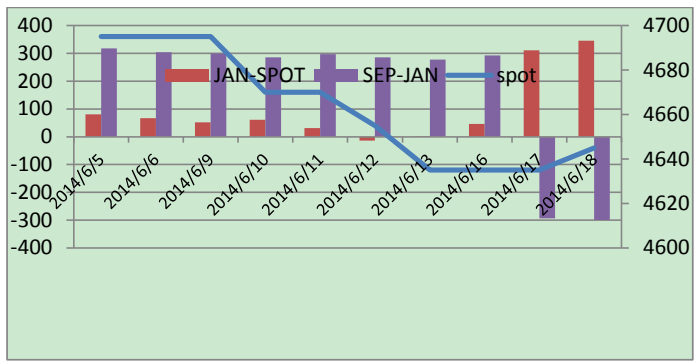
早籼稻



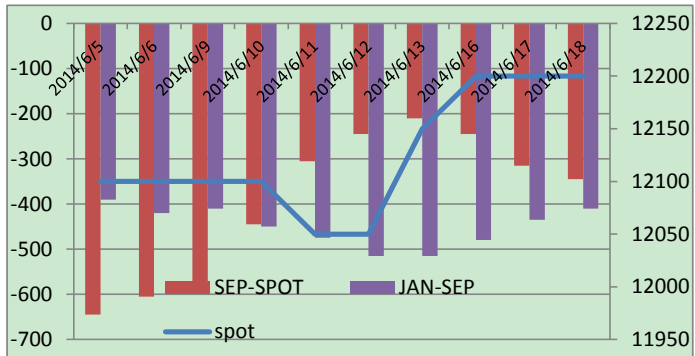
棉花



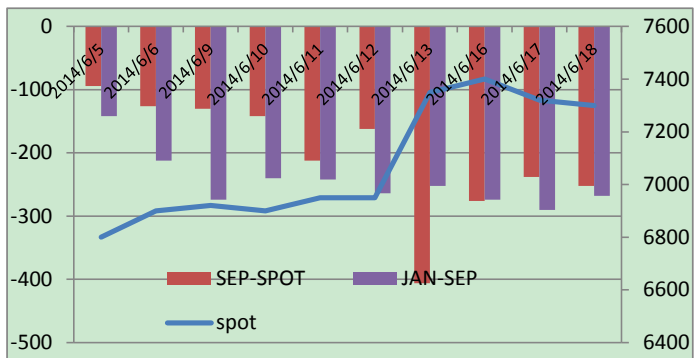
白糖



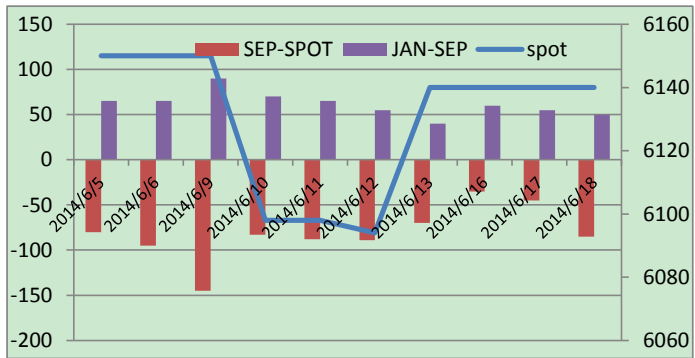
LLDPE



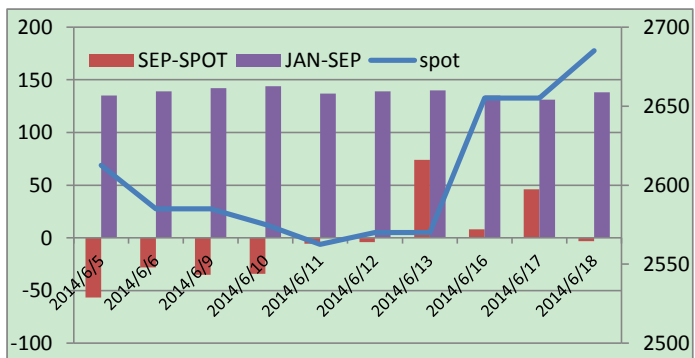
PTA



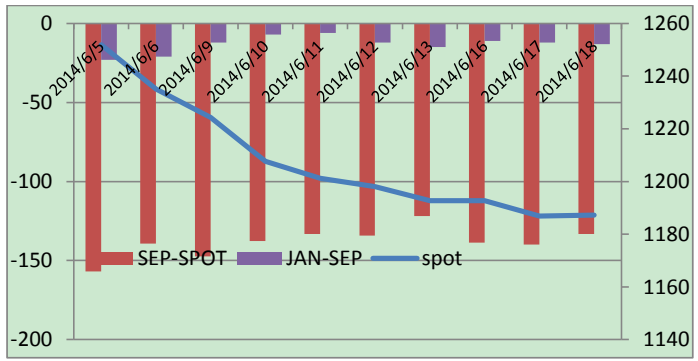
PVC



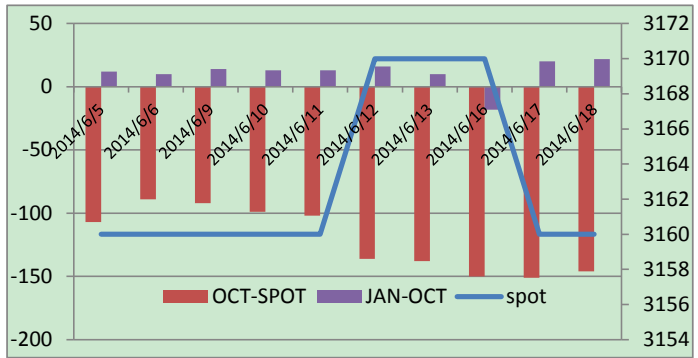
甲醇



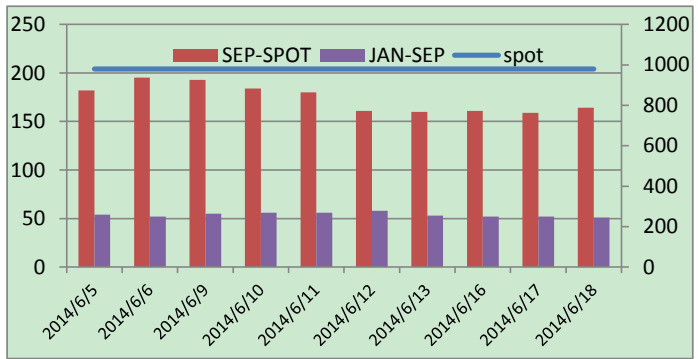
玻璃



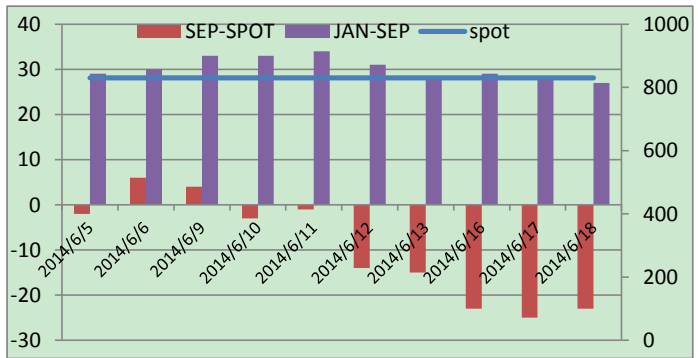
螺纹



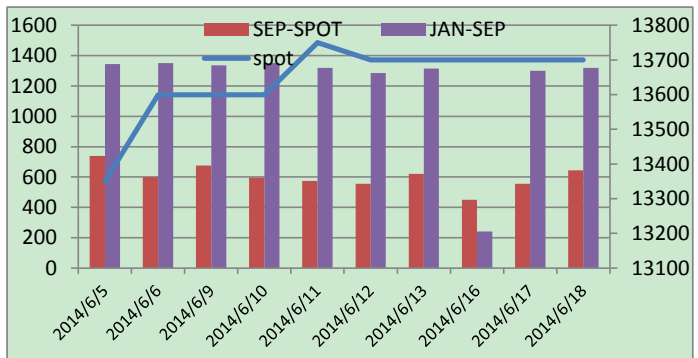
焦炭



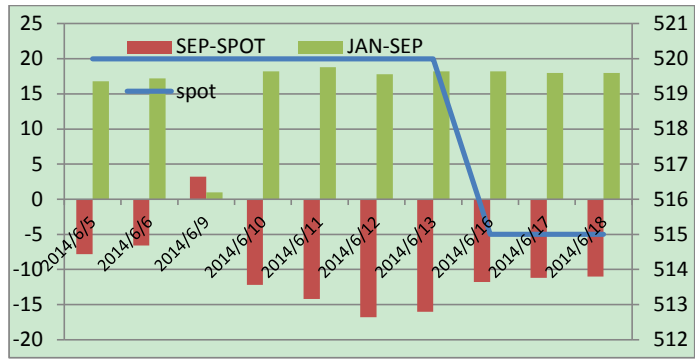
焦煤



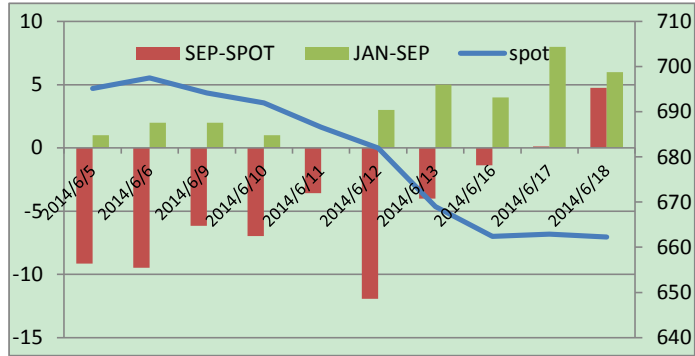
橡胶



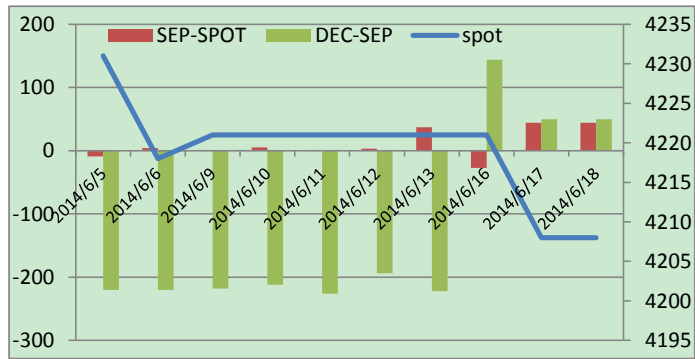
动力煤



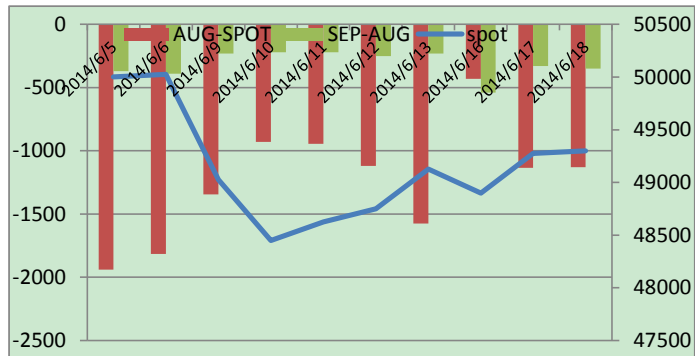
铁矿石



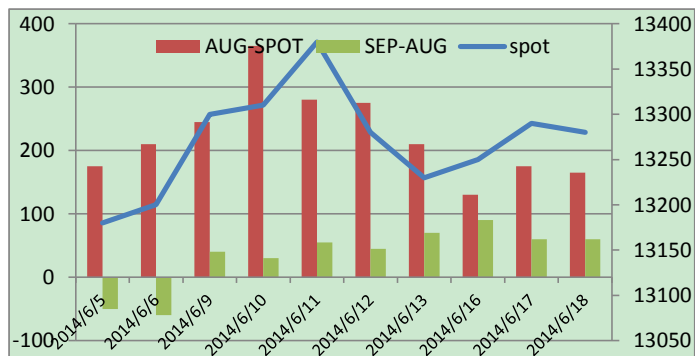
沥青



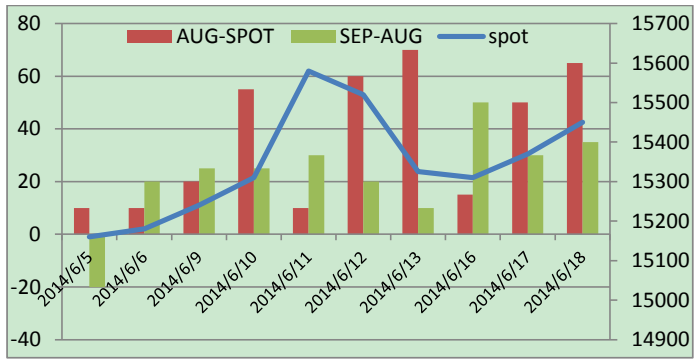
铜



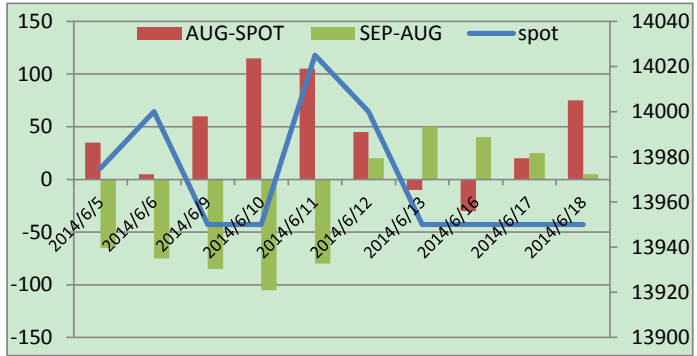
铝



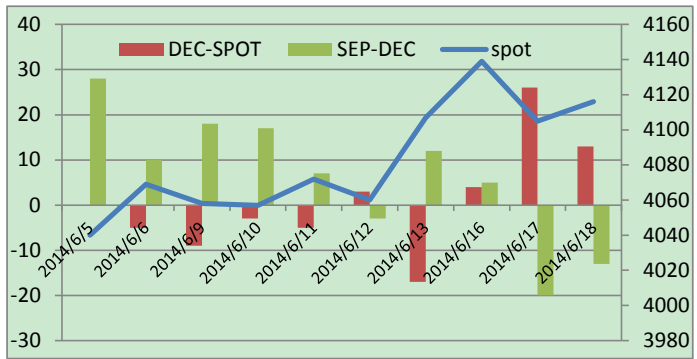
锌



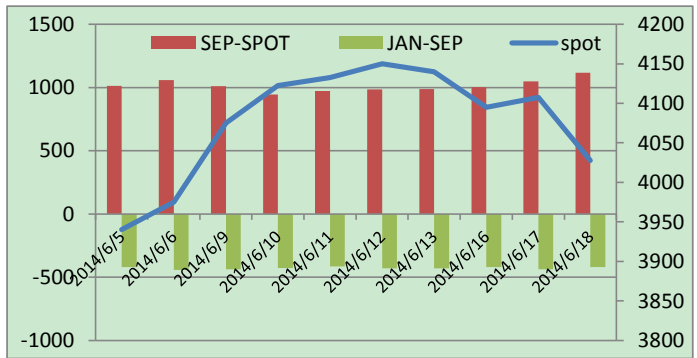
铅



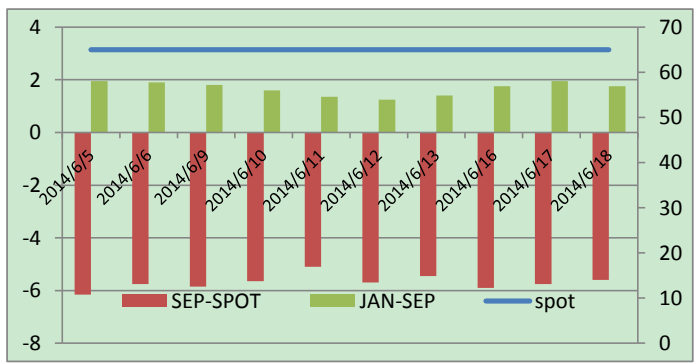
白银



鸡蛋



纤维板



胶合板

