

永安杭州研究中心

分析师：刘慧娇 投资咨询号：Z0001681
 电话：0571-88373219 邮箱：lhjpass@163.com

2015/1/9

概述

1、主力持有收益：

品种	持有收益 (%)	排序	品种	变化%
胶合板	66.54	1	橡胶	3.31
大豆	45.14	2	LLDPE	2.60
沥青	25.19	3	铜	2.04
强麦	-610.73	-1	强麦	-64.24
玻璃	-48.45	-2	沥青	-4.06
早籼稻	-47.25	-3	胶合板	-2.79

2、主力价格：

排序	品种	结算价格 (%)	排序	品种	结算价格 (%)
1	菜油	1.56	-1	沥青	-2.01
2	豆油	0.74	-2	橡胶	-1.60
3	焦炭	0.67	-3	锌	-0.90
4	棕榈油	0.60	-4	胶合板	-0.50
5	甲醇	0.45	-5	PVC	-0.28
6	玻璃	0.42	-6	螺纹	-0.23

3、持仓量：

品种	持仓变化%	排序	品种	周均变化%
菜油	188.30	1	沥青	413.16
沥青	150.82	2	铝	82.88
豆油	53.25	3	PTA	62.93
菜籽	-100.00	-1	纤维板	-74.38
鸡蛋	-57.08	-2	胶合板	-74.26
强麦	-51.95	-3	大豆	-73.34

4、成交量：

品种	成交变化%	排序	品种	周均变化%
沥青	39.56	1	沥青	144.82
菜油	11.70	2	PTA	35.48
焦煤	5.89	3	鸡蛋	19.29
纤维板	-5.69	-1	焦炭	-41.34
早籼稻	-5.29	-2	纤维板	-31.72
玻璃	-3.58	-3	胶合板	-31.16

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	2420.00	2400	-2.40	2015/5/15	0.82	0.29
大豆	3800.00	4508	45.14	2015/5/15	0.62	0.11
豆粕	3200.00	2861	-34.05	2015/5/15	-0.49	-0.07
菜粕	2250.00	2250	0.00	2015/5/15	-0.25	-0.09
豆油	5813.33	5742	-3.57	2015/5/15	0.85	0.74
棕榈油	5050.00	5062	0.68	2015/5/15	1.70	0.60
菜油	6225.00	6138	-4.07	2015/5/15	0.34	1.56
菜籽	5180.00	4479	-30.55	2015/7/14	-0.16	0.00
强麦	2880.00	2540	-610.73	2015/1/16	-64.24	0.08
早灿稻	2670.00	2293	-47.25	2015/5/15	-0.66	-0.09
鸡蛋	4045.00	4280	15.78	2015/5/15	1.57	0.35
胶合板	121.38	129.9	66.54	2015/2/13	-2.79	-0.50
纤维板	65.00	61.35	-17.10	2015/5/15	0.36	0.16
LLDPE	9250.00	8360	-30.60	2015/5/15	2.60	-0.18
PVC	5670.00	5335	-18.05	2015/5/15	1.51	-0.28
PTA	4380.00	4662	17.38	2015/5/15	1.47	0.04
甲醇	1885.00	2031	16.93	2015/6/12	1.08	0.45
玻璃	1150.26	954	-48.45	2015/6/12	0.86	0.42
橡胶	12350.00	13225	19.02	2015/5/15	3.31	-1.60
焦炭	1185.00	1057	-34.80	2015/5/15	1.86	0.67
焦煤	808.52	741	-26.19	2015/5/15	0.06	0.14
螺纹钢	2750.00	2580	-18.94	2015/5/15	1.35	-0.23
铁矿石	544.21	512	-18.08	2015/5/15	1.06	0.20
动力煤	515.00	481	-21.50	2015/5/8	-0.45	-0.08
铝	12740.00	12800	2.55	2015/3/16	0.46	0.08
铜	45525.00	44740	-9.56	2015/3/16	2.04	0.18
锌	16750.00	16515	-7.75	2015/3/16	-1.79	-0.90
铅	12575.00	12395	-7.91	2015/3/16	0.31	-0.12
黄金	242.35	245.2	2.69	2015/6/15	0.49	-0.06
白银	3492.00	3558	4.29	2015/6/15	0.48	0.06
棉花	13603.00	13125	-10.47	2015/5/15	-0.19	-0.04
白糖	4500.00	4671	10.52	2015/5/15	1.14	0.39
沥青	3041.72	3414	25.19	2015/6/15	-4.06	-2.01

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(天津港含税平仓价); 焦煤(澳大利亚); 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	4949		3256	0.66	0
大豆	13485		17814	1.32	2050
豆粕	5980		10804	1.81	1100
菜粕	2600		3954	1.52	0
豆油	9734		2412	0.25	-240
棕榈油	100		15004	150.04	0
菜油	2683	1830	4860	1.81	0
菜籽	0	0	66	-	0
强麦	5348	0	10380	1.94	0
早灿稻	218	0	384	1.76	0
鸡蛋	0		6	-	0
胶合板	816		2828	3.47	0
纤维板	6		352	58.67	0
LLDPE	16		1576	98.50	-6
PVC	60		1558	25.97	60
PTA	8943		20978	2.35	411
甲醇	1193		3120	2.62	0
玻璃	650		1516	2.33	0
橡胶	119930		19280	0.16	0
焦炭	1110		21564	19.43	0
焦煤	0		6828	-	0
螺纹	9051		16560	1.83	0
铁矿石	0		3766	-	0
动力煤	0		10594	-	0
铝	46885		30050	0.64	-1713
铜	31128		26250	0.84	301
锌	9597		6270	0.65	-201
铅	39252		4120	0.10	-704
黄金	1140		78	0.07	0
白银	120346		4936	0.04	0
棉花	710		21816	30.73	27
白糖	34104		78268	2.29	792
沥青	0		10	-	0

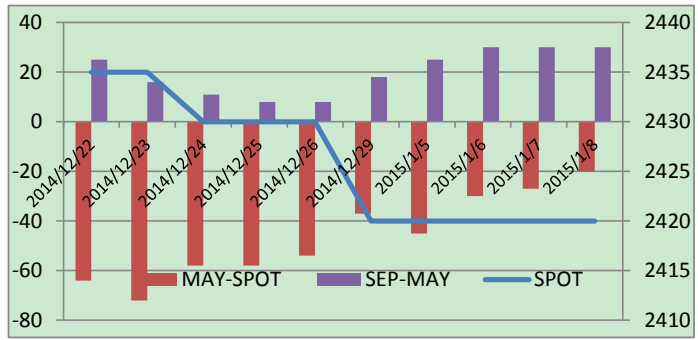
注：持仓量统计的是该品种近月合约持仓量，仓单是交易所仓单数量。当持仓/仓单比大于20则存在逼仓风险

持仓&成交

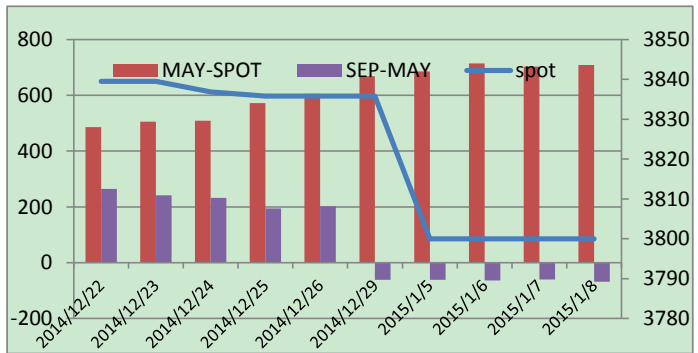
品种

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	269282	74522	-2.30	28.69	-6.15	-5.40
大豆	354782	109272	-1.17	-5.42	-13.88	-73.34
豆粕	3057600	1239394	0.59	-20.50	-1.76	-26.54
菜粕	1268514	1357062	-1.26	-16.36	-1.86	-37.75
豆油	848852	501408	1.04	53.25	2.46	-34.22
棕榈油	619708	513536	1.85	33.17	-3.93	-56.63
菜油	175624	145458	11.70	188.30	2.39	-26.19
菜籽	76	0	0.00	-100.00	-5.00	-25.00
强麦	16708	568	-0.81	-51.95	-2.82	-48.21
早籼稻	1002	74	-5.29	8.82	-26.61	-60.58
鸡蛋	165908	90802	0.09	-57.08	19.29	-9.45
胶合板	18354	7056	0.95	-7.96	-31.16	-74.26
纤维板	2984	1920	-5.69	23.87	-31.72	-74.38
LLDPE	710492	1046064	-3.46	-28.74	1.70	61.11
PVC	53974	6842	3.67	-41.00	-11.74	37.85
PTA	1647846	1833990	1.50	-35.24	35.48	62.93
甲醇	26540	10000	0.56	-49.82	-20.06	-71.89
玻璃	693174	550296	-3.58	4.24	4.95	-22.96
橡胶	305372	721514	0.69	-8.63	4.53	28.98
焦炭	166144	227106	-0.10	34.35	-41.34	43.50
焦煤	196544	139566	5.89	10.86	-6.21	49.38
螺纹	2666072	3893890	-0.67	-15.13	-1.96	47.14
铁矿石	838810	741612	-0.83	-29.41	-9.32	28.01
动力煤	39648	9308	0.60	-20.57	-15.10	-62.83
铝	385664	81836	0.42	-24.46	11.31	82.88
铜	695008	382756	-0.75	-27.84	-3.14	-10.13
锌	259634	243846	-1.10	5.58	11.19	24.56
铅	43558	12778	0.53	-27.34	-6.83	-49.44
黄金	217208	177132	1.16	-25.53	9.07	23.48
白银	426520	1440368	2.46	-23.02	3.42	17.34
棉花	585136	191330	1.22	-13.85	-7.90	-44.97
白糖	1075474	1070020	2.26	-22.59	-5.39	-2.06
沥青	628	306	39.56	150.82	144.82	413.16

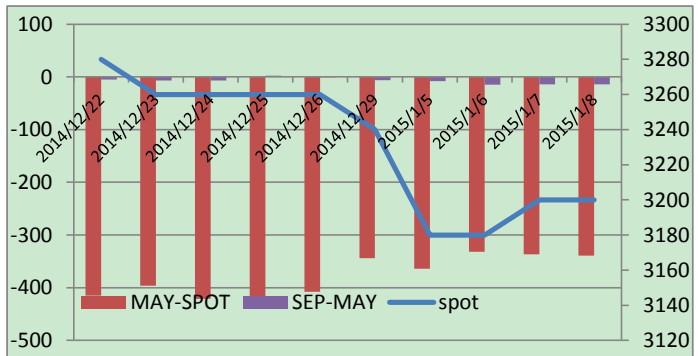
玉米



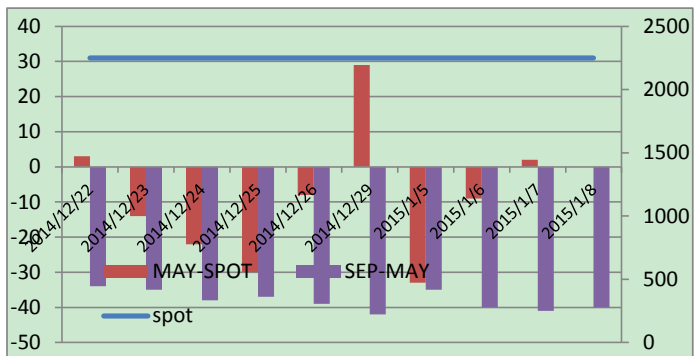
大豆



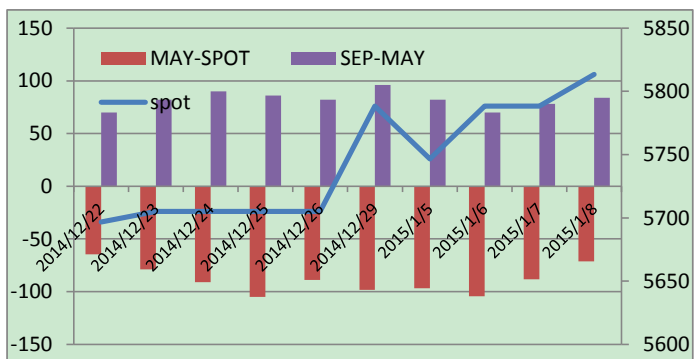
豆粕



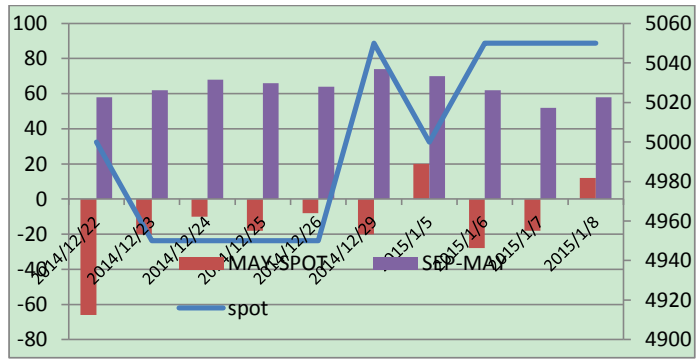
菜粕



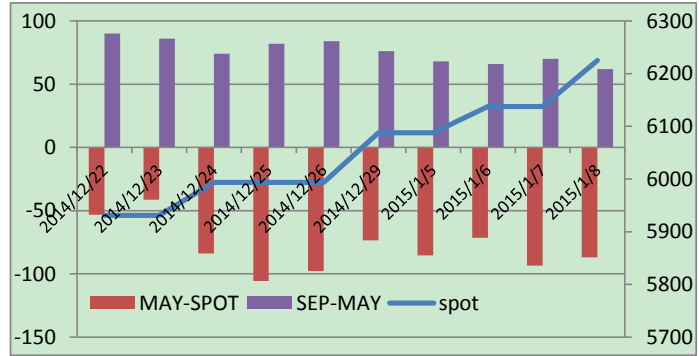
豆油



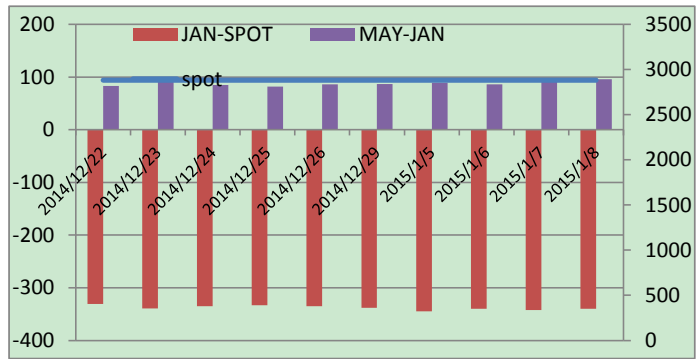
棕榈油



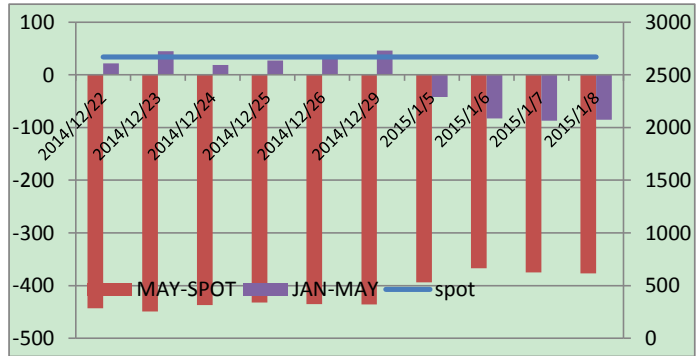
菜油



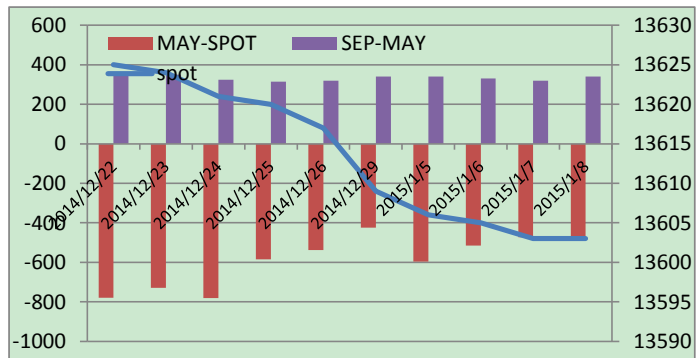
强麦



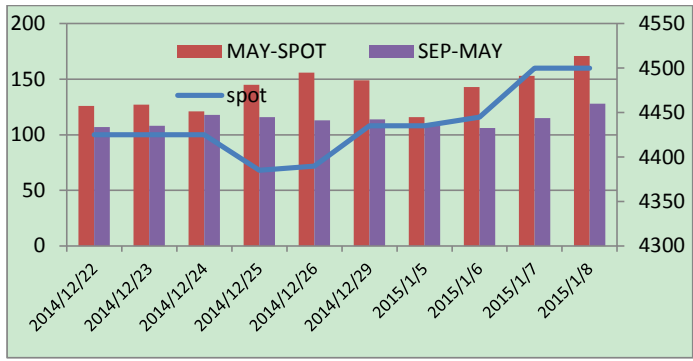
早籼稻



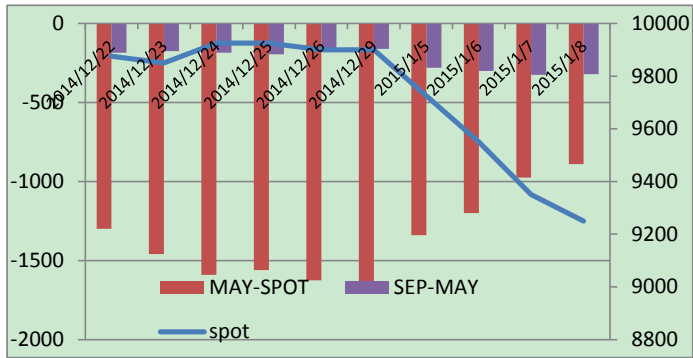
棉花



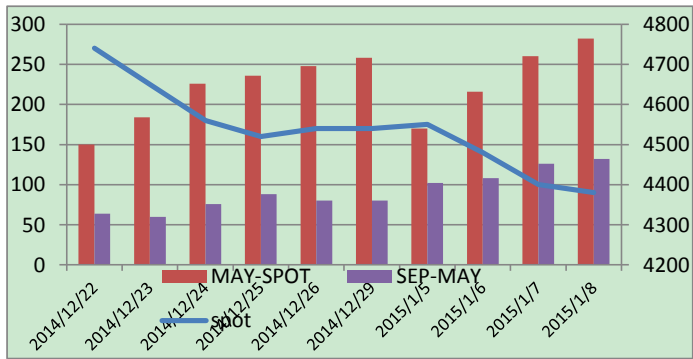
白糖



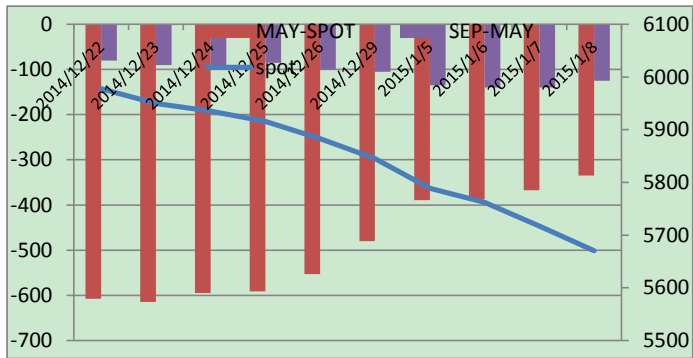
LLDPE



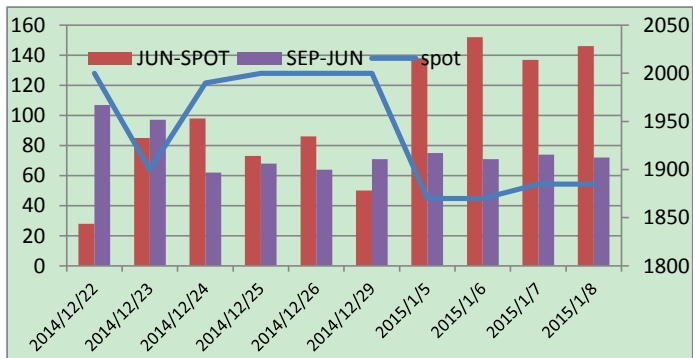
PTA



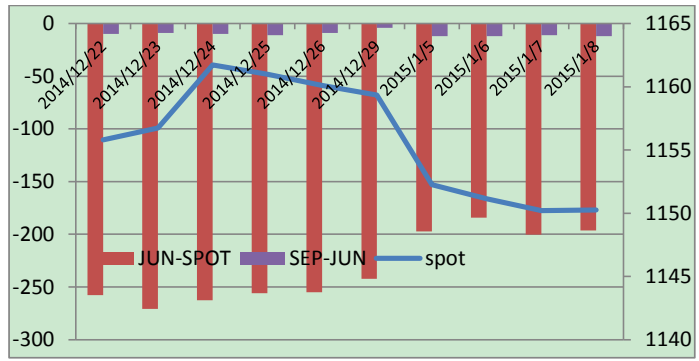
PVC



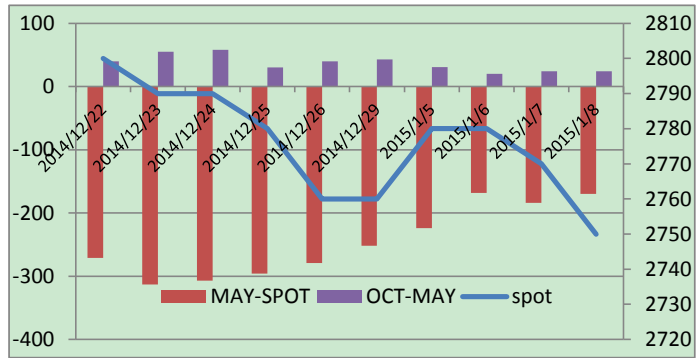
甲醇



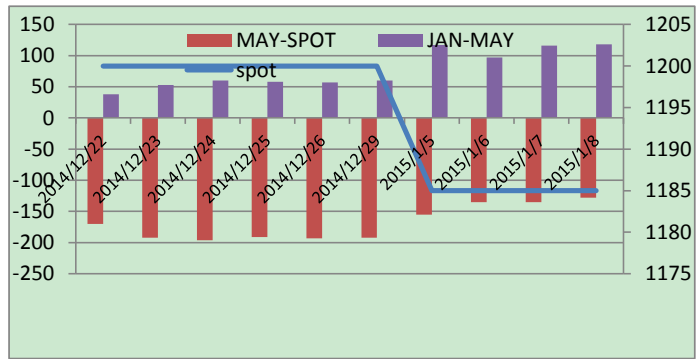
玻璃



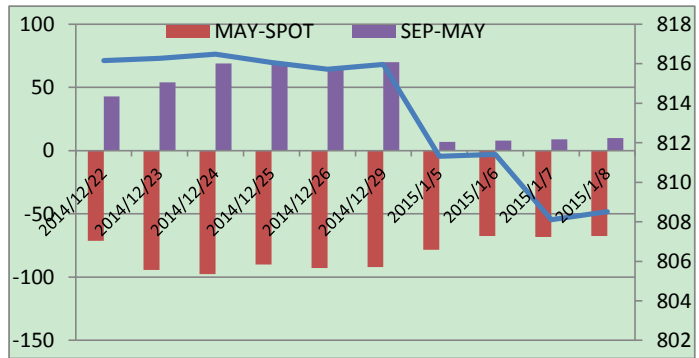
螺纹



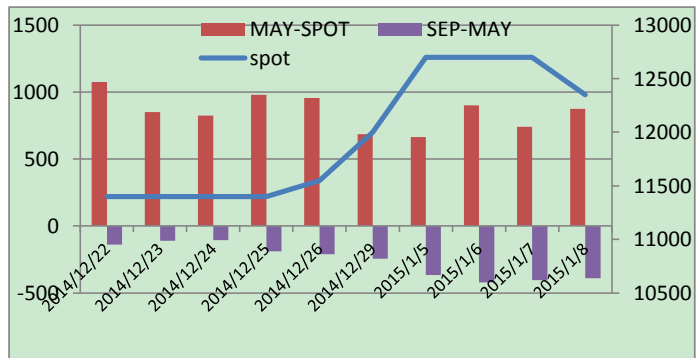
焦炭

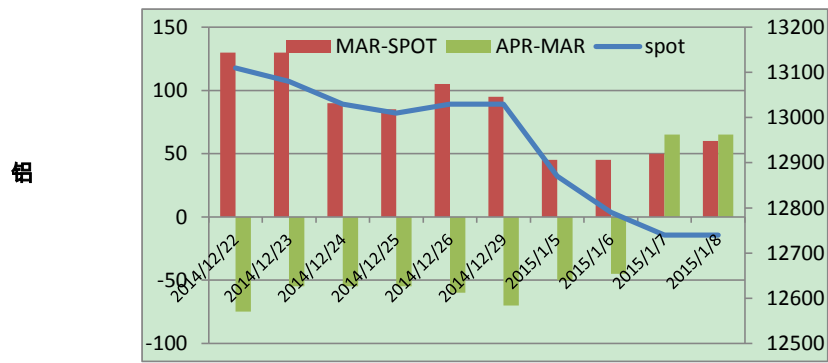
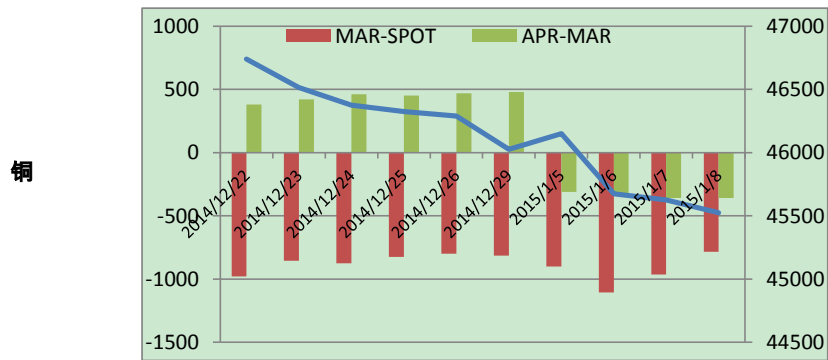
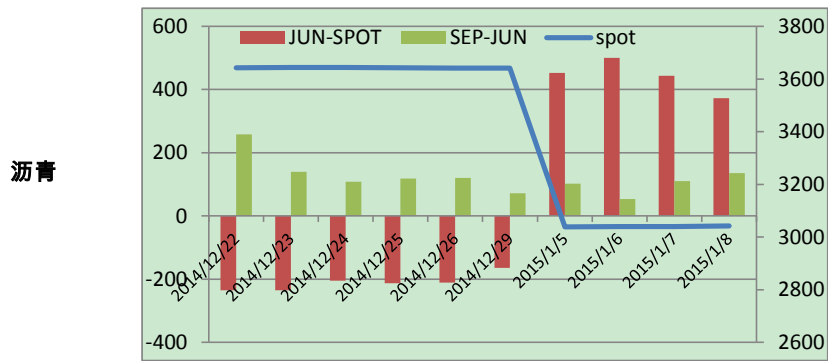
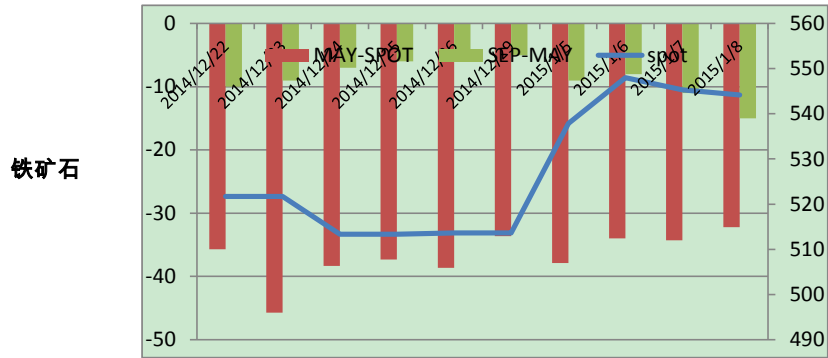
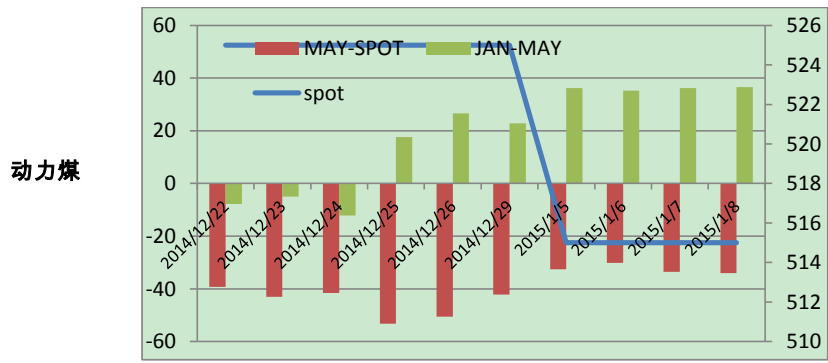


焦煤

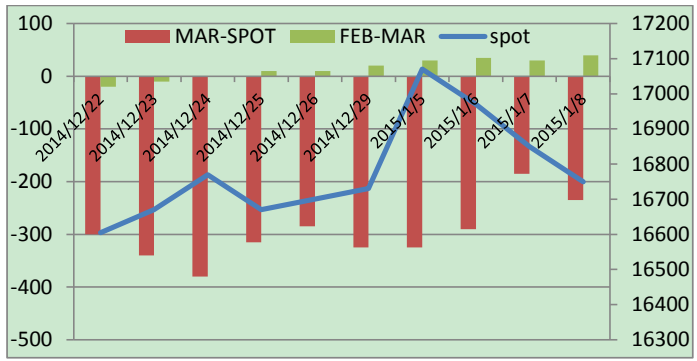


橡胶

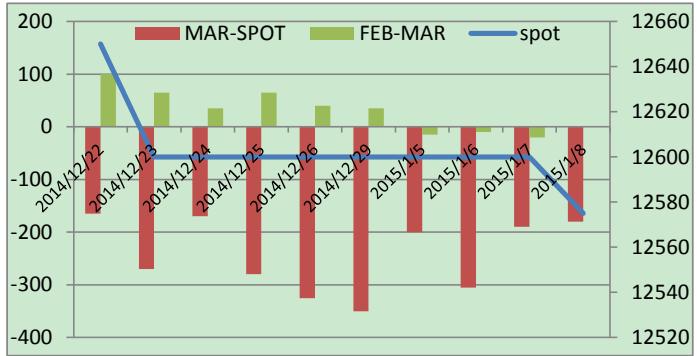




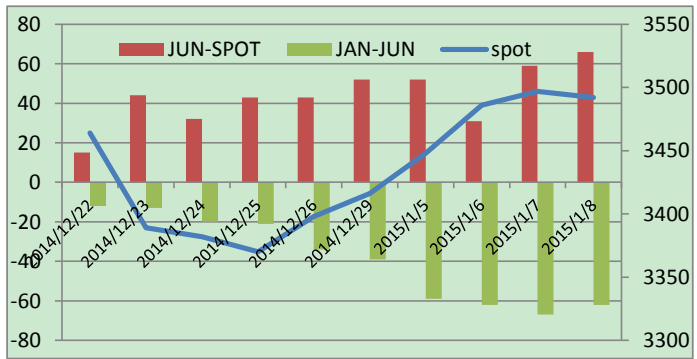
锌



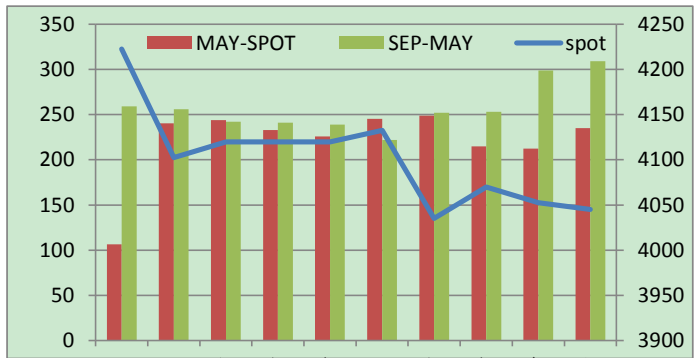
铅



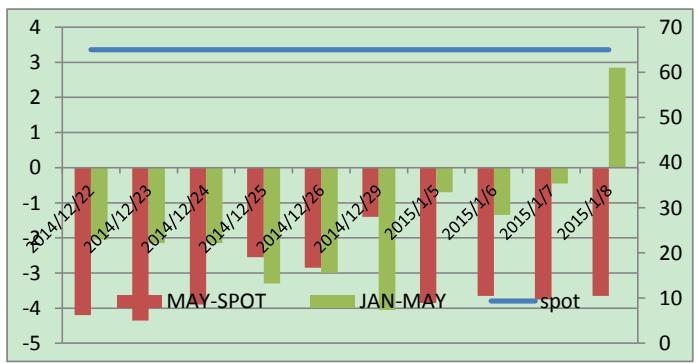
白银



鸡蛋



纤维板



胶合板

