



量化日报之微观数据

分析师：马海燕
从业资格证号：F03099962
投资咨询证号：Z0017813

道通期货研究所

2025年9月10日

一、跟踪品种要点

从波动情况看，今日涨幅前三，工业硅涨2.98%，LPG涨1.36%，苹果涨1.34%，下跌前三：碳酸锂跌-2.88%，棕榈油跌-2.53%，豆油跌-1.84%；今日36/62品种上涨，商品涨跌各半，原油系小幅上涨，油脂、农产品下跌，贵金属、有色、软商品、化工、农产品震荡。从近一周涨跌幅来看，多晶硅、黄金、白银、铜多头持续性尚可，鸡蛋、双硅、碳酸锂、豆类空头持续性较好，各品种走势分化。

从资金角度情况看，黄金、铜沉淀资金最大，今日资金流入金额前三：原油、螺纹、镍，流出品种中：黄金、碳酸锂、豆油流出较多资金；从资金流入比例看，流入排前的有：原油、LPG、豆一，流出排前三的为：苹果、菜油、豆油。今日仓单变化较大的有：螺纹（+8223）、玉米（-4305）。

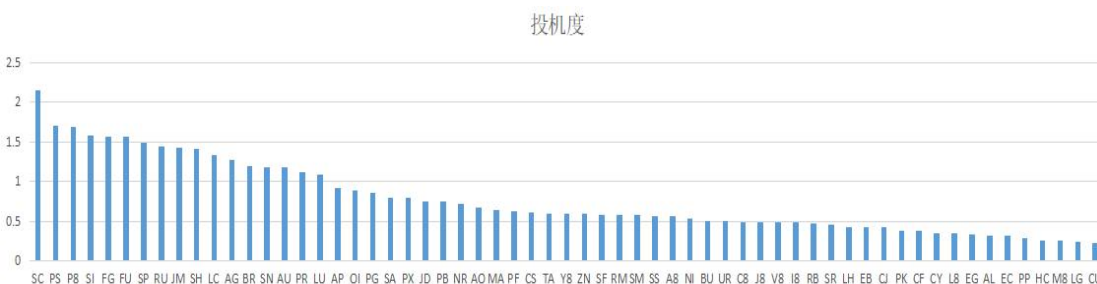
从持仓看，持仓量增加前三：豆一、原油、鸡蛋；在前20名会员持仓中，净多持仓增加明显的有：多晶硅、碳酸锂、苹果，净空持仓增加明显的有：棕榈油、瓶片、红枣；其中玉米淀粉、豆一、玻璃、工业硅多头增仓，红枣、尿素、LPG、锰硅、镍、黄金空头增仓。

综合来看，近日可重点关注品种：焦煤、多晶硅、黄金、棕榈油、氧化铝、铁矿

二、市场数据

	涨跌幅	(收盘)	日振幅	5日涨跌幅	成交量	持仓量	持仓变化	沉淀资金(亿)	资金流向(亿)	资金流向比例	注册仓单数量	注册仓单增减	仓单持仓比
AU	-0.11	1.55	3.71	525000	447297	-0.69%	1,048.2343	-8.51	-0.81%	45951	1536	10.27%	
AG	-0.48	1.41	-0.21	1066280	837947	0.22%	345.9402	-0.90	-0.26%	1252170	1831	149.43%	
CU	0.16	0.50	0.18	108739	485945	-0.67%	372.2844	-4.03	-1.08%	19126	45	3.94%	
V8	0.19	1.21	-0.61	760687	1565636	-1.66%	56.3432	-0.81	-1.43%	100335	7111	6.41%	
AL	0.22	0.38	0.31	177701	542337	1.36%	107.0793	1.07	1.00%	64937	478	11.97%	
AO	0.14	1.47	-2.85	260542	390562	-1.03%	50.5736	-0.46	-0.91%	121933	7822	31.22%	
ZN	0.34	0.56	-0.48	130767	221749	-1.76%	47.3352	-0.79	-1.68%	44329	1648	19.99%	
NI	0.09	0.60	-1.36	116462	216229	2.88%	63.2767	1.80	2.85%	22304	-295	10.31%	
SN	0.31	1.09	-1.26	68255	57599	-0.13%	37.6873	0.06	0.17%	7482	-56	12.99%	
FE	-0.74	0.63	-0.28	66980	89999	4.50%	14.9109	0.50	3.36%	53689	-131	59.66%	
LC	-2.88	3.42	-2.38	1063402	796180	-1.26%	112.8519	-4.96	-4.39%	38101	0	4.79%	
SI	-2.98	5.81	2.37	763494	485465	-1.18%	42.7655	0.74	1.72%	50045	90	10.31%	
RB	-0.39	0.94	-0.19	1494531	3200261	2.52%	149.2804	2.53	1.69%	242840	8223	7.59%	
PS	-1.07	2.58	2.10	519820	304278	-2.20%	109.0181	-3.67	-3.36%	7370	500	2.42%	
I8	-0.05	1.55	4.13	414448	856365	0.32%	151.5155	0.40	0.27%	2000	100	0.23%	
J8	0.37	3.04	0.77	25587	52202	-1.40%	33.6707	-0.35	-1.04%	1430	120	2.74%	
JM	-0.57	2.61	0.91	1268768	885248	-1.92%	142.9693	-3.65	-2.55%	1300	-200	0.15%	
HC	-0.15	1.16	1.48	584608	2186856	-0.33%	111.1817	-0.85	-0.76%	25059	0	1.15%	
SF	0.16	2.15	1.80	248481	421790	-2.51%	19.3102	-0.46	-2.37%	17330	0	4.11%	
SM	0.26	1.72	1.94	330448	575293	0.31%	31.0357	0.18	0.59%	62288	-122	10.83%	
SS	-0.27	0.73	-0.84	164023	285915	-0.71%	28.0921	-0.50	-1.79%	98288	-246	34.38%	
SA	0.16	2.34	1.02	1602297	1997070	-0.79%	92.6373	-0.54	-0.58%	7451	-308	0.37%	
PG	-0.84	2.43	4.32	2354432	1510592	-0.19%	71.5572	-0.76	-1.06%	2088	-5	0.14%	
SH	0.19	1.24	-3.84	369212	261436	0.06%	32.3247	0.07	0.20%	21	-53	0.01%	
SC	1.14	1.54	-0.82	157927	73754	7.00%	78.9421	6.00	7.60%	5721000	0	7756.87%	
FU	-0.76	1.56	-2.04	600497	385391	-2.46%	23.6203	-0.41	-1.74%	101500	0	26.34%	
LU	-0.03	0.89	-4.77	159676	146571	2.42%	10.8887	0.25	2.32%	10020	0	6.84%	
PG	1.36	2.31	1.13	139295	162402	5.56%	20.9261	1.32	6.33%	13003	-5	8.01%	
TA	0.43	0.79	-1.24	811678	1356030	-2.19%	45.1847	-0.84	-1.86%	11842	-2809	0.87%	
PP	0.00	0.43	0.06	212180	750033	1.17%	36.6672	0.39	1.05%	13749	-64	1.83%	
PX	0.60	1.12	-1.00	221096	280032	0.30%	15.2837	0.13	0.83%	0	0	0.00%	
EB	0.04	0.66	1.76	239463	560800	-0.86%	27.7817	-0.23	-0.83%	1784	-543	0.32%	

FF	0.17	0.74	1.13	198250	314428	-2.89%	14.1470	-0.39	77%	3568	0	1.13%
EG	0.07	0.56	0.44	114086	333686	-0.02%	20.2363	-0.05	25%	9192	-20	2.75%
L8	0.04	0.32	0.34	207545	602025	-0.07%	31.1992	-0.03	10%	9298	887	1.54%
MA	0.42	1.68	1.57	699008	1099262	-0.38%	42.5689	-0.03	06%	14519	983	1.32%
BU	0.82	1.03	2.72	222817	436057	-0.22%	32.9376	0.20	60%	64860	-300	14.87%
UR	0.83	1.37	4.30	197669	393182	4.65%	21.3824	0.71	32%	8897	54	2.26%
RU	0.26	0.81	0.82	258354	178986	-0.77%	57.4682	-0.28	49%	155250	-1400	86.74%
NR	0.14	0.80	0.21	102618	141754	0.26%	36.2041	0.04	11%	47678	604	33.63%
ER	0.20	1.01	0.94	131850	109805	-4.14%	14.1610	-0.58	41%	13670	30	12.45%
CF	0.17	0.62	1.37	269067	704133	0.05%	69.4567	0.10	14%	5322	-137	0.76%
CY	0.03	0.44	0.50	8431	23577	-1.35%	2.4437	-0.03	29%	90	-2	0.38%
SR	0.31	0.53	1.09	232177	500226	0.39%	39.1881	0.24	62%	11772	-205	2.35%
SP	0.45	2.28	0.95	562111	377744	-1.37%	31.5926	-0.28	90%	244911	38	64.84%
A8	1.36	1.46	1.34	206277	364651	7.00%	19.9998	1.05	24%	7807	-10	2.14%
M8	0.23	0.60	0.13	1065482	4212068	0.47%	176.0804	0.41	23%	25915	0	0.62%
RM	0.52	1.20	0.73	376440	650114	-0.54%	29.9213	-0.38	28%	10383	-960	1.60%
Y8	1.84	1.70	1.29	512750	858927	-2.43%	98.6713	-4.47	53%	24544	0	2.86%
OI	0.74	1.01	0.02	345038	386537	-3.79%	67.8856	-3.15	63%	6857	387	1.77%
P8	2.53	2.37	1.84	918431	544949	-1.02%	80.5843	-2.95	66%	1485	205	0.27%
C8	0.77	1.04	0.32	773359	1568284	-0.92%	48.8282	-0.92	89%	51959	-4305	3.31%
CS	0.91	1.15	0.80	174596	281605	3.27%	8.5291	0.12	43%	9406	0	3.34%
PK	0.15	0.37	0.13	91117	234878	-0.23%	14.6904	-0.01	08%	0	0	0.00%
CJ	0.44	1.10	3.02	81634	193461	-0.37%	19.2730	0.02	09%	9325	-6	4.82%
AP	1.34	1.59	2.23	97029	105741	-15.93%	17.2187	-2.99	39%	0	0	0.00%
JD	1.70	1.54	0.61	776104	1039837	5.91%	45.4757	1.79	88%	0	0	0.00%
LH	0.64	1.44	2.06	32626	75719	-2.87%	25.8099	-0.59	30%	428	0	0.57%
EC	0.10	2.21	5.47	15226	47320	0.24%	11.9947	0.02	14%	0	0	0.00%
PR	0.15	0.63	1.01	74622	67049	-1.53%	8.3516	-0.11	38%	559	-187	0.83%
LG	0.10	0.49	0.49	5181	20822	-1.56%	2.4794	-0.04	55%	262	178	1.26%

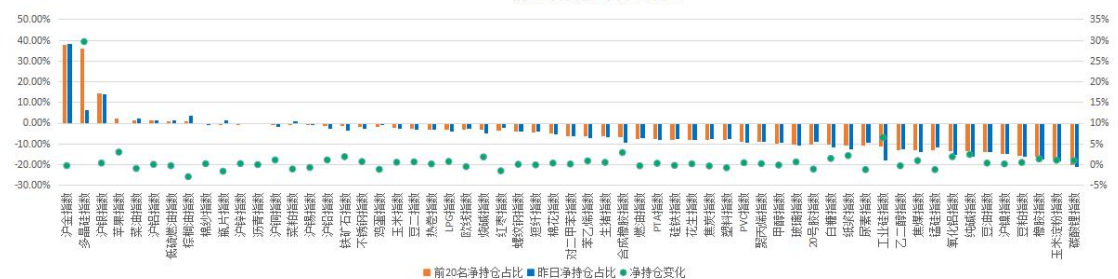


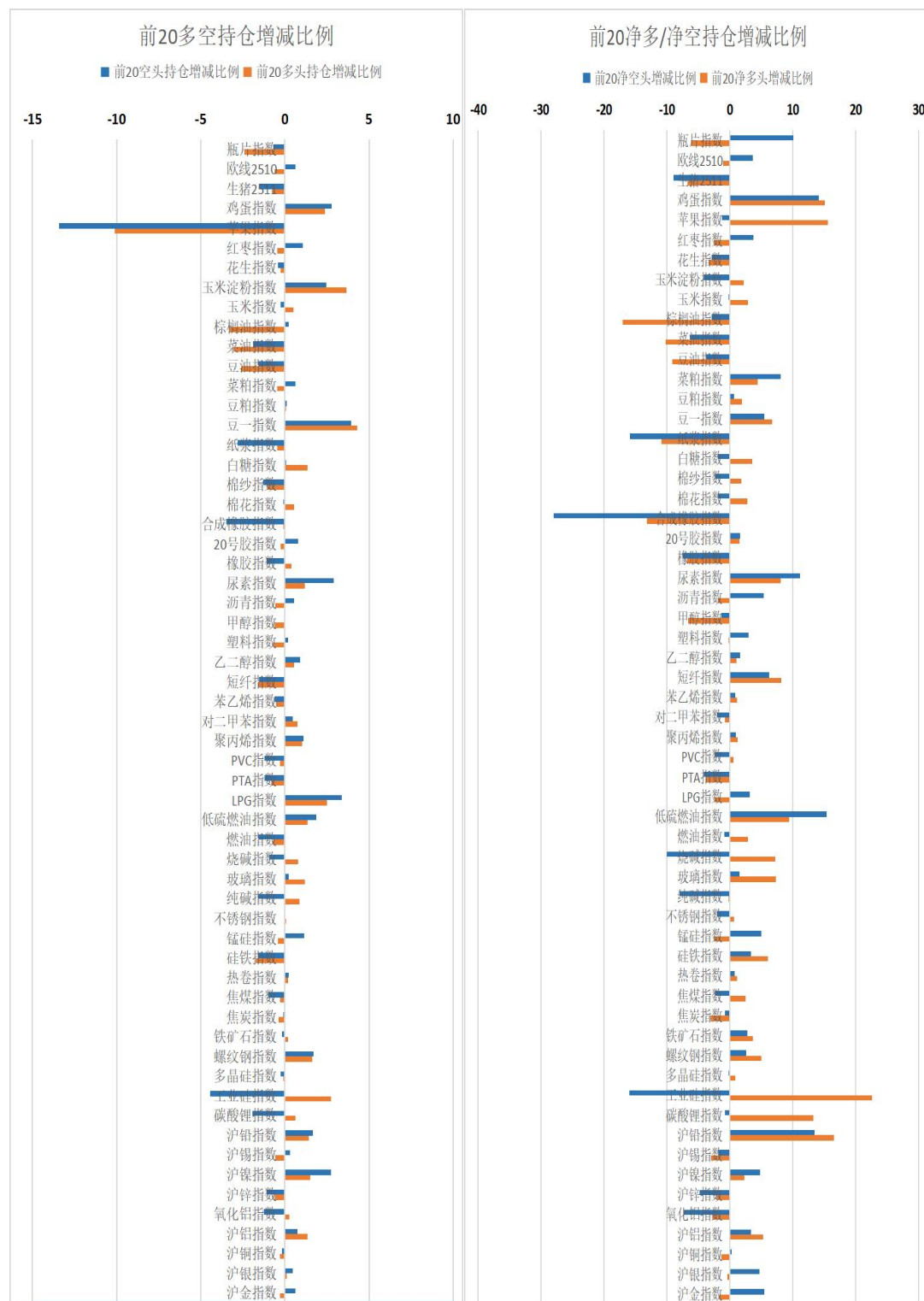
三、会员持仓数据

2025-9-10		2025-9-9		会员多头持仓					会员空头持仓				
当日	昨日	前20名多总持仓	总持仓变化	前20多持仓增量	前10名多总持仓	多总持仓变化	前10多持仓增量	前20空总持仓	空总持仓变化	前20空持仓增量	前10空总持仓	空总持仓变化	前10空持仓增量
AU888.SHF	沪金指数	251787	-0.54	-1296	199342	-0.66	-1281	82397	1.73	2871	64669	1.44	2115
AG888.SHF	沪银指数	366328	0.56	944	274031	-1.07	-969	247265	-0.16	3833	176275	0.60	2275
CU888.SHF	沪铜指数	292628	0.70	-1411	217976	-0.08	-559	295933	-0.99	-879	234199	-1.11	-846
AL888.SHF	沪铝指数	347817	1.68	7262	258820	1.68	7075	340870	1.77	3991	238496	-0.34	1632
AO888.SHF	氧化铝指数	178231	0.25	1121	116992	0.96	837	230293	-3.06	-4804	181247	-2.90	-5416
ZN888.SHF	沪锌指数	130159	-2.61	-1331	89021	-0.81	-545	131029	-2.91	-2428	101298	-2.24	-1323
NI888.SHF	沪镍指数	123645	3.16	3259	94926	2.32	2515	155452	3.01	5887	117260	4.56	5257
SN888.SHF	沪锡指数	28385	-1.83	-337	20286	-2.26	-225	29026	-0.25	179	21688	2.63	173
PB888.SHF	沪铅指数	60614	1.88	1282	44644	1.41	619	61972	0.48	1492	48385	1.17	561
LC888.GFE	碳酸锂指数	481258	1.92	5106	375794	3.44	5925	641190	0.00	-15270	539406	0.77	-9460
SI888.GFE	工业硅指数	287244	3.36	13290	221574	4.81	12620	342233	-6.25	-21504	260565	-7.63	-19198
PS888.GFE	多晶硅指数	176102	-0.69	-94	146374	0.28	1102	66880	-57.55	-775	50792	-58.02	-101
RB888.SHF	螺纹钢指数	1757804	2.77	51910	1320763	2.34	41103	1892494	2.81	54895	1435586	2.03	28535
I888.DCE	铁矿石指数	505107	1.18	1779	372418	2.14	1770	518522	-1.81	-1505	379247	-0.49	-1865
J888.DCE	焦炭指数	27697	-0.67	-187	20005	0.40	136	31942	-0.07	-12	24159	-0.17	-41
JM888.DCE	焦煤指数	420804	-1.34	-2506	293753	-1.28	-1963	537139	-2.85	-8439	398891	-2.34	-9552
HC888.SHF	热卷指数	1384956	1.22	4442	1021449	0.06	1722	1455170	1.06	4984	1072892	-0.07	1572
SP888.CZC	硅铁指数	302893	-2.35	-7282	215125	-3.26	-7189	336074	-2.00	-6845	248205	-2.14	-5419
SM888.CZC	锰硅指数	387186	-0.58	-2278	258364	-0.49	-1238	463029	1.19	6552	350071	0.73	2981
SS888.SHF	不锈钢指数	173389	0.18	30	131613	1.44	1086	178858	-0.86	-195	131444	-0.87	62
SA888.CZC	纯碱指数	1001669	1.71	17397	626370	1.08	16140	1274841	-2.44	-31789	966625	-3.48	-34160
FG888.CZC	玻璃指数	783499	1.46	17877	515545	1.32	6701	938492	0.29	3709	712577	0.49	14871
SB888.CZC	烧碱指数	184795	1.04	2092	135574	1.76	2360	193356	-1.36	-2382	145412	-3.18	-4790
FU888.SHF	燃油指数	174140	-3.78	-2583	130432	-1.94	-1810	202870	-2.86	-6001	152711	-2.86	-4106
LU888.SHF	低硫燃油指数	49946	1.95	1993	36530	1.22	440	48437	3.09	2707	35094	3.14	2468
PG888.DCE	LPG指数	102839	3.90	4079	82458	4.90	3850	108124	2.95	5470	90838	2.74	4817
TA888.CZC	PTA指数	818657	-1.67	-10988	599936	-1.74	-9901	924215	-2.05	-16237	738343	-3.28	-24929
V888.DCE	PVC指数	883196	-0.67	-4248	571999	-0.96	-3804	1024153	-1.34	-19214	794102	-1.41	-11337
PP888.DCE	聚丙烯指数	454063	1.72	7665	335471	1.43	5099	521874	1.45	8378	429897	1.58	6666
PX888.CZC	对二甲苯指数	203149	0.68	2117	147065	1.35	2058	220281	0.60	1323	169441	1.11	1865
EB888.DCE	苯乙烯指数	350456	-0.82	-2966	273799	-0.74	-2867	385947	-1.94	-3355	299317	-0.79	-1330

PF888.CZC	短纤指数	241528	-2.01	-4964	177375	-1.41	-2316	255337	-1.84	-4833	179466	-1.11	-1657
EG888.DCE	乙二醇指数	186151	0.92	1828	133728	1.33	1932	229883	1.32	2999	183884	1.71	3086
1888.DCE	塑料指数	336415	-1.16	-3960	243150	-1.62	-4495	386277	0.30	1244	314101	0.11	350
MA888.CZC	甲醇指数	646043	-1.04	-6515	475142	-1.03	-4920	754531	-0.65	-715	590916	-1.11	-4881
B0888.SHF	沥青指数	296454	-1.37	-2531	194713	-1.68	1157	299156	-1.22	2325	199348	-0.68	162
UR888.CZC	尿素指数	211473	2.24	4636	139638	3.15	5058	253952	4.70	11404	187463	6.93	13382
RU888.SHF	橡胶指数	96533	0.43	707	67309	1.30	1174	125712	-1.63	-1953	93490	-3.00	-2697
NR888.SHF	20号胶指数	85175	-0.94	-341	62789	-0.37	297	99794	0.92	1089	77159	0.78	597
BR888.SHF	合成橡胶指数	53907	-1.22	-115	42366	0.39	166	61117	-6.48	-3834	50206	-7.82	-4259
CF888.CZC	棉花指数	470273	0.23	3862	342033	-0.56	-1916	504918	-0.15	-769	378695	-1.32	-5080
CY888.CZC	棉纱指数	22856	-1.20	-246	18669	-1.19	-224	22697	-1.33	-305	18338	-1.70	-317
SR888.CZC	白糖指数	309786	2.22	6739	222907	2.03	4434	362302	0.01	86	282009	0.81	2267
SP888.SHF	纸浆指数	178044	-1.14	-1758	124096	-1.83	-2245	218241	-4.60	-10531	165757	-6.03	-10661
A888.DCE	豆一指数	232507	7.00	15680	188423	5.55	11392	261428	4.92	14406	204255	6.73	12883
M888.DCE	豆粕指数	2820816	0.60	3378	1969252	0.04	773	3280027	0.04	1763	2751554	0.01	796
RM888.CZC	菜粕指数	384244	-0.96	-2913	292244	-1.19	-3444	389473	1.00	3986	286068	1.47	4139
Y888.DCE	豆油指数	554943	-2.06	-22280	414996	-7.25	-32476	673030	-2.44	-13420	566975	-2.30	-13375
OI888.CZC	菜油指数	288806	-3.96	-11701	212583	-3.53	-7462	283212	-2.61	-7257	212395	-2.35	-5103
P888.DCE	棕榈油指数	326586	-5.28	-17941	248230	-6.57	-11648	322376	-0.40	1252	226819	-0.67	-1531
C888.DCE	玉米指数	1138268	1.18	8136	860279	-0.03	1983	1176427	0.48	-3851	939905	0.26	1846
CS888.DCE	玉米淀粉指数	165436	4.72	10329	119567	4.82	5376	214446	3.10	6903	169677	2.44	4048
PK888.CZC	花生指数	148232	-0.48	-604	98525	-0.97	-968	166925	-0.58	-979	110722	-0.53	-585
CJ888.CZC	红枣指数	106740	-0.96	-862	70114	-0.72	127	113834	1.84	2061	80472	2.13	1675
AP888.CZC	苹果指数	60745	-16.36	-10700	44080	-18.25	-9850	58330	-20.56	-14207	38752	-24.38	-10713
JD888.DCE	鸡蛋指数	478072	2.25	24819	332157	4.15	12774	498761	5.02	28800	348051	4.06	13816
LH2511.DCE	生油2511	47177	-1.41	-597	31776	-1.91	-620	50014	-2.25	-1153	35803	-2.52	-926
BC2510.SHF	欧线2510	25913	-1.12	-293	17440	-1.82	-323	28509	0.72	288	19323	1.97	412
PR888.CZC	藕片指数	57564	-2.72	-1607	42659	-3.58	-1584	57724	-0.78	-453	45152	-0.82	-374

前20名会员净持仓占比





注：以上文中涉及数据来源为：同花顺iFind
请务必仔细阅读正文后免责声明

道通期货经纪有限公司（以下简称“本公司”）具有中国证监会核准的期货投资咨询业务资格【苏证监期货字[2013] 449号】。

本报告的观点和信息仅供本公司的合格投资者参考，无意针对或打算违反任何地区、国家、城市或其它法律管辖区域内的法律法规。本报告难以设置访问权限，若给您造成不便，敬请谅解。若您并非道通期货客户中的合格投资者，请勿阅读、订阅或接收任何相关信息。本报告不构成具体业务的推介，亦不应被视为任何投资、法律、会计或税务建议，且本公司不会因接收人收到本报告而视其为本公司的当然客户。请您根据自身的风险承受能力自行作出投资决定并自主承担投资风险，不应凭借本内容进行具体操作。

分析师声明

作者具有中国期货业协会授予的期货投资咨询执业资格或相当的专业胜任能力，力求报告内容独立、客观、公正。本报告仅反映作者的不同设想、见解及分析方法。作者所得报酬的任何组成部分无论是在过去、现在及将来均不会直接或间接地与研究报告所表述的具体建议或观点相联系。本报告所载的观点并不代表本公司或任何其附属或联营公司的立场，特此声明。

免责声明

本报告的信息来源于已公开的资料，但本公司对该等信息的准确性、完整性或可靠性不作任何保证。本报告所载的资料、意见及推测仅反映本公司于发布本报告当日的判断，本报告所指的期货标的的价格可升可跌，过往表现不应作为日后的表现依据。在不同时期，或因使用不同假设和标准，采用不同观点和分析方法，本公司可发出与本报告所载资料、意见及推测不一致的报告，对此本公司可不发出特别通知。本公司不保证本报告所含信息保持在最新状态。同时，本公司对本报告所含信息可在不发出通知的情形下做出修改，投资者应当自行关注相应的更新或修改。因使用不同假设和标准、采用不同观点和分析方法而与道通期货其它业务部门、单位或附属机构在制作类似的其他材料时所给出的意见不同或者相反，道通期货并不承担提示本报告的收件人注意该等材料的责任。

本报告中所指的研究服务可能不适合个别客户，不构成客户私人咨询建议，客户应考虑本报告中的任何意见或建议是否符合其特定状况。在任何情况下，本报告中的信息或所表述的意见均不构成对任何人的投资建议。在任何情况下，本公司、本公司员工或者关联机构不承诺投资者一定获利，不与投资者分享投资收益，也不对任何人因使用本报告中的任何内容所引致的任何直接或间接损失或与此有关的其他损失负任何责任。投资者务必注意，其据此做出的任何投资决策与本公司、本公司员工或者关联机构无关。市场有风险，投资需谨慎。投资者不应将本报告作为作出投资决策的唯一参考因素，亦不应认为本报告可以取代自己的判断。在决定投资前，如有需要，投资者务必向专业人士咨询并谨慎决策。

版权声明

本报告版权仅为本公司所有，未经书面许可，任何机构和个人不得以任何形式翻版、复制、发表或引用。如征得本公司同意进行引用、刊发的，需在允许的范围内使用，并注明出处为“道通期货研究”，提示使用本报告的风险，且不得对本报告进行任何有悖原意的引用、删节和修改。若本公司以外的其他个人或机构（以下简称“该个人或机构”）发送本报告，则由该个人或机构独自为此发送行为负责。通过此途径获得本报告的投资者应自行联系该个人或机构以要求获悉更

详细信息或进而交易本报告中提及的期货品种。本报告不构成本公司向该个人或机构之客户提供的投资建议，本公司、本公司员工或者关联机构亦不为该个人或机构之客户因使用本报告或报告所载内容引起的任何损失承担任何责任。

除非另有说明，本报告中使用的所有商标、服务标记及标记均为道通期货所有或经合法授权被许可使用的商标、服务标记及标记，未经道通期货或商标所有权人的书面许可，任何单位或个人不得使用该商标、服务标记及标记。

----- 高效、严谨、敬业 -----