



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10月13日

一、跟踪品种要点

从波动情况看，今日涨幅前三，白银涨4.04%，黄金涨2.87%，花生涨1.96%，下跌前三：合成橡胶跌2.70%，20号胶跌-2.55%，橡胶跌-2.41%；今日13/62品种上涨，商品涨少跌多，贵金属上涨，工业品下跌，有色、黑色、软商品、化工、农产品震荡。从近一周涨跌幅来看，黄金、白银、苹果、焦煤、铜多头持续性尚可，鸡蛋、生猪、白糖、棉花、尿素、乙二醇、橡胶空头持续性较好，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：黄金、白银、铁矿，流出品种中：铜、铝、锡流出较多资金；从资金流入比例看，流入排前的有：棉纱、花生、合成橡胶，流出排前三的为：锡、生猪、铝。今日仓单变化较大的有：氧化铝（+21129）、白银（-44605）。

从持仓看，持仓量增加前三：棉纱、花生、合成橡胶；在前20名会员持仓中，净多持仓增加明显的有：铝、多晶硅、焦煤，净空持仓增加明显的有：低硫、苹果、豆二；其中瓶片、鸡蛋、纸浆、合成橡胶、甲醇、多晶硅、工业硅、镍、白银多头增仓，苹果、棉花、橡胶、沥青、燃油、铅空头增仓。

综合来看，近日可重点关注品种：焦煤、白银、铜、生猪、尿素、橡胶

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	仓单持仓比
AU	2.87	2.94	3.42	618953	418835	0.86%	1,108.1383	54.58	4.93%	70728	0	16.89%
AG	4.04	5.77	3.48	2823544	836401	8.35%	407.2454	47.27	11.61%	1124456	-44605	134.44%
CU	-0.92	1.73	3.23	604572	566102	-2.10%	460.1804	-14.21	-3.09%	32890	2926	5.81%
V8	-0.29	0.82	3.54	694704	1481511	1.35%	50.7762	0.49	0.96%	111863	-595	7.55%
AL	-0.47	1.40	0.66	372593	482457	-5.70%	95.8053	-6.38	-6.66%	63151	4032	13.09%
AO	-1.19	1.85	2.65	316840	452873	3.99%	56.8644	1.78	3.13%	197158	21129	43.53%
ZN	-0.05	1.45	1.31	294760	212601	-1.29%	46.5949	0.03	0.07%	59614	-1030	28.04%
NI	-0.62	1.23	0.07	245840	213406	0.84%	63.1900	0.69	1.09%	25272	44	11.84%
SN	-1.47	2.26	2.99	159842	66231	-7.01%	45.4430	-3.75	-8.25%	5745	-64	8.67%
PB	-0.23	1.10	-0.05	103136	82733	6.44%	14.3604	1.11	7.74%	29569	-499	35.74%
LC	-0.57	1.42	-0.48	434460	682469	0.11%	109.1153	-0.51	-0.46%	36718	-5951	5.38%
SI	-1.18	3.30	1.55	360924	429365	3.36%	38.7636	1.67	4.32%	50854	573	11.84%
RB	-0.61	1.48	-0.61	1430529	2539849	1.57%	111.9711	0.93	0.83%	280457	-2510	11.04%
PS	-0.92	1.11	4.67	396534	246615	-0.04%	82.0703	-0.80	-0.98%	7900	-240	3.20%
I8	1.11	1.67	1.69	443744	805231	2.42%	142.0497	4.87	3.43%	800	0	0.10%
J8	-1.42	3.11	2.62	22196	49973	1.27%	33.2928	-0.06	-0.17%	2190	40	4.38%
JM	-1.22	3.67	3.70	1047780	800960	-1.00%	134.0944	-3.04	-2.27%	200	0	0.02%
HC	-0.73	1.43	1.72	689773	1785652	1.48%	83.1313	0.24	0.29%	51372	2058	2.88%
SF	-0.48	1.13	4.49	362560	408925	7.88%	17.8778	1.24	6.94%	14036	-1004	3.43%
SM	-0.26	0.78	1.69	293153	574593	1.70%	30.2782	0.40	1.31%	52402	-1639	9.12%
SS	-1.13	1.43	1.56	306704	279712	11.36%	26.7314	2.02	7.54%	85166	-1088	30.45%
SA	0.56	2.08	3.23	1548787	1908924	-2.57%	87.1963	-1.66	-1.91%	7565	512	0.40%
FC	2.13	3.11	5.39	2303251	1609679	0.45%	77.2031	-1.07	-1.39%	0	0	0.00%
SH	-0.12	2.26	1.79	394532	201008	0.51%	24.0768	0.22	0.93%	450	-173	0.22%
SC	-1.83	2.76	7.47	222105	86229	4.72%	86.2834	2.37	2.74%	5401000	0	6263.55%
FU	1.62	1.23	6.45	805367	420056	5.56%	25.2043	0.94	3.73%	45800	-31990	10.90%
LU	1.89	1.22	7.08	152964	144284	6.79%	10.2443	0.47	4.58%	13080	0	9.07%
PG	-0.45	1.15	6.03	99069	167996	2.75%	19.2947	0.42	2.17%	0	0	0.00%
TA	-0.53	0.97	2.88	930131	1427812	3.32%	46.3547	1.01	2.19%	32580	0	2.28%
PP	-0.40	1.06	2.83	448483	846197	1.71%	40.0982	0.50	1.25%	13970	0	1.65%
PX	-0.75	1.14	3.08	319966	245731	0.62%	12.4786	-0.28	-2.24%	0	0	0.00%
EB	-0.77	1.20	3.62	326760	563673	0.53%	26.5047	-0.09	-0.34%	1450	650	0.26%

PF	-0.57	0.84	-2.83	517697	297242	1.84%	12.8832	0.17	1.28%	0	-2300	0.00%
EG	0.24	1.32	-2.40	154607	367720	-1.92%	21.2672	-0.38	-1.77%	7476	0	2.03%
L8	-0.74	0.80	-2.40	336658	683415	1.86%	33.5854	0.36	1.07%	12729	-66	1.86%
MA	1.30	2.20	-0.51	1607177	1346555	-1.26%	44.5142	0.09	0.20%	11282	-100	0.84%
BU	-1.58	1.65	-5.69	341102	341209	5.77%	24.3013	0.99	4.06%	43900	0	12.87%
UR	0.81	2.00	-3.29	230754	423970	-1.88%	22.1473	-0.23	-1.02%	6917	-100	1.63%
RU	-2.41	3.00	-3.36	346857	185775	5.16%	55.5475	1.48	2.66%	142940	-1450	76.94%
NR	-2.55	3.19	-3.25	133282	121735	2.59%	29.6515	0.15	0.51%	41429	100	34.03%
ER	-2.70	3.24	-4.07	203994	117029	16.88%	14.0858	1.73	12.25%	8550	430	7.31%
CF	-0.12	1.07	-0.66	387264	836990	3.45%	78.2598	2.70	3.45%	2867	-75	0.34%
CY	-0.21	0.83	-1.09	12248	14810	27.80%	1.4357	0.31	21.59%	0	0	0.00%
SR	-0.49	0.89	-0.18	274624	519918	2.38%	33.9382	0.47	1.39%	8681	-186	1.67%
SP	1.77	2.57	-1.82	375716	408546	4.13%	35.5881	1.72	4.83%	231391	-302	56.64%
A8	0.35	1.01	-1.17	193974	318282	-1.27%	17.6787	-0.16	-0.91%	7090	-200	2.23%
M8	0.21	1.08	-0.14	1526030	4018343	0.46%	161.6622	1.02	0.63%	41285	0	1.03%
RM	-0.30	1.90	-0.63	380086	639468	-0.55%	26.8560	-0.37	-1.36%	9089	-110	1.42%
Y8	-0.39	1.13	-1.24	364088	743784	-1.43%	85.3283	-1.58	-1.85%	25444	0	3.42%
OI	-0.45	1.41	-1.61	332676	423886	1.14%	73.9399	0.61	0.82%	0	-8057	0.00%
P8	-0.72	1.36	-1.41	558411	482630	-2.96%	72.0422	-2.74	-3.80%	500	0	0.10%
C8	-1.03	1.26	-2.26	938263	1621691	0.76%	48.0257	-0.12	-0.26%	36709	14009	2.26%
CS	-1.15	1.27	-2.79	224484	292872	7.23%	8.4514	0.48	5.65%	12982	4954	4.43%
PK	1.96	2.22	-2.41	330578	291250	23.40%	16.3012	3.34	20.51%	0	0	0.00%
CJ	-0.05	1.77	-1.26	206045	241753	2.26%	24.2675	0.52	2.15%	0	0	0.00%
AP	-1.17	1.01	-2.76	103390	133577	-2.33%	23.1259	-0.83	-3.60%	0	0	0.00%
JD	0.86	1.65	-3.29	583864	785012	2.11%	33.6356	0.98	2.91%	13	-60	0.00%
LH	-1.72	2.74	-1.53	51913	57257	-5.19%	16.3068	-1.19	-7.32%	90	90	0.16%
EC	-0.54	4.50	-12.07	24678	28771	2.55%	8.9909	0.18	1.95%	0	0	0.00%
PR	-0.48	0.88	-2.72	84390	74510	3.09%	9.1499	0.23	2.52%	0	-44	0.00%
LG	-1.14	1.78	0.25	17931	18826	-4.19%	2.2117	-0.12	-5.57%	434	0	2.31%

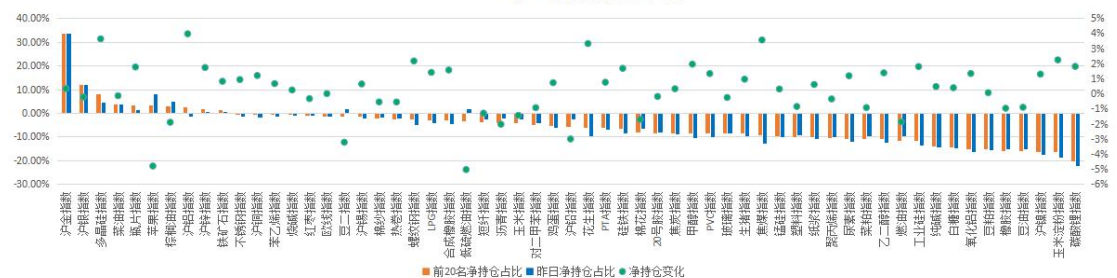


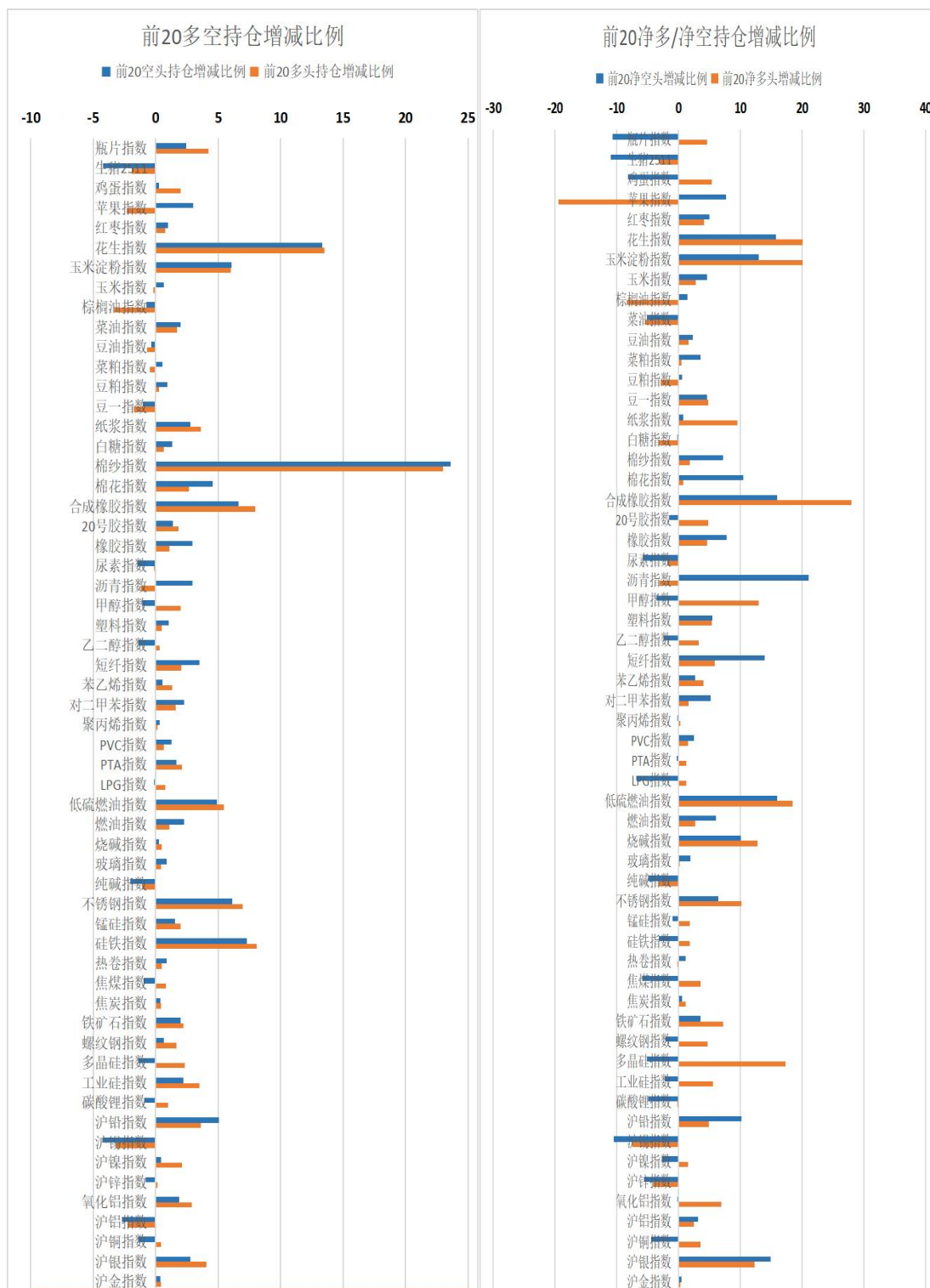
三、会员持仓数据

2025-10-13		2025-10-10		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	前10多总持仓	多总持仓变化	前10多持仓增	前20空总持仓	空总持仓变化	前20空持仓增	前10空总持仓	空总持仓变化	前10空持仓增	前20空总持仓	空总持仓变化	前20空持仓增	前10空总持仓	空总持仓变化	前10空持仓增				
AU8888.SHF	沪金指数	220070	1.45	1743	174235	0.34	1163	78569	0.74	1630	60648	1.97	1258										
AG8888.SHF	沪银指数	368167	7.22	33949	285512	12.51	32168	268339	7.57	23002	194173	8.03	13415										
CU8888.SHF	沪铜指数	319375	-1.04	2399	248036	1.30	3728	322076	-3.10	-7711	249125	-2.37	-5803										
AL8888.SHF	沪铝指数	314039	-2.51	-10636	241246	-2.02	-3495	302092	-8.38	-12941	221120	-5.76	-8514										
AO8888.SHF	氧化铝指数	200247	6.77	12961	130767	6.36	8071	268585	3.69	8603	206821	3.70	7875										
ZN8888.SHF	沪锌指数	134444	0.30	343	95612	1.24	871	130712	-2.43	-1706	104609	-2.43	-2707										
NI8888.SHF	沪镍指数	121533	2.55	4519	91456	-0.34	98	156271	0.38	946	114117	0.43	522										
SB8888.SHF	沪锡指数	33514	-7.42	-2110	25849	-5.83	-1599	34441	-8.52	-2814	24082	-8.53	-1722										
FE8888.SHF	沪铁指数	55803	2.00	2999	44491	0.49	216	60446	6.56	4199	47076	8.64	4176										
LC8888.GFE	碳酸锂指数	399025	0.82	6689	324184	2.14	5788	538230	-1.62	-6303	452884	-1.93	-8518										
SI8888.GFE	工业硅指数	252819	6.31	15014	182243	8.07	13615	303061	3.14	9401	219706	3.98	9376										
PS8888.GFE	多晶硅指数	138855	3.84	5723	109112	3.56	5330	118613	-3.12	-3319	91660	-4.12	-2648										
RB8888.SHF	螺纹钢指数	1450200	4.87	42342	1093480	2.92	29886	1518230	0.96	16787	1172516	0.89	12760										
I8888.DCE	铁矿石指数	494655	1.99	17606	360339	4.25	15756	482908	0.62	15831	350052	1.68	6746										
J8888.DCE	焦炭指数	25488	0.84	213	18752	1.53	282	29673	0.37	177	22002	0.79	448										
JM8888.DCE	焦煤指数	411612	2.44	6531	288279	1.58	5406	485220	-3.90	-7937	361573	-1.11	-4061										
HC8888.SHF	热卷指数	1114072	0.38	8957	846010	0.08	3236	1159943	1.29	15854	883169	1.43	13266										
SF8888.CZC	硅铁指数	296437	12.54	33039	224501	13.40	27088	323760	9.73	29897	252463	10.72	25449										
SM8888.SHF	锰硅指数	402323	2.47	11398	293924	3.41	9854	457261	1.99	8906	363707	2.33	8295										
SS8888.SHF	不锈钢指数	161370	13.91	19456	119331	12.60	12862	162614	12.07	17091	121804	11.81	12870										
SA8888.CZC	纯碱指数	933073	-2.50	-20369	594958	-3.29	-20222	1201304	-3.23	-39026	900429	-4.34	-11037										
FG8888.CZC	玻璃指数	872306	0.35	6951	599631	0.77	4604	1010792	0.78	14270	775818	1.02	12776										
SR8888.CZC	烧碱指数	143048	0.42	939	109612	-1.43	-1593	144405	0.09	537	112319	0.23	1259										
FU8888.SHF	燃油指数	196420	0.29	4538	143943	0.23	1295	245335	4.51	9622	187015	4.71	9894										
IU8888.SHF	低硫燃油指数	82392	71.01	7838	65661	85.87	6201	87063	90.36	7086	67580	100.74	8050										
PG8888.DCE	豆粕指数	95208	1.89	1309	76399	1.27	1422	100090	-0.39	-123	83619	-1.36	-1154										
TA8888.CZC	PTA指数	899516	3.47	30134	649121	4.58	28405	988704	2.35	23568	815406	2.79	22160										
Y8888.DCE	PVC指数	854946	3.46	9874	547581	1.20	4757	982342	1.12	18628	766256	2.36	19085										
PP8888.DCE	聚丙烯指数	512633	-0.40	1219	386515	-0.32	-8	599894	0.40	2519	496287	0.92	4680										
PX8888.CZC	对二甲苯指数	176489	1.53	3864	134594	3.75	6600	188940	2.74	5552	146287	7.01	10034										
EB8888.DCE	苯乙烯指数	379155	5.31	7308	299321	4.21	1605	382501	4.21	2907	305602	4.74	4605										

FF8888.CZC	短纤指数	229265	2.30	6128	159997	1.13	5029	240871	3.95	10355	165173	2.79	4488									
BC8888.DCE	二乙二醇指数	212750	0.45	1145	156259	0.58	4500	252679	-1.93	-4982	203823	-1.01	-2077									
L8888.DCE	塑料指数	393346	0.74	3340	284106	-1.18	-2484	461182	2.20	6979	376596	2.36	8115									
MA8888.CZC	甲醇指数	840408	0.75	26806	622649	0.29	1816	956131	-2.23	-14743	762216	-3.31	-26103									
B08888.SHF	沥青指数	179134	-1.93	-4106	132967	1.62	227	193109	2.01	10069	140462	4.74	11387									
UR8888.CZC	尿素指数	222748	-0.46	-524	151622	0.36	548	267897	-2.54	-6216	197791	-3.57	-7126									
RU8888.SHF	橡胶指数	98038	0.58	1986	69056	-0.80	334	127809	3.03	5485	97166	3.80	3555									
NR8888.SHF	20号胶指数	70476	-0.61	2206	51642	-2.35	216	80670	0.07	1664	60151	0.58	1025									
BR8888.SHF	合成橡胶指数	58604	16.82	9324	42419	14.53	5051	62282	13.49	7767	49650	15.20	6678									
CF8888.CZC	棉花指数	542424	3.34	22108	393344	4.34	16355	609599	5.84	38173	453538	4.22	18375									
CV8888.CZC	棉纱指数	13680	30.20	3409	11356	33.11	2881	14026	30.93	3494	11169	31.68	2687									
SR8888.CZC	白糖指数	322427	0.99	3238	230248	2.24	6608	397691	0.75	6725	309975	1.60	4889									
SP8888.SHF	纸浆指数	212113	7.40	14760	155598	7.77	15165	253102	5.81	11307	192124	4.49	8657									
A8888.DCE	豆一指数	191286	-3.93	-5616	155875	-5.18	-8511	222287	-1.61	-3309	178886	-3.11	-5741									
M8888.DCE	豆粕指数	2548369	1.37	10098	1851960	0.79	14580	3163783	1.12	36731	2592169	1.68	39710									
RM8888.CZC	菜粕指数	352681	-0.87	-3089	256460	-1.47	-3838	421563	0.60	3350	317994	1.71	5354									
Y8888.DCE	豆油指数	477470	-1.96	-5266	365718	-1.61	-1548	597395	-0.73	-2698	504949	-0.23	-1171									
OI8888.CZC	菜油指数	319289	2.15	7199	247273	-1.34	-3371	303773	2.41	8430	236495	2.30	5322									
P8888.DCE	棕榈油指数	288128	-5.55	-16081	214727	-8.65	-20342	273023	-2.49	-3683	197997	0.14	275									
C8888.DCE	玉米指数	1149434	-1.26	-1382	916230	-0.64	-5904	1216548	0.76	10439	989825	0.62	2342									
CS8888.DCE	玉米淀粉指数	171742	11.60	17555	132396	12.06	15742	219469	7.32	17700	167060	11.87	18017									
PK8888.CZC	花生指数	176605	25.67	39376	117066	24.56	24388	194694	19.44	38765	131253	14.92	18822									
CJ8888.CZC	红枣指数	135435	1.14	1857	88960	0.21	552	138206	1.76	2431	92524	-0.35	-322									
AP8888.CZC	苹果指数	77778	-4.65	-3071	56937	-4.35	-1574	73556	4.09	3965	48116	4.20	3261									
JD8888.DCE	鸡蛋指数	351685	1.51	15525	253995	3.26	9463	394806	0.15	2186	273800	0.05	3229									
LN2511.DCE	生猪2511	31100	-3.64	-1110	20641	-3.60	-588	33297	-6.78	-2423	23712	-6.28	-1533									
PR8888.CZC	藕片指数	64008	4.96	3145	46552	1.73	1329	61554	2.80	1830	47186	0.97	1071									

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 -----