



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15日

一、跟踪品种要点

从波动情况看，今日涨幅前三，白银涨3.77%，黄金涨2.26%，欧线涨2.06%，下跌前三：低硫跌1.31%，锌跌-0.94%，螺纹跌-0.88%；今日34/62品种上涨，商品涨跌各半，贵金属上涨，原油系下跌，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、铜，流出品种中：镍、锡、橡胶流出较多资金；从资金流入比例看，流入排前的有：花生、白银、多晶硅，流出排前三的为：锡、欧线、镍。今日仓单变化较大的有：热卷（+39913）、白银（-32643）。

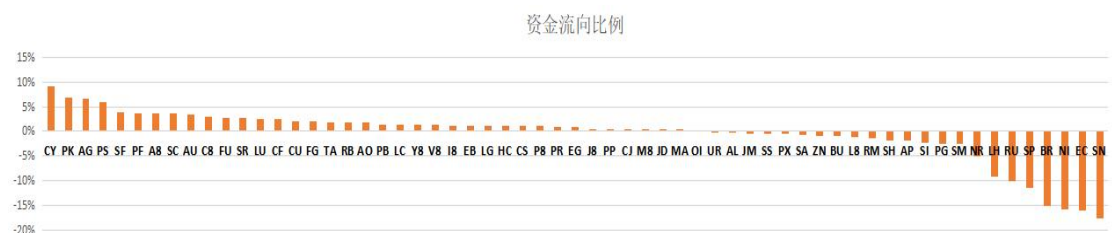
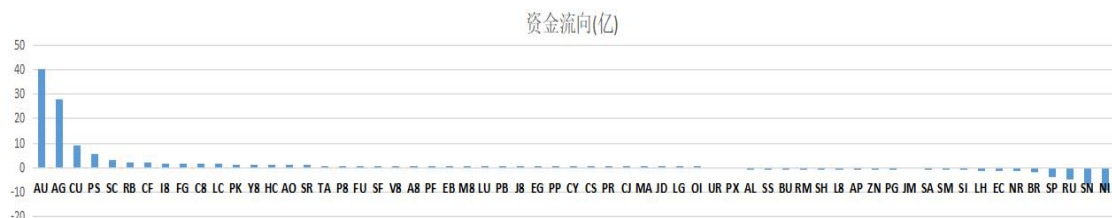
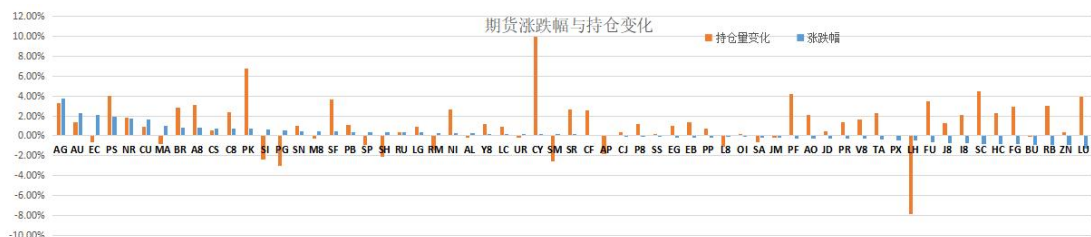
从持仓看，持仓量增加前三：棉纱、花生、原油；在前20名会员持仓中，净多持仓增加明显的有：燃油、沥青、铅，净空持仓增加明显的有：多晶硅、锡、低硫；其中花生、甲醇、PX、低硫、燃油多头增仓，豆一、白糖、棉花、橡胶系、苯乙烯、玻璃、硅铁、螺纹、多晶硅、镍、锌空头增仓。

综合来看，近日可重点关注品种：焦煤、白银、铜、橡胶、玻璃、原油

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	2.26	2.71	10.85	560963	416066	1.38%	1,139.5031	40.02	3.51%	75099	2916	18.05%
AG	3.77	5.19	9.42	2982047	838652	3.25%	423.6667	28.07	6.62%	1030429	-32643	122.87%
CU	1.68	2.44	4.16	316273	556350	0.92%	449.0284	9.12	2.03%	44531	8236	8.00%
V8	-0.32	0.83	4.47	691854	1530791	1.64%	51.9040	0.68	1.32%	111334	-142	7.27%
AL	0.28	0.60	0.96	185975	489755	-0.05%	96.3279	-0.07	-0.07%	71394	8218	14.58%
AO	-0.25	1.24	3.51	268430	466538	2.06%	58.0956	1.03	1.77%	217032	6038	46.52%
ZN	-0.94	0.58	1.01	232694	210731	0.32%	45.3113	-0.45	-1.00%	65666	7172	31.16%
NI	0.29	0.48	0.10	151421	230212	2.63%	57.0524	-9.01	-15.79%	26558	1531	11.54%
SN	0.47	1.24	3.42	84842	65742	0.97%	37.7882	-6.62	-17.53%	5677	50	8.64%
PB	0.41	1.00	1.55	64818	84493	1.06%	14.6529	0.21	1.41%	32007	1302	37.88%
LC	0.22	1.40	1.17	339252	671967	0.95%	108.3567	1.51	1.40%	33076	-2104	4.92%
SI	0.61	2.09	-0.13	309911	432314	-2.35%	37.9530	-0.85	-2.24%	50357	-840	11.65%
RB	-0.88	1.14	1.78	1226672	2670442	3.00%	115.3241	2.10	1.82%	298752	8587	11.19%
PS	1.96	3.52	-0.18	458830	264077	4.06%	92.0911	5.54	6.01%	8050	100	3.05%
I8	-0.77	1.50	-1.10	399889	849127	2.06%	144.5235	1.80	1.24%	700	-100	0.08%
J8	-0.71	2.16	-0.10	22516	51105	1.28%	34.0114	0.19	0.56%	2190	0	4.29%
JM	-0.21	2.69	-0.03	1184056	825396	-0.15%	138.5016	-0.50	-0.36%	200	0	0.02%
HC	-0.83	1.33	2.43	641144	1881267	2.24%	85.9414	1.06	1.23%	99691	39913	5.30%
SF	0.41	1.31	3.87	345539	426073	3.64%	18.5169	0.71	3.84%	13137	-528	3.08%
SM	0.14	1.22	1.22	369720	575203	-2.60%	30.2814	-0.76	-2.52%	49756	-161	8.65%
SS	-0.03	0.43	1.66	143262	285701	0.06%	26.6176	-0.12	-0.47%	84007	-490	29.40%
SA	-0.16	1.20	3.26	976048	1899715	-0.61%	85.5784	-0.65	-0.76%	7856	-26	0.41%
PG	-0.87	1.82	7.59	1674774	1791199	2.91%	82.0199	1.65	2.01%	0	0	0.00%
SH	0.37	1.47	2.47	348888	194444	-2.06%	22.8836	-0.40	-1.73%	400	-41	0.21%
SC	-0.80	1.29	9.52	143457	89970	4.52%	88.2837	3.14	3.55%	5401000	0	6003.11%
FU	-0.63	1.15	8.20	613640	456475	3.50%	26.8622	0.74	2.76%	45800	0	10.03%
LU	-1.31	1.03	9.31	159531	152439	3.98%	10.5832	0.27	2.52%	13080	0	8.58%
PG	0.55	1.88	5.12	109959	168378	-3.01%	19.4884	-0.48	-2.46%	0	0	0.00%
TA	-0.38	0.74	4.86	795581	1524041	2.32%	48.4233	0.92	1.91%	36978	2994	2.43%
PP	-0.09	0.88	4.38	330641	881413	0.72%	41.0061	0.18	0.44%	13814	0	1.57%
PX	-0.43	1.06	5.05	337158	253018	0.03%	11.7687	-0.06	-0.50%	1826	0	0.72%
EB	-0.08	1.17	5.43	331640	600993	1.33%	27.6184	0.34	1.24%	1325	-80	0.22%

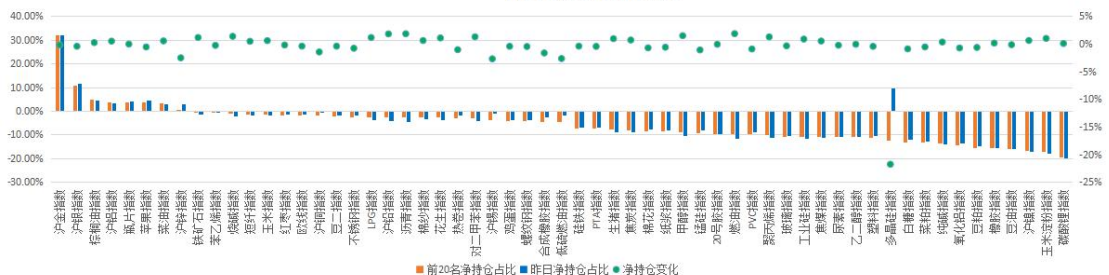
PF	-0.23	0.58	-4.35	482363	340169	4.16%	14.4941	0.54	3.73%	2300	0	0.68%
EG	-0.07	1.21	-3.88	125466	368831	0.99%	21.0258	0.19	0.88%	7776	0	2.11%
L8	-0.10	0.78	-3.72	252722	688611	-1.09%	33.4730	-0.40	-1.21%	12707	-10	1.85%
MA	-0.97	1.80	-2.54	922123	1401933	-0.81%	45.3644	0.07	0.14%	11282	0	0.80%
BU	-0.87	0.93	-7.14	262129	346507	-0.12%	24.3529	-0.24	-1.00%	42370	-1530	12.23%
UR	0.19	0.81	-3.60	143143	418701	-0.19%	21.6815	-0.01	-0.03%	6493	-77	1.55%
RU	0.36	0.74	-3.02	215882	185789	0.37%	49.9929	-5.01	-10.02%	139560	-860	75.12%
NR	1.76	1.85	-2.03	128174	126007	1.83%	28.5556	-1.42	-4.97%	39917	-1512	31.68%
BR	0.84	1.67	-4.33	132752	127258	2.85%	12.7691	-1.93	-15.15%	8750	0	6.88%
CF	0.05	0.67	-0.48	247183	872239	2.53%	81.1150	2.04	2.51%	2773	-50	0.32%
CY	0.16	0.56	-0.77	10085	19172	9.96%	1.8541	0.17	9.20%	0	0	0.00%
SR	0.07	0.52	-1.42	221305	575738	2.62%	37.2876	0.98	2.63%	8438	-50	1.47%
SP	0.39	0.71	-1.01	255021	400573	-0.93%	31.4972	-3.59	-11.40%	227676	-3611	56.84%
A8	0.78	0.88	-2.02	225594	324503	3.07%	18.1599	0.68	3.73%	7090	0	2.18%
M8	0.46	0.95	-0.42	1127363	4077452	-0.26%	163.2550	0.30	0.18%	43256	2058	1.06%
RM	0.30	1.42	-2.10	229949	649882	-1.49%	26.8010	-0.37	-1.38%	9089	0	1.40%
Y8	0.22	0.82	-1.32	258651	759684	1.16%	87.0822	1.19	1.36%	26294	850	3.46%
OI	-0.13	0.81	-1.88	249206	430790	0.21%	74.1762	0.02	0.03%	7590	0	1.76%
P8	-0.02	1.16	-1.09	505523	495197	1.17%	73.6855	0.84	1.14%	500	0	0.10%
C8	0.71	0.75	-0.74	843483	1690042	2.39%	50.5919	1.54	3.04%	36709	0	2.17%
CS	0.75	0.79	-2.30	231269	292631	0.50%	8.4863	0.10	1.22%	12938	0	4.42%
PK	0.70	0.81	-2.86	243043	336558	6.72%	18.9647	1.30	6.86%	0	0	0.00%
CJ	-0.01	1.03	-1.85	108284	240079	0.39%	24.0430	0.09	0.38%	0	0	0.00%
AP	0.01	0.72	-2.11	46769	125848	-1.85%	21.8537	-0.41	-1.87%	0	0	0.00%
JD	-0.26	1.16	-2.53	421632	756093	0.43%	32.6813	0.05	0.16%	15	-13	0.00%
LH	-0.44	1.66	-7.28	42981	44805	-7.91%	13.0759	-1.18	-9.06%	111	21	0.25%
EC	0.22	1.34	-2.72	42616	27023	-0.62%	7.8492	-1.25	-15.99%	0	0	0.00%
PR	-0.29	0.66	-4.09	53942	75694	1.38%	9.1332	0.09	1.00%	44	0	0.06%
LG	0.36	0.88	-0.29	14420	19664	0.89%	2.3058	0.03	1.24%	434	0	2.21%



三、会员持仓数据

2025-10-15		2025-10-14		会员多头持仓										会员空头持仓									
当日	昨日	前20名总持仓	总持仓变化	前20名总持仓	总持仓变化	前10名总持仓	总持仓变化	前10名总持仓	总持仓变化	前20名总持仓	总持仓变化	前20名总持仓	总持仓变化	前20名总持仓	总持仓变化	前10名总持仓	总持仓变化	前10名总持仓	总持仓变化	前20名总持仓	总持仓变化	前20名总持仓	总持仓变化
A08888.SHF	沪金指数	212862	11.05	2245	171300	0.76	2032	80154	1.68	1456	61907	2.47	1674										
AG8888.SHF	沪银指数	379089	6.39	10402	291875	7.32	9365	287130	8.97	11860	211113	9.82	7617										
CU8888.SHF	沪铜指数	303444	-1.96	-1562	232438	-8.27	-2455	314090	0.73	3408	242022	0.68	1729										
AL8888.SHF	沪铝指数	322328	0.27	1303	249390	0.52	2198	303245	-0.46	43	221280	-0.44	-801										
A08888.SHF	氧化铝指数	201271	-0.29	1245	130806	-0.27	-98	267957	1.63	4499	205706	1.31	3051										
ZN8888.SHF	沪锌指数	133460	-1.01	266	96832	-0.25	-24	132835	3.11	4751	107486	4.16	5440										
NI8888.SHF	沪镍指数	126472	4.57	3963	93016	2.44	1648	164591	3.27	6431	120936	3.79	5156										
SO8888.SHF	沪锡指数	31422	-0.91	-737	24189	-8.40	-707	33958	1.57	103	23844	1.29	415										
PB8888.SHF	沪钨指数	57473	0.38	252	45389	0.71	313	59610	-1.04	656	46150	-1.65	-1473										
LC8888.GFE	碳酸锂指数	381693	0.69	3098	308099	0.58	2010	513831	0.71	3653	431694	0.97	4480										
SI8888.GFE	工业硅指数	269062	-1.53	-6210	195467	-1.68	-3732	315350	-2.77	-5290	233064	-1.26	-4486										
PS8888.GFE	多晶硅指数	110823	-26.48	5605	85427	-26.23	6972	143326	15.03	8771	110445	11.00	4779										
RB8888.SHF	螺纹钢指数	1485425	2.15	27751	1103187	0.60	6425	1597136	3.08	54526	1239078	3.91	46076										
I8888.DCE	铁矿石指数	516733	2.28	6945	369821	1.55	5583	517750	0.43	2181	379216	0.03	1607										
J8888.DCE	焦炭指数	26050	1.46	404	19107	1.70	320	30215	0.30	91	22453	1.12	249										
JM8888.DCE	焦煤指数	415663	-0.34	-1281	296702	0.04	386	505027	-1.08	3788	372574	0.80	2955										
HC8888.SHF	热卷指数	1151458	0.57	13356	866847	-0.07	-398	1205800	2.35	31694	908139	1.00	9500										
SP8888.CZC	硅铁指数	310186	3.98	11879	227307	2.90	10173	341234	4.53	15291	256334	4.02	12565										
SF8888.CZC	锰硅指数	404983	-1.72	-11329	290008	0.06	-12267	458740	-1.31	-6108	356620	-1.62	-8535										
SS8888.SHF	不锈钢指数	162554	-0.40	907	117237	-1.25	-1486	169432	1.01	1612	124223	0.61	2991										
SA8888.CZC	纯碱指数	928346	0.08	2793	587853	-0.33	-1936	1188435	-0.55	-3892	896052	-0.37	-768										
PG8888.CZC	玻璃指数	966382	2.27	23369	643313	2.57	16091	1147995	2.99	35288	901303	2.75	23873										
SR8888.CZC	烧碱指数	133682	-1.73	-2496	100384	-8.33	-3995	135528	-1.54	-5751	100718	-1.40	-6886										
FU8888.SHF	燃油指数	208434	3.97	5499	147456	3.02	5342	252441	0.57	3955	195820	-0.47	2374										
LU8888.SHF	低硫燃油指数	85408	0.46	5549	65557	-2.18	3001	92242	5.24	5126	73845	6.92	4113										
PG8888.DCE	LPG指数	92630	-1.02	-2698	75108	-8.02	-1729	96847	-4.87	-3125	80880	-1.08	-3043										
TA8888.DCE	PTA指数	952200	2.07	19268	681439	1.97	13140	1063780	2.81	29959	880693	2.26	23492										
VB8888.DCE	PVC指数	870806	0.37	4081	555593	0.24	1569	1019156	2.00	19069	796332	1.88	14515										
PP8888.DCE	聚丙烯指数	532230	0.86	4710	397522	0.92	3650	619369	-0.90	877	509752	-0.14	1084										
PX8888.CZC	对二甲苯指数	185828	2.58	5665	147350	2.83	4963	193563	0.79	2429	153589	2.32	3484										
EB8888.DCE	苯乙烯指数	398151	1.40	6696	312971	0.43	1351	402586	1.87	16200	321142	1.87	5865										
PF8888.CZC	短纤指数	266472	3.80	9743	187740	2.73	8954	270920	3.24	8492	185509	4.46	8778										
EG8888.DCE	乙二醇指数	208842	0.81	2162	152621	0.48	1084	249292	0.98	2481	202511	1.03	2069										
L8888.DCE	塑料指数	386783	-1.40	-8714	280103	-2.77	-7162	463017	-1.49	-5461	379654	-1.73	-5702										
MA8888.CZC	甲醇指数	874154	0.94	10166	652688	2.48	15792	988837	-1.32	-11374	796654	-1.39	-5808										
BU8888.SHF	沥青指数	176455	0.35	309	133167	-0.16	333	185590	-1.95	-3614	134810	-1.05	-8379										
UR8888.CZC	尿素指数	217973	-0.39	-845	145898	-0.20	341	263754	0.09	440	193943	-0.28	-551										
RU8888.SHF	橡胶指数	100076	1.87	1076	70748	1.66	1156	128796	1.37	658	97908	0.79	789										
NR8888.SHF	20号胶指数	73154	3.76	879	53221	2.95	1074	85208	3.65	2812	63584	3.42	2758										
BR8888.SHF	合成橡胶指数	65091	2.11	2747	47762	1.56	2429	70713	5.83	3923	56618	5.78	3305										
CF8888.CZC	棉花指数	557918	1.67	11079	402505	1.70	6745	632754	2.82	17949	471639	3.09	14859										
CY8888.CZC	棉纱指数	17741	9.88	1610	14503	10.19	1424	18247	9.32	1556	14300	9.78	1429										
SR8888.CZC	白糖指数	352820	2.04	7048	251527	2.61	6407	428451	3.44	14817	340594	4.12	13480										
SP8888.SHF	纸浆指数	215827	-1.55	-1003	159262	-0.57	-636	250204	-0.45	-1700	189207	-1.79	-1219										
A8888.DCE	豆一指数	193703	1.52	2986	153229	0.05	-266	220342	1.60	13656	172430	-1.30	6694										
M8888.DCE	豆粕指数	2566456	-1.35	-5771	1881990	-0.21	4031	3195612	-0.29	-7689	2612964	-0.16	-4174										
RM8888.CZC	菜粕指数	349520	-1.31	-8272	249498	-1.57	-3621	436094	-1.30	-4159	329819	-0.62	-2059										
Y8888.DCE	豆油指数	484048	0.97	8638	377694	2.46	9058	606283	1.24	7418	512891	1.24	6295										
OI8888.CZC	菜油指数	323889	0.34	2073	239401	-1.78	-2472	308911	-0.36	-477	234467	-1.04	-2468										
P8888.DCE	棕榈油指数	300525	1.35	1886	217828	0.19	407	276275	0.99	6493	203448	3.25	6658										
C8888.DCE	玉米指数	1223528	3.15	32623	965970	3.54	27745	1246822	2.36	31970	1000163	1.46	21011										
CS8888.DCE	玉米淀粉指数	168696	1.01	3121	127259	-2.31	-3010	218485	-0.38	1810	169740	-0.99	1754										
PK8888.CZC	花生指数	208431	5.34	10950	135651	5.80	7933	217376	3.75	9496	136253	1.04	1405										
CJ8888.CZC	红枣指数	134009	0.47	991	87504	0.51	448	137995	0.88	1210	92933	1.11	1021										
AP8888.CZC	苹果指数	72015	-8.77	-2820	51465	-5.15	-2578	67165	-1.86	-1974	43892	-1.30	-1011										
JD8888.DCE	鸡蛋指数	347811	0.81	2605	249286	1.41	2115	378842	1.74	4954	267485	0.42	1528										
LH2511.DCE	生蒜2511	24824	5.37	-2268	16338	-8.25	-1357	26861	-1.61	-1559	20513	-0.52	115										
PR8888.DCE	藕片指数	64298	0.83	530	45782	0.85	788	61365	0.89	543	46138	0.84	385										

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 -----