



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16日

一、跟踪品种要点

从波动情况看，今日涨幅前三，多晶硅涨3.30%，焦煤涨3.11%，碳酸锂涨2.76%，下跌前三：欧线跌-3.37%，生猪跌-2.06%，苹果跌-1.80%；今日45/62品种上涨，商品涨多跌少，工业品上涨，贵金属继续上涨，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：焦煤、多晶硅、铁矿，流出品种中：黄金、铜、白银流出较多资金；从资金流入比例看，流入排前的有：苹果、多晶硅、红枣，流出排前三的为：铅、生猪、欧线。今日仓单变化较大的有：热卷（+51414）、白银（-48174）。

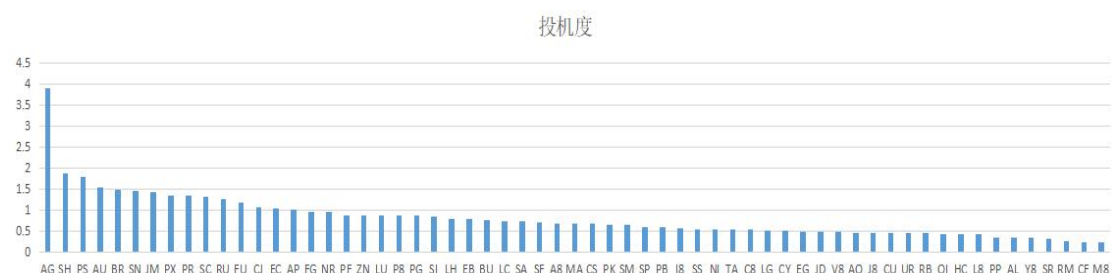
从持仓看，持仓量增加前三：苹果、多晶硅、红枣；在前20名会员持仓中，净多持仓增加明显的有：焦煤、20号胶、纸浆，净空持仓增加明显的有：花生、苹果、低硫；其中红枣、豆一、20号胶、LPG、焦煤、铁矿、多晶硅多头增仓，苹果、花生、玉米淀粉、低硫、碳酸锂、锌空头增仓。

综合来看，近日可重点关注品种：焦煤、白银、铜、原油、生猪、多晶硅

二、市场数据

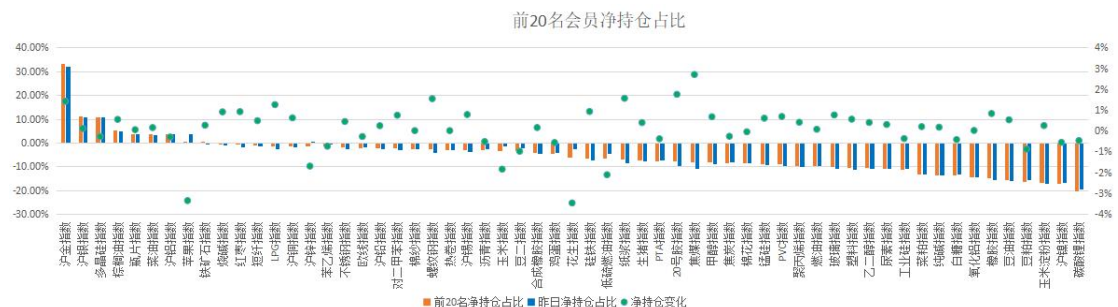
	涨跌幅(收盘)	日振幅	5日涨跌幅	成交量	持仓量	持仓变化	沉淀资金(亿)	资金流向(亿)	资金流向比例	注册仓单数量	注册仓单增/减	仓单持仓比
AU	0.66	1.57	10.58	611400	396512	-4.70%	1,075.2687	-64.23	-5.97%	80961	5862	20.42%
AG	0.43	3.81	10.10	3239346	829172	-1.13%	419.0366	-4.63	-1.10%	982255	-48174	118.46%
CU	0.90	1.11	2.29	255805	546239	-1.82%	431.6874	-17.34	-4.02%	44406	-125	8.13%
V8	0.36	1.11	-3.02	738262	1529413	-0.09%	52.0177	0.11	0.22%	111165	-169	7.27%
AL	0.29	0.64	1.45	180408	494100	0.89%	96.2235	-0.10	-0.11%	71542	148	14.48%
AO	0.21	0.93	-2.54	225738	470652	0.88%	57.9623	-0.13	-0.23%	216433	-599	45.99%
ZN	0.32	0.86	0.69	192896	219855	4.33%	45.3732	0.06	0.14%	67466	1800	30.69%
NI	0.08	0.65	0.35	127768	228515	-0.74%	55.5172	-1.54	-2.77%	26474	-84	11.59%
SN	-0.11	1.36	2.29	93501	63684	-3.13%	35.8652	-1.92	-5.36%	5609	-68	8.81%
PB	-0.05	0.33	1.15	48215	80068	-5.24%	13.0497	-1.60	-12.25%	32007	0	39.97%
LC	2.76	2.61	2.96	507153	681313	1.39%	112.5777	4.22	3.75%	30456	-2620	4.47%
SI	0.70	2.07	0.18	362791	429946	-0.55%	38.1656	0.21	0.56%	50291	-66	11.70%
RB	0.56	1.09	-0.62	1220123	2668939	-0.06%	115.2211	-0.10	-0.09%	299051	299	11.20%
PS	3.30	4.56	2.70	498555	278578	5.49%	100.0118	7.92	7.92%	8130	80	2.92%
I8	-0.36	1.75	-0.99	511354	889476	4.75%	150.8304	6.31	4.18%	700	0	0.08%
J8	1.95	2.99	3.29	23891	50896	-0.41%	34.5330	0.52	1.51%	2190	0	4.30%
JM	3.11	3.85	5.58	1233446	854021	3.47%	147.7610	9.26	6.27%	200	0	0.02%
HC	0.19	1.03	-1.10	812489	1903611	1.19%	86.4395	0.50	0.58%	151105	51414	7.94%
SF	2.01	2.38	0.05	303888	419896	-1.45%	19.1075	0.59	3.09%	12611	-526	3.00%
SM	0.16	1.04	-0.02	377672	574160	-0.18%	30.3231	0.04	0.14%	48976	-780	8.53%
SS	0.43	0.91	-1.02	162150	289810	1.44%	26.7946	0.18	0.66%	83231	-776	28.72%
SA	0.32	2.09	-1.34	1391874	1905560	0.31%	86.2522	0.67	0.78%	9283	1427	0.49%
FG	1.66	1.92	-4.75	1669248	1742537	-2.72%	81.0732	-0.95	-1.17%	0	0	0.00%
SH	0.57	1.14	-2.68	359188	192531	-0.98%	22.9988	0.12	0.50%	390	-10	0.20%
SC	-0.02	1.55	-7.14	115766	87171	-3.11%	85.5113	-2.77	-3.24%	5211000	-190000	5977.91%
FU	0.34	1.05	-6.19	553848	465932	2.07%	27.5135	0.65	2.37%	44960	-840	9.65%
LU	0.06	1.01	-7.17	133592	152495	0.04%	10.5933	0.01	0.10%	7960	-5120	5.22%
PG	2.64	2.91	-1.34	148804	170702	1.38%	20.2545	0.77	3.78%	0	0	0.00%
TA	0.75	1.26	-2.94	854206	1542463	1.21%	49.9648	1.54	3.09%	36978	0	2.40%
PP	0.35	1.14	-3.36	322678	880201	-0.14%	41.0745	0.07	0.17%	13778	-36	1.57%
PX	0.97	1.55	-2.80	338231	249026	-1.58%	12.1159	0.35	2.87%	1000	-826	0.40%
EB	0.98	2.39	-3.19	472286	590305	-1.78%	27.3881	-0.23	-0.84%	1265	-60	0.21%

PF	0.73	1.16	-2.68	293746	333768	-1.88%	14.6995	0.21	1.40%	2300	0	0.69%
EG	0.76	2.19	-2.76	185500	364768	-1.10%	20.9571	-0.07	-0.33%	7776	0	2.13%
L8	0.27	1.00	-3.09	293770	688744	0.02%	33.5717	0.10	0.29%	12707	0	1.84%
MA	0.87	2.09	-0.47	978686	1411203	0.66%	46.2479	0.88	1.91%	11282	0	0.80%
BU	0.28	0.91	-5.58	269344	353353	1.98%	24.8490	0.50	2.00%	36370	-6000	10.29%
UR	0.25	1.93	-3.65	188890	411411	-1.74%	21.5206	-0.16	-0.75%	6438	-55	1.56%
RU	0.04	1.26	-0.81	233262	184844	-0.51%	49.6209	-0.37	-0.75%	136630	-2930	73.92%
NR	0.93	1.89	1.62	120945	126560	0.44%	28.4909	-0.06	-0.23%	40119	202	31.70%
BR	1.96	2.55	-0.49	175422	118844	-6.61%	12.0304	-0.74	-6.14%	8750	0	7.36%
CF	0.38	0.77	0.89	225712	877562	0.61%	83.8480	2.73	3.26%	2724	-49	0.31%
CY	0.39	0.59	0.14	10028	19666	2.58%	1.9816	0.13	6.43%	0	0	0.00%
SR	0.07	0.41	-1.60	191195	583429	1.34%	38.0468	0.76	2.00%	8438	0	1.45%
SP	-0.12	0.82	1.41	245073	396982	-0.90%	30.7940	-0.70	-2.28%	227468	-208	57.30%
A8	0.50	1.10	2.58	230431	331421	2.13%	18.6402	0.48	2.58%	7090	0	2.14%
M8	-0.21	0.56	-0.42	955505	4100269	0.56%	163.8312	0.58	0.35%	43122	-134	1.05%
RM	0.34	0.86	-1.80	175832	642503	-1.14%	26.5328	-0.27	-1.01%	8699	-390	1.35%
Y8	0.06	0.54	1.54	263608	768234	1.13%	88.1172	1.04	1.17%	26294	0	3.42%
OI	-0.06	0.56	-1.32	188261	425102	-1.32%	73.3604	-0.82	-1.11%	7590	0	1.79%
P8	-0.03	0.93	1.19	432684	494130	-0.22%	73.5015	-0.18	-0.25%	500	0	0.10%
C8	0.61	0.65	0.28	898597	1669926	-1.19%	50.2869	-0.31	-0.61%	36709	0	2.20%
CS	-0.21	0.62	-2.11	203932	301206	2.93%	8.7163	0.23	2.64%	12938	0	4.30%
PK	-1.17	1.38	2.33	232457	346556	2.97%	19.6584	0.69	3.53%	0	0	0.00%
CJ	2.17	2.44	4.99	268869	251876	4.91%	25.7699	1.73	6.70%	0	0	0.00%
AP	-1.80	2.62	-1.16	141927	141046	12.08%	24.0476	2.19	9.12%	0	0	0.00%
JD	-0.94	1.10	-4.47	386451	775856	2.61%	33.2106	0.53	1.59%	15	0	0.00%
LH	-2.06	2.89	-9.63	33489	41232	-7.97%	11.7851	-1.29	-10.95%	111	0	0.27%
EC	-3.37	3.51	-4.67	27124	25798	-4.53%	7.2412	-0.61	-8.40%	0	0	0.00%
FR	0.67	1.19	-2.68	99428	73600	-2.77%	9.2379	0.10	1.13%	44	0	0.06%
LG	0.49	0.74	-0.26	10336	19747	0.42%	2.3268	0.02	0.90%	434	0	2.20%



三、会员持仓数据

2025-10-16		2025-10-15		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名空总持仓	空总持仓变化	前20名空总持仓	空总持仓变化	前10名空总持仓	空总持仓变化	前10名空总持仓	空总持仓变化	前10名空总持仓	空总持仓变化	前10名空总持仓	空总持仓变化	前10名空总持仓	空总持仓变化
AU8888.SHF	沪金指数	208895	-1.86	-3170	167492	-2.22	-3418	76818	-4.16	1712	58249	-5.91	1253										
AG8888.SHF	沪银指数	373373	-1.51	1340	287722	-1.42	-1661	281553	-1.94	-130	208629	-1.18	-948										
CU8888.SHF	沪铜指数	297745	-1.88	-2757	224877	-3.25	-3321	304818	-2.95	-3965	234557	-3.08	-5125										
AL8888.SHF	沪铝指数	322154	-0.05	5344	249562	0.07	3797	304391	0.38	3986	221196	-0.04	2416										
AO8888.SHF	氧化铝指数	201685	0.21	3182	131434	0.48	2488	268899	0.35	4037	208487	1.35	4384										
ZN8888.SHF	沪锌指数	137039	2.68	8789	96959	1.18	4976	140120	5.48	10927	114435	6.47	9528										
NI8888.SHF	沪镍指数	124068	-1.90	1741	90928	-2.24	966	163184	-0.85	2271	120763	-0.14	1850										
SN8888.SHF	沪锡指数	29313	-6.71	-676	22488	-7.03	-672	31274	-7.90	-1093	22110	-7.27	-1014										
PB8888.SHF	沪铂指数	53705	-6.56	-258	41689	-8.15	-555	55537	-6.83	302	43206	-6.38	636										
LC8888.GFE	碳酸锂指数	386748	1.32	5926	310997	0.94	1617	523943	1.97	14446	443918	2.83	12659										
SI8888.GFE	工业硅指数	272035	1.10	6244	195052	-0.21	2749	319685	1.37	2078	234212	0.49	1187										
PS8888.GFE	多晶硅指数	168424	-2.19	12638	133506	-3.14	7754	138751	-3.19	9414	109010	-1.30	5807										
RB8888.SHF	螺纹钢指数	1483618	-0.12	4739	1099911	-0.30	2340	1554192	-2.69	-11994	1210262	-2.33	-10936										
I8888.DCE	铁矿石指数	539804	4.46	29693	393116	6.30	23295	538535	4.01	21631	401204	5.80	22595										
J8888.DCE	焦炭指数	25952	-0.38	-92	19029	-0.41	-78	30236	0.07	100	22490	0.16	37										
JM8888.DCE	焦煤指数	446929	7.52	25689	318127	7.22	21960	516346	2.24	9865	375635	0.82	3061										
K8888.SHF	热卷指数	1172102	1.79	36235	899907	3.81	33141	1227003	1.76	13090	912106	0.44	5947										
SF8888.CZC	硅铁指数	309714	-0.15	3118	231637	1.90	4330	336427	-1.41	-4558	254739	-0.62	-1595										
SM8888.CZC	锰硅指数	400457	-1.12	-4267	285971	-1.39	-2949	450660	-1.76	-8080	350203	-1.80	-5800										
SS8888.SHF	不锈钢指数	168077	3.40	5955	119300	1.76	2495	173769	2.56	5045	120452	1.79	2757										
SA8888.CZC	纯碱指数	938517	1.10	11043	595604	1.32	7751	1196181	0.65	8918	891319	-0.53	-4525										
FG8888.CZC	玻璃指数	923257	-3.46	-29424	620486	-3.55	-22827	1096479	-4.49	-40604	862797	-3.20	-25108										
SB8888.CZC	烧碱指数	133766	0.08	571	101615	1.23	1231	133870	-1.22	-1362	100377	-0.34	-341										
FU8888.SHF	燃油指数	213387	2.38	5097	149771	1.57	2869	257985	2.20	4945	196666	1.45	5192										
LU8888.SHF	低硫燃油指数	85545	0.16	235	66937	2.11	1872	95603	3.64	3859	78415	6.19	4676										
PG8888.CZC	LPG指数	94704	2.24	5756	74617	-0.65	1979	96841	-0.01	-250	80637	-0.30	-243										
TA8888.CZC	PTA指数	948068	-0.43	-1801	680476	-0.14	374	1066948	0.30	7127	888699	0.91	8010										
Y8888.DCE	PVC指数	874746	0.45	5167	556891	0.23	4559	1012507	-0.65	-6497	786392	-1.25	-10255										
PP8888.DCE	聚丙烯指数	532681	0.08	-1252	395746	-0.45	-1721	616131	-0.52	-6534	506764	-0.59	-4537										
PX8888.CZC	对二甲苯指数	182946	-1.55	-2882	145827	-1.03	-110	188705	-2.51	-4257	150199	-2.21	204										
EB8888.DCE	苯乙烯指数	392644	-1.38	-8804	303086	-3.16	-6235	401391	-0.30	-1462	319891	-0.39	-1251										
PF8888.CZC	短纤指数	261735	-1.78	-4737	185481	-1.20	-2130	264492	-2.37	-6428	181478	-2.17	-4031										
EG8888.DCE	乙二醇指数	205424	-1.64	-3418	150063	-1.68	-2243	243980	-2.13	-4767	198015	-2.22	-4496										
L8888.DCE	塑料指数	384192	-0.67	-3231	277409	-0.96	-2561	456613	-1.38	-3436	377178	-0.65	-2074										
MA8888.CZC	甲醇指数	884707	1.21	10553	654698	0.31	2010	1000739	0.19	2708	796731	0.01	77										
RU8888.SHF	沥青指数	214404	21.51	5106	149353	12.15	2311	225556	21.53	7184	159054	17.98	7034										
UR8888.CZC	尿素指数	215173	-1.28	-2800	144105	-1.23	-1793	258926	-1.83	-2972	188362	-2.88	-3831										
RU8888.SHF	橡胶指数	99814	-0.26	-420	69972	-1.10	-367	126880	-1.50	433	96717	-1.22	-920										
NR8888.SHF	20号胶指数	75921	3.78	3773	54649	2.68	2121	85816	0.71	958	64001	0.66	2338										
ER8888.SHF	合成橡胶指数	62947	-3.29	-1133	47863	0.21	222	68016	-3.81	-683	55073	-2.73	-1044										
CF8888.CZC	棉花指数	562933	0.90	5577	405838	0.83	3333	638667	0.93	5913	477019	1.14	5380										
CY8888.CZC	棉纱指数	18384	3.62	646	15202	4.82	699	18902	3.59	686	15034	5.13	842										
SR8888.CZC	白糖指数	356659	1.09	5123	254931	1.35	4808	435776	1.71	7479	347239	1.95	6655										
SF8888.SHF	纸浆指数	217757	0.89	911	159698	0.27	2332	245649	-1.82	-2941	185635	-1.89	-3200										
M8888.DCE	豆一指数	195170	0.76	5406	156056	1.84	3122	220227	-0.05	-115	169125	-1.92	-2449										
M8888.DCE	豆粕指数	2547561	-0.74	711	1880302	-0.09	-1688	3216590	0.66	21966	2616956	0.15	6116										
RM8888.CZC	菜粕指数	349988	0.13	676	248253	-0.50	-1245	434312	-0.41	-789	327069	-0.83	-2750										
Y8888.DCE	豆油指数	492065	1.66	5906	382824	1.36	5130	611650	0.89	5367	517341	0.87	4450										
OI8888.CZC	菜油指数	321116	-0.86	-2773	234651	-1.98	-4750	305693	-1.04	-2496	231351	-1.33	-2210										
P8888.DCE	棕榈油指数	296260	-1.42	-4175	216347	-0.68	-3217	269378	-2.50	-1734	198793	-2.29	-4655										
C8888.DCE	玉米指数	1202724	-1.70	-17282	949118	-1.74	-16852	1256554	0.78	9621	989675	-1.05	-13413										
CS8888.DCE	玉米淀粉指数	169618	0.55	5016	124420	-2.23	-733	220119	0.75	8225	173272	2.08	4514										
PK8888.CZC	花生指数	214373	2.85	6084	137325	1.23	1756	235602	8.38	18740	148232	8.79	15868										
CJ8888.CZC	红枣指数	139579	4.16	5733	92051	5.20	4741	141452	2.51	3457	93302	0.40	369										
AP8888.CZC	苹果指数	82475	14.52	11382	61059	18.84	10912	81770	21.74	15428	55387	26.19	13570										
JD8888.DCE	鸡蛋指数	366347	5.33	12200	261583	4.93	9311	402585	6.27	9337	277926	3.90	4013										
LH2511.DCE	生油2511	22907	-7.72	-1768	14967	-8.39	-1205	25643	-4.53	-883	19609	-4.41	-904										
FR8888.CZC	蓖麻子指数	63532	-1.19	-519	45777	-0.01	235	60644	-1.17	-642	45822	-0.68	-305										





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 -----