



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24日

一、跟踪品种要点

从波动情况看，今日涨幅前三，鸡蛋涨2.18%，欧线涨2.11%，燃油涨2.08%，下跌前三：红枣跌-3.56%，玻璃跌-1.42%，工业硅跌-1.35%；今日23/62品种上涨，商品涨少跌多，原油系、有色上涨，贵金属下跌，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、碳酸锂、欧线多头持续性尚可，鸡蛋、生猪、白糖乙二醇空头持续性较好，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：铜、铝、螺纹，流出品种中：黄金、白银、多晶硅流出较多资金；从资金流入比例看，流入排前的有：铜、铝、锡，流出排前三的为：不锈钢、短纤、多晶硅。今日仓单变化较大的有：白银（+1605）、热卷（-4799）。

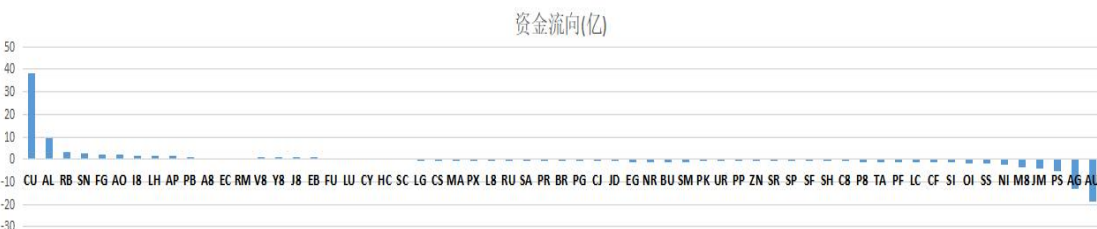
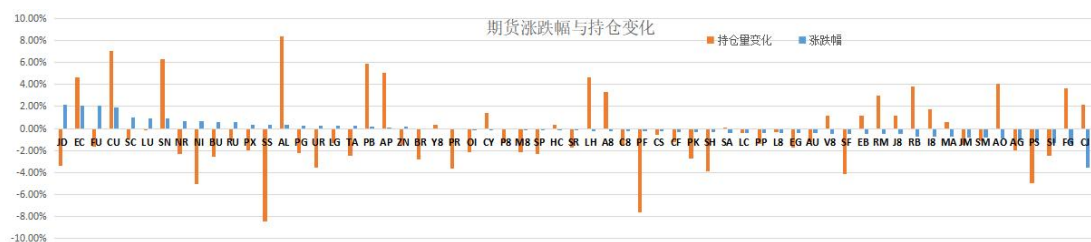
从持仓看，持仓量增加前三：铝、铜、锡；在前20名会员持仓中，净多持仓增加明显的有：燃油、低硫、铅，净空持仓增加明显的有：玻璃、短纤、甲醇；其中苹果、豆一、低硫、燃油、铅、锡、铜多头增仓，玉米淀粉、菜粕、甲醇、苯乙烯、玻璃、螺纹、氧化铝空头增仓。

综合来看，近日可重点关注品种：焦煤、黄金、铜、原油、苹果、碳酸锂

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	-0.44	1.71	-2.93	499450	355918	-1.28%	1,070.7972	-18.69	-1.75%	87015	0	24.45%
AG	-1.18	2.52	-5.73	1475916	739893	-1.97%	402.8712	-12.99	-3.23%	664971	1605	89.87%
CU	1.94	1.86	3.16	301579	583612	7.10%	469.6977	38.47	8.19%	35071	-977	6.01%
VB	-0.46	0.86	0.45	720391	1485302	1.19%	49.2618	0.35	0.72%	120448	-1000	8.11%
AL	0.31	0.78	1.13	360153	607139	8.42%	117.8172	9.22	7.82%	66695	-199	10.99%
AO	-0.95	1.58	0.79	273410	494413	4.09%	61.3598	1.84	2.99%	221257	0	44.75%
ZN	0.07	0.69	1.81	204908	213396	-1.51%	43.6424	-0.73	-1.67%	65849	320	30.86%
NI	0.63	0.82	0.60	215024	223520	-5.05%	54.6284	-2.55	-4.66%	26810	-71	11.99%
SN	0.94	1.00	0.94	115788	69196	6.29%	39.3369	2.67	6.79%	5567	97	8.05%
PE	0.17	1.08	2.79	127508	122488	5.88%	19.6880	0.99	5.04%	23048	-686	18.82%
LC	-0.40	2.47	5.87	864433	812167	-0.41%	141.8676	-1.17	-0.82%	28699	-60	3.53%
SI	-1.35	1.33	0.30	288717	427574	-2.51%	37.9724	-1.51	-3.98%	48327	-44	11.30%
RB	-0.75	1.17	0.03	1241282	2744894	3.79%	118.1376	3.32	2.81%	150419	1437	5.48%
PS	-1.19	1.63	-4.19	289188	231619	-4.95%	79.5599	-5.15	-6.47%	9420	200	4.07%
I8	-0.75	1.77	-0.36	410932	958153	1.73%	161.7877	1.56	0.97%	700	0	0.07%
J8	-0.53	1.63	5.01	24176	49772	1.20%	35.4625	0.24	0.67%	2070	0	4.16%
JM	-0.80	2.09	4.99	1269761	925008	-1.49%	167.9939	-3.92	-2.34%	100	0	0.01%
HC	-0.18	0.74	0.96	530725	1977020	0.30%	90.2967	0.03	0.03%	137065	-4799	6.93%
SF	-0.50	1.56	1.50	230142	359429	-4.11%	16.1559	-0.79	-4.92%	11163	-21	3.11%
SM	-0.81	1.68	0.38	477947	543458	-1.13%	28.3122	-0.55	-1.95%	44876	-960	8.26%
SS	0.32	0.52	1.42	186892	218446	-8.49%	20.0351	-1.81	-9.04%	74195	-181	33.96%
SA	-0.40	1.36	-0.40	1167872	1912908	0.11%	85.8511	-0.28	-0.33%	9934	0	0.52%
PG	-1.42	2.04	-4.56	2104709	2073267	3.68%	92.0678	2.00	2.17%	455	0	0.02%
SH	-0.33	1.38	-3.33	397705	186982	-3.87%	21.4314	-0.95	-4.45%	134	0	0.07%
SC	1.02	1.54	4.31	206308	83805	-1.01%	85.7439	0.00	0.00%	5211000	0	6218.01%
FU	2.08	1.50	4.10	929085	449769	-1.62%	27.7700	0.10	0.35%	29890	-1500	6.65%
LU	0.94	1.03	2.06	175002	166354	-0.15%	11.7967	0.09	0.79%	4960	0	2.98%
PG	0.26	0.98	1.50	93771	163287	-2.21%	19.1390	-0.39	-2.06%	2416	0	1.48%
TA	0.22	0.95	1.48	1156553	1429546	-2.46%	45.8847	-1.06	-2.32%	45734	0	3.20%
PP	-0.40	0.70	0.71	286928	849986	-1.37%	39.6792	-0.71	-1.80%	14586	0	1.72%
PX	0.34	1.11	2.21	407074	235455	-1.98%	11.1076	-0.22	-2.01%	394	0	0.17%
EB	-0.50	1.38	-1.13	434253	604724	1.19%	27.7324	0.19	0.68%	858	0	0.14%

FF	-0.24	0.76	0.94	254357	308749	-7.63%	13.3788	-1.16	-8.64%	4636	0	1.50%
EG	-0.41	1.10	-0.29	185637	363378	-1.76%	20.7565	-0.46	-2.21%	7555	-390	2.08%
L8	-0.41	0.83	0.58	289457	656666	-0.33%	32.0498	-0.24	-0.75%	12958	0	1.97%
MA	-0.78	1.35	-1.68	742056	1463474	0.62%	46.8457	-0.10	-0.22%	14092	0	0.96%
EU	0.61	0.97	3.41	306928	347078	-2.57%	25.2446	-0.51	-2.01%	12420	0	3.58%
UR	0.24	0.91	2.42	180215	378217	-3.54%	20.0838	-0.68	-3.41%	5407	-77	1.43%
RU	0.60	1.45	3.05	274847	190590	-1.10%	52.6916	-0.27	-0.52%	124020	-3190	65.07%
NR	0.64	1.72	1.62	116995	120054	-2.29%	27.2074	-0.49	-1.80%	42640	0	35.52%
BR	0.00	1.48	0.53	138061	111613	-2.79%	11.2292	-0.33	-2.96%	8920	0	7.99%
CF	-0.31	0.88	1.56	310939	914852	-1.22%	88.0904	-1.39	-1.58%	2503	-23	0.27%
CY	-0.06	0.55	2.02	11842	24539	1.38%	2.4732	0.03	1.15%	6	0	0.02%
SR	-0.20	0.51	0.65	194884	561431	-1.77%	36.7388	-0.74	-2.00%	8185	-11	1.46%
SP	-0.15	0.58	1.81	169791	352922	-2.29%	26.9178	-0.74	-2.75%	226002	0	64.04%
A8	-0.22	0.58	2.22	188676	357207	3.29%	20.5319	0.61	2.97%	7090	0	1.98%
M8	-0.14	0.66	0.77	1388406	3851604	-2.12%	155.0656	-3.60	-2.32%	42582	0	1.11%
RM	-0.52	0.99	-1.03	334548	704130	2.97%	28.4236	0.60	2.10%	4260	-442	0.61%
Y8	0.00	0.69	-0.77	359815	801195	0.36%	91.1930	0.33	0.37%	27344	1050	3.41%
OI	-0.04	1.08	-1.92	261485	400934	-2.12%	67.3768	-1.59	-2.36%	7540	0	1.88%
P8	-0.11	0.84	-1.96	515039	500424	-1.30%	72.9604	-1.04	-1.42%	600	0	0.12%
CB	-0.23	0.51	0.37	585451	1760731	-1.58%	53.2128	-0.99	-1.86%	61968	0	3.52%
CS	-0.29	0.73	1.45	162022	288294	-0.59%	8.4651	-0.07	-0.87%	12504	0	4.34%
PK	-0.33	0.77	-1.76	140797	319481	-2.76%	17.5933	-0.59	-3.36%	0	0	0.00%
CJ	-3.56	4.05	-5.74	393520	284521	2.16%	27.4387	-0.41	-1.49%	0	0	0.00%
AP	0.11	1.38	5.15	120029	167548	5.10%	29.9851	1.49	4.97%	0	0	0.00%
JD	2.18	2.79	4.12	924369	738497	-3.41%	32.9145	-0.44	-1.32%	20	20	0.00%
LH	-0.20	1.72	2.27	102151	112397	4.68%	35.0319	1.50	4.28%	206	95	0.18%
EC	2.11	3.18	10.90	35117	30249	4.62%	9.4156	0.60	6.39%	0	0	0.00%
PR	0.00	0.67	0.80	85959	69666	-3.64%	8.3834	-0.33	-3.91%	774	0	1.11%
LG	0.23	0.76	1.03	16186	25074	-1.33%	2.9848	-0.03	-1.13%	444	0	1.77%

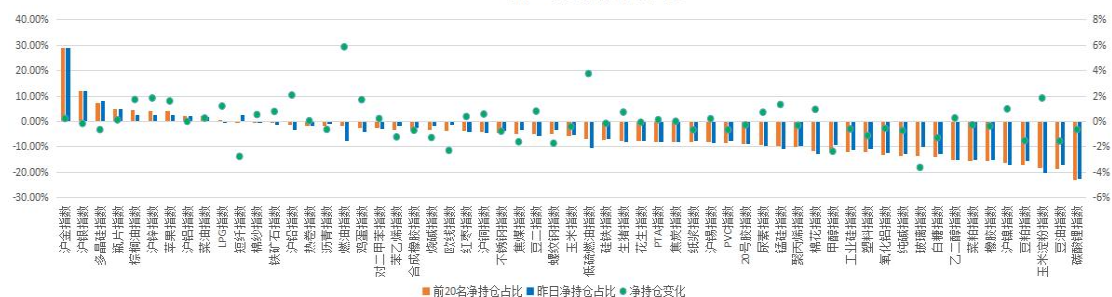


三、会员持仓数据

2025-10-24		2025-10-23		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多持仓	多持仓变化	前10名总持仓	总持仓变化	前10多持仓	多持仓变化	前20空持仓	空持仓变化	前20空持仓	空持仓变化	前10空持仓	空持仓变化
AI8888.SHF	沪金指数	169611	-0.99	-1607	136273	1.26	-1887	66178	1.57	-950	49113	1.48	-478		
AC8888.SHF	沪铜指数	353609	-2.07	-6995	296912	3.32	-9405	265839	1.56	-5199	188510	2.50	-3920		
CU8888.SHF	沪铜指数	304623	3.05	22777	233015	8.12	17506	328158	5.93	20132	248836	7.62	16554		
AL8888.SHF	沪铝指数	395178	10.80	30024	308011	10.50	23960	381744	10.95	30565	282976	11.06	22787		
AO8888.SHF	氧化铝指数	206817	3.68	7937	132454	2.31	3167	271914	1.88	12284	201850	1.83	14186		
ZN8888.SHF	沪锌指数	135823	-1.32	-1136	96227	-0.98	-716	126691	4.23	-2245	101190	2.97	-1831		
NI8888.SHF	沪镍指数	120983	12.22	-4495	91278	1.42	-1255	157492	3.45	-7684	115649	5.81	-7748		
SN8888.SHF	沪锡指数	34730	5.55	3172	26728	5.97	2339	40414	5.33	2493	29453	1.88	1296		
PB8888.SHF	沪铅指数	85617	7.64	6454	65223	10.76	2727	87336	1.56	5320	67551	5.89	4623		
LC8888.GFE	碳酸锂指数	450767	-0.15	228	344806	1.71	-5064	639236	0.63	4436	535513	0.39	1180		
SI8888.SHF	工业硅指数	280772	-1.21	-7615	207796	2.75	-5866	332219	1.46	-4011	242887	1.76	-4284		
PS8888.SHF	多晶硅指数	139040	2.50	-7100	112628	4.03	-4144	122259	5.19	-2662	96705	4.04	-2838		
RB8888.SHF	螺纹钢指数	1479329	2.50	29958	1082243	10.10	17155	1619117	5.70	91966	1235243	7.14	68718		
I8888.DCE	铁矿石指数	575662	5.51	7838	425051	11.30	5454	581474	11.14	4282	428952	1.85	2529		
J8888.DCE	焦炭指数	24043	0.19	77	17529	1.25	-222	28035	0.37	102	20371	-0.24	-34		
JM8888.DCE	焦煤指数	485807	-0.72	-9161	354792	2.47	-7939	531629	1.14	-9	390088	0.43	1948		
HC8888.SHF	热卷指数	1245270	0.41	7470	925603	1.09	-8496	1276680	0.38	8277	973044	0.64	8241		
SM8888.CZC	硅铁指数	269577	15.64	-9509	198784	3.14	-6442	295323	16.47	-9168	231119	1.78	-4194		
SM8888.CZC	锰硅指数	380354	-0.56	-2127	271961	10.69	1855	433107	12.23	-9758	337763	0.78	-2663		
SC8888.SHF	不锈钢指数	108471	15.98	-10372	80840	3.16	-6266	118644	14.22	-11800	92124	10.25	-7757		
SA8888.CZC	纯碱指数	946860	-0.79	-986	601026	1.78	-10906	1206722	0.59	11629	908719	1.31	12048		
FG8888.CZC	玻璃指数	1051683	-0.39	12028	695128	-0.05	-3877	1332466	1.30	87194	1052367	3.35	94503		
SM8888.CZC	烧碱指数	124676	1.05	-3317	92397	5.05	-2996	130796	12.22	-2904	99905	0.81	-813		

PP888B.CZC	短纤指数	240077	-15.15	-27113	173834	-1.01	-17395	240217	-6.90	-16809	166660	-4.08	-4127
EO888B.DCE	乙二醇指数	193849	-5.58	-5076	134836	-3.75	-14935	248646	-2.74	-6575	204590	-5.37	-7131
LB888.DCE	塑料指数	364348	-0.78	-3386	262912	-0.63	-4676	443886	-1.01	1675	356222	-0.59	-2090
MA888B.CZC	甲醇指数	909610	-1.37	-12413	669123	-1.29	-8760	1063493	-2.24	23285	863725	-1.90	24320
EU888B.SHF	沥青指数	215968	-6.66	-2229	160157	-2.19	-1764	221796	-3.82	-3510	154027	-2.18	-953
UR888B.CZC	尿素指数	199771	-2.94	-5946	131458	-3.42	-3360	234080	-4.10	-10010	166333	-5.82	-6610
RU888B.SHF	橡胶指数	101305	-1.13	-671	73107	-0.31	-35	131251	-0.56	-1145	100773	-1.03	-1085
NR888B.SHF	20号胶指数	69932	-2.77	-2095	51511	-3.96	-1414	80792	-2.25	-2574	61711	-2.75	-929
BR888B.SHF	合成橡胶指数	56108	-2.77	-4496	44734	-7.04	-2595	59750	-3.27	-3887	49722	-5.77	-2119
CF888B.CZC	棉花指数	580876	0.08	1068	432525	0.35	1498	695628	-1.33	-9168	520291	-1.29	-6787
CT888B.CZC	棉纱指数	23325	-1.42	470	18994	-0.99	186	23341	-0.88	350	19183	-0.88	167
SR888B.CZC	白糖指数	357054	-2.90	-10665	262360	-2.75	-7406	435881	-1.03	-4525	345190	-1.31	-4595
SP888B.SHF	纸浆指数	194766	-1.18	-3563	143359	-1.83	-2481	223659	-1.10	-4514	166811	-1.92	-2977
A888B.DCE	豆一指数	215480	-1.60	12177	169445	-5.80	10548	227233	-0.00	9150	170891	-1.93	3553
MA888B.DCE	豆粕指数	2393803	-1.18	-29903	1788601	-3.24	-30422	3048580	-2.04	-35170	2497361	-1.14	-22123
RM888B.CZC	菜粕指数	370589	-1.53	9406	260361	-1.98	6195	479224	-0.09	14710	371443	-1.71	9807
Y888B.DCE	豆油指数	499433	-1.06	-1982	382346	-0.10	-304	647903	-1.22	4649	551170	-0.90	4895
OI888B.CZC	菜油指数	298346	-1.23	-6811	207457	-3.85	-8311	290430	-2.55	-7294	210610	-2.50	-7648
P888B.DCE	棕榈油指数	289524	-1.04	1827	210285	-1.48	2583	267458	-2.08	-9042	193234	-1.12	-4536
CS888B.DCE	玉米指数	1225967	-1.54	-28665	922814	-2.70	-27035	1327135	-1.90	-13953	1061179	-1.82	-16339
CS888B.DCE	玉米淀粉指数	157371	-5.83	3438	115067	-2.79	1808	210179	-5.33	8088	166343	-7.56	270
FK888B.CZC	花生指数	194862	-1.51	-9101	122082	-0.68	-8735	219515	-1.18	-9580	140597	-5.82	-5586
CJ888B.CZC	红枣指数	147640	-1.76	5084	93819	-0.14	1775	158011	-0.07	3885	104090	-1.45	2834
AP888B.CZC	苹果指数	97094	-3.83	9119	67863	-1.68	7507	89998	-0.93	5922	52936	-1.88	5256
JD888B.DCE	鸡蛋指数	349561	-1.41	-4020	256774	-1.12	-3454	368818	-1.56	-5640	267851	-1.76	-3568
LH2601.DCE	生油2001	61647	-1.85	3287	42370	-2.58	1641	65927	-1.41	2920	46644	-1.46	2506
PR888B.CZC	棉片指数	60234	-2.99	1887	44351	-2.26	-1025	56743	-3.05	-1787	43810	-1.80	-80

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 -----