



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29日

一、跟踪品种要点

从波动情况看，今日涨幅前三，焦煤涨4.98%，欧线涨4.62%，焦炭涨3.19%，下跌前三：菜油跌-2.12%，棕榈油跌-1.23%，低硫跌-0.89%；今日50/62品种上涨，商品涨多跌少，黑色、有色上涨，油脂下跌，黑色、软商品、化工、农产品震荡。从近一周涨跌幅来看，苹果、焦煤、铜铝、碳酸锂、欧线多头持续性尚可，红枣、原木、生猪、黄金、白银、甲醇空头持续性较好，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、焦煤、碳酸锂，流出品种中：黄金、苹果、原油流出较多资金；从资金流入比例看，流入排前的有：欧线、焦煤、合成橡胶，流出排前三的为：苹果、瓶片、原油。今日仓单变化较大的有：热卷（+3402）、锰硅（-38603）。

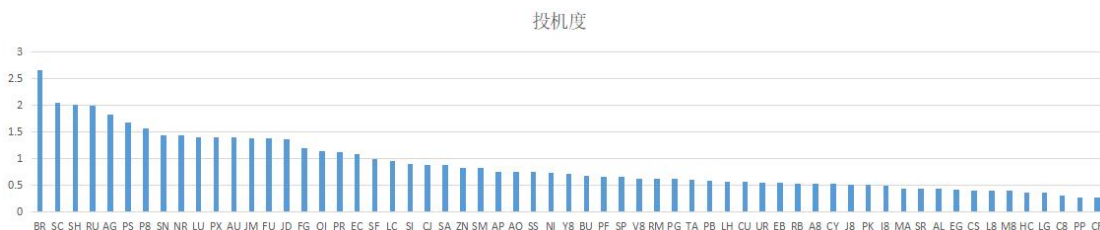
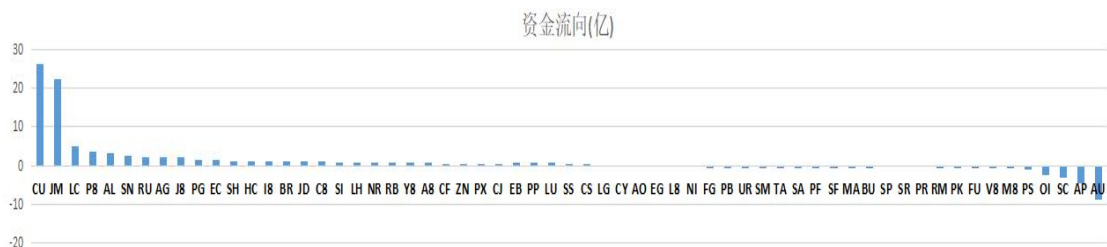
从持仓看，持仓量增加前三：合成橡胶、欧线、焦煤；在前20名会员持仓中，净多持仓增加明显的有：铁矿、不锈钢、鸡蛋，净空持仓增加明显的有：燃油、锰硅、花生；其中红枣、橡胶、LPG、烧碱、焦煤、螺纹、锡铝多头增仓，生猪、PX、焦炭、锌空头增仓。

综合来看，近日可重点关注品种：焦煤、黄金、铜、苹果、碳酸锂、棕榈油

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	仓单持仓比
AU	1.07	1.91	-8.35	477855	342696	-1.93%	1,001.2387	-8.87	-0.89%	87816	801	25.63%	
AG	2.60	2.91	-3.93	1251314	688870	-1.93%	375.4413	2.33	0.62%	653828	-3599	94.91%	
CU	1.98	1.96	3.89	347234	617144	3.70%	498.7066	26.07	5.23%	35745	-101	5.79%	
V8	1.29	1.56	1.80	936523	1478579	-2.50%	49.7652	-0.63	-1.26%	120224	-136	8.13%	
AL	0.73	0.79	1.66	272349	625507	2.27%	121.1503	3.31	2.73%	66044	-199	10.56%	
AO	2.16	2.44	2.48	375256	494736	-2.20%	62.9112	-0.05	-0.08%	223372	0	45.15%	
ZN	0.55	0.57	2.10	173585	210352	0.60%	42.8258	0.42	0.97%	67424	-847	32.05%	
NI	0.82	1.00	0.20	162425	222302	-0.96%	54.0871	-0.08	-0.15%	31433	48	14.14%	
SN	1.24	0.96	1.97	107077	74434	4.97%	42.6837	2.52	5.90%	5682	73	7.63%	
PB	0.03	0.47	1.21	71428	122463	-0.46%	19.2639	-0.12	-0.60%	22997	-100	18.78%	
LC	1.56	2.29	9.03	834935	875981	1.55%	159.4580	4.85	3.04%	27525	190	3.14%	
SI	2.42	2.29	4.55	388798	432693	-0.16%	39.6106	0.87	2.20%	47338	-706	10.94%	
RB	1.35	1.35	2.95	1418690	2629626	-0.59%	116.0987	0.74	0.64%	146140	-1221	5.56%	
PS	1.15	3.29	4.23	420120	250114	-2.24%	90.4750	-1.02	-1.13%	9120	-30	3.65%	
I8	1.55	1.78	4.33	456857	916501	-0.82%	161.1944	1.13	0.70%	600	-100	0.07%	
J8	3.19	3.83	7.70	26248	50565	2.56%	36.9859	2.04	5.52%	2070	0	4.09%	
JM	4.98	5.49	10.68	1367601	986010	8.21%	187.2143	22.40	11.96%	0	0	0.00%	
HC	1.21	1.39	3.88	710447	1979898	0.13%	92.9112	1.17	1.26%	134773	3402	6.81%	
SF	0.63	1.06	2.57	328849	331706	-2.62%	15.0246	-0.31	-2.09%	0	-8675	0.00%	
SM	1.09	1.19	1.91	426690	519582	-1.74%	27.4423	-0.18	-0.67%	0	-38603	0.00%	
SS	0.45	0.60	1.05	135428	180453	1.31%	16.3833	0.18	1.11%	73777	-119	40.88%	
SA	1.59	2.31	4.08	1631629	1847145	-1.80%	84.9015	-0.22	-0.26%	8945	200	0.48%	
FG	1.23	2.20	3.89	2447057	2037078	-1.40%	93.5806	-0.11	-0.12%	415	-8	0.02%	
SH	0.89	1.83	-0.42	426261	212816	4.19%	24.2997	1.18	4.86%	114	-20	0.05%	
SC	-0.24	1.40	5.21	154325	75440	-3.97%	76.9251	-3.14	-4.08%	4202000	0	5569.99%	
FU	-0.68	0.79	5.42	636691	459275	-1.96%	28.3361	-0.62	-2.18%	37890	0	8.25%	
LU	-0.89	0.89	5.57	216256	153920	1.58%	11.1558	0.26	2.30%	4960	0	3.22%	
PG	1.07	1.98	4.44	109496	177616	4.96%	21.2549	1.40	6.57%	3096	680	1.74%	
TA	0.43	1.12	5.02	874030	1431584	-0.86%	47.0371	-0.22	-0.46%	48579	0	3.39%	
PP	0.42	0.79	1.65	245190	870023	0.26%	40.7797	0.28	0.68%	14569	-4	1.67%	
PX	0.54	1.13	5.10	364701	261450	2.72%	12.3987	0.41	3.31%	215	0	0.08%	
EB	0.74	1.25	0.94	339326	618233	-2.36%	29.0287	0.30	1.02%	470	-280	0.08%	

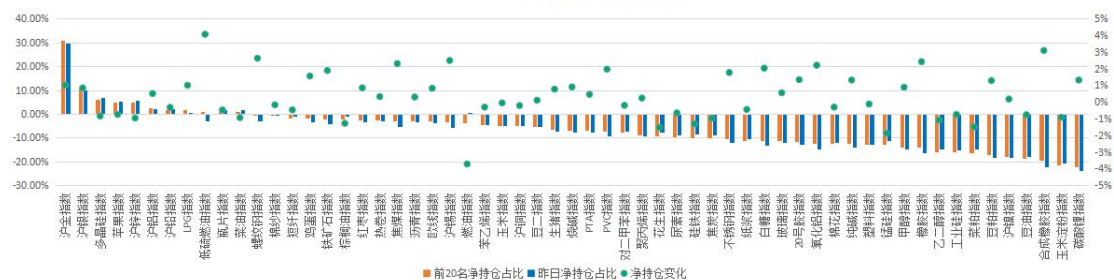
FF	0.30	0.97	3.44	193116	288407	-2.18%	12.7073	-0.25	-1.97%	4636	0	1.61%
EG	0.74	1.18	2.40	143744	346749	-1.43%	20.0084	-0.05	-0.26%	7555	0	2.18%
L8	0.33	0.73	1.86	260997	645412	-0.58%	31.6904	-0.08	-0.25%	12745	0	1.97%
MA	0.75	1.51	-0.13	705488	1584354	-1.40%	50.4254	-0.34	-0.68%	12122	-1750	0.77%
BU	-0.15	0.85	3.24	233855	340063	-1.26%	24.5371	-0.35	-1.43%	12920	0	3.80%
UR	0.61	1.10	2.29	197506	357794	-1.19%	19.0072	-0.13	-0.67%	0	-2970	0.00%
RU	1.76	2.83	3.31	390351	195555	2.68%	55.0964	2.36	4.28%	122890	320	62.84%
NR	1.54	2.86	2.99	159141	111160	1.82%	25.5296	0.80	3.14%	44253	-201	39.81%
BR	-0.12	2.76	-2.29	294712	111477	11.06%	10.8404	1.06	9.74%	8580	0	7.70%
CF	0.41	0.72	0.44	255130	910968	0.23%	88.1233	0.52	0.60%	2460	-11	0.27%
CY	0.50	0.69	0.43	12762	24192	-1.44%	2.4406	-0.02	-0.97%	4	-2	0.02%
SR	0.20	0.46	0.90	241743	554317	-1.33%	36.5405	-0.42	-1.15%	7625	-70	1.38%
SP	0.31	0.95	1.42	222550	341138	-1.38%	25.7291	-0.40	-1.54%	225428	-534	66.08%
A8	-0.05	0.95	1.38	192941	359520	1.94%	20.9804	0.64	3.05%	7190	100	2.00%
M8	0.00	1.10	2.32	1457109	3633919	-0.73%	148.2128	-0.81	-0.55%	42332	-50	1.16%
RM	-0.72	1.77	1.68	433105	695264	-0.30%	28.2546	-0.50	-1.77%	3915	-135	0.56%
Y8	-0.59	1.60	-2.00	570036	801966	1.20%	90.7255	0.69	0.76%	27644	500	3.45%
OI	-2.12	2.72	-3.73	443090	385507	-1.42%	62.9646	-2.39	-3.79%	7540	0	1.96%
P8	-1.23	2.04	-4.71	852511	547707	6.30%	77.5803	3.72	4.79%	0	-512	0.00%
C8	-0.33	0.42	-1.02	539820	1774664	0.60%	54.1247	0.98	1.82%	63966	2000	3.60%
CS	0.12	0.74	0.08	113832	280362	-1.09%	8.3137	0.05	0.56%	12504	0	4.46%
PK	0.20	0.52	-0.57	145797	288006	-3.78%	15.8967	-0.60	-3.77%	0	0	0.00%
CJ	0.23	1.75	-8.12	259800	293042	0.88%	27.6291	0.40	1.46%	0	0	0.00%
AP	-0.26	0.80	4.16	138558	182634	-11.41%	34.1150	-4.36	-12.77%	0	0	0.00%
JD	1.84	2.28	6.68	970111	710571	-0.40%	32.9773	1.02	3.06%	38	0	0.01%
LH	0.21	0.90	-0.41	68559	119788	2.17%	37.3662	0.87	2.32%	206	0	0.17%
EC	4.62	5.23	5.75	34539	31906	10.40%	10.1483	1.36	13.43%	0	0	0.00%
PR	0.24	0.72	3.37	67699	60450	-6.01%	7.3384	-0.46	-6.24%	697	-66	1.15%
LG	0.24	0.47	-5.03	7626	21290	-1.27%	2.4378	-0.01	-0.56%	444	0	2.09%

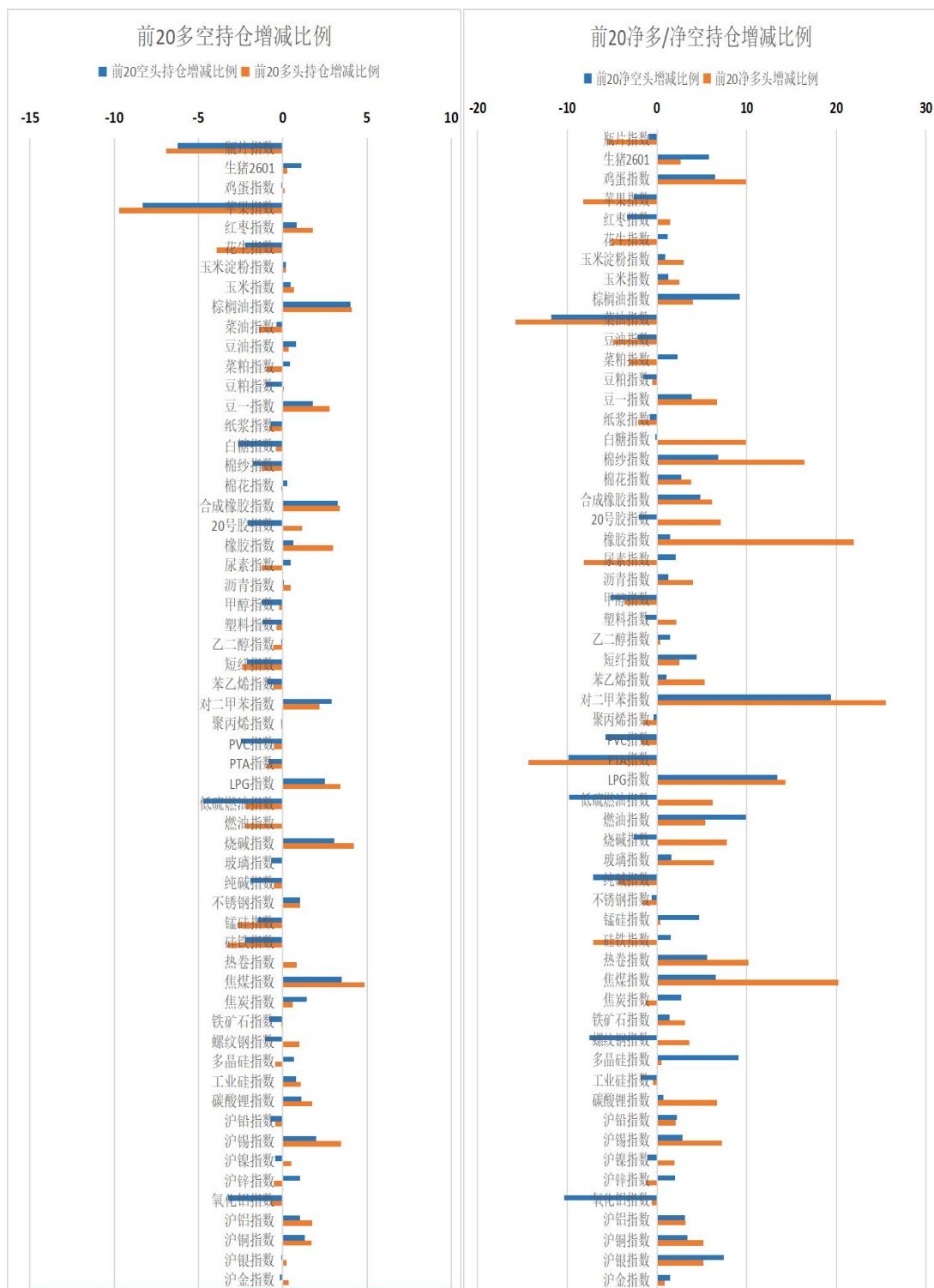


三、会员持仓数据

2025-10-29		2025-10-28		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		
A08888.SHF	沪金指数	170205	0.13	1244	1244	138075	0.34	463	64463	-1.86	-556	48585	-0.92		
A08888.SHF	沪银指数	322427	0.01	1440	250501	0.41	2420	246819	-1.75	-65	185155	-1.25			
C08888.SHF	沪铜指数	313933	4.81	10539	245693	5.72	7500	351428	5.20	8065	270027	6.22			
AL8888.SHF	沪铝指数	401078	1.43	10808	308267	0.80	7105	384442	0.57	6514	288659	1.07			
A08888.SHF	氧化铝指数	204969	-1.74	-3446	133530	-0.04	684	266431	-5.71	-16109	199336	-5.10			
ZW8888.SHF	沪锌指数	131885	-2.01	-1126	93799	-1.00	-950	121967	-6.60	2157	99236	-1.45			
NI8888.SHF	沪镍指数	119089	-0.17	1118	87181	0.07	454	159309	-6.61	-968	116407	-1.75			
SW8888.SHF	沪锡指数	38323	6.89	2583	28618	7.61	2160	40823	2.15	1475	29895	2.03			
PB8888.SHF	沪铅指数	84759	-3.49	-576	65411	-2.05	-2635	82454	-1.05	-888	64541	-1.16			
LC8888.SHF	碳酸锂指数	487675	3.89	15345	364734	1.92	7172	683300	1.54	9841	571777	1.38			
SI8888.GFE	工业硅指数	270100	0.22	4672	198321	-0.89	-2195	339394	1.11	3351	239576	-6.97			
PS8888.GFE	多晶硅指数	147455	-5.47	-1132	118947	-5.54	-3786	132290	-2.89	1661	102269	-2.48			
RB8888.SHF	螺纹钢指数	1484349	2.80	25545	1097687	2.83	33263	1494308	-1.90	-27873	1126843	-2.20			
I8888.DCE	铁矿石指数	550647	1.10	-889	401286	-1.27	345	570298	-1.99	-7551	410052	-1.88			
J8888.DCE	焦炭指数	23671	0.48	299	17073	0.13	22	28711	2.57	720	20597	1.70			
JW8888.DCE	焦煤指数	520179	8.69	47934	388587	11.03	39819	549124	4.83	34628	400990	2.86			
HC8888.SHF	热卷指数	1254843	0.99	16747	943740	1.11	10301	1309496	0.46	-82	1007572	-0.23			
SP8888.CZC	硅铁指数	239446	-0.54	-10897	174648	-5.47	-2187	272174	-1.78	-7496	215067	-6.69			
SM8888.CZC	锰硅指数	348633	-1.52	-13866	251263	-2.61	-7811	415967	-1.84	-7780	330027	-1.61			
SS8888.SHF	不锈钢指数	99741	1.98	1855	76576	2.73	2114	118534	-6.81	1877	96163	-6.54			
SM8888.CZC	纯碱指数	929872	-1.06	-9909	598830	-1.06	-6393	1161349	-1.25	-35328	873355	-1.35			
FG8888.CZC	玻璃指数	1073941	-0.27	-1397	715250	-1.15	-5974	1305409	-1.33	-13876	995901	-1.17			
SR8888.CZC	烧碱指数	136386	5.85	8935	99963	5.86	6898	150663	4.44	6553	115762	4.42			
FU8888.SHF	燃油指数	264154	-0.32	-10325	190957	-0.33	-2721	281115	-0.26	-297	191525	-1.19			
LU8888.SHF	低硫燃油指数	72659	-0.10	-3422	56727	-2.85	-2580	70905	-16.33	-7267	55425	-16.72			
PG8888.CZC	LPG指数	116752	5.85	6073	93507	5.52	4610	113832	3.83	4442	96816	2.83			
TA8888.CZC	PTA指数	901259	-1.57	-13935	678138	-0.13	3769	1002572	-1.13	-12364	794983	-1.09			
V8888.DCE	PVC指数	852188	-0.62	-8113	551188	-0.22	-1192	960041	-0.96	-36788	736419	-1.79			
PP8888.DCE	聚丙烯指数	513982	-0.06	-540	376553	-0.02	-147	592685	-0.36	-333	485330	-0.32			
PX8888.DCE	对二甲苯指数	183005	3.21	4747	134106	0.78	1059	203030	3.44	7605	157777	3.06			
EB8888.DCE	苯乙烯指数	415884	2.34	-3503	330377	1.87	-6537	444967	2.48	-5809	345725	4.08			
PF8888.CZC	短纤指数	220867	-1.23	-6983	161984	-2.66	-779	225453	-1.63	-6082	153585	-1.48			
EG8888.DCE	乙二醇指数	196880	-1.01	-2017	141213	-1.88	-2493	253609	-0.41	-105	203209	-1.42			
L8888.DCE	塑料指数	370537	2.90	-2426	266444	1.68	-1396	452914	2.44	-7707	355486	1.06			
MA8888.SHF	甲醇指数	944428	-0.55	-3416	696233	0.95	8865	1164606	-1.89	-19928	949586	-1.29			
BU8888.CZC	沥青指数	204410	-0.11	1563	156746	0.65	1597	214478	-0.64	241	150330	-1.54			
UR8888.CZC	尿素指数	189320	-2.38	-4423	120663	-3.33	-2938	223929	-1.18	1655	160356	-0.43			
RU8888.SHF	橡胶指数	104998	5.08	5828	77683	7.88	5776	132396	0.91	1200	101825	0.41			
NR8888.SHF	20号胶指数	56665	-1.80	1271	43436	3.90	510	69463	0.96	-2326	53792	-3.84			
BR8888.SHF	合成橡胶指数	51495	4.88	3778	37157	6.11	3699	73013	1.88	3613	61247	1.22			
CF8888.CZC	棉花指数	581668	-0.14	1445	425126	-0.23	-981	695456	0.33	2295	519830	0.46			
CY8888.CZC	棉纱指数	22905	-2.16	-305	18878	2.65	-514	23086	-1.98	-428	18944	-2.65			
SR8888.CZC	白糖指数	355012	-0.65	-2327	2591167	-1.32	-2309	416981	-1.37	-14563	321732	-2.24			
SP8888.SHF	纸浆指数	181551	-1.50	-2807	135102	-2.42	-2810	219197	-0.79	-2469	159962	-1.92			
A8888.DCE	豆一指数	218020	5.79	10006	170343	3.30	9309	215879	2.56	6436	165598	3.59			
M8888.DCE	豆粕指数	2246475	-0.92	679	1697009	-0.16	8487	2862497	-1.46	-36201	2369820	-1.82			
RM8888.CZC	菜粕指数	366153	-2.16	-6637	259046	5.12	-6383	479098	-0.42	2971	370409	0.41			
Y8888.DCE	豆油指数	493593	-1.21	2778	378690	-1.36	-7169	644107	0.29	6257	551581	0.53			
OI8888.CZC	菜油指数	283866	-1.88	-5429	192579	-5.10	-5591	280384	-6.60	-1395	201489	-2.02			
P8888.DCE	棕榈油指数	295901	4.47	22538	161296	6.67	13706	307953	6.84	22070	234501	9.57			
C8888.DCE	玉米指数	1254663	0.75	11687	943067	0.62	7079	1341849	0.82	8185	1087044	1.29			
CS8888.DCE	玉米淀粉指数	151237	-1.34	4190	190217	-1.25	-127	211928	-0.05	552	167978	0.29			
FK8888.CZC	花生指数	168412	-2.80	-11336	108374	-2.50	-5017	194545	-1.29	-6447	133232	-0.39			
CT8888.CZC	红枣指数	156082	3.03	5181	101458	2.42	4759	163161	1.37	2432	107557	1.21			
AF8888.CZC	苹果指数	103171	-1.90	-17729	71998	-16.61	-15605	94528	-11.02	-15165	61076	-17.91			
JD8888.DCE	鸡蛋指数	332914	0.17	702	247113	1.26	1670	345109	-1.98	-597	248397	-1.99			
LR2601.DCE	生猪2601	64875	0.50	323	43724	-1.23	-546	69497	1.23	1336	47863	0.12			
PR8888.CZC	扁豆指数	51435	-1.50	-4168	37978	3.05	-577	50778	-0.99	-3764	39191	-3.28			

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 -----