



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30日

一、跟踪品种要点

从波动情况看，今日涨幅前三，菜粕涨0.72%，碳酸锂涨0.67%，苹果涨0.49%，下跌前三：玻璃跌-3.22%，红枣跌-2.56%，生猪跌-2.50%；今日11/62品种上涨，商品涨少跌多，普跌行情，贵金属、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、烧碱空头持续性较好，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：碳酸锂、玻璃、黄金，流出品种中：白银、焦煤、纯碱流出较多资金；从资金流入比例看，流入排前的有：烧碱、生猪、甲醇，流出排前三的为：欧线、不锈钢、锡。今日仓单变化较大的有：低硫（+42400）、热卷（-5938）。

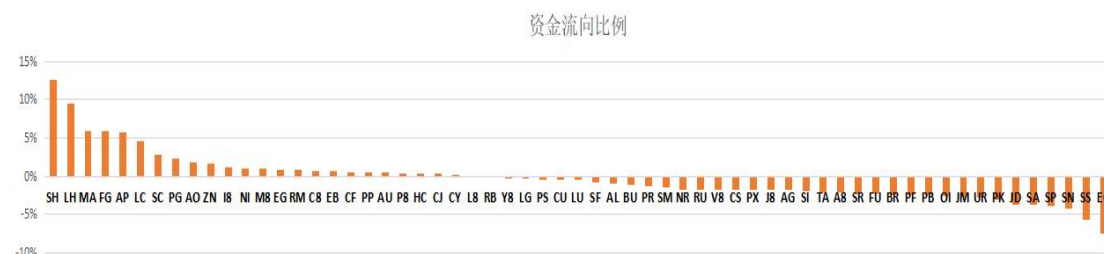
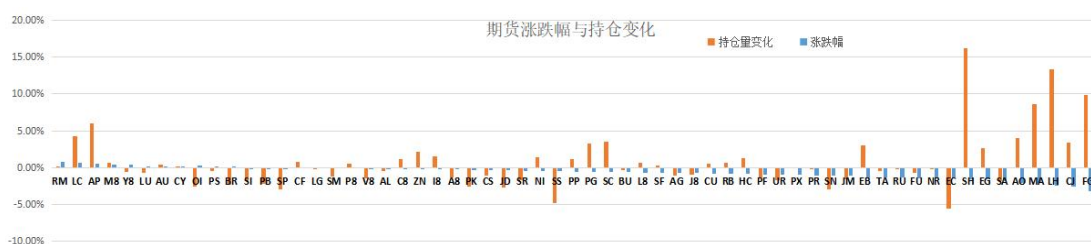
从持仓看，持仓量增加前三：烧碱、生猪、玻璃；在前20名会员持仓中，净多持仓增加明显的有：合成橡胶、镍、乙二醇，净空持仓增加明显的有：烧碱、燃油、硅铁；其中红枣、苹果、玉米淀粉、乙二醇、苯乙烯、PTA、LPG、铁矿、铅多头增仓，生猪、橡胶、甲醇、烧碱、玻璃、硅铁、碳酸锂、氧化铝空头增仓。

综合来看，近日可重点关注品种：焦煤、黄金、铜、苹果、碳酸锂、甲醇

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	0.15	2.60	4.21	552587	343917	0.36%	1,006.3229	5.08	0.51%	87816	0	25.53%
AG	0.71	2.69	1.24	1400021	681462	-1.08%	368.7585	-6.68	-1.81%	662835	9007	97.27%
CU	0.82	1.78	3.02	428404	620126	0.48%	496.3208	-2.39	-0.48%	37437	1692	6.04%
V8	0.21	1.25	1.14	1179366	1456577	-1.49%	48.9192	-0.85	-1.73%	120267	43	8.26%
AL	0.23	0.67	1.06	299427	622167	-0.53%	120.0015	-1.15	-0.96%	66418	374	10.68%
AO	2.04	2.42	-0.28	476749	514662	4.03%	64.1051	1.19	1.86%	225761	2389	43.87%
ZN	0.26	0.88	1.70	167872	214801	2.12%	43.5646	0.74	1.70%	67124	-300	31.25%
NI	0.46	0.85	-0.26	143969	225487	1.43%	54.6100	0.52	0.96%	31532	99	13.98%
SN	1.08	1.25	0.60	105218	72249	-2.94%	40.9841	-1.70	-4.15%	5732	50	7.93%
PB	-0.07	0.36	1.05	60690	119775	-2.19%	18.7986	-0.47	-2.48%	21645	-1352	18.07%
LC	0.67	3.16	8.09	1037085	912869	4.21%	167.2887	7.83	4.68%	27641	116	3.03%
SI	-0.06	1.84	4.54	428563	424602	-1.87%	38.8448	-0.77	-1.97%	47410	72	11.17%
RB	0.83	1.43	1.40	1659834	2647901	0.69%	115.8991	-0.20	-0.17%	145840	-300	5.51%
PS	0.07	1.80	5.11	299470	248933	-0.47%	90.1079	-0.37	-0.41%	9330	210	3.75%
I8	-0.26	1.53	3.49	409689	929951	1.47%	163.1304	1.94	1.19%	600	0	0.06%
J8	-0.75	1.94	4.61	21661	50050	-1.02%	36.3336	-0.65	-1.80%	2070	0	4.14%
JM	1.10	2.49	6.52	1327959	970861	-1.54%	182.3137	-4.90	-2.69%	0	0	0.00%
HC	0.84	1.37	2.15	781271	2005363	1.29%	93.2740	0.36	0.39%	128835	-5938	6.42%
SF	0.71	1.53	2.13	343039	332067	0.11%	14.9016	-0.12	-0.83%	2624	0	0.79%
SM	-0.14	1.01	0.64	311639	513200	-1.23%	27.0686	-0.37	-1.38%	8100	8100	1.58%
SS	-0.52	0.98	0.24	149771	171826	-4.78%	15.4970	-0.89	-5.72%	73777	0	42.94%
SA	1.88	2.82	1.13	1589709	1813394	-1.83%	81.8177	-3.08	-3.77%	8875	-70	0.49%
FG	3.22	3.48	-0.09	2889227	2237473	9.84%	99.4359	5.86	5.89%	402	-13	0.02%
SH	1.60	2.19	2.13	478454	247343	16.22%	27.7829	3.48	12.54%	114	0	0.05%
SC	0.61	1.49	2.39	141082	78129	3.56%	79.1651	2.24	2.83%	4202000	0	5378.28%
FU	1.44	1.26	2.28	758004	455728	-0.77%	27.7236	-0.61	-2.21%	55750	17860	12.23%
LU	0.19	1.45	3.54	180422	152857	-0.69%	11.0984	-0.06	-0.52%	47360	42400	30.98%
PG	0.59	0.90	2.26	86671	183364	3.24%	21.7758	0.52	2.39%	3811	715	2.08%
TA	1.38	2.09	2.03	1095650	1424520	-0.49%	46.1148	-0.92	-2.00%	61295	12716	4.30%
PP	0.57	0.81	0.53	298994	879510	1.09%	40.9891	0.21	0.51%	14569	0	1.66%
PX	1.01	1.56	2.11	307671	261109	-0.13%	12.1818	-0.22	-1.78%	215	0	0.08%
EB	1.36	2.05	1.99	424354	636935	3.03%	29.2281	0.20	0.68%	74	-396	0.01%

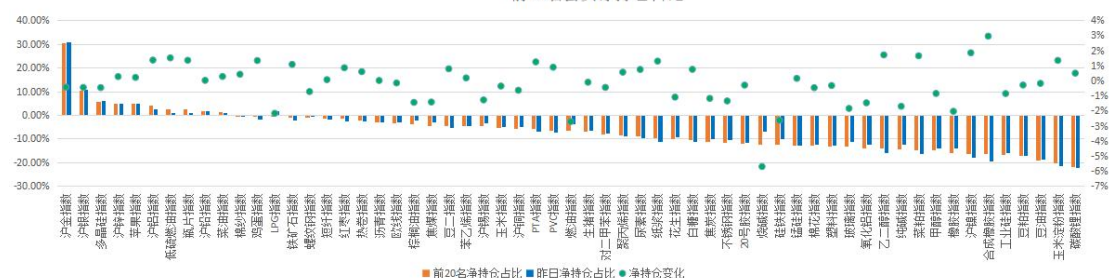
FF	0.96	1.61	1.25	248678	284399	-1.39%	12.4064	-0.30	-2.43%	4636	0	1.63%
EG	1.63	1.88	0.44	142780	355996	2.67%	20.1939	0.19	0.92%	7555	0	2.12%
L8	0.70	0.84	0.37	273715	649834	0.69%	31.6836	-0.01	-0.02%	12745	0	1.96%
MA	2.07	2.25	2.03	944877	1720503	8.59%	53.6031	3.18	5.93%	11997	-125	0.70%
BU	0.64	1.01	-0.03	212219	338671	-0.41%	24.2851	-0.25	-1.04%	12120	-800	3.58%
UR	0.97	1.69	0.55	189004	351676	-1.71%	18.4921	-0.52	-2.79%	0	0	0.00%
RU	1.41	1.32	1.86	270183	195030	-0.27%	54.1671	-0.93	-1.72%	121670	-1220	62.39%
NR	1.45	1.46	1.56	118604	110959	-0.18%	25.1097	-0.42	-1.67%	44857	604	40.43%
ER	0.05	1.40	2.32	187673	108901	-2.31%	10.5863	-0.25	-2.40%	8580	0	7.88%
CF	-0.12	0.70	0.41	302494	917833	0.75%	88.6299	0.51	0.57%	2434	-26	0.27%
CY	0.15	0.69	0.66	15215	24229	0.15%	2.4473	0.01	0.27%	4	0	0.02%
SR	0.42	0.62	0.70	222192	544814	-1.71%	35.7582	-0.78	-2.19%	7541	-84	1.38%
SP	-0.12	1.19	0.44	252528	331199	-2.91%	24.7544	-0.97	-3.94%	224942	-486	67.92%
A8	-0.27	0.70	1.16	154835	354889	-1.29%	20.5660	-0.41	-2.02%	7190	0	2.03%
M8	0.41	0.86	2.82	1443873	3655350	0.59%	149.6371	1.42	0.95%	42332	0	1.16%
RM	0.72	1.02	2.82	322794	696435	0.17%	28.4994	0.24	0.86%	3915	0	0.56%
Y8	0.40	0.97	0.97	357910	796983	-0.62%	90.5081	-0.22	-0.24%	27644	0	3.47%
OI	0.10	0.79	3.27	215859	375603	-2.57%	61.4010	-1.56	-2.55%	7540	0	2.01%
P8	-0.16	0.97	3.47	539231	550840	0.57%	77.8966	0.32	0.41%	0	0	0.00%
C8	-0.23	0.56	0.83	627210	1795058	1.15%	54.5134	0.39	0.71%	63966	0	3.56%
CS	0.33	0.82	-0.21	134086	277442	-1.04%	8.1684	-0.15	-1.78%	12504	0	4.51%
PK	0.32	0.74	-0.41	133765	280630	-2.56%	15.4288	-0.47	-3.03%	0	0	0.00%
CJ	2.56	3.21	9.45	405936	302888	3.36%	27.7260	0.10	0.35%	0	0	0.00%
AP	0.49	1.45	5.11	163058	193588	6.00%	36.2123	2.10	5.79%	0	0	0.00%
JD	0.40	0.83	6.95	520329	691671	-2.66%	31.7985	-1.18	-3.71%	38	0	0.01%
LH	2.50	2.71	2.78	112404	135813	13.38%	41.3045	3.94	9.53%	206	0	0.15%
EC	1.45	2.67	3.10	17598	30114	-5.62%	9.4391	-0.71	-7.51%	0	0	0.00%
PR	1.05	1.45	1.12	90116	60405	-0.07%	7.2464	-0.09	-1.27%	697	0	1.15%
LG	-0.13	0.62	4.47	8515	21273	-0.08%	2.4291	-0.01	-0.36%	166	-278	0.78%



三、会员持仓数据

2025-10-30		2025-10-29		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10名总持仓	总持仓变化	前10名总持仓	总持仓变化
AU8888.SHF	沪金指数	170616	0.24	995	137744	-0.24	-331	66026	2.42	1641	49205	1.28	745		
AG8888.SHF	沪银指数	318964	-1.07	3961	252190	0.67	4361	247289	0.19	1767	184793	-0.20	-632		
CU8888.SHF	沪铜指数	319671	-0.08	489	242254	-1.40	-4005	355347	1.12	2527	273711	1.36	1836		
AL8888.SHF	沪铝指数	404608	0.88	4426	312605	1.41	4842	379622	-1.25	1283	284945	-1.29	-4103		
AO8888.SHF	氧化铝指数	234104	-14.21	4353	147585	10.53	-1618	305670	14.73	19646	227161	13.96	19508		
ZN8888.SHF	沪锌指数	133652	1.34	2801	95201	1.49	2050	122963	0.82	2048	97025	-2.23	-1208		
NI8888.SHF	沪镍指数	121380	1.92	1935	88363	1.36	1182	158027	-0.80	1047	115934	-0.41	1856		
SN8888.SHF	沪锡指数	35905	-6.31	-1769	26407	-7.73	-1460	39264	-3.82	-1161	28825	-3.58	-1050		
FB8888.SHF	沪铂指数	84080	-0.80	963	64971	-0.67	748	81815	-0.77	-326	63406	-1.76	-856		
LC8888.CFE	碳酸锂指数	498084	2.13	23932	364683	-0.01	14074	697493	2.08	32076	583670	2.08	26920		
SI8888.CFE	工业硅指数	250288	-7.34	-7015	183429	-7.51	-8066	321970	-5.13	-2009	228208	-4.75	-3532		
PS8888.CFE	多晶硅指数	151090	2.47	6007	119252	0.26	250	137170	3.69	6687	106558	4.19	5165		
RB8888.SHF	螺纹钢指数	1493341	0.61	11774	1105332	0.70	17103	1522845	1.91	29771	1132271	0.48	5428		
I8888.DCE	铁矿石指数	560528	1.79	9881	408401	1.77	7115	570513	0.04	478	406812	-0.79	-2858		
J8888.DCE	焦炭指数	22522	-4.85	-1093	16083	-5.80	-856	28106	-2.11	-539	20188	-1.99	-394		
JW8888.DCE	焦煤指数	506977	-2.54	-11789	372882	-4.04	-15705	549362	0.04	-3106	407915	1.73	3607		
HC8888.SHF	热卷指数	1279625	1.97	14284	962383	1.98	18931	1323183	1.05	26301	1034882	2.71	29579		
SP8888.CZC	硅铁指数	234626	-2.01	-4406	166432	-4.70	-7548	276177	1.47	5495	215561	0.69	1494		
SM8888.CZC	锰硅指数	342217	-1.84	-4531	245681	-2.22	-5582	407995	-1.92	-7723	325255	-1.45	-4772		
SS8888.SHF	不锈钢指数	93839	-5.92	-4174	72446	-5.39	-4060	114066	-3.77	-3086	92498	-3.81	-2048		
SA8888.CZC	纯碱指数	899603	-3.26	-28496	567674	-5.20	-28948	1157929	-0.29	-471	876652	0.38	3297		
FG8888.CZC	玻璃指数	1153193	7.38	79454	768774	7.48	53524	1448921	10.99	164399	1109458	11.40	126578		
SR8888.CZC	烧碱指数	149788	9.83	14864	102768	2.81	4971	180517	19.82	29854	139071	20.14	26148		
FU8888.SHF	燃油指数	249834	-5.42	-12002	183224	-4.05	-7046	279127	-0.71	-1150	189364	-1.13	-1155		
LJ8888.SHF	低硫燃油指数	68807	-5.30	-2766	53613	-5.49	-2759	64768	-8.66	-5876	49725	-10.28	-3352		
PG8888.DCE	LPG指数	133247	14.13	5491	108822	16.38	3931	134229	17.92	3671	113225	16.95	1784		
TA8888.CZC	PTA指数	916310	1.67	16087	698695	3.03	25114	999511	-0.31	-3061	779874	-1.90	-9550		
V8888.DCE	PVC指数	842689	-1.11	-9228	548574	-0.47	4139	936090	-2.49	-23954	715375	-2.86	-21286		
PP8888.DCE	聚丙烯指数	536683	4.42	9049	394991	4.90	10984	611379	3.15	7217	497165	2.44	6674		
PX8888.CZC	对二甲苯指数	183395	0.21	1622	136268	1.61	2162	204591	0.77	3465	160221	1.55	2444		
EB8888.DCE	苯乙烯指数	426591	2.57	16828	338068	2.33	10933	455457	2.36	10539	354816	2.63	11889		
PF8888.CZC	短纤指数	216890	-1.80	-3761	158248	-2.31	-949	221256	-1.86	-1448	151026	-1.67	-2559		
EC8888.DCE	乙二醇指数	206463	3.92	7026	145147	2.79	5553	256802	1.26	3011	207249	1.99	4040		
L8888.DCE	塑料指数	371216	0.18	3834	266493	0.01	24	456328	0.75	3426	357264	0.50	1778		
MA8888.CZC	甲醇指数	1008956	8.83	64606	727810	4.54	31577	1262848	8.44	98242	1036688	9.17	87102		
B0888.SHF	沥青指数	204232	-0.09	181	155454	-0.82	-661	214252	-0.11	921	151716	0.92	2757		
UR8888.CZC	尿素指数	187286	-1.07	-2034	120404	-0.21	-259	218720	-2.33	-4819	157265	-1.93	-1594		
RU8888.SHF	橡胶指数	101215	-3.51	-3466	73235	-5.73	-4352	132628	0.18	2490	103262	1.41	1437		
NR8888.SHF	20号胶指数	56565	-0.18	-191	42494	-2.17	-311	69680	0.31	453	54052	0.48	254		
BR8888.SHF	合成橡胶指数	50739	-1.47	-502	36747	-1.10	-211	68553	-6.11	-3915	57770	-5.68	-2878		
CF8888.CZC	棉花指数	579436	-0.38	-1880	424790	-0.08	-336	698465	0.43	3022	524245	0.85	4415		
CY8888.CZC	棉纱指数	22897	-0.03	154	18641	-1.26	-97	22978	-0.47	-82	18612	-1.75	-149		
SR8888.CZC	白糖指数	349512	-1.55	-5356	258998	-0.07	-169	406374	-2.54	-10607	313328	-2.61	-8294		
SP8888.SHF	纸浆指数	179046	-1.38	-495	134770	-0.25	545	211332	-3.59	-4693	155535	-2.77	-3501		
A8888.DCE	豆一指数	218760	0.34	1408	172671	1.37	2328	212492	-1.61	-3288	163546	-1.24	-2052		
M8888.CZC	豆粕指数	2235077	-0.51	7132	1673280	-1.40	-8238	2865767	0.11	3309	2352044	-0.75	-7768		
RM8888.CZC	菜粕指数	368270	0.58	2464	262899	1.49	4500	469988	-1.90	-9099	359671	-2.90	-10738		
Y8888.DCE	豆油指数	481020	-2.55	-8895	364619	-3.72	-10725	632126	-1.86	-11981	536969	-2.65	-14612		
O8888.CZC	菜油指数	277152	-2.37	-6714	187010	-2.89	-5480	272749	-2.72	-7635	196790	-2.33	-4699		
P8888.DCE	棕榈油指数	295724	-0.06	1794	216943	0.30	2712	315846	2.56	6288	240472	2.55	5971		
C8888.DCE	玉米指数	1275213	1.64	22073	959157	1.71	16122	1370037	2.10	26320	1107697	1.90	23258		
CS8888.DCE	玉米淀粉指数	153884	1.75	3812	111764	2.33	2986	210239	-0.80	104	166908	-0.64	-1519		
FK8888.CZC	花生指数	164899	-2.09	-3115	105840	-2.34	-2534	193458	-0.56	-26	134485	0.94	2939		
CJ8888.CZC	红枣指数	162415	4.06	6589	107771	6.22	7077	167166	2.45	4005	108987	1.33	2095		
AF8888.CZC	苹果指数	112275	8.82	9726	80948	12.43	9567	102717	8.66	8575	67974	11.29	7700		
JD8888.DCE	鸡蛋指数	329912	-0.90	-2783	242917	-1.70	-2858	332610	-3.62	-4811	243848	-1.83	-3809		
LH2601.DCE	生漆2601	73859	13.85	9613	50325	15.10	7069	80117	15.28	10864	55174	15.27	7711		
PR8888.CZC	瓶片指数	51838	0.78	403	38872	2.35	912	50370	-0.80	-408	39012	-0.46	-179		

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 -----