

CFTC 大額交易人持倉報告

永豐期貨顧問事業部編製

2021/1/18

資料來源：CFTC官網、精誠資訊DQII

永豐期貨股份有限公司 | 台北市重慶南路一段2號8樓 | 02-2381-1799 | 109年金管期總字第008號 | 顧問事業部
本報告純屬研究性質，僅供永豐金控同仁及客戶參考，不提供或嘗試遊說客戶作為交易期權之依據，客戶於決策時應依個人財務狀況審慎評估所能承擔之風險，並就投資結果自行負責，本公司恕不負任何法律責任，亦不作任何保證。本報告內容或有取材於本公司認可之來源，但不保證其真實性或完整性，相關圖表均採用特定軟體，以歷史數據進行繪製及統計，並不具預測未來之能力與代表未來獲利，客戶參考使用前須審慎評估。報告內容中所有資訊有其時效性，爾後若有變更，本公司將不作預告或主動更新。未經本公司授權，禁止以任何形式複製、轉載或節錄。

目錄

- P3 報告閱讀說明
- P4 大額交易人身分分類
- P5 金融類投機部位每週變動表
- P6 商品類投機部位每週變動表

金融類

- P7 mini 道瓊
- P8 mini NQ
- P9 mini S&P
- P10 VIX
- P11 30年債
- P12 10年債
- P13 5年債
- P14 2年債
- P15 歐元
- P16 日圓
- P17 英鎊
- P18 瑞郎
- P19 加幣
- P20 澳幣
- P21 紐幣
- P22 美元指數
- P23 綜美(未含)
- P24 綜美(包含)

商品類

- P25 黃金
- P26 白銀
- P27 銅
- P28 白金
- P29 輕原油
- P30 熱燃油
- P31 天然氣
- P32 無鉛汽油
- P33 活牛
- P34 活豬
- P35 玉米
- P36 小麥
- P37 黃豆
- P38 黃豆油
- P39 黃豆粉
- P40 粗米
- P41 咖啡
- P42 可可
- P43 11號糖
- P44 棉花

CFTC大額交易人持倉報告閱讀說明

在美國負責主管期貨交易的是商品期貨交易委員會，
(Commodity Futures Trading Commission，簡稱CFTC)
CFTC在每週五美國東部時間下午03:30，
台灣時間週六上午03:30(冬令延後1小時)，
於官網上發佈統計至每週二收盤，
在美國上市交易的期貨商品未平倉部位現況。

每個期貨商品未平倉部位由需申報與不需申報兩部分組成，
持有部位則分為多單、空單、扣抵部位等三種類別，
(不需申報的部份本報告不予呈現)
(1口扣抵部位表示各持有1口多單與空單)
(本報告將扣抵部位還原至多單與空單)

在2009/9/4與2010/7/20，CFTC為增加市場交易透明度，
分別將商品類與金融類須申報的期貨交易人身分細分成四大類，
以下將簡單說明：

大額交易人身分類別說明

金融類

Dealer / Intermediary (經紀商 / 中間商)

被歸類為市場的賣方，設計並且販售各種金融商品給客戶或發行於市場；藉由期貨合約來降低手中持有部位的風險，如大型投資銀行與證券經紀商。

Asset Manager / Institutional (資產管理人 / 資產管理機構)

這一類的市場參與者為機構投資人者，包括退休基金、養老基金、保險公司、共同基金，以及客戶為法人機構的基金經理人

Leveraged Money (槓桿式基金)

以避險基金與各類型基金經理人為代表，如有登記的CTA(商品交易投資顧問)、CPO(期貨基金經理人)，與未登記但經CFTC認可的私募基金。

Other Reportables (其他)

需申報但不屬於上面三項的交易人。

商品類

Producer / Merchant / Processor / User (生產商 / 貿易商 / 加工商 / 用戶)

從事實體商品生產、加工、包裝或運輸的相關交易人，包括生產商、製造商、貿易商、加工商等使用者，利用期貨市場來規避或管理營運風險。

Swap Dealers (掉期交易商)

從事OTC市場交易的互換交易商，會利用期貨來管理或規避交換交易時所產生的風險。

Managed Money (管理基金)

主要是替客戶或自身進行買賣交易以獲取營利的管理基金，如有登記的CTA(商品交易投資顧問)、CPO(期貨基金經理人)，與未登記但經CFTC認可的私募基金。

Other Reportables (其他)

需申報但不屬於上面三項的交易人。

金融類投機部位每週變動表

數據日期 2021/01/12

種類	商品	總OI		槓桿基金		
		總OI	變動	多空淨部位	淨部位變動	佔總OI%
指數	YM	84513	+3072	-2011	+1288	-2.38%
	ES	3106913	+94405	-172071	-4380	-5.54%
	NQ	256159	+15375	-66809	-13263	-26.08%
	VX	325153	+28327	-99369	+1618	-30.56%
債券	10年債	4425411	+637403	-14791	+199530	-0.33%
	2年債	1977161	+46694	-461717	+18067	-23.35%
	5年債	3435792	+111710	-822870	+43998	-23.95%
	30年債	1331360	+65891	-389601	+916	-29.26%
外匯	瑞郎	51573	+212	+10949	+2249	+21.23%
	澳幣	154750	-7654	+23879	+10315	+15.43%
	日圓	200608	-18734	+12021	-2601	+5.99%
	紐幣	44767	-2488	+2364	+4350	+5.28%
	英鎊	171453	+3761	+8133	+4244	+4.74%
	歐元	721744	-7372	+16778	+6510	+2.32%
	加幣	165967	-3044	-2353	-1171	-1.42%
	綜美(未含)	1099925	-15523	-29409	-9428	-2.67%
	綜美(含美)	1134845	-18265	-33056	-12939	-2.91%
	美元	34920	-2742	-3647	-3512	-10.44%

金融類投機部位每週變動表

數據日期 2021/01/12

種類	商品	總OI		管理基金		
		總OI	變動	多空淨部位	淨部位變動	佔總OI%
金屬	白金	60573	-1130	+20058	-525	+33.11%
	銅	258126	-4649	+76449	-4319	+29.62%
	白銀	198448	-9205	+43395	-4238	+21.87%
	黃金	754574	-55665	+105270	-46859	+13.95%
能源	無鉛汽油	410349	-7051	+79809	+6904	+19.45%
	輕原油	2755072	+122490	+350144	+18489	+12.71%
	天然氣	1139047	-34475	+76280	+31387	+6.70%
	熱燃油	376249	-278	+3135	-1252	+0.83%
肉類	活豬	245388	+3674	+38742	+1664	+15.79%
	活牛	359752	+16012	+42827	-3160	+11.90%
農產	黃豆粉	499855	+13121	+84408	-187	+16.89%
	黃豆油	568408	-3163	+93536	-19382	+16.46%
	粗米	9818	+181	+1537	+230	+15.65%
	玉米	2580675	+201473	+374714	+24826	+14.52%
	黃豆	1342333	+59686	+166485	-9342	+12.40%
	小麥	538192	+15758	+16987	-8224	+3.16%
軟性	棉花	288080	+12062	+69702	-1010	+24.20%
	11號糖	1278094	-931	+219831	-9790	+17.20%
	可可	250130	-4065	+26284	-862	+10.51%
	咖啡	305452	-5459	+16097	-5960	+5.27%

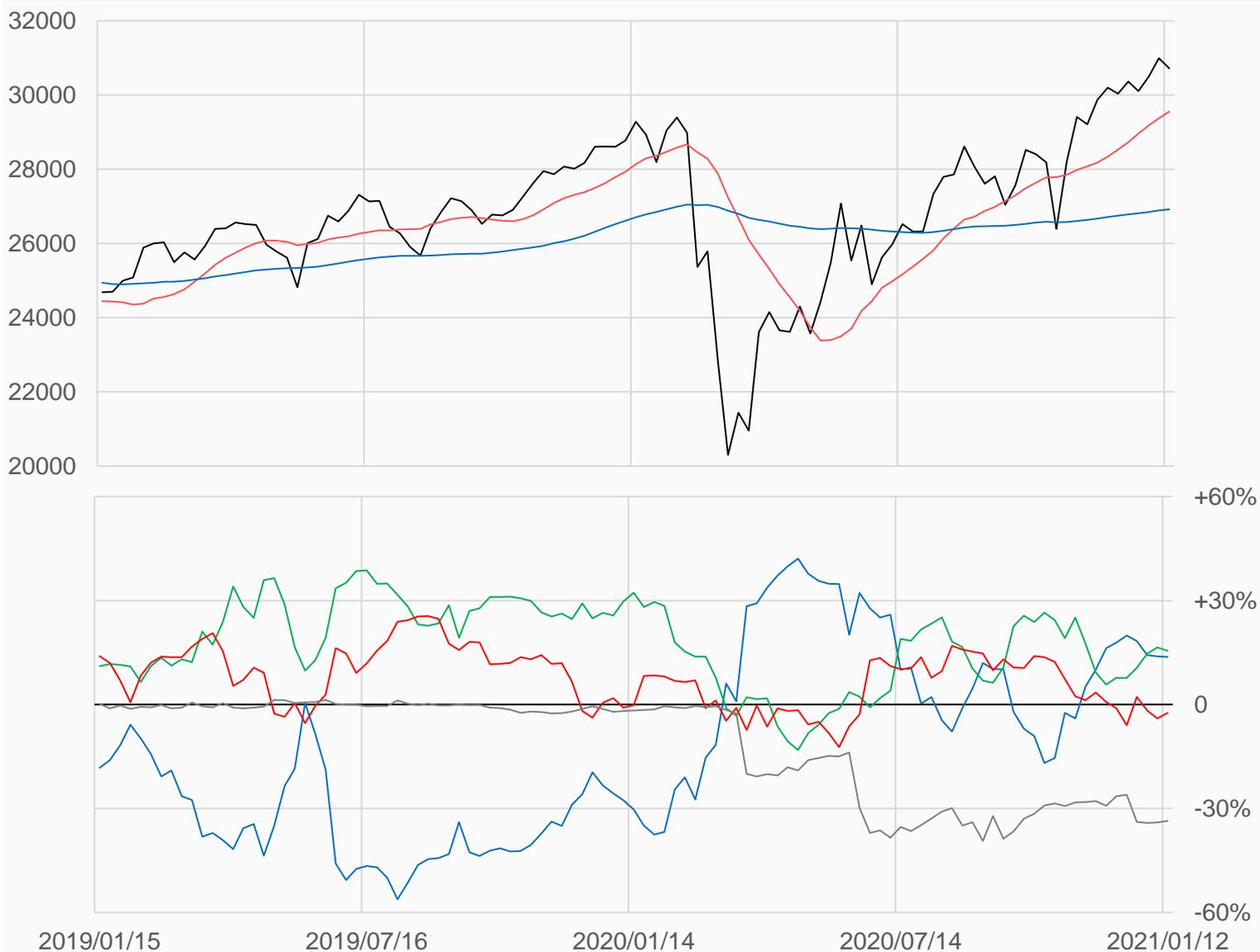
mini 道瓊

mini道瓊較前一週下跌273點收在30720點，
 槓桿基金多單增加1929口，空單增加641口，
 淨空單較前一週減少39.04%或1288口至2011口。

數據日期	前期OI	本期OI	增減	增減	週五收盤價	較前週變動
2021/01/12	81441	84513	+3072	+3.77%	30720	↓ -273
分類	多單OI	增減	空單OI	增減	多空淨部位	淨部位變動
經紀商	32881	+431	21287	+180	+11594	+251
資產管理	16317	-320	3245	+27	+13072	-347
槓桿基金	16688	+1929	18699	+641	-2011	+1288
其他	375	0	28777	+657	-28402	-657

週五收盤價與13週與52週平均線

— YM — 13週 29554 — 52週 26916



淨部位佔總OI% 經紀 +13.7% 資管 +15.5% 槓桿 -2.4% 其他 -33.6%

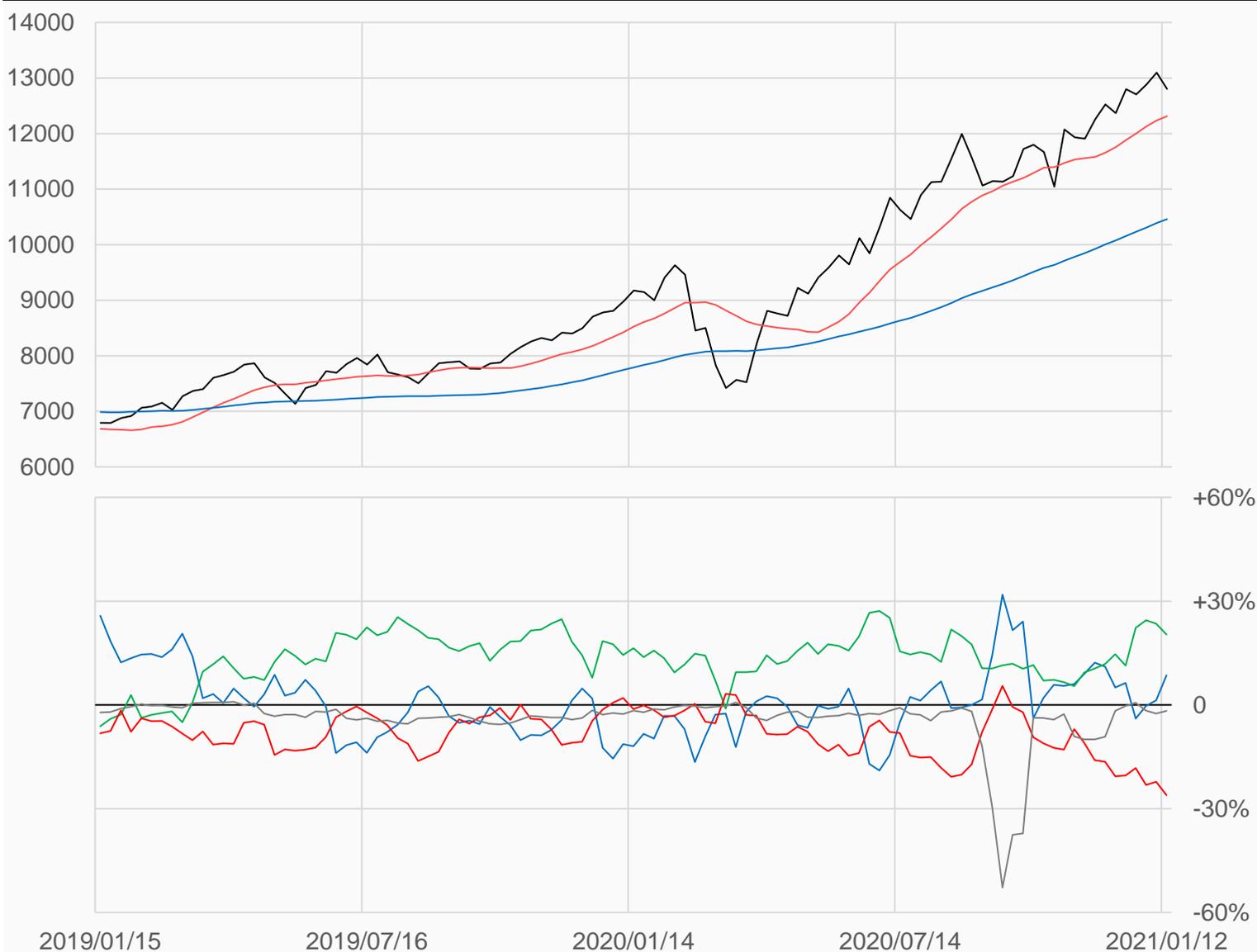
mini NQ

miniNQ較前一週下跌295點收在12802.25點，
槓桿基金多單增加4776口，空單增加18039口，
淨空單較前一週增加13263口至66809口。

數據日期	前期OI	本期OI	增減	增減	週五收盤價	較前週變動
2021/01/12	240784	256159	+15375	+6.39%	12802.25	↓ -295.00
分類	多單OI	增減	空單OI	增減	多空淨部位	淨部位變動
經紀商	55189	+10250	33337	-8411	+21852	+18661
資產管理	83293	-490	31097	+3824	+52196	-4314
槓桿基金	71224	+4776	138033	+18039	-66809	-13263
其他	9549	+640	13950	-1027	-4401	+1667

週五收盤價與13週與52週平均線

— NQ — 13週 12313 — 52週 10459



淨部位佔總OI% 經紀 **+8.5%** 資管 **+20.4%** 槓桿 **-26.1%** 其他 **-1.7%**

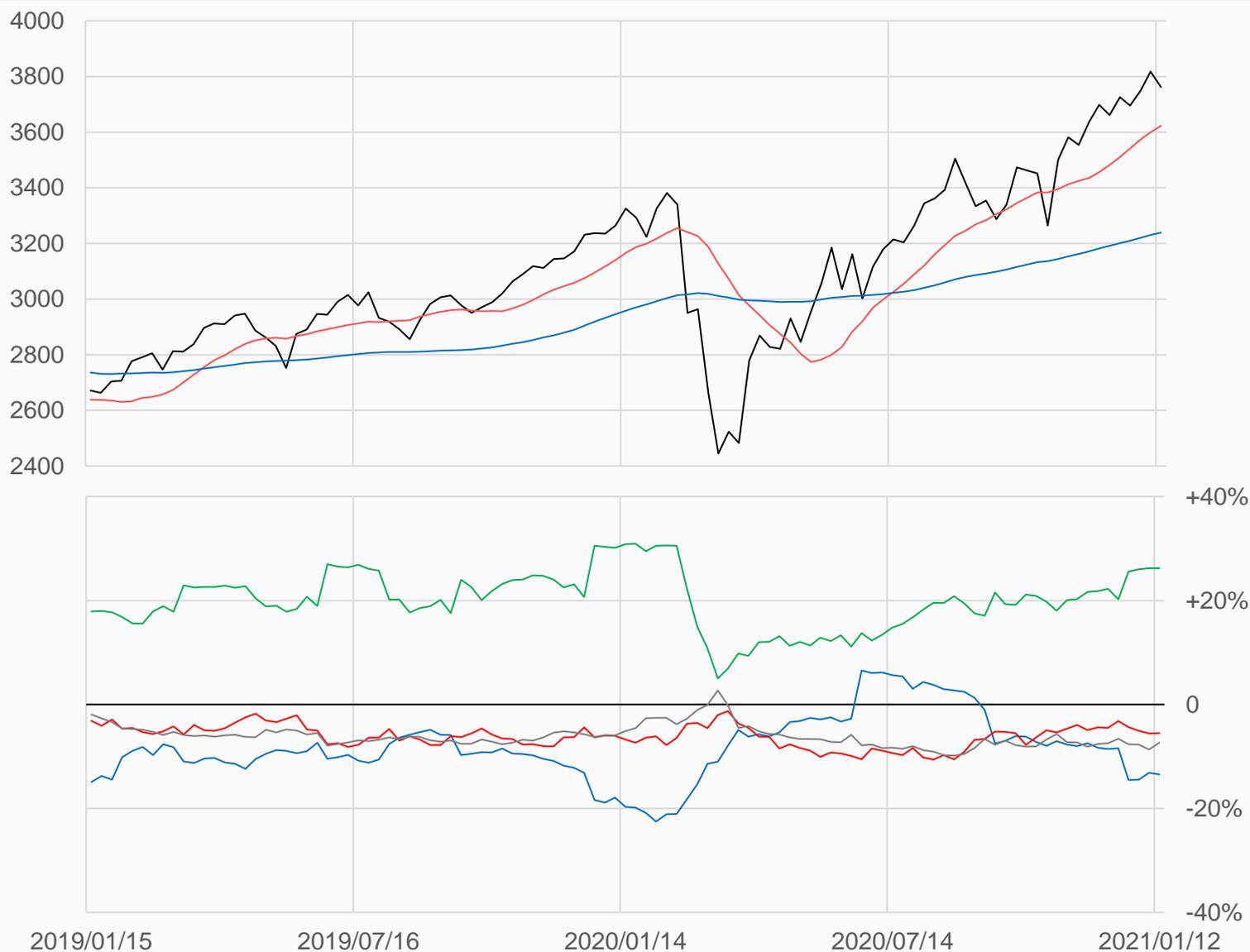
mini S&P

miniS&P較前一週下跌55.25點收在3762.25點，
 槓桿基金多單增加68074口，空單增加72453口，
 淨空單較前一週增加4379口至172071口。

數據日期	前期OI	本期OI	增減	增減	週五收盤價	較前週變動
2021/01/12	3012508	3106913	+94405	+3.13%	3762.25	↓ -55.25
分類	多單OI	增減	空單OI	增減	多空淨部位	淨部位變動
經紀商	397827	+22199	814988	+43926	-417161	-21727
資產管理	1611284	+4001	796946	-21031	+814338	+25032
槓桿基金	673288	+68074	845359	+72453	-172071	-4379
其他	128372	+3041	357174	-28699	-228802	+31740

週五收盤價與13週與52週平均線

— ES — 13週 3623 — 52週 3239



淨部位佔總OI% 經紀 -13.4% 資管 +26.2% 槓桿 -5.5% 其他 -7.4%

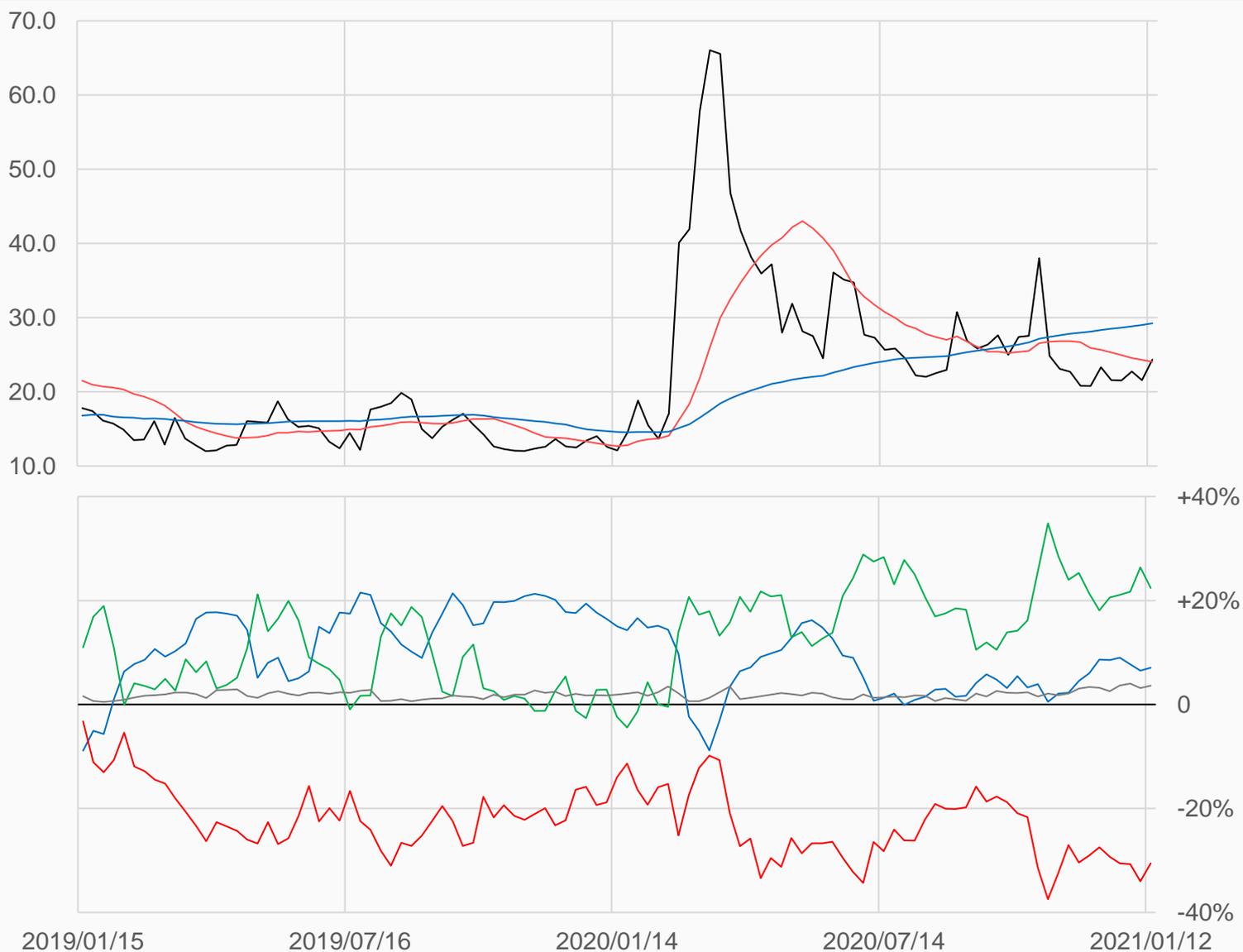
VIX

VIX較前一週上漲2.78點收在24.34點，
槓桿基金多單增加14116口，空單增加12498口，
淨空單較前一週減少1618口至99369口。

數據日期	前期OI	本期OI	增減	增減	週五收盤價	較前週變動
2021/01/12	296826	325153	+28327	+9.54%	24.34	↑ +2.78
分類	多單OI	增減	空單OI	增減	多空淨部位	淨部位變動
經紀商	50657	+2416	27663	-1157	+22994	+3573
資產管理	160608	+8844	87772	+14358	+72836	-5514
槓桿基金	74035	+14116	173404	+12498	-99369	+1618
其他	22127	+2949	10378	+663	+11749	+2286

週五收盤價與13週與52週平均線

— VX — 13週 24.07 — 52週 29.24



淨部位佔總OI% 經紀 +7.1% 資管 +22.4% 槓桿 -30.6% 其他 +3.6%

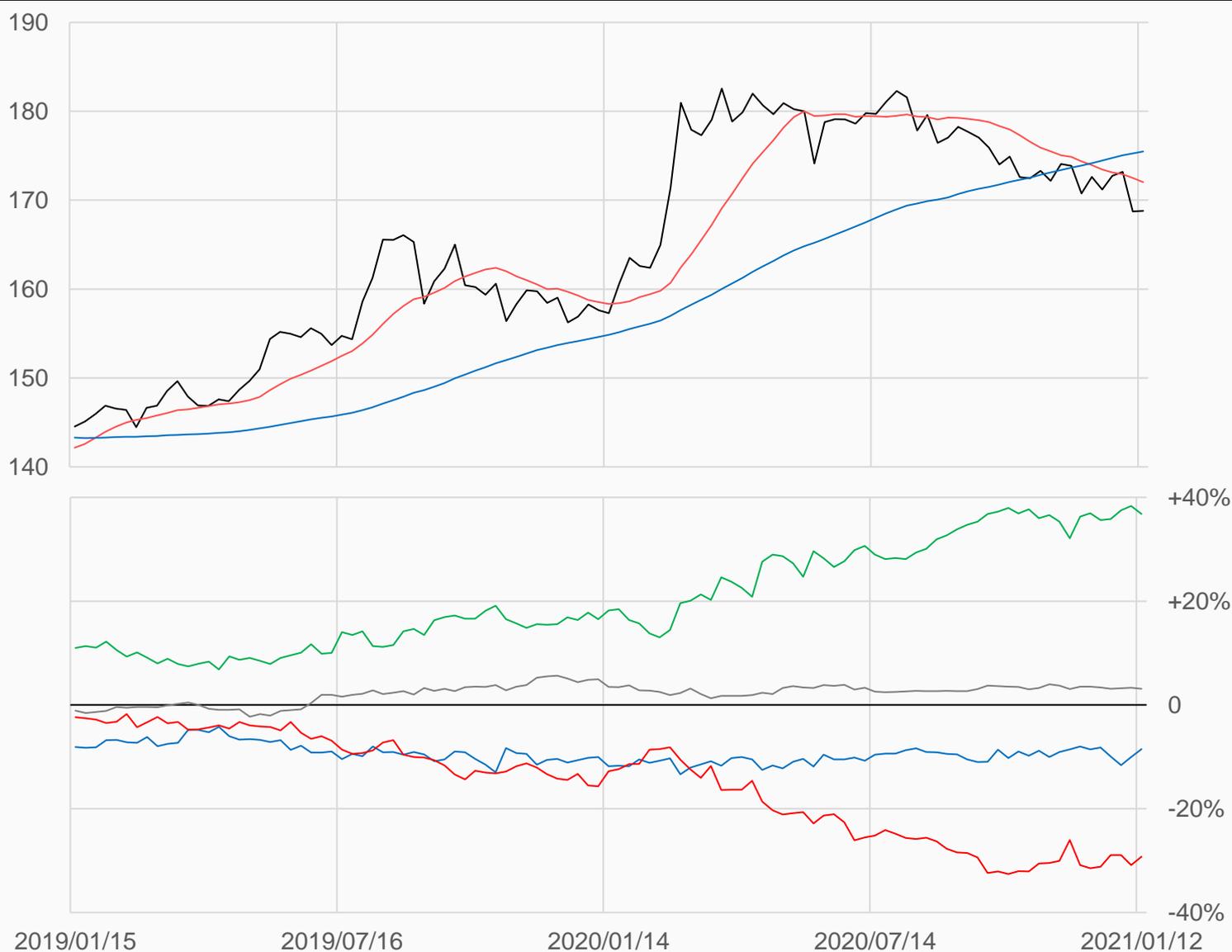
30年債

美國30年公債較前一週上漲0.0625點收在168.8125點，
槓桿基金多單增加8556口，空單增加7640口，
淨空單較前一週減少916口至389601口。

數據日期	前期OI	本期OI	增減	增減	週五收盤價	較前週變動
2021/01/12	1265469	1331360	+65891	+5.21%	168 26/32	↑ + 2/32
分類	多單OI	增減	空單OI	增減	多空淨部位	淨部位變動
經紀商	45537	+15025	158709	+1196	-113172	+13829
資產管理	881727	+26406	392217	+22042	+489510	+4364
槓桿基金	145829	+8556	535430	+7640	-389601	+916
其他	92249	+16346	50590	+16583	+41659	-237

週五收盤價與13週與52週平均線

— US — 13週 172 — 52週 175.5



淨部位佔總OI% 經紀 **-8.5%** 資管 **+36.8%** 槓桿 **-29.3%** 其他 **+3.1%**

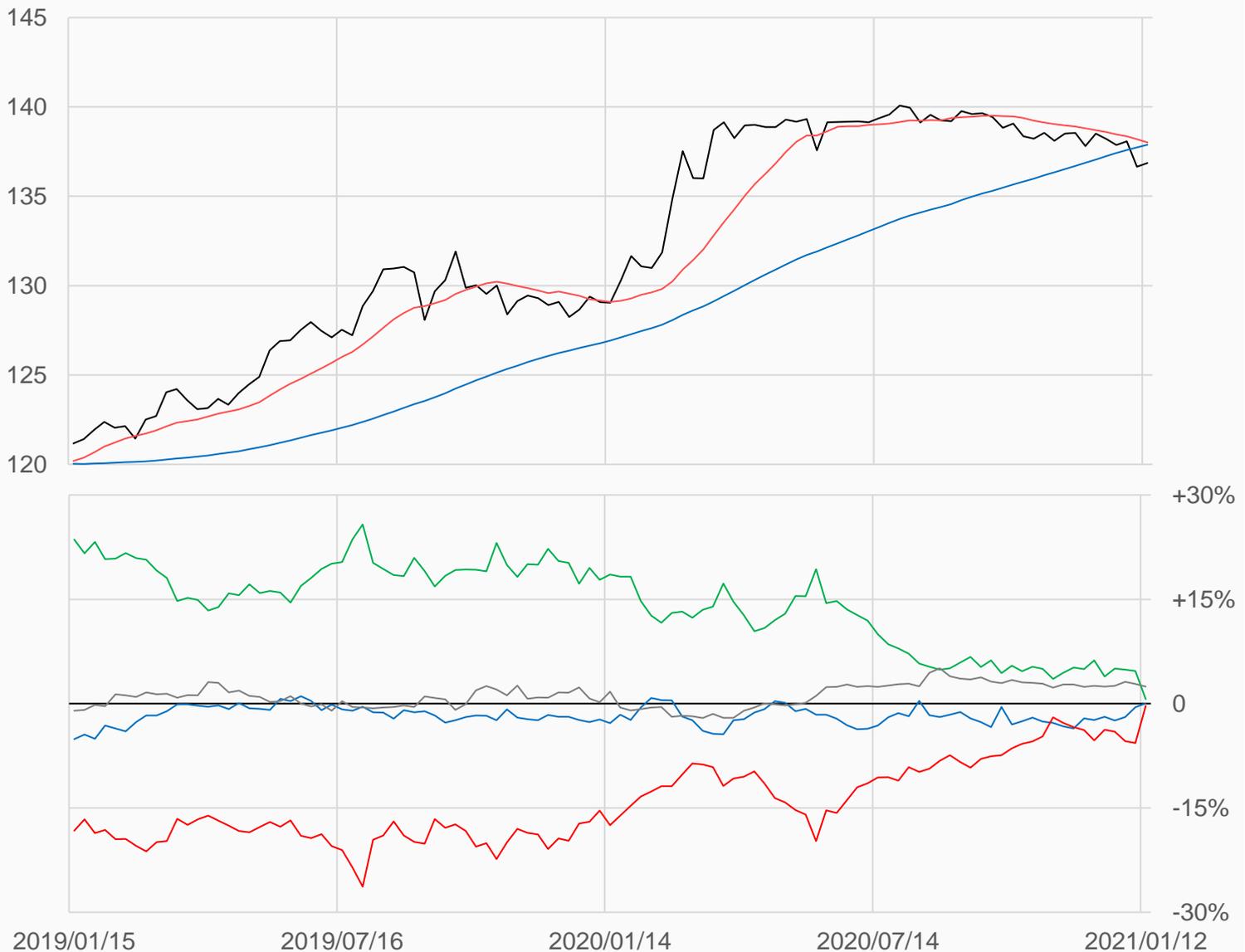
10年債

美國10年公債較前一週上漲0.2031點收在136.859375點，
槓桿基金多單增加364085口，空單增加164554口，
淨空單較前一週減少199531口至14791口。

數據日期	前期OI	本期OI	增減	增減	週五收盤價	較前週變動
2021/01/12	3788008	4425411	+637403	+16.83%	136 55/64	▲ + 13/64
分類	多單OI	增減	空單OI	增減	多空淨部位	淨部位變動
經紀商	407461	+71190	404896	+48566	+2565	+22624
資產管理	2039560	+76045	2010822	+224778	+28738	-148733
槓桿基金	1157428	+364085	1172219	+164554	-14791	+199531
其他	434469	+135721	326088	+134818	+108381	+903

週五收盤價與13週與52週平均線

— TY — 13週 138 — 52週 137.9



淨部位佔總OI% 經紀 **+0.1%** 資管 **+0.6%** 槓桿 **-0.3%** 其他 **+2.4%**

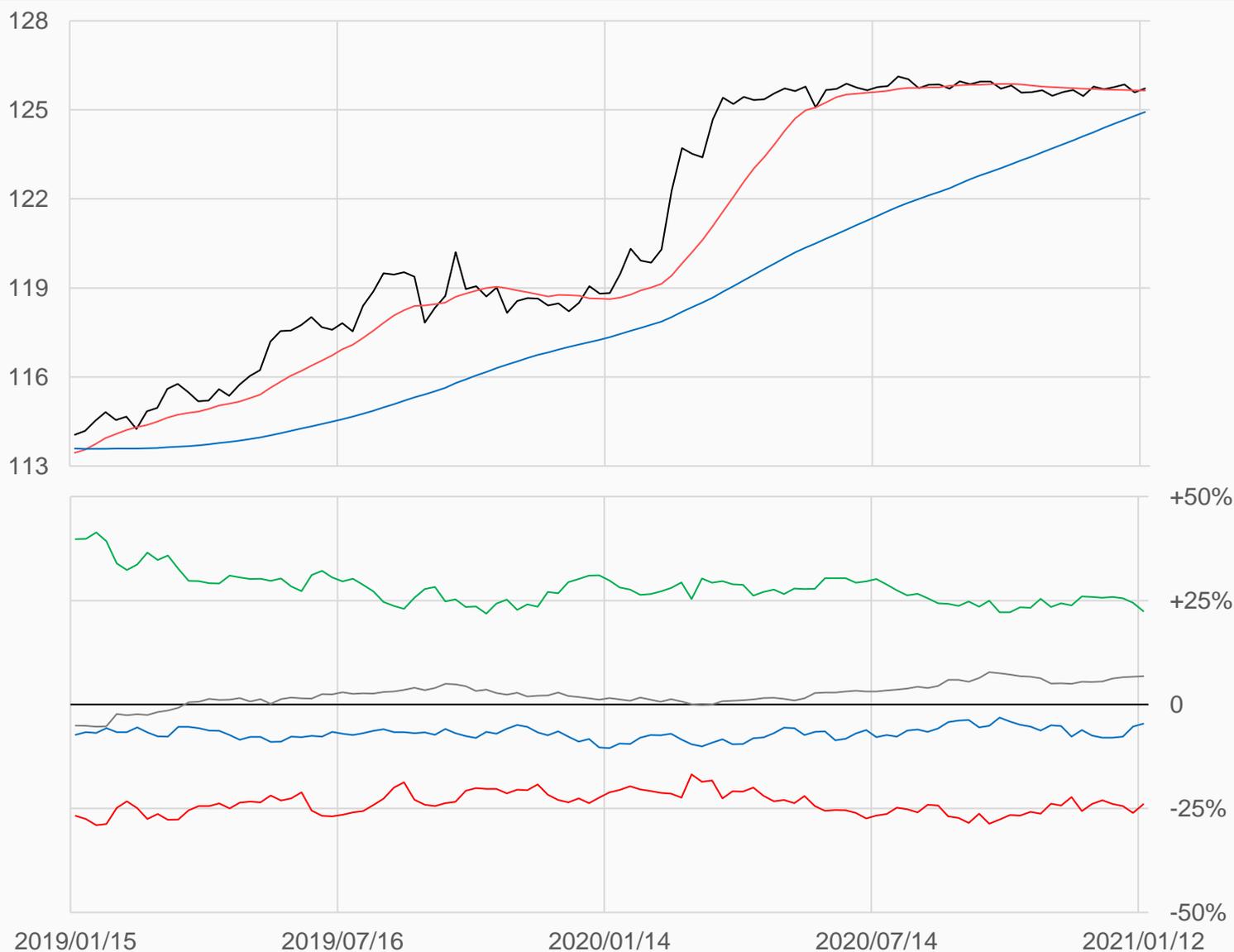
5年公債

美國5年公債較前一週上漲0.125點收在125.71875點，
槓桿基金多單增加58860口，空單增加14862口，
淨空單較前一週減少43998口至822870口。

數據日期	前期OI	本期OI	增減	增減	週五收盤價	較前週變動
2021/01/12	3324082	3435792	+111710	+3.36%	125 92/128	↑ + 16/128
分類	多單OI	增減	空單OI	增減	多空淨部位	淨部位變動
經紀商	104129	+16400	262883	-814	-158754	+17214
資產管理	1977794	+18423	1207250	+60379	+770544	-41956
槓桿基金	672361	+58860	1495231	+14862	-822870	+43998
其他	388755	+30805	154548	+18985	+234207	+11820

週五收盤價與13週與52週平均線

— FV — 13週 125.7 — 52週 124.9



淨部位佔總OI% 經紀 **-4.6%** 資管 **+22.4%** 槓桿 **-23.9%** 其他 **+6.8%**

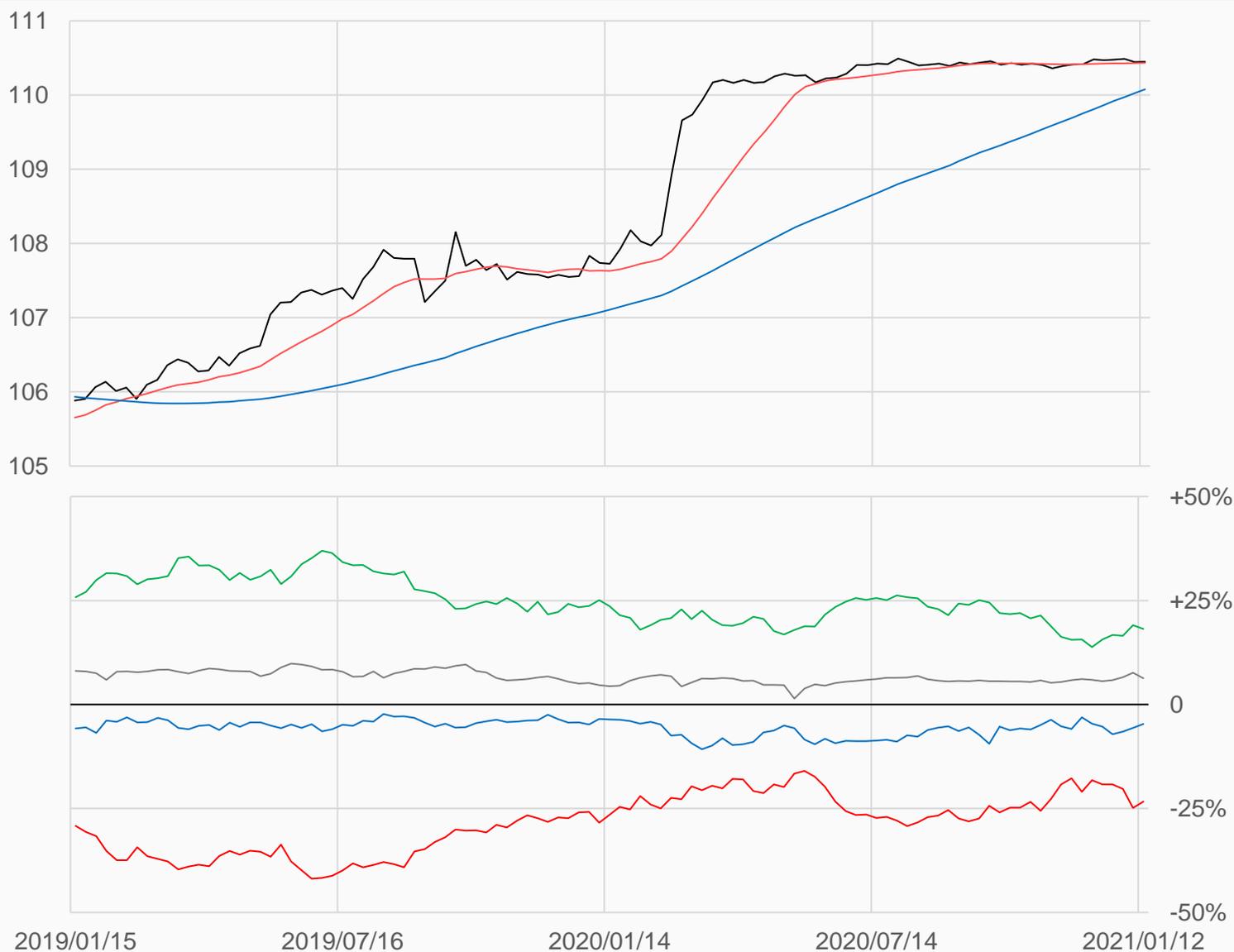
2年公債

美國2年公債較前一週上漲0.0039點收在110.44921875點，
槓桿基金多單增加31030口，空單增加12963口，
淨空單較前一週減少18067口至461717口。

數據日期	前期OI	本期OI	增減	增減	週五收盤價	較前週變動
2021/01/12	1930467	1977161	+46694	+2.42%	110 58/128	↑ + 1/128
分類	多單OI	增減	空單OI	增減	多空淨部位	淨部位變動
經紀商	55860	+12725	148575	-3563	-92715	+16288
資產管理	1149249	+8300	790326	+17106	+358923	-8806
槓桿基金	426877	+31030	888594	+12963	-461717	+18067
其他	176123	-4612	51196	+18206	+124927	-22818

週五收盤價與13週與52週平均線

— TU — 13週 110.4 — 52週 110.1



淨部位佔總OI% 經紀 **-4.7%** 資管 **+18.2%** 槓桿 **-23.4%** 其他 **+6.3%**

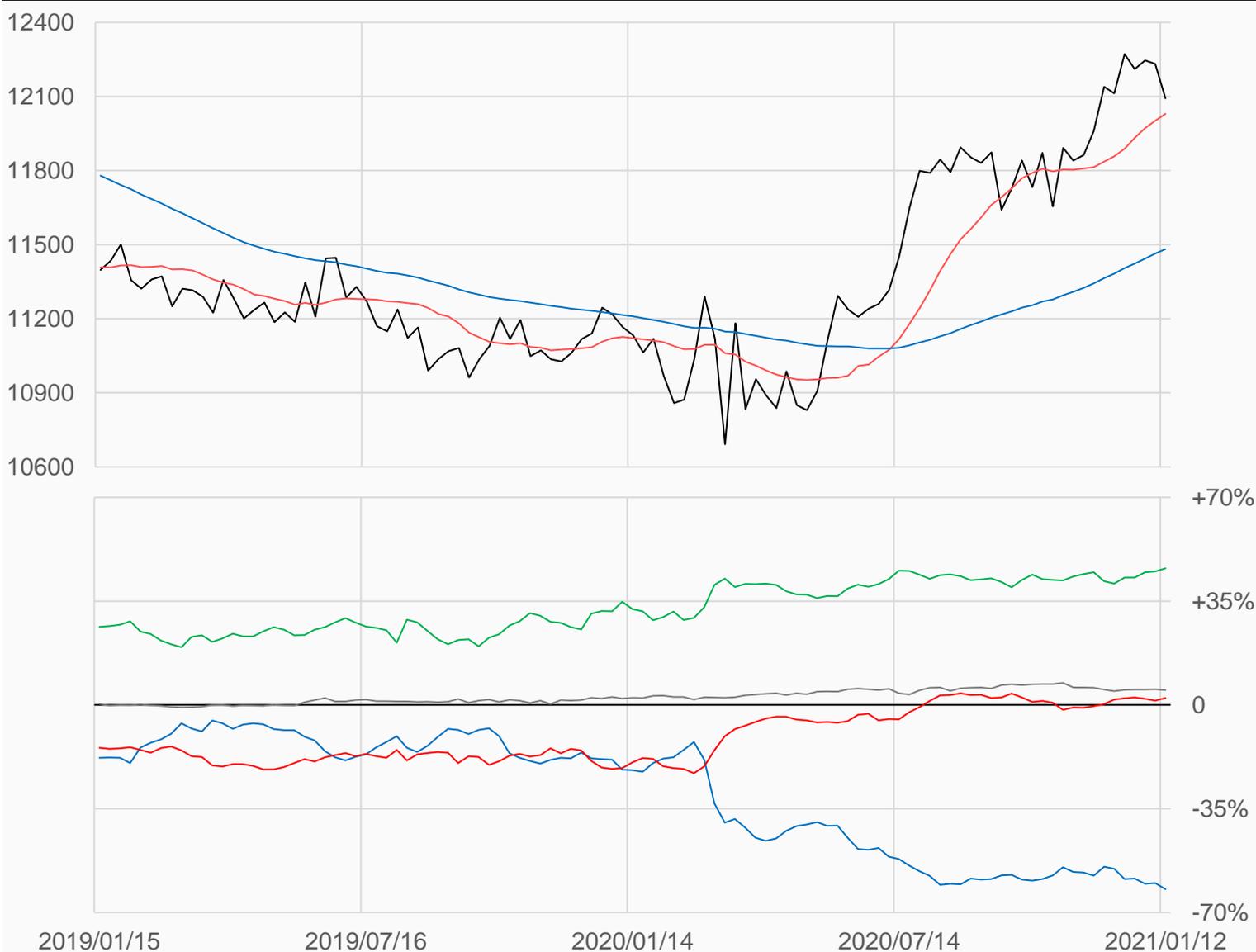
歐元

歐元較前一週下跌140點收在12092.5點，
 槓桿基金多單減少2824口，空單減少9334口，
 淨多單較前一週增加6510口至16778口。

數據日期	前期OI	本期OI	增減	增減	週五收盤價	較前週變動
2021/01/12	729116	721744	-7372	-1.01%	12092.5	↓ -140.0
分類	多單OI	增減	空單OI	增減	多空淨部位	淨部位變動
經紀商	46717	-6154	495170	+4661	-448453	-10815
資產管理	429008	+1634	96437	-2851	+332571	+4485
槓桿基金	98445	-2824	81667	-9334	+16778	+6510
其他	44290	-2960	7938	-770	+36352	-2190

週五收盤價與13週與52週平均線

— EC — 13週 12030 — 52週 11482



淨部位佔總OI% 經紀 -62.1% 資管 +46.1% 槓桿 +2.3% 其他 +5.0%

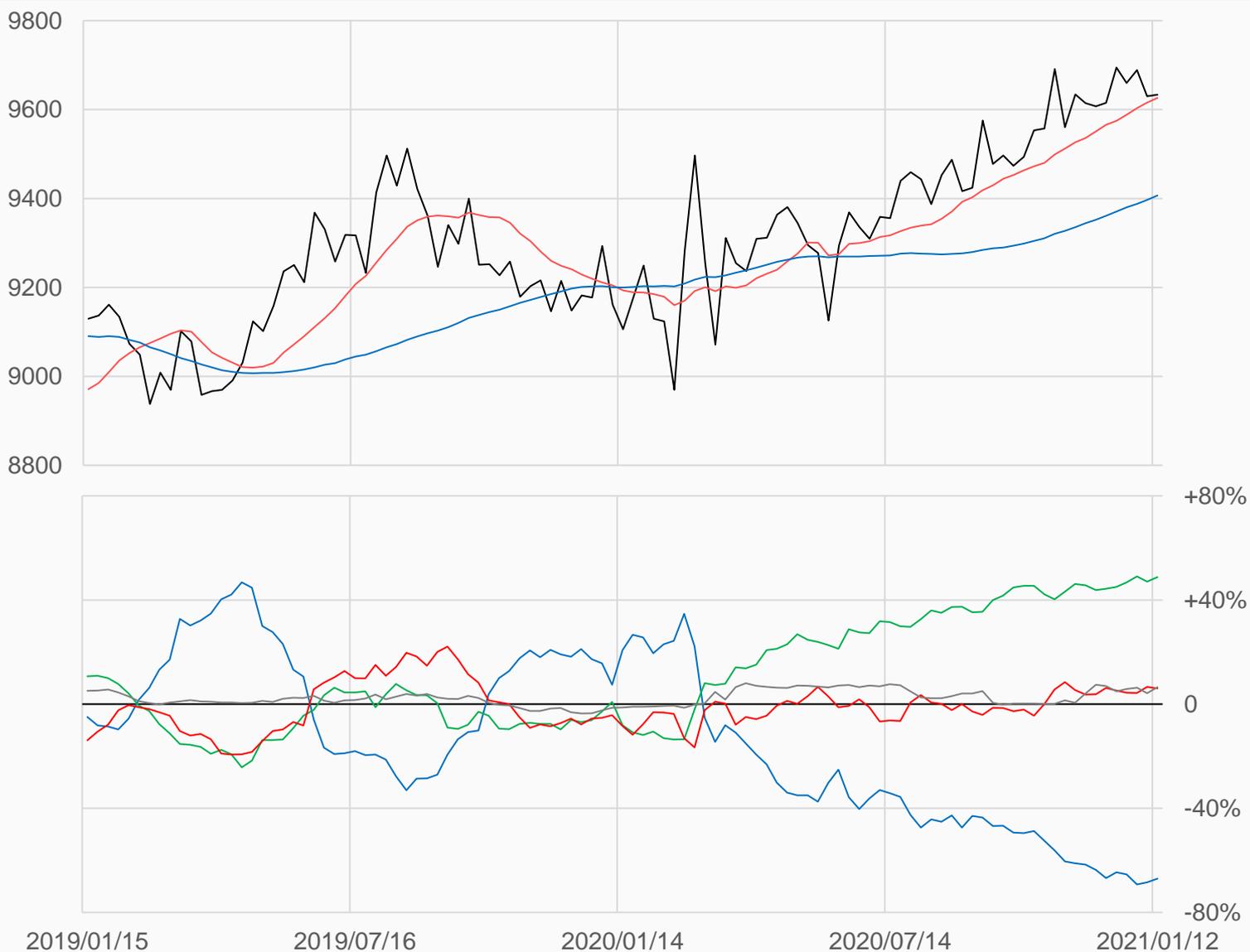
日圓

日圓較前一週上漲3.5點收在9633.5點，
 槓桿基金多單減少11250口，空單減少8649口，
 淨多單較前一週減少2601口至12021口。

數據日期	前期OI	本期OI	增減	增減	週五收盤價	較前週變動
2021/01/12	219342	200608	-18734	-8.54%	9633.5	↑ +3.5
分類	多單OI	增減	空單OI	增減	多空淨部位	淨部位變動
經紀商	6930	+683	141309	-15035	-134379	+15718
資產管理	111901	-6912	14092	-1525	+97809	-5387
槓桿基金	35275	-11250	23254	-8649	+12021	-2601
其他	14331	+4575	1219	+656	+13112	+3919

週五收盤價與13週與52週平均線

— JY — 13週 9626 — 52週 9407



淨部位佔總OI% 經紀 -67.0% 資管 +48.8% 槓桿 +6.0% 其他 +6.5%

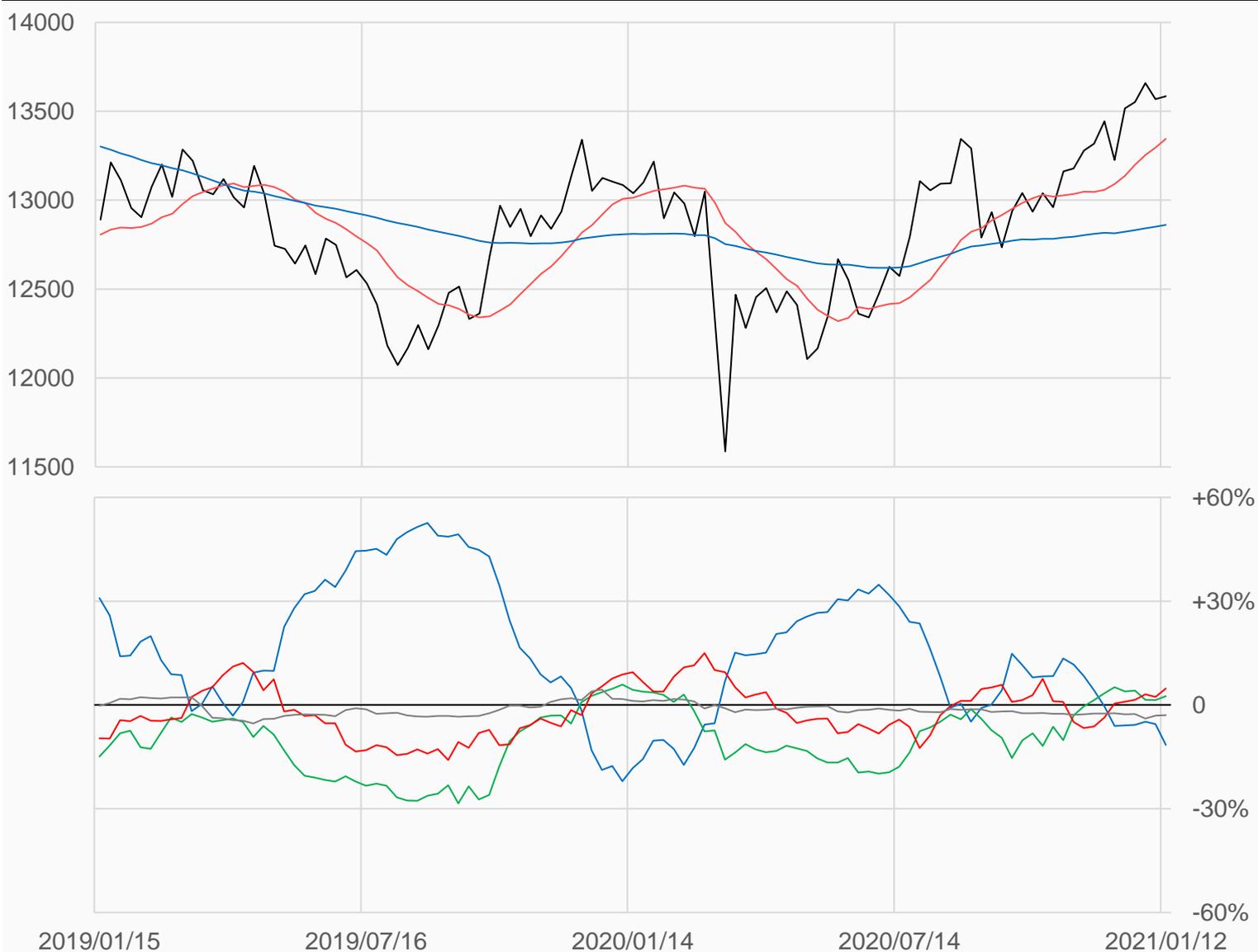
英鎊

英鎊較前一週上漲17點收在13585點，
 槓桿基金多單增加3387口，空單減少857口，
 淨多單較前一週增加4244口至8133口。

數據日期	前期OI	本期OI	增減	增減	週五收盤價	較前週變動
2021/01/12	167692	171453	+3761	+2.24%	13585	↑ +17
分類	多單OI	增減	空單OI	增減	多空淨部位	淨部位變動
經紀商	17796	-3878	37602	+6656	-19806	-10534
資產管理	60647	+1671	56253	-382	+4394	+2053
槓桿基金	51990	+3387	43857	-857	+8133	+4244
其他	3082	+748	8200	+674	-5118	+74

週五收盤價與13週與52週平均線

— BP — 13週 13345 — 52週 12862



淨部位佔總OI% 經紀 -11.6% 資管 +2.6% 槓桿 +4.7% 其他 -3.0%

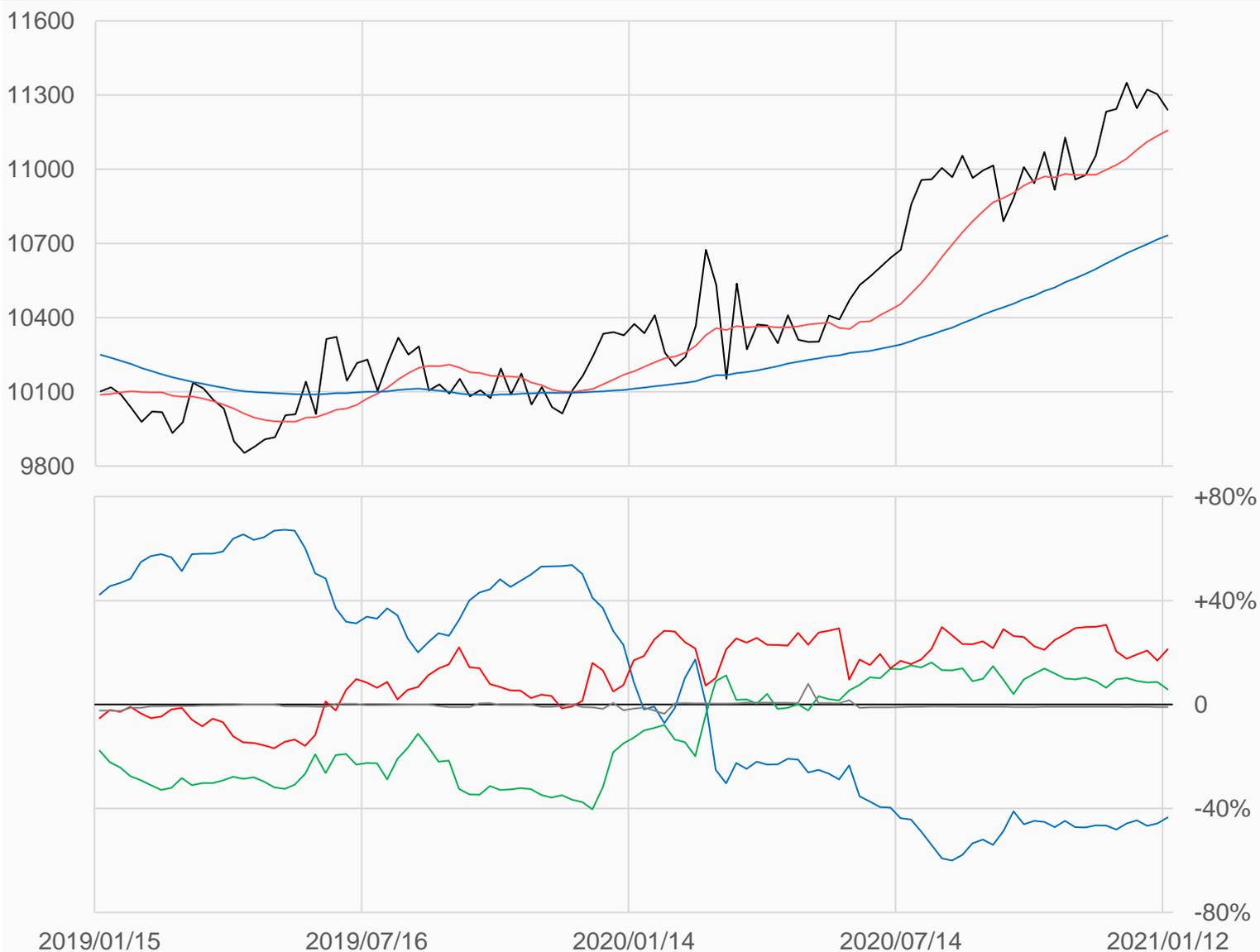
瑞郎

瑞郎較前一週下跌63點收在11240點，
 槓桿基金多單增加2618口，空單增加369口，
 淨多單較前一週增加2249口至10949口。

數據日期	前期OI	本期OI	增減	增減	週五收盤價	較前週變動
2021/01/12	51361	51573	+212	+0.41%	11240	↓ -63
分類	多單OI	增減	空單OI	增減	多空淨部位	淨部位變動
經紀商	2052	+506	24475	-606	-22423	+1112
資產管理	8944	-1400	5956	+58	+2988	-1458
槓桿基金	19193	+2618	8244	+369	+10949	+2249
其他	0	0	484	0	-484	0

週五收盤價與13週與52週平均線

— SF — 13週 11157 — 52週 10733



淨部位佔總OI% 經紀 -43.5% 資管 +5.8% 槓桿 +21.2% 其他 -0.9%

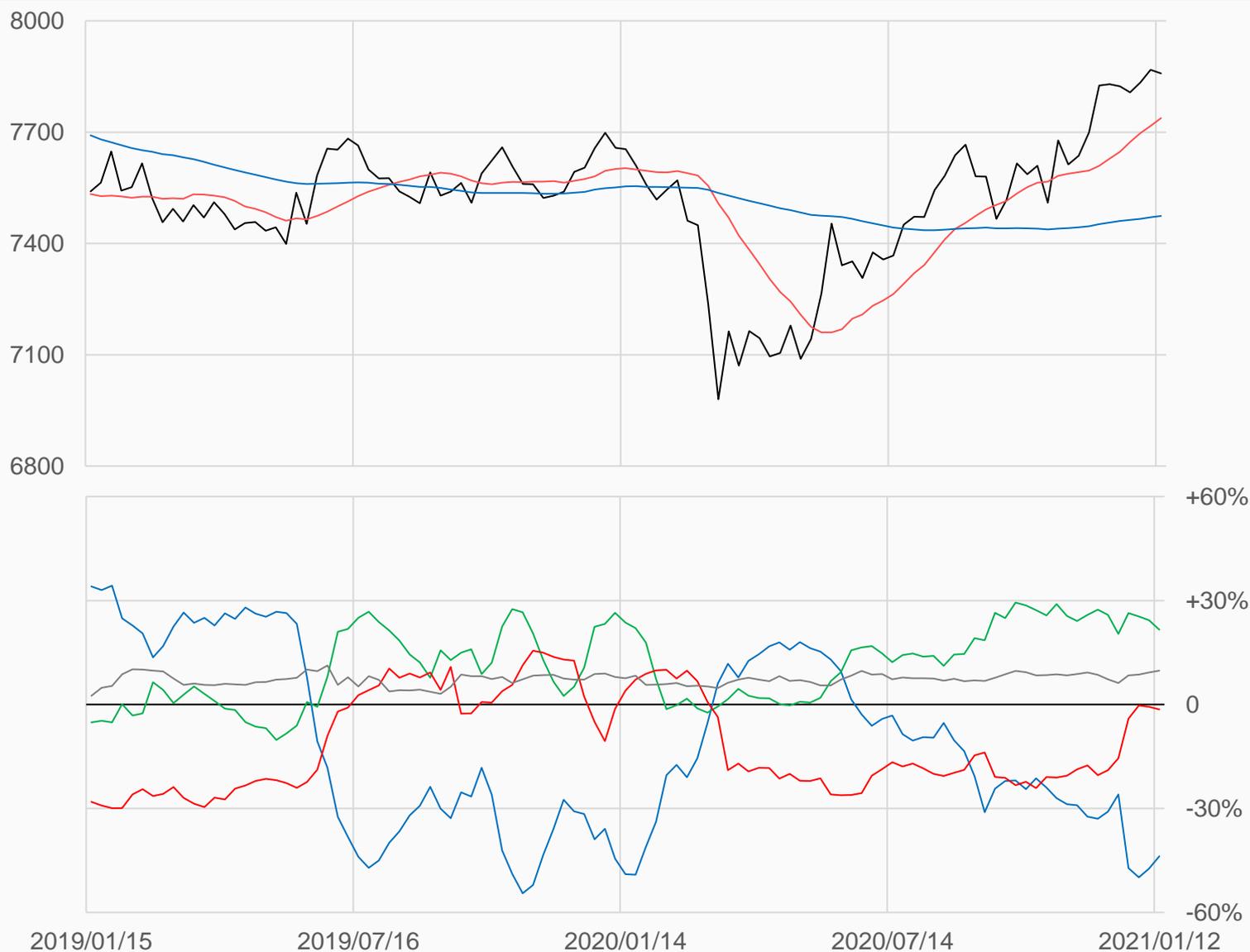
加幣

加幣較前一週下跌9.5點收在7858.5點，
 槓桿基金多單減少1570口，空單減少398口，
 淨空單較前一週增加1172口至2353口。

數據日期	前期OI	本期OI	增減	增減	週五收盤價	較前週變動
2021/01/12	169011	165967	-3044	-1.80%	7858.5	↓ -9.5
分類	多單OI	增減	空單OI	增減	多空淨部位	淨部位變動
經紀商	6112	-920	78742	-8328	-72630	+7408
資產管理	65552	-432	29698	+4890	+35854	-5322
槓桿基金	35536	-1570	37889	-398	-2353	-1172
其他	17070	+724	904	+207	+16166	+517

週五收盤價與13週與52週平均線

— CD — 13週 7738 — 52週 7474



淨部位佔總OI% 經紀 -43.8% 資管 +21.6% 槓桿 -1.4% 其他 +9.7%

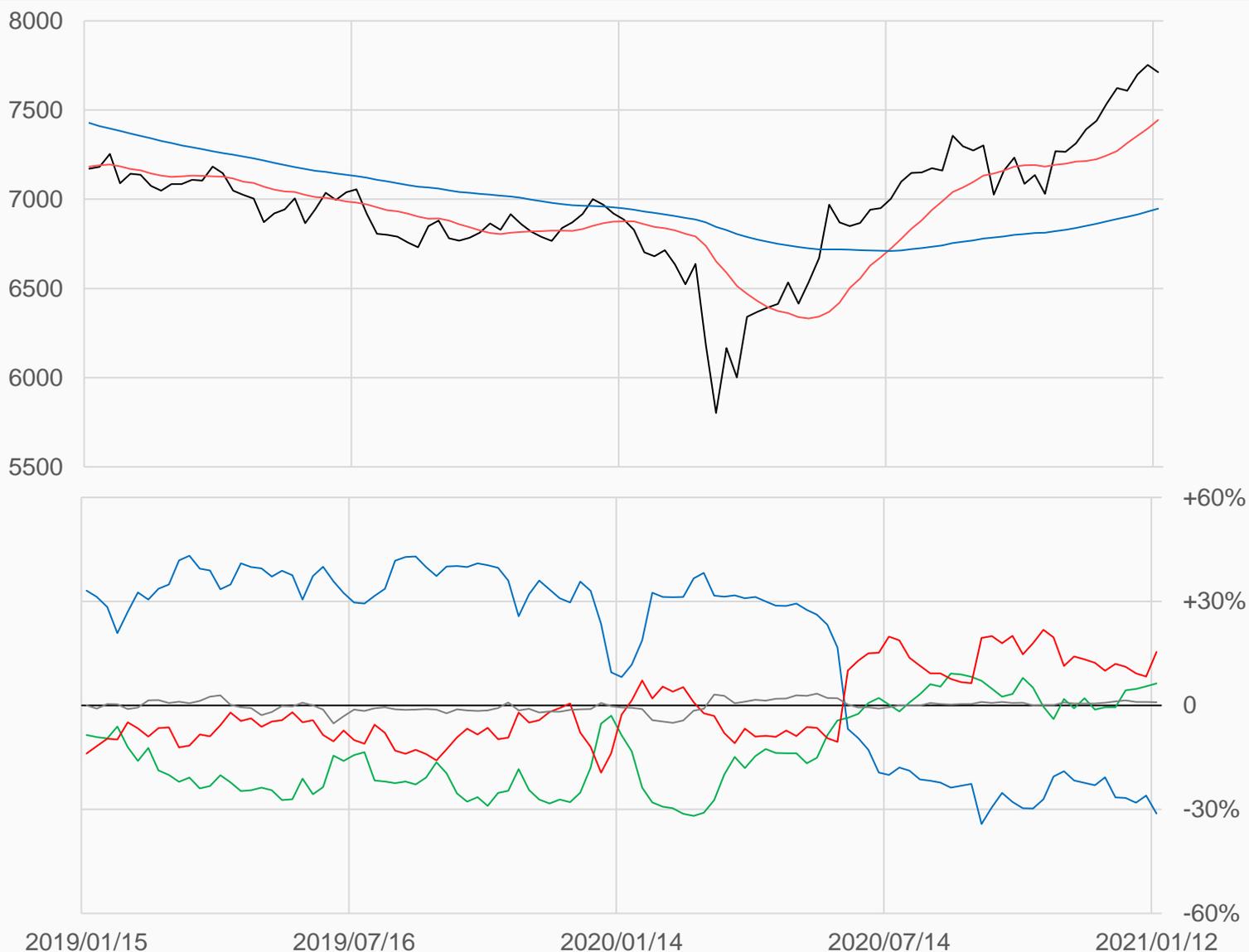
澳幣

澳幣較前一週下跌41點收在7712點，
 槓桿基金多單減少2447口，空單減少12762口，
 淨多單較前一週增加10315口至23879口。

數據日期	前期OI	本期OI	增減	增減	週五收盤價	較前週變動
2021/01/12	162404	154750	-7654	-4.71%	7712	↓ -41
分類	多單OI	增減	空單OI	增減	多空淨部位	淨部位變動
經紀商	5870	-1168	54101	+4864	-48231	-6032
資產管理	61641	-126	51795	-1004	+9846	+878
槓桿基金	52215	-2447	28336	-12762	+23879	+10315
其他	1859	-222	444	-25	+1415	-197

週五收盤價與13週與52週平均線

— AD — 13週 7444 — 52週 6947



淨部位佔總OI% 經紀 -31.2% 資管 +6.4% 槓桿 +15.4% 其他 +0.9%

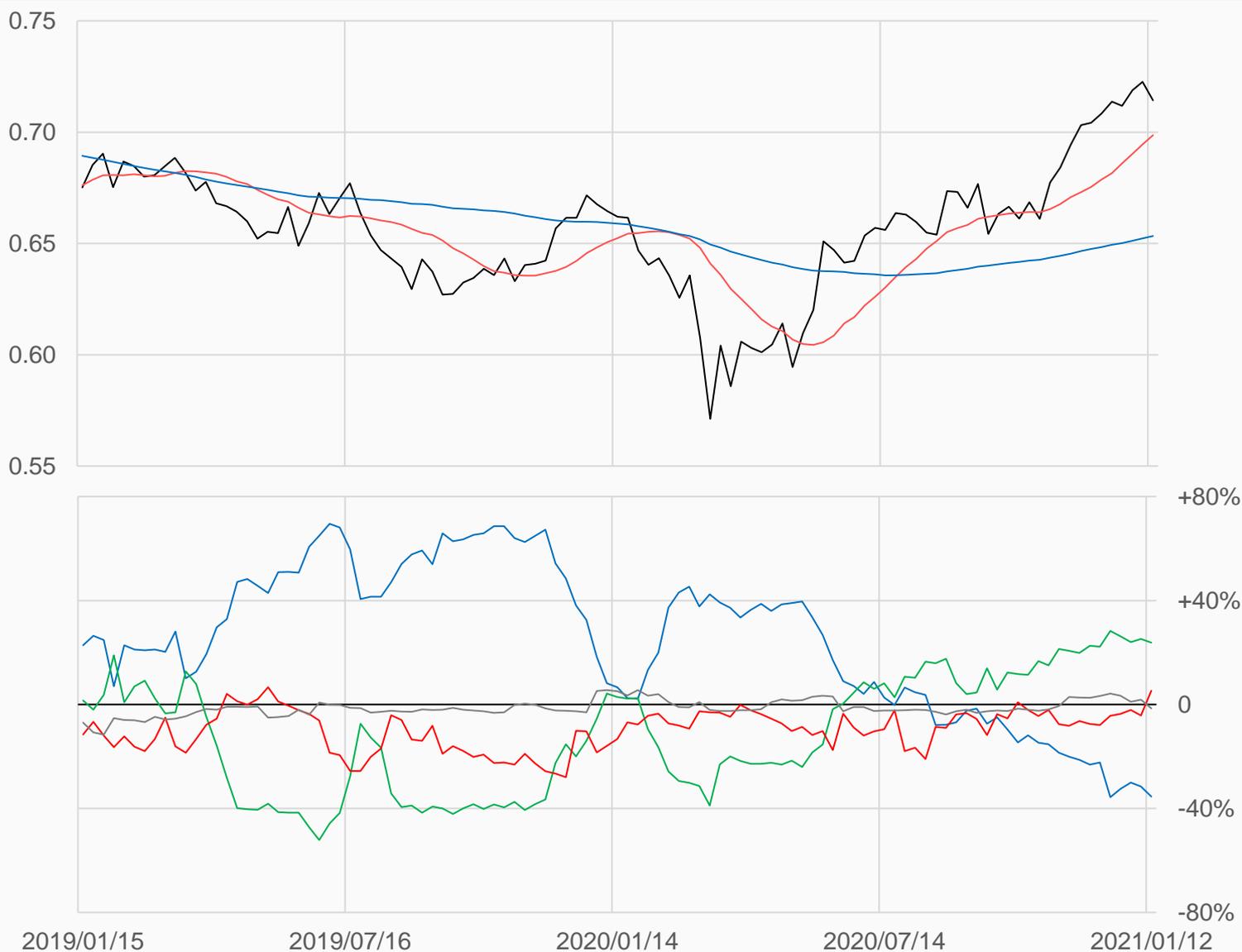
紐幣

紐幣較前一週下跌0.0083點收在0.7143點，
 槓桿基金多單增加1471口，空單減少2880口，
 淨多單較前一週增加4351口至2364口。

數據日期	前期OI	本期OI	增減	增減	週五收盤價	較前週變動
2021/01/12	47255	44767	-2488	-5.27%	0.7143	↓ -0.0083
分類	多單OI	增減	空單OI	增減	多空淨部位	淨部位變動
經紀商	2771	-256	18613	+651	-15842	-907
資產管理	16810	-1433	6164	-173	+10646	-1260
槓桿基金	18003	+1471	15639	-2880	+2364	+4351
其他	914	-1435	1588	+104	-674	-1539

週五收盤價與13週與52週平均線

— NE — 13週 0.699 — 52週 0.653



淨部位佔總OI% 經紀 -35.4% 資管 +23.8% 槓桿 +5.3% 其他 -1.5%

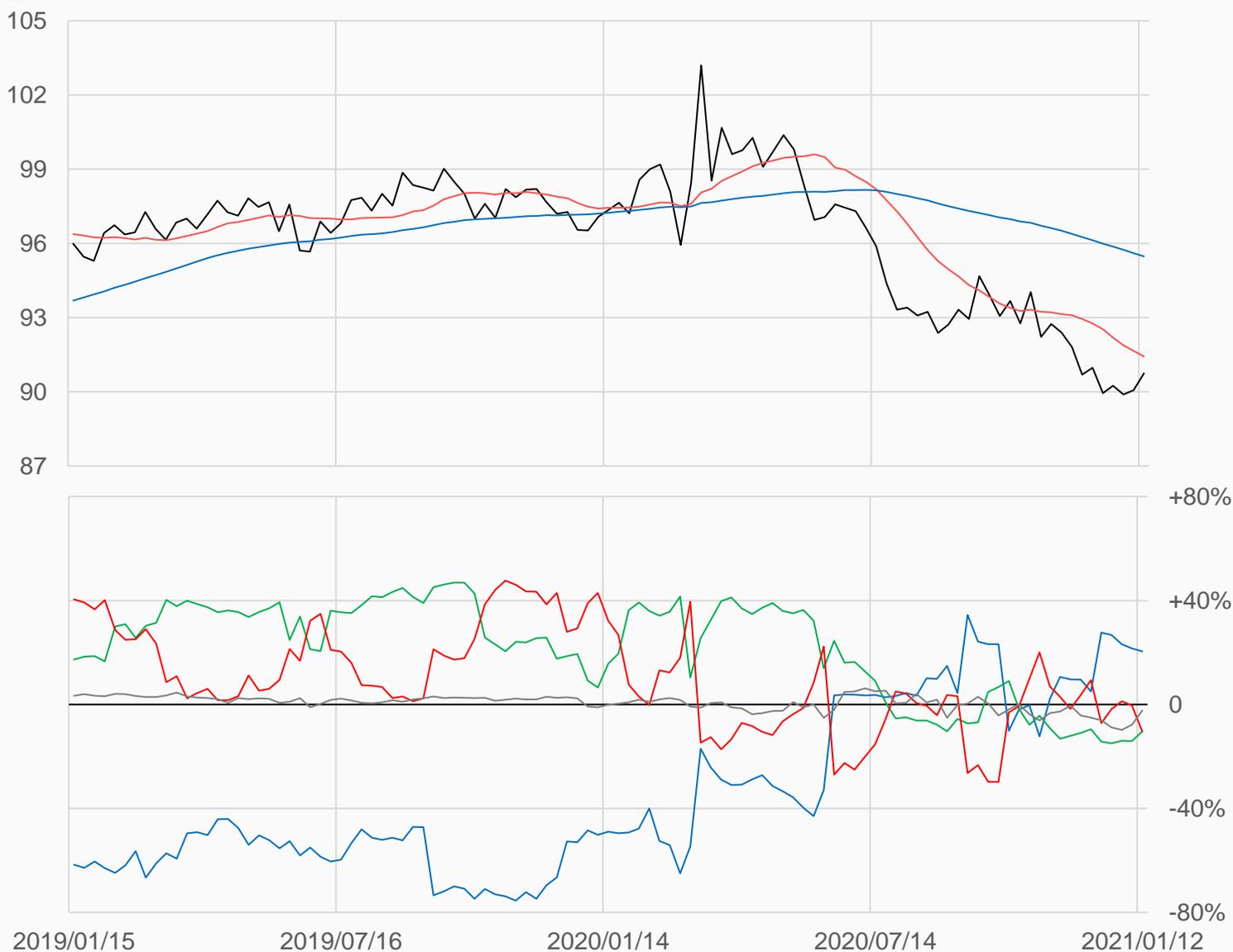
美元

美元較前一週上漲0.686點收在90.754點，
 槓桿基金多單減少5380口，空單減少1869口，
 淨空單較前一週增加3511口至3647口。

數據日期	前期OI	本期OI	增減	增減	週五收盤價	較前週變動
2021/01/12	37662	34920	-2742	-7.28%	90.754	↑ +0.686
分類	多單OI	增減	空單OI	增減	多空淨部位	淨部位變動
經紀商	8631	-476	1499	+501	+7132	-977
資產管理	7560	+1186	11177	-506	-3617	+1692
槓桿基金	12085	-5380	15732	-1869	-3647	-3511
其他	2030	+1158	2826	-984	-796	+2142

週五收盤價與13週與52週平均線

— DX — 13週 91.43 — 52週 95.48



淨部位佔總OI% 經紀 +20.4% 資管 -10.4% 槓桿 -10.4% 其他 -2.3%

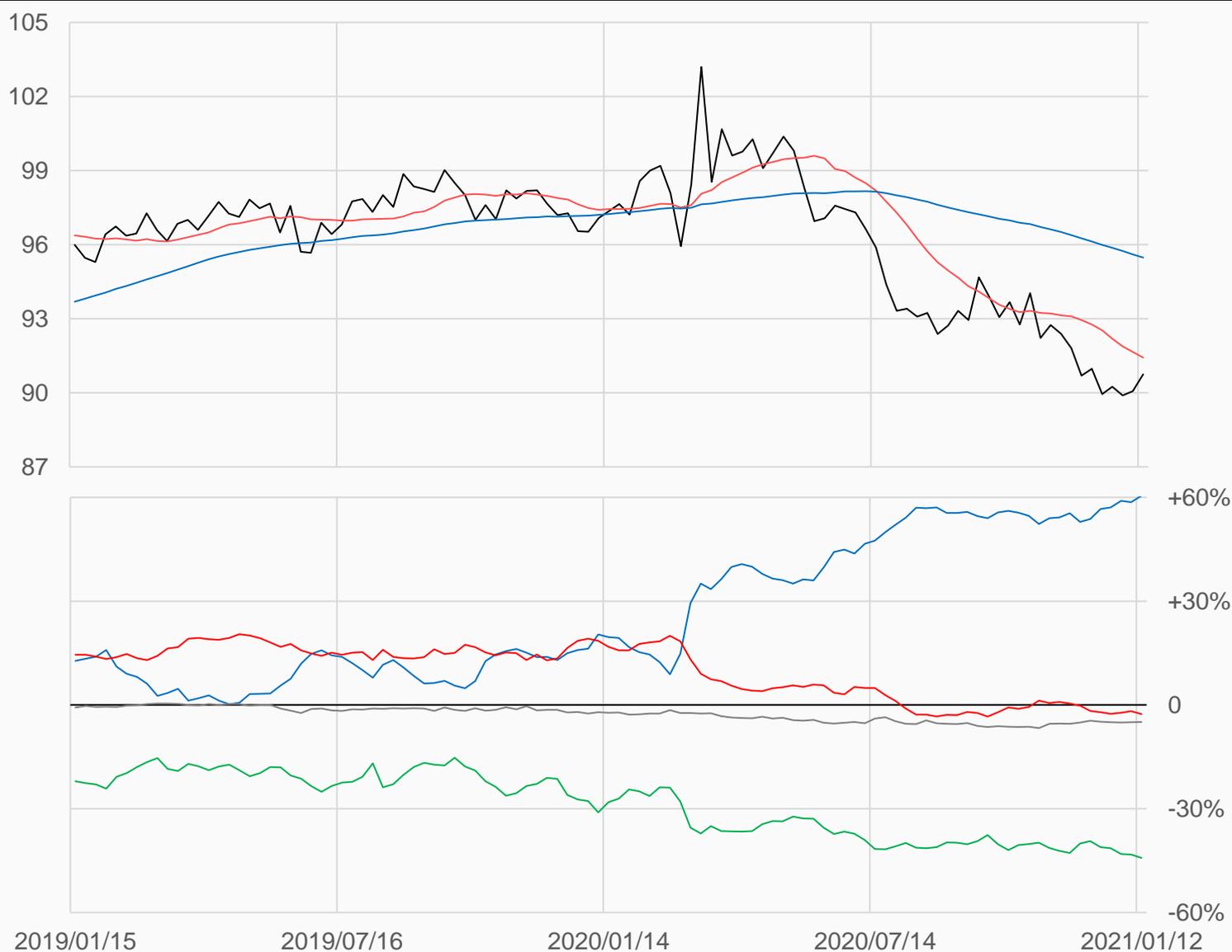
綜合美元 (不含美元)

綜合美元較前一週上漲0.686點收在90.754點，
槓桿基金多單減少16054口，空單減少6626口，
淨空單較前一週增加9428口至29409口。

數據日期	前期OI	本期OI	增減	增減	週五收盤價	較前週變動
2021/01/12	1115448	1099925	-15523	-1.39%	90.754	↑ +0.686
分類	多單OI	增減	空單OI	增減	多空淨部位	淨部位變動
經紀商	734802	+2395	69656.8	-8953	+665145	+11348
資產管理	151374	-3828	637800	+387	-486427	-4215
槓桿基金	131657	-16054	161066	-6626	-29409	-9428
其他	12632.6	-733	67057.8	-2549	-54425	+1816

週五收盤價與13週與52週平均線

— DXY — 13週 91.43 — 52週 95.48



淨部位佔總OI% 經紀 +60.5% 資管 -44.2% 槓桿 -2.7% 其他 -4.9%

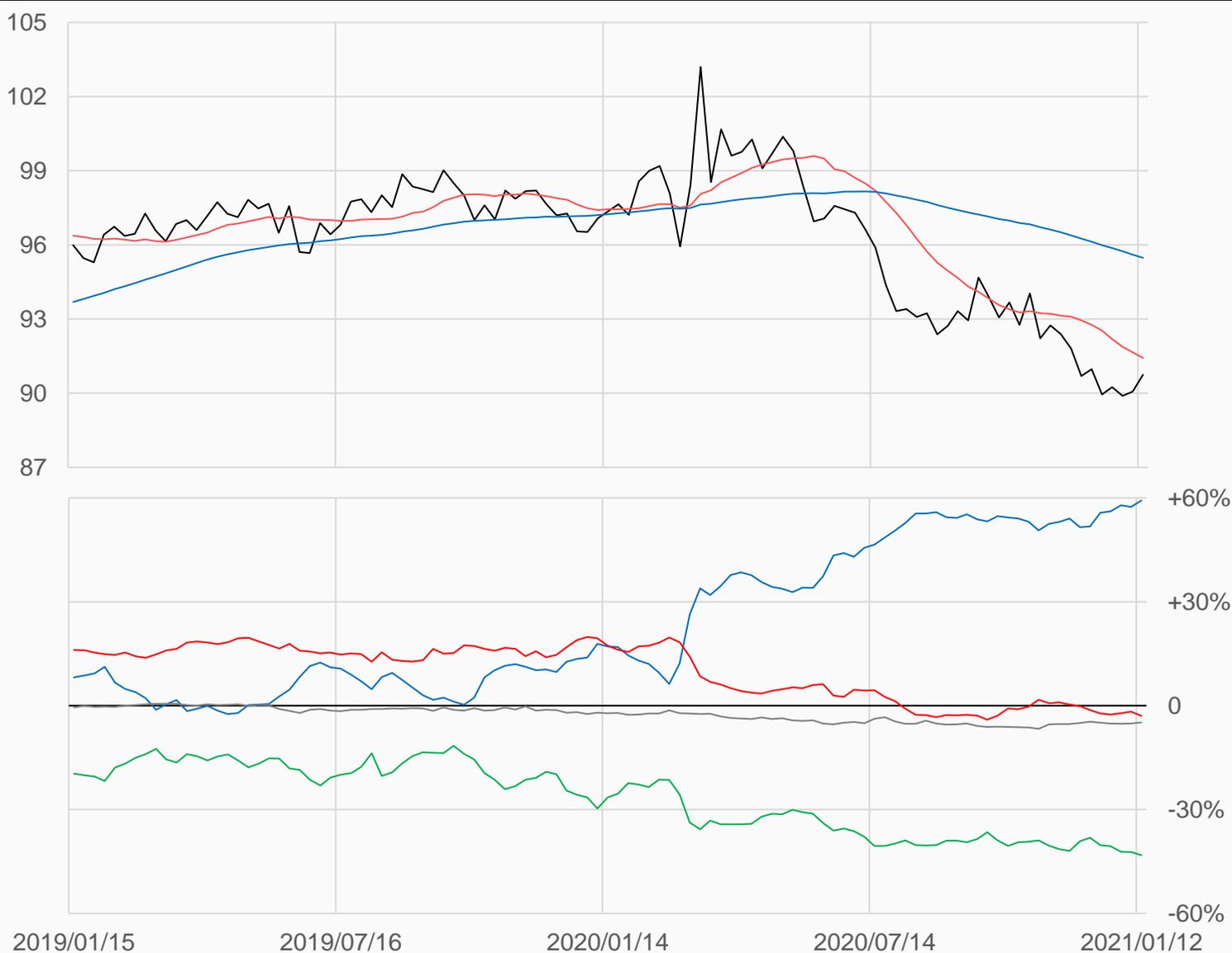
綜合美元 (含美元)

綜合美元較前一週上漲0.686點收在90.754點，
槓桿基金多單減少21434口，空單減少8495口，
淨空單較前一週增加12939口至33056口。

數據日期	前期OI	本期OI	增減	增減	週五收盤價	較前週變動
2021/01/12	1153110	1134845	-18265	-1.58%	90.754	↑ +0.686
分類	多單OI	增減	空單OI	增減	多空淨部位	淨部位變動
經紀商	743433	+1919	71155.8	-8452	+672277	+10371
資產管理	158934	-2642	648977	-119	-490044	-2523
槓桿基金	143742	-21434	176798	-8495	-33056	-12939
其他	14662.6	+425	69883.8	-3533	-55221	+3958

週五收盤價與13週與52週平均線

— DXX — 13週 91.43 — 52週 95.48



淨部位佔總OI% 經紀 +59.2% 資管 -43.2% 槓桿 -2.9% 其他 -4.9%

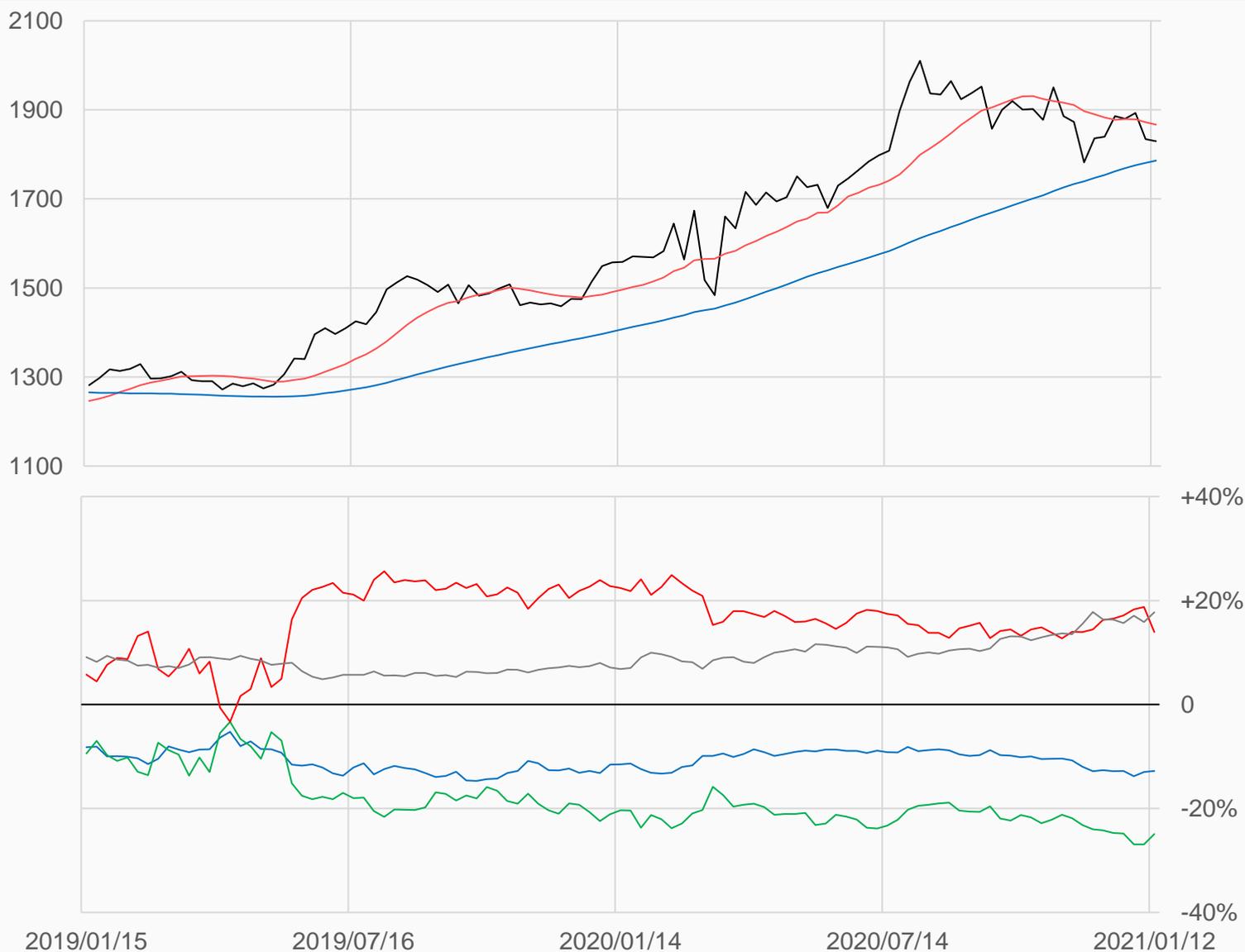
黃金

黃金較前一週下跌4.8點收在1829.3點，
管理基金多單減少46468口，空單增加391口，
淨多單較前一週減少46859口至105270口。

數據日期	前期OI	本期OI	增減	增減	週五收盤價	較前週變動
2021/01/12	810238	754574	-55664	-6.87%	1829.3	↓ -4.8
分類	多單OI	增減	空單OI	增減	多空淨部位	淨部位變動
生產商	33127	-4620	129683	-13341	-96556	+8721
互換交易	142073	+3560	330135	-26411	-188062	+29971
管理基金	214356	-46468	109086	+391	+105270	-46859
其他	295613	-9760	161827	-15004	+133786	+5244

週五收盤價與13週與52週平均線

— GC — 13週 1867 — 52週 1786



淨部位佔總OI% 生產 -12.8% 互換 -24.9% 管理 +14.0% 其他 +17.7%

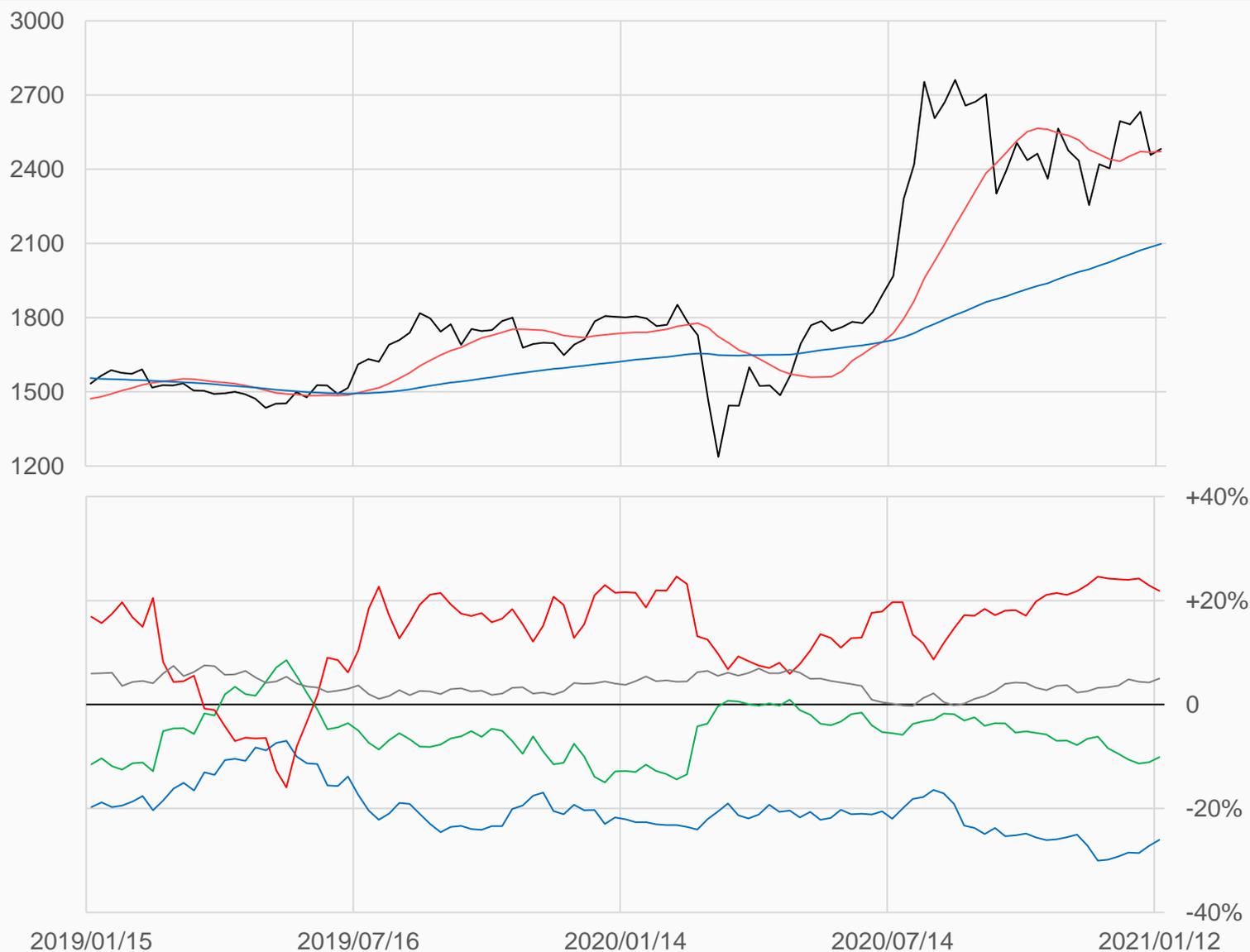
白銀

白銀較前一週上漲24.3點收在2482.5點，
管理基金多單減少5130口，空單減少892口，
淨多單較前一週減少4238口至43395口。

數據日期	前期OI	本期OI	增減	增減	週五收盤價	較前週變動
2021/01/12	207653	198448	-9205	-4.43%	2482.5	↑ +24.3
分類	多單OI	增減	空單OI	增減	多空淨部位	淨部位變動
生產商	8680	+89	60325	-4803	-51645	+4892
互換交易	40572	-703	60730	-3644	-20158	+2941
管理基金	74585	-5130	31190	-892	+43395	-4238
其他	44244	+122	34285	-1084	+9959	+1206

週五收盤價與13週與52週平均線

— SI — 13週 2471 — 52週 2098



淨部位佔總OI% 生產 -26.0% 互換 -10.2% 管理 +21.9% 其他 +5.0%

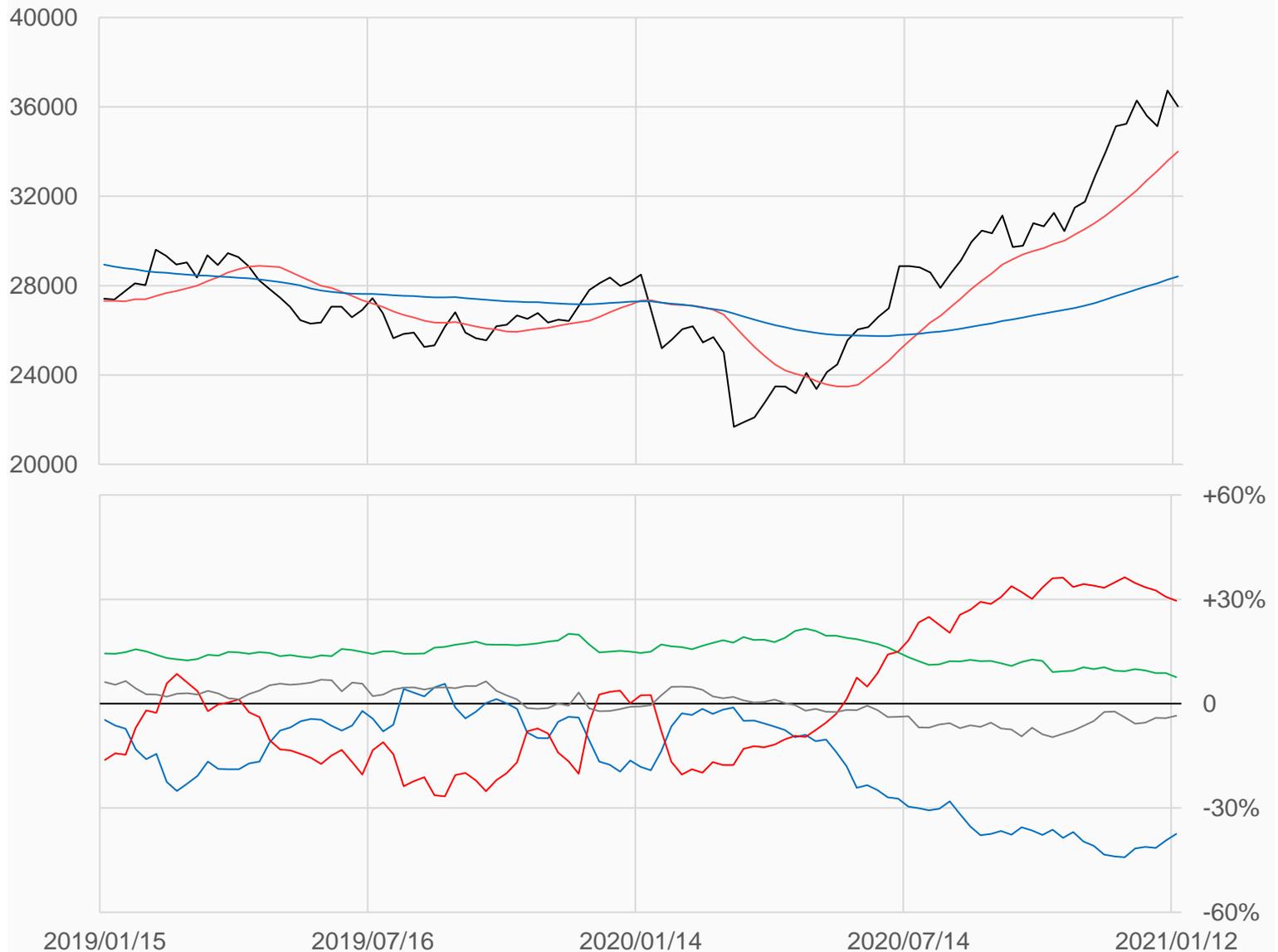
銅

銅較前一週下跌705點收在36030點，
管理基金多單減少3176口，空單增加1143口，
淨多單較前一週減少4319口至76449口。

數據日期	前期OI	本期OI	增減	增減	週五收盤價	較前週變動
2021/01/12	262775	258126	-4649	-1.77%	36030	↓ -705
分類	多單OI	增減	空單OI	增減	多空淨部位	淨部位變動
生產商	18504	+1008	115131	-5748	-96627	+6756
互換交易	45968	-3630	26315	-120	+19653	-3510
管理基金	134694	-3176	58245	+1143	+76449	-4319
其他	38044	+3010	47106	+1211	-9062	+1799

週五收盤價與13週與52週平均線

— HG — 13週 34003 — 52週 28417



淨部位佔總OI% 生產 -37.4% 互換 +7.6% 管理 +29.6% 其他 -3.5%

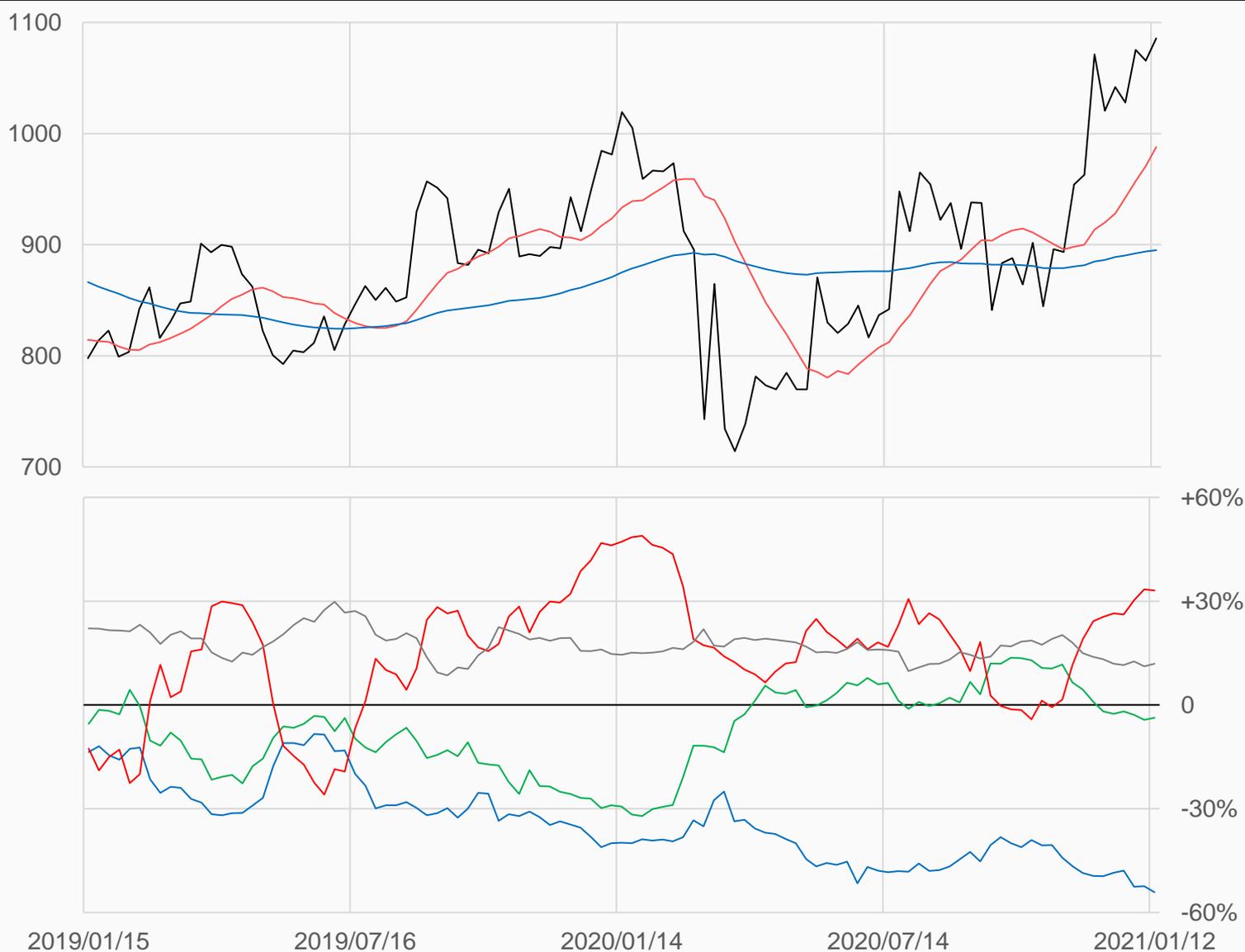
白金

白金較前一週上漲20點收在1085.7點，
管理基金多單減少787口，空單減少262口，
淨多單較前一週減少525口至20058口。

數據日期	前期OI	本期OI	增減	增減	週五收盤價	較前週變動
2021/01/12	61703	60573	-1130	-1.83%	1085.7	↑ +20.0
分類	多單OI	增減	空單OI	增減	多空淨部位	淨部位變動
生產商	1304	-160	34102	+312	-32798	-472
互換交易	9808	-355	12032	-789	-2224	+434
管理基金	28170	-787	8112	-262	+20058	-525
其他	11750	+341	4555	+26	+7195	+315

週五收盤價與13週與52週平均線

— PL — 13週 987.8 — 52週 895



淨部位佔總OI% 生產 -54.1% 互換 -3.7% 管理 +33.1% 其他 +11.9%

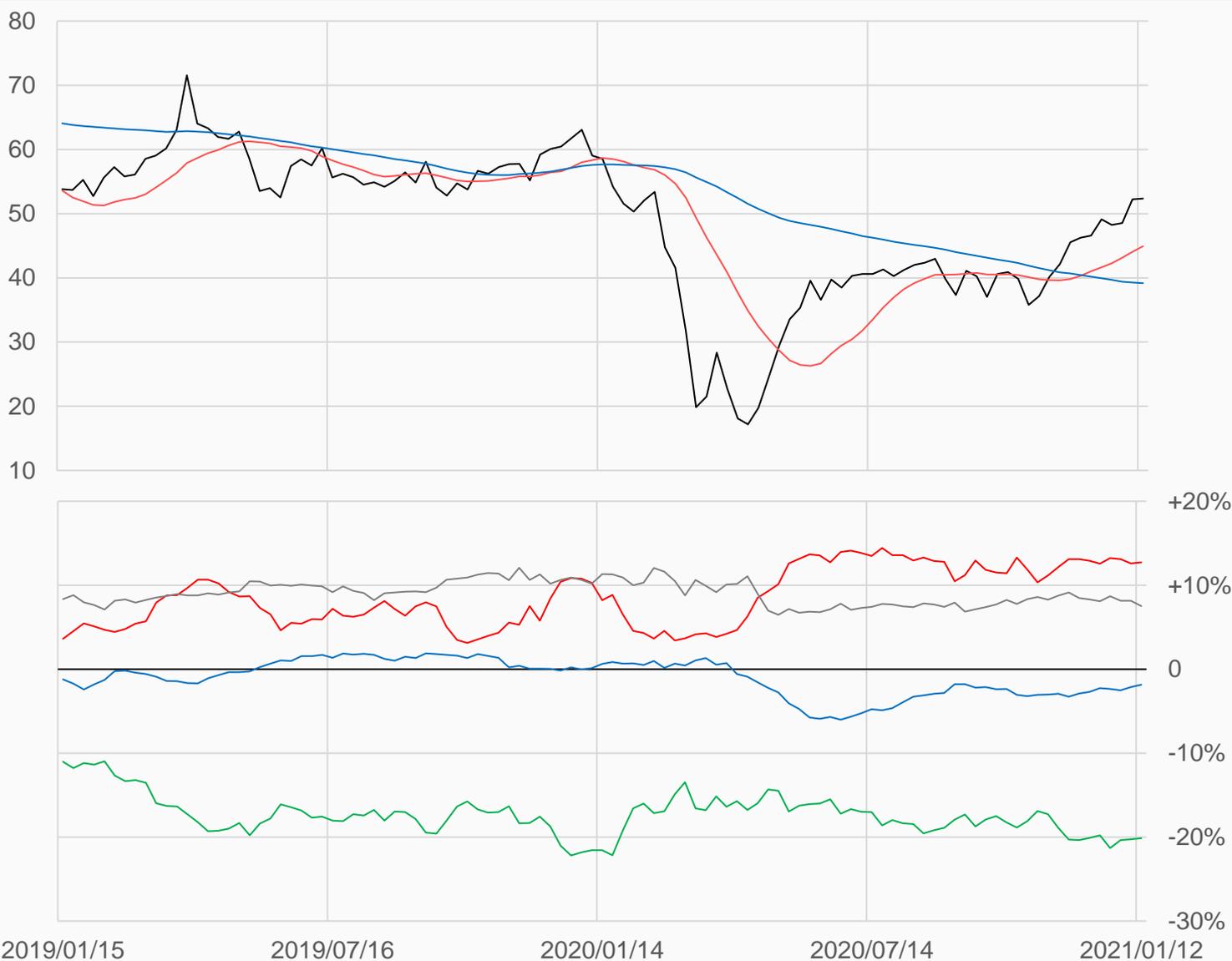
輕原油

輕原油較前一週上漲0.12點收在52.36點，
管理基金多單增加42614口，空單增加24125口，
淨多單較前一週增加18489口至350144口。

數據日期	前期OI	本期OI	增減	增減	週五收盤價	較前週變動
2021/01/12	2632582	2755072	+122490	+4.65%	52.36	↑ +0.12
分類	多單OI	增減	空單OI	增減	多空淨部位	淨部位變動
生產商	497714	+40857	548481	+35444	-50767	+5413
互換交易	401354	+6622	955843	+28039	-554489	-21417
管理基金	1036613	+42614	686469	+24125	+350144	+18489
其他	707641	+31002	500657	+38602	+206984	-7600

週五收盤價與13週與52週平均線

— CL — 13週 44.91 — 52週 39.17



淨部位佔總OI% 生產 -1.8% 互換 -20.1% 管理 +12.7% 其他 +7.5%

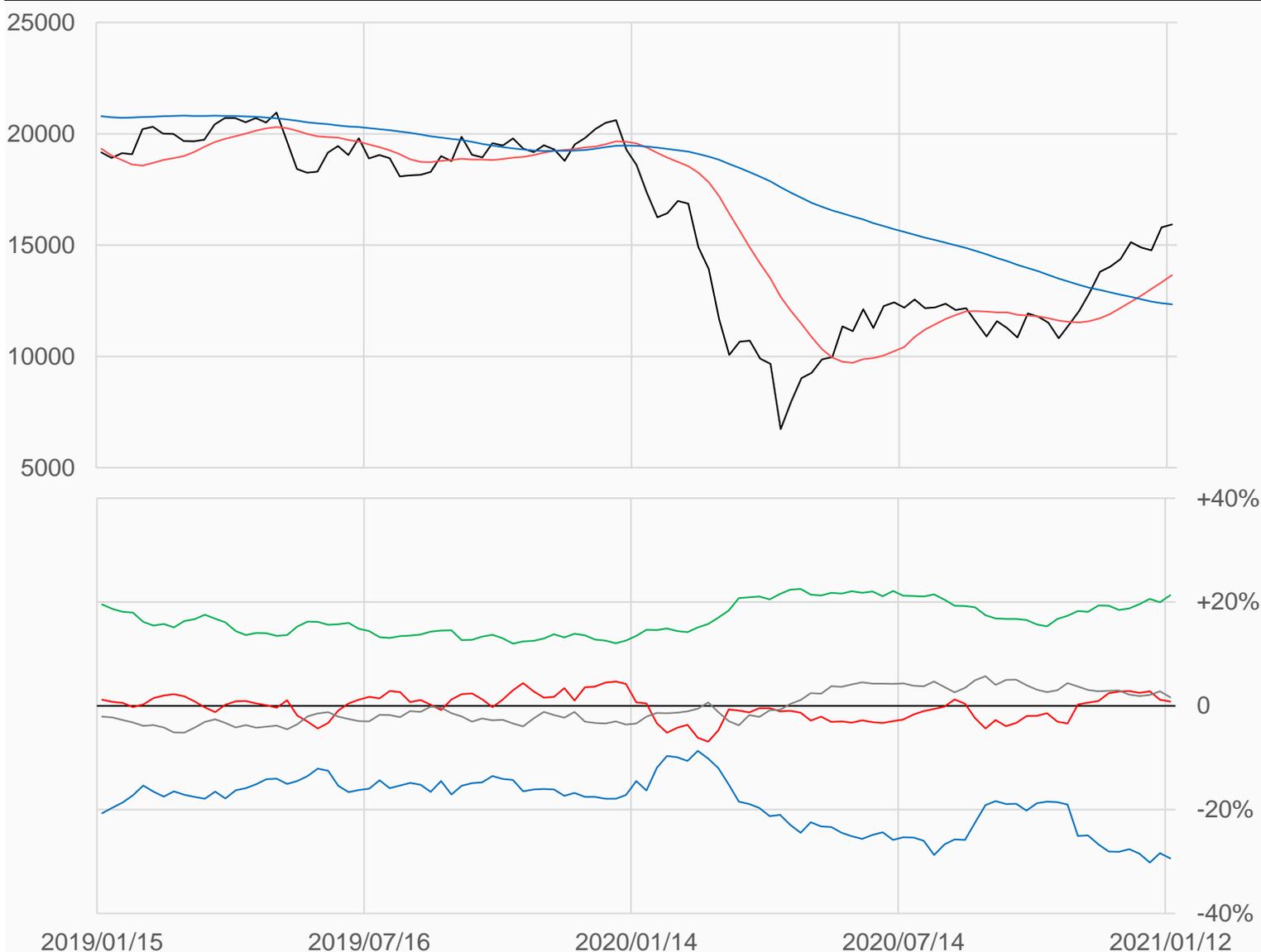
熱燃油

熱燃油較前一週上漲134點收在15929點，
管理基金多單減少3000口，空單減少1748口，
淨多單較前一週減少1252口至3135口。

數據日期	前期OI	本期OI	增減	增減	週五收盤價	較前週變動
2021/01/12	376528	376249	-279	-0.07%	15929	↑ +134
分類	多單OI	增減	空單OI	增減	多空淨部位	淨部位變動
生產商	115519	+2096	226099	+5849	-110580	-3753
互換交易	91999	+4531	11738	-651	+80261	+5182
管理基金	59259	-3000	56124	-1748	+3135	-1252
其他	63707	-6707	57475	-2300	+6232	-4407

週五收盤價與13週與52週平均線

— HO — 13週 13644 — 52週 12340



淨部位佔總OI% 生產 -29.4% 互換 +21.3% 管理 +0.8% 其他 +1.7%

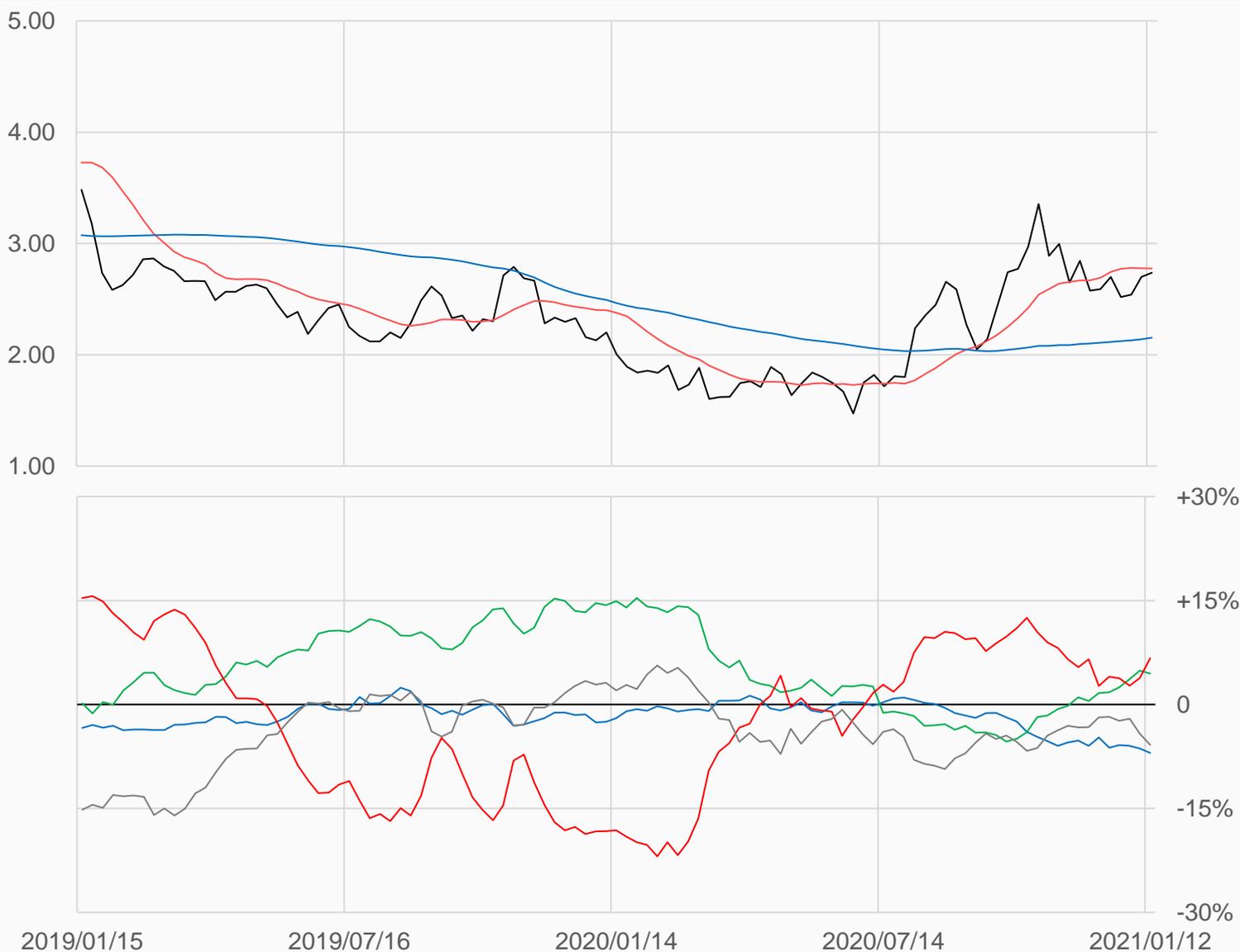
天然氣

天然氣較前一週上漲0.037點收在2.737點，
管理基金多單減少4177口，空單減少35565口，
淨多單較前一週增加31388口至76280口。

數據日期	前期OI	本期OI	增減	增減	週五收盤價	較前週變動
2021/01/12	1173521	1139047	-34474	-2.94%	2.737	↑ +0.037
分類	多單OI	增減	空單OI	增減	多空淨部位	淨部位變動
生產商	177322	-15126	256879	-10279	-79557	-4847
互換交易	269798	-10390	219020	-3583	+50778	-6807
管理基金	476202	-4177	399922	-35565	+76280	+31388
其他	153159	-5203	219443	+11495	-66284	-16698

週五收盤價與13週與52週平均線

— NG — 13週 2.774 — 52週 2.153



淨部位佔總OI% 生產 -7.0% 互換 +4.5% 管理 +6.7% 其他 -5.8%

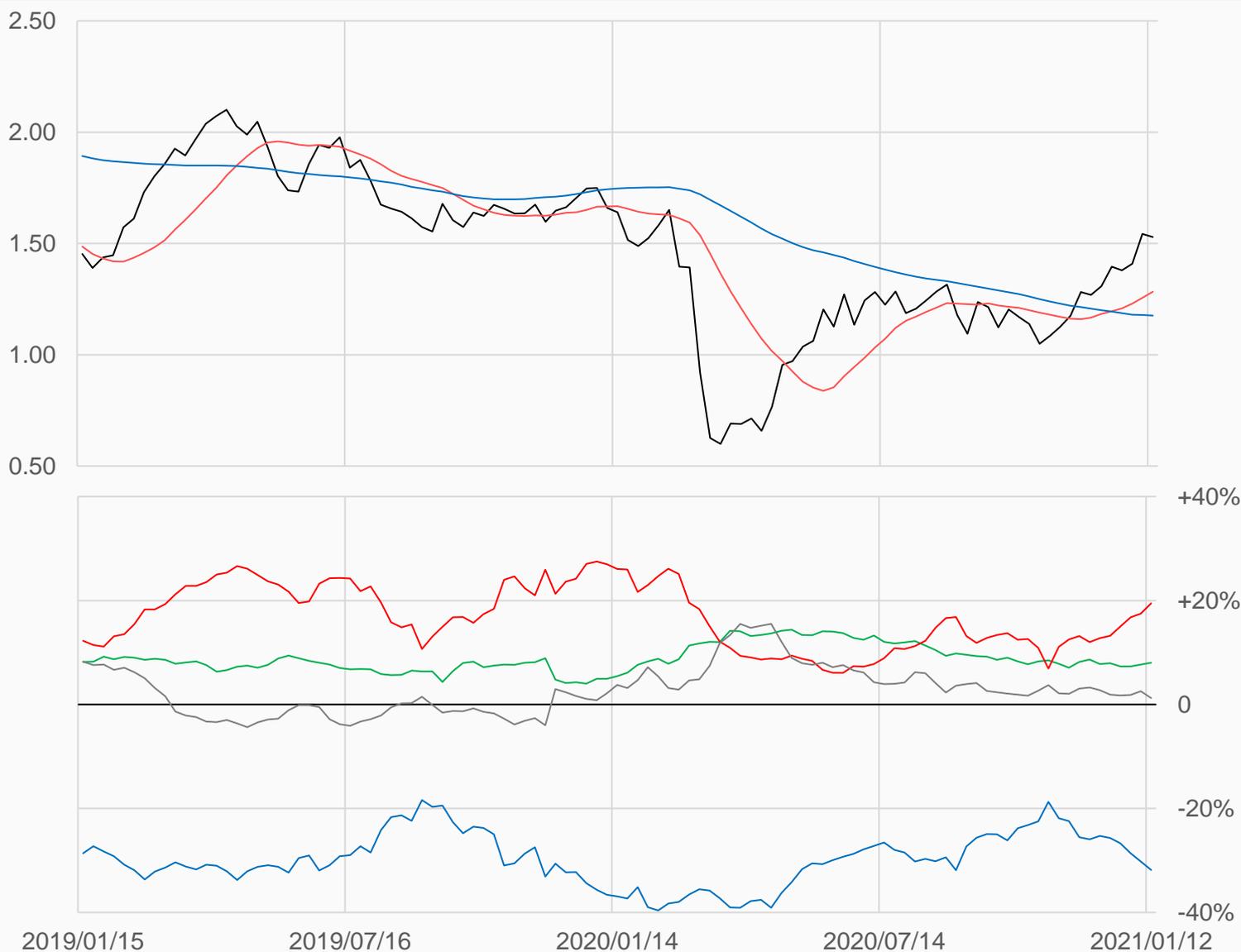
無鉛汽油

無鉛汽油較前一週下跌0.0139點收在1.5284點，
管理基金多單增加4725口，空單減少2178口，
淨多單較前一週增加6903口至79809口。

數據日期	前期OI	本期OI	增減	增減	週五收盤價	較前週變動
2021/01/12	417400	410349	-7051	-1.69%	1.5284	↓ -0.0139
分類	多單OI	增減	空單OI	增減	多空淨部位	淨部位變動
生產商	131733	-19406	262318	-14869	-130585	-4537
互換交易	60125	+3473	27202	+2661	+32923	+812
管理基金	136336	+4725	56527	-2178	+79809	+6903
其他	54969	-4519	49802	+1035	+5167	-5554

週五收盤價與13週與52週平均線

— RB — 13週 1.283 — 52週 1.176



淨部位佔總OI% 生產 -31.8% 互換 +8.0% 管理 +19.4% 其他 +1.3%

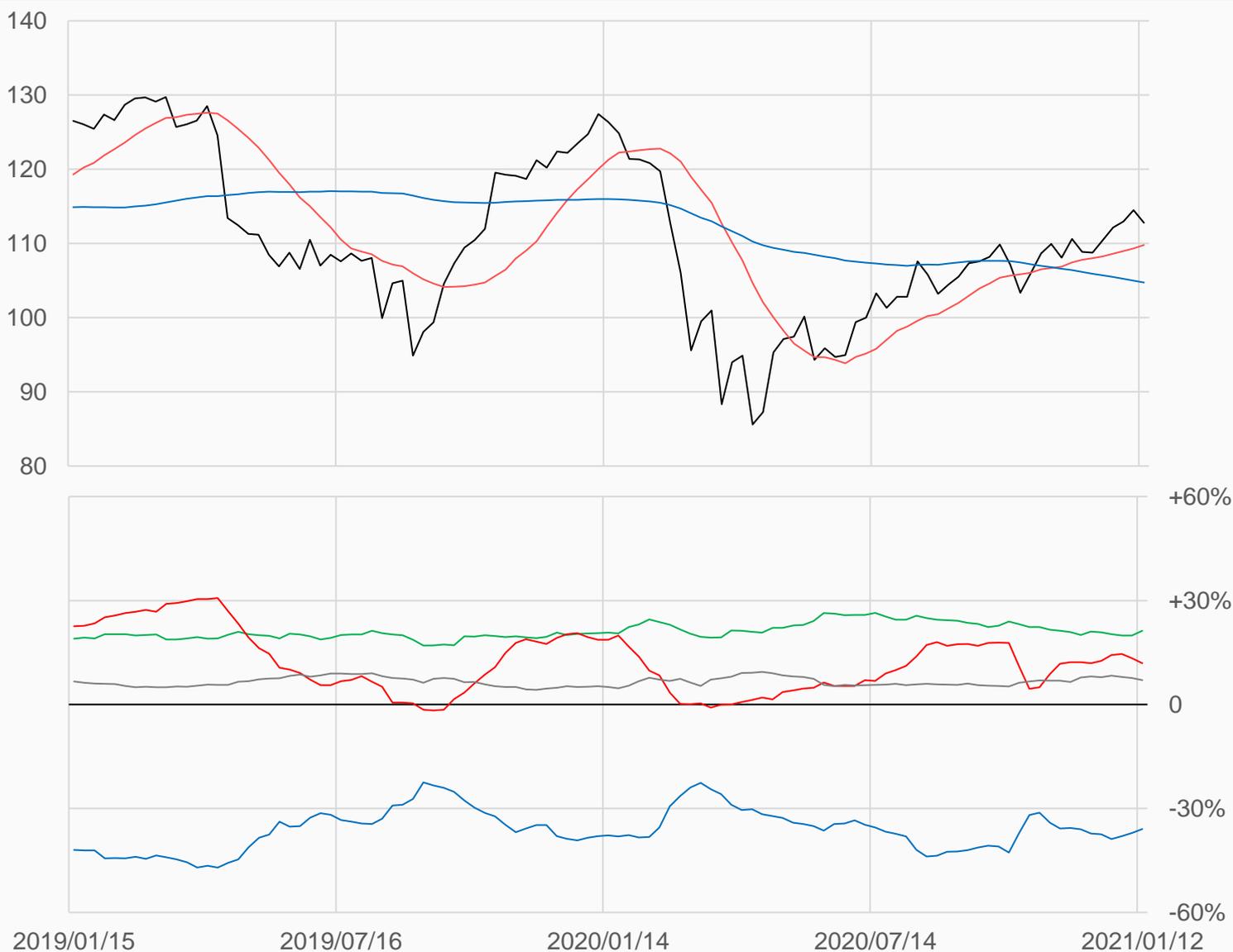
活牛

活牛較前一週下跌1.7點收在112.775點，
管理基金多單增加6527口，空單增加9688口，
淨多單較前一週減少3161口至42827口。

數據日期	前期OI	本期OI	增減	增減	週五收盤價	較前週變動
2021/01/12	343740	359752	+16012	+4.66%	112.775	↓ -1.700
分類	多單OI	增減	空單OI	增減	多空淨部位	淨部位變動
生產商	51489	+2411	180882	+4272	-129393	-1861
互換交易	82100	+5514	5611	-2427	+76489	+7941
管理基金	118541	+6527	75714	+9688	+42827	-3161
其他	70751	+994	45373	+1841	+25378	-847

週五收盤價與13週與52週平均線

— LC — 13週 109.8 — 52週 104.7



淨部位佔總OI% 生產 -36.0% 互換 +21.3% 管理 +11.9% 其他 +7.1%

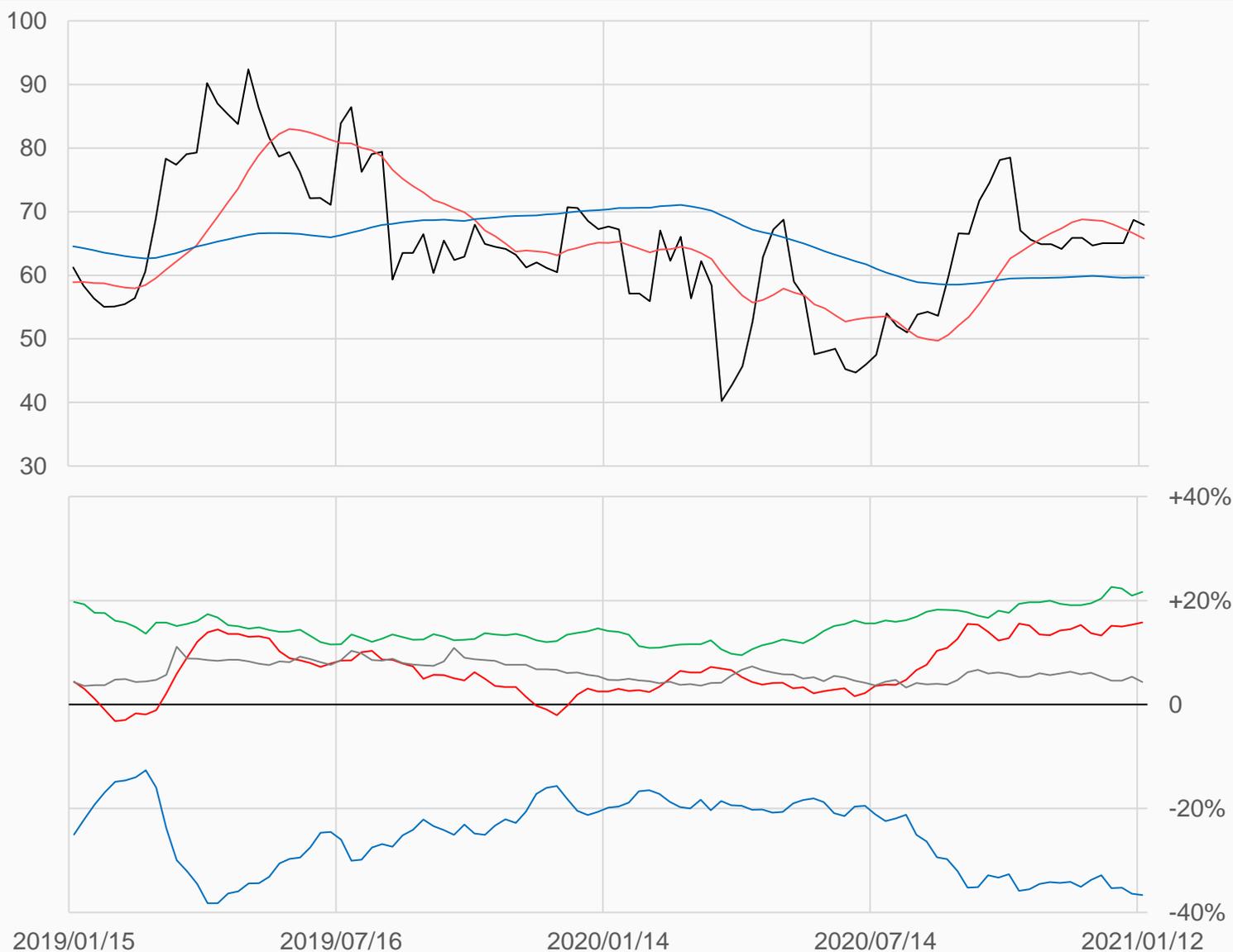
活豬

活豬較前一週下跌0.775點收在67.925點，
管理基金多單增加3657口，空單增加1992口，
淨多單較前一週增加1665口至38742口。

數據日期	前期OI	本期OI	增減	增減	週五收盤價	較前週變動
2021/01/12	241713	245388	+3675	+1.52%	67.925	↓ -0.775
分類	多單OI	增減	空單OI	增減	多空淨部位	淨部位變動
生產商	14376	-50	104358	+1911	-89982	-1961
互換交易	61917	+532	8722	-2031	+53195	+2563
管理基金	85210	+3657	46468	+1992	+38742	+1665
其他	61614	-545	50953	+1663	+10661	-2208

週五收盤價與13週與52週平均線

— LH — 13週 65.75 — 52週 59.66



淨部位佔總OI% 生產 -36.7% 互換 +21.7% 管理 +15.8% 其他 +4.3%

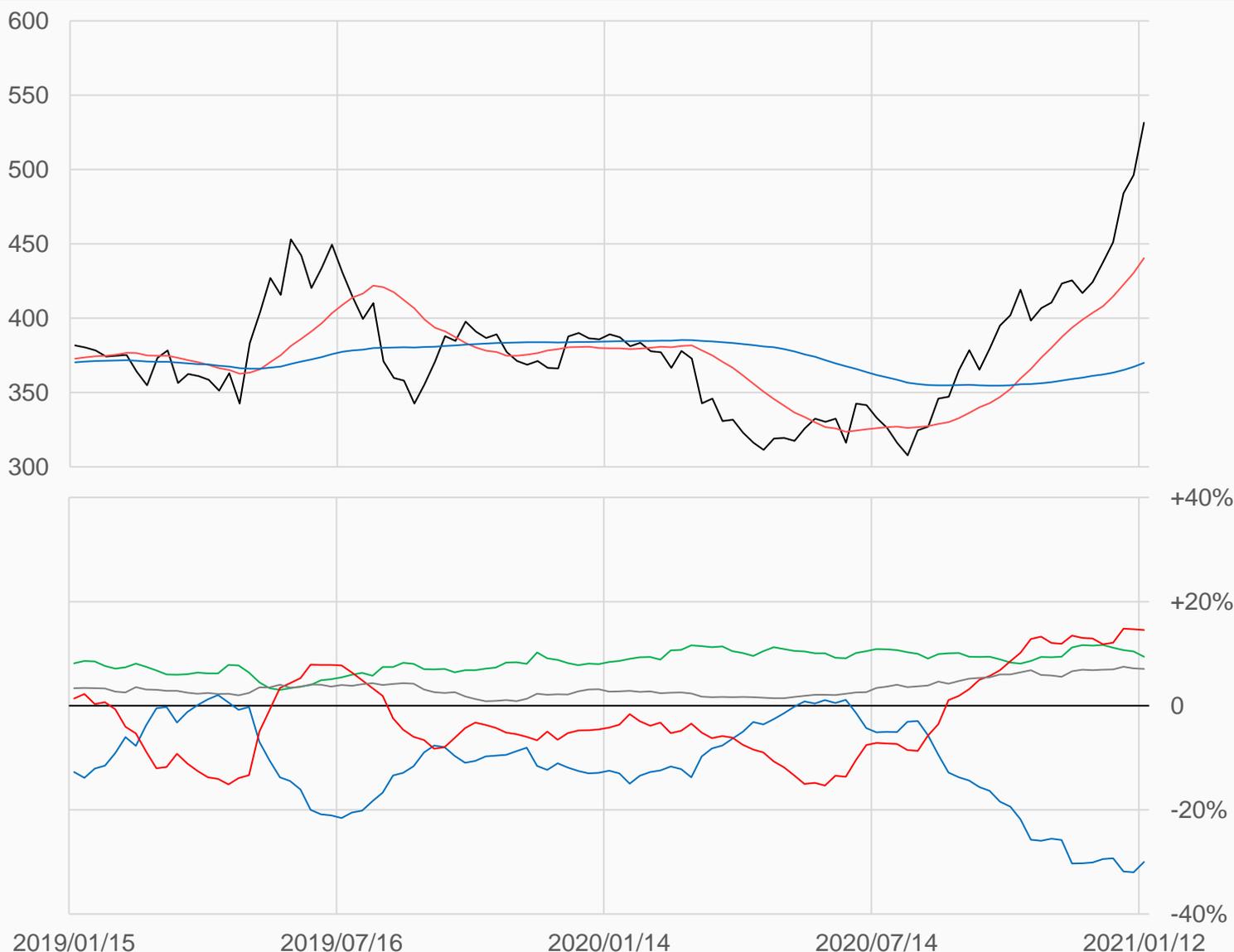
玉米

玉米較前一週上漲35.25點收在531.5點，
管理基金多單增加59138口，空單增加34312口，
淨多單較前一週增加24826口至374714口。

數據日期	前期OI	本期OI	增減	增減	週五收盤價	較前週變動
2021/01/12	2379202	2580675	+201473	+8.47%	531.50	↑ +35.25
分類	多單OI	增減	空單OI	增減	多空淨部位	淨部位變動
生產商	615868	+66571	1390249	+79898	-774381	-13327
互換交易	390030	+5355	146747	+9966	+243283	-4611
管理基金	678701	+59138	303987	+34312	+374714	+24826
其他	675988	+71530	493121	+59417	+182867	+12113

週五收盤價與13週與52週平均線

— ZC — 13週 440.4 — 52週 370



淨部位佔總OI% 生產 -30.0% 互換 +9.4% 管理 +14.5% 其他 +7.1%

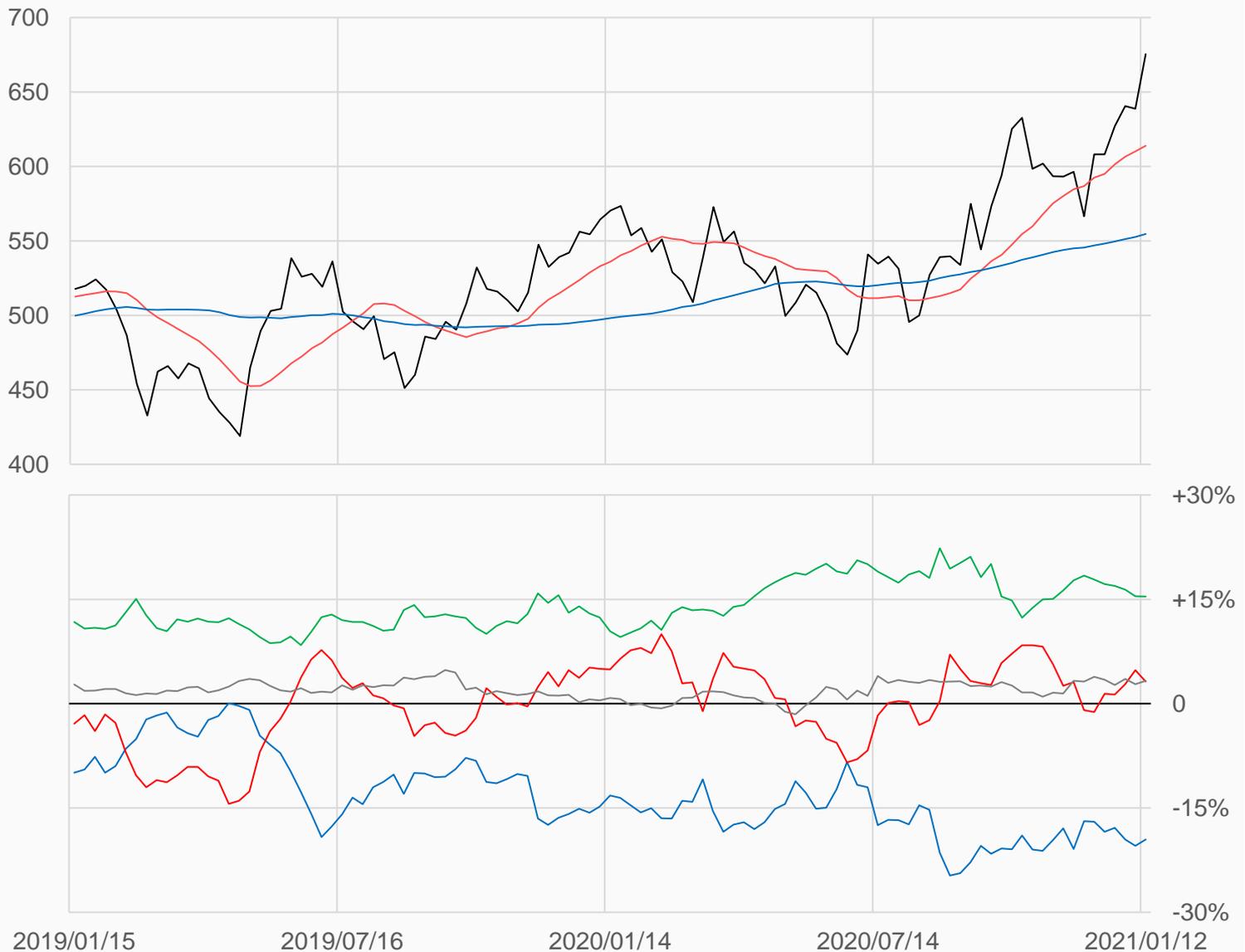
小麥

小麥較前一週上漲36.75點收在675.5點，
管理基金多單增加476口，空單增加8699口，
淨多單較前一週減少8223口至16987口。

數據日期	前期OI	本期OI	增減	增減	週五收盤價	較前週變動
2021/01/12	522434	538192	+15758	+3.02%	675.50	↑ +36.75
分類	多單OI	增減	空單OI	增減	多空淨部位	淨部位變動
生產商	56576	+6472	161768	+4842	-105192	+1630
互換交易	127284	+2283	44403	+72	+82881	+2211
管理基金	182310	+476	165323	+8699	+16987	-8223
其他	134356	+5940	116661	+2931	+17695	+3009

週五收盤價與13週與52週平均線

— ZW — 13週 613.9 — 52週 554.7



淨部位佔總OI% 生產 -19.5% 互換 +15.4% 管理 +3.2% 其他 +3.3%

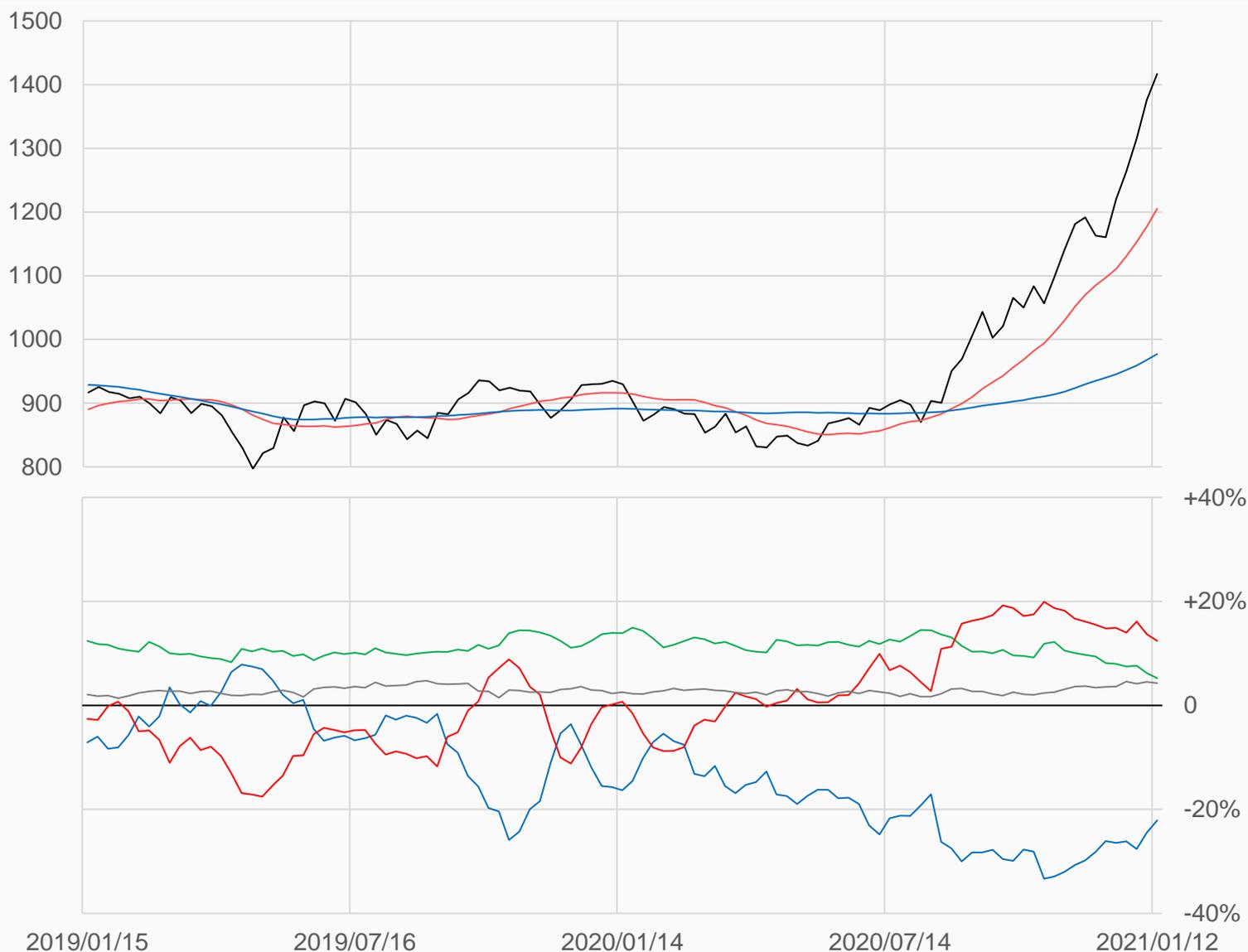
黃豆

黃豆較前一週上漲41點收在1416.75點，
管理基金多單增加3223口，空單增加12565口，
淨多單較前一週減少9342口至166485口。

數據日期	前期OI	本期OI	增減	增減	週五收盤價	較前週變動
2021/01/12	1282647	1342333	+59686	+4.65%	1416.75	↑ +41.00
分類	多單OI	增減	空單OI	增減	多空淨部位	淨部位變動
生產商	344849	+12184	641966	-4662	-297117	+16846
互換交易	202387	+4468	132157	+14085	+70230	-9617
管理基金	301949	+3223	135464	+12565	+166485	-9342
其他	397044	+33760	339645	+34231	+57399	-471

週五收盤價與13週與52週平均線

— ZS — 13週 1205 — 52週 977.1



淨部位佔總OI% 生產 -22.1% 互換 +5.2% 管理 +12.4% 其他 +4.3%

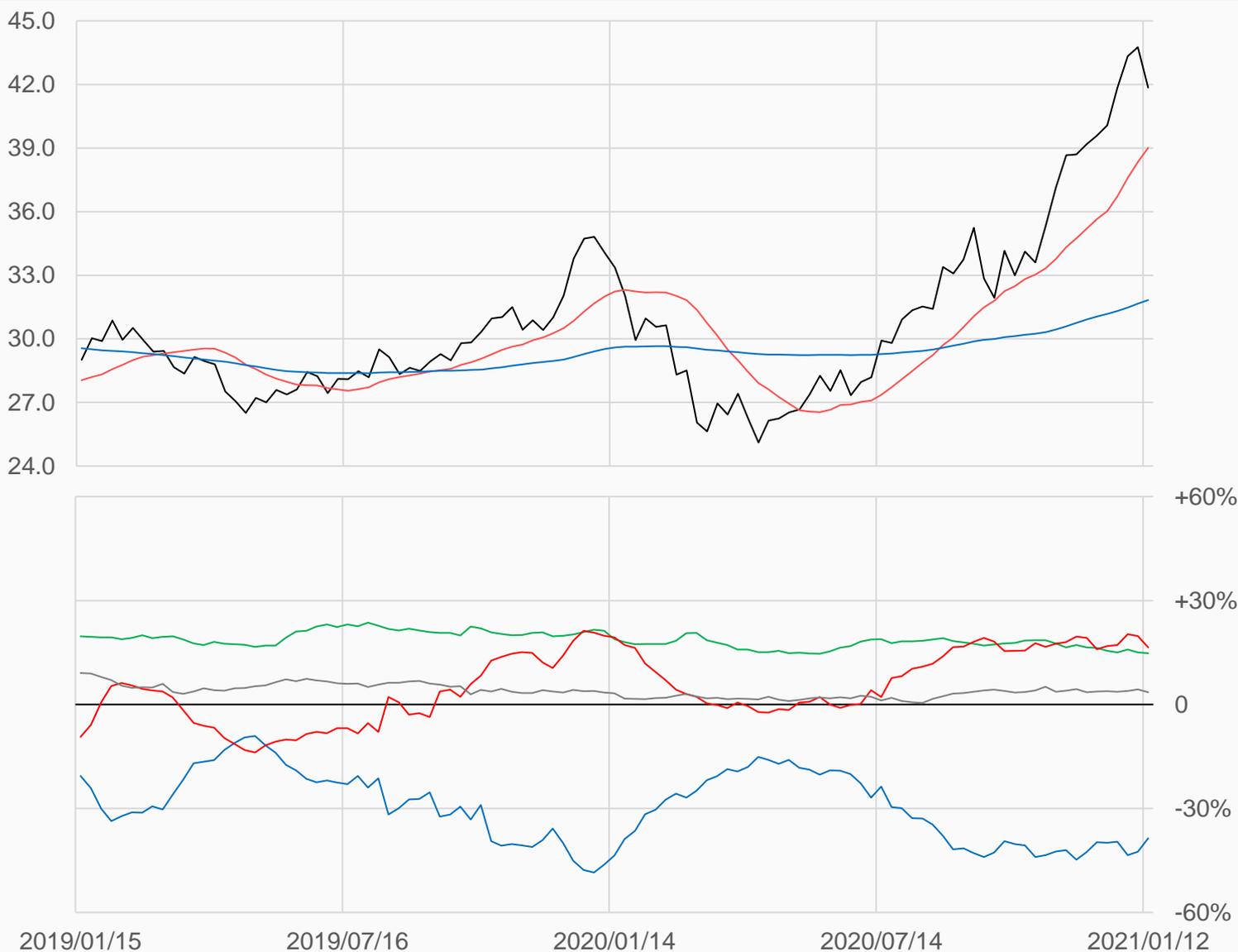
黃豆油

黃豆油較前一週下跌1.91點收在41.85點，
管理基金多單減少10400口，空單增加8981口，
淨多單較前一週減少19381口至93536口。

數據日期	前期OI	本期OI	增減	增減	週五收盤價	較前週變動
2021/01/12	571571	568408	-3163	-0.55%	41.85	↓ -1.91
分類	多單OI	增減	空單OI	增減	多空淨部位	淨部位變動
生產商	118864	+8190	338146	-15298	-219282	+23488
互換交易	106301	+455	22345	+2362	+83956	-1907
管理基金	174237	-10400	80701	+8981	+93536	-19381
其他	121597	-2753	101332	+1878	+20265	-4631

週五收盤價與13週與52週平均線

— BO — 13週 39.01 — 52週 31.83



淨部位佔總OI% 生產 -38.6% 互換 +14.8% 管理 +16.5% 其他 +3.6%

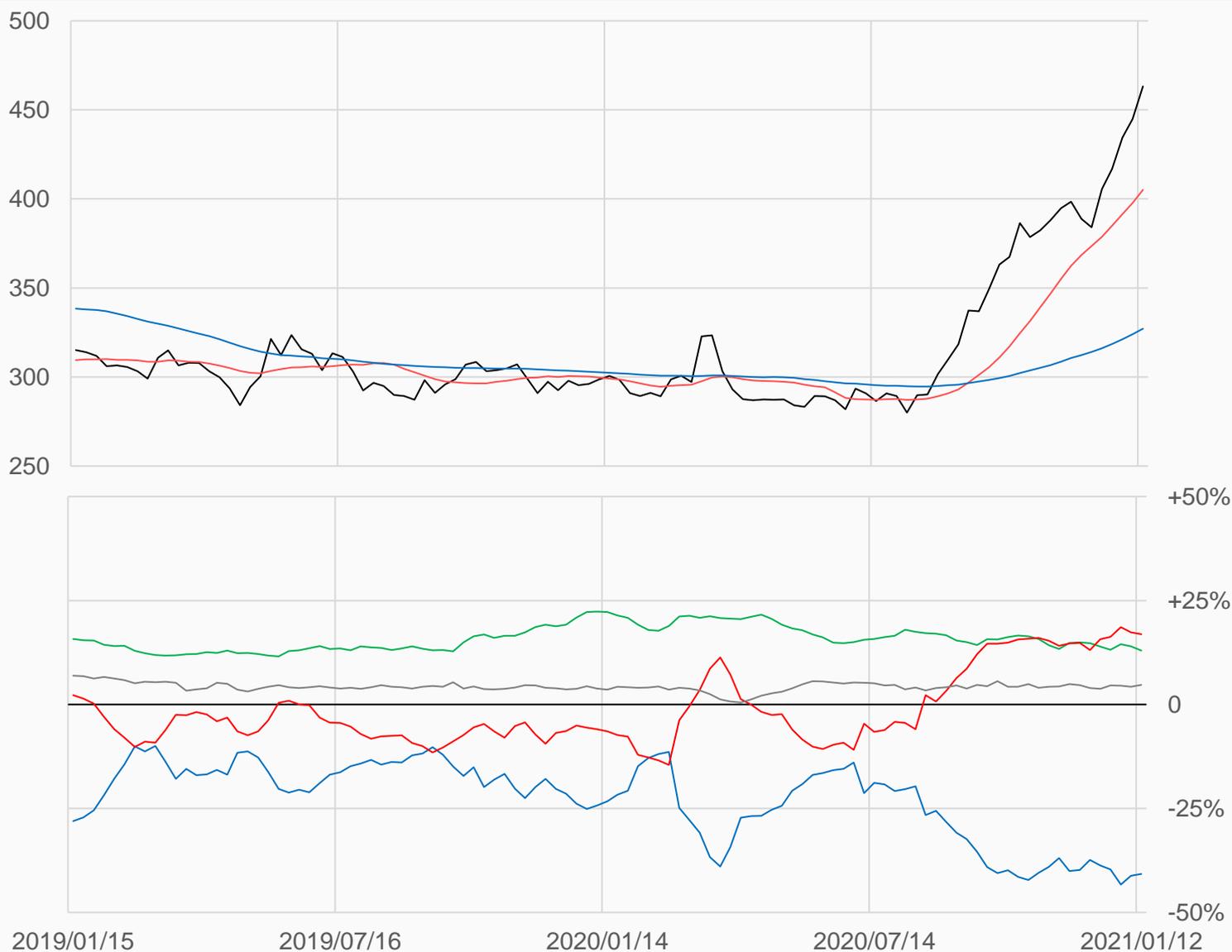
黃豆粉

黃豆粉較前一週上漲18.4點收在463.2點，
管理基金多單減少46口，空單增加140口，
淨多單較前一週減少186口至84408口。

數據日期	前期OI	本期OI	增減	增減	週五收盤價	較前週變動
2021/01/12	486734	499855	+13121	+2.70%	463.2	↑ +18.4
分類	多單OI	增減	空單OI	增減	多空淨部位	淨部位變動
生產商	116230	+992	319855	+4010	-203625	-3018
互換交易	90593	-1967	25706	+1304	+64887	-3271
管理基金	130492	-46	46084	+140	+84408	-186
其他	104812	+12068	81156	+9348	+23656	+2720

週五收盤價與13週與52週平均線

— SM — 13週 405.1 — 52週 327.1



淨部位佔總OI% 生產 -40.7% 互換 +13.0% 管理 +16.9% 其他 +4.7%

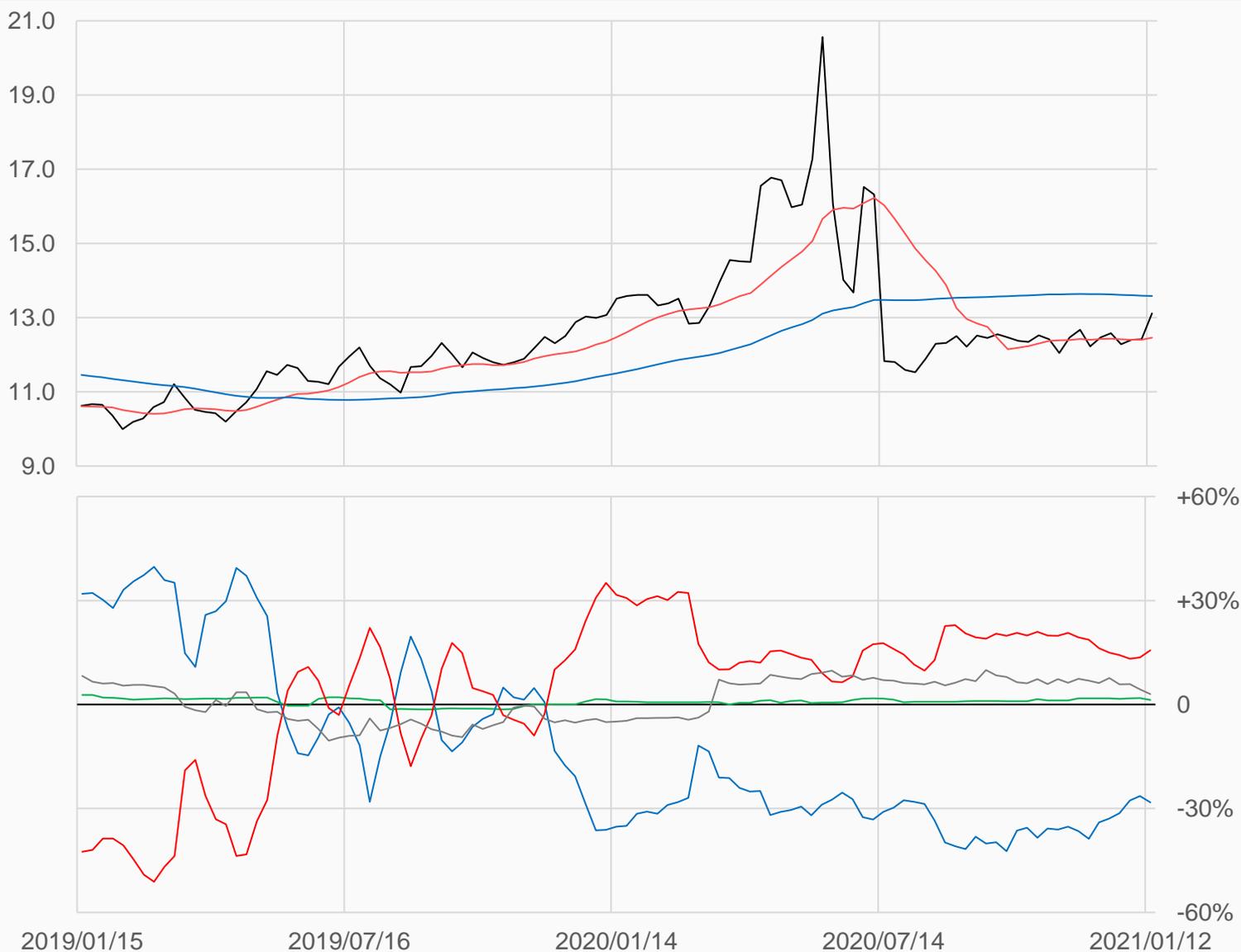
粗米

粗米較前一週上漲0.7點收在13.115點，
管理基金多單增加130口，空單減少100口，
淨多單較前一週增加230口至1537口。

數據日期	前期OI	本期OI	增減	增減	週五收盤價	較前週變動
2021/01/12	9637	9818	+181	+1.88%	13.115	↑ +0.700
分類	多單OI	增減	空單OI	增減	多空淨部位	淨部位變動
生產商	5044	-178	7814	+50	-2770	-228
互換交易	129	-51	0	0	+129	-51
管理基金	2004	+130	467	-100	+1537	+230
其他	1119	+110	824	+233	+295	-123

週五收盤價與13週與52週平均線

— RR — 13週 12.46 — 52週 13.58



淨部位佔總OI% 生產 -28.2% 互換 +1.3% 管理 +15.7% 其他 +3.0%

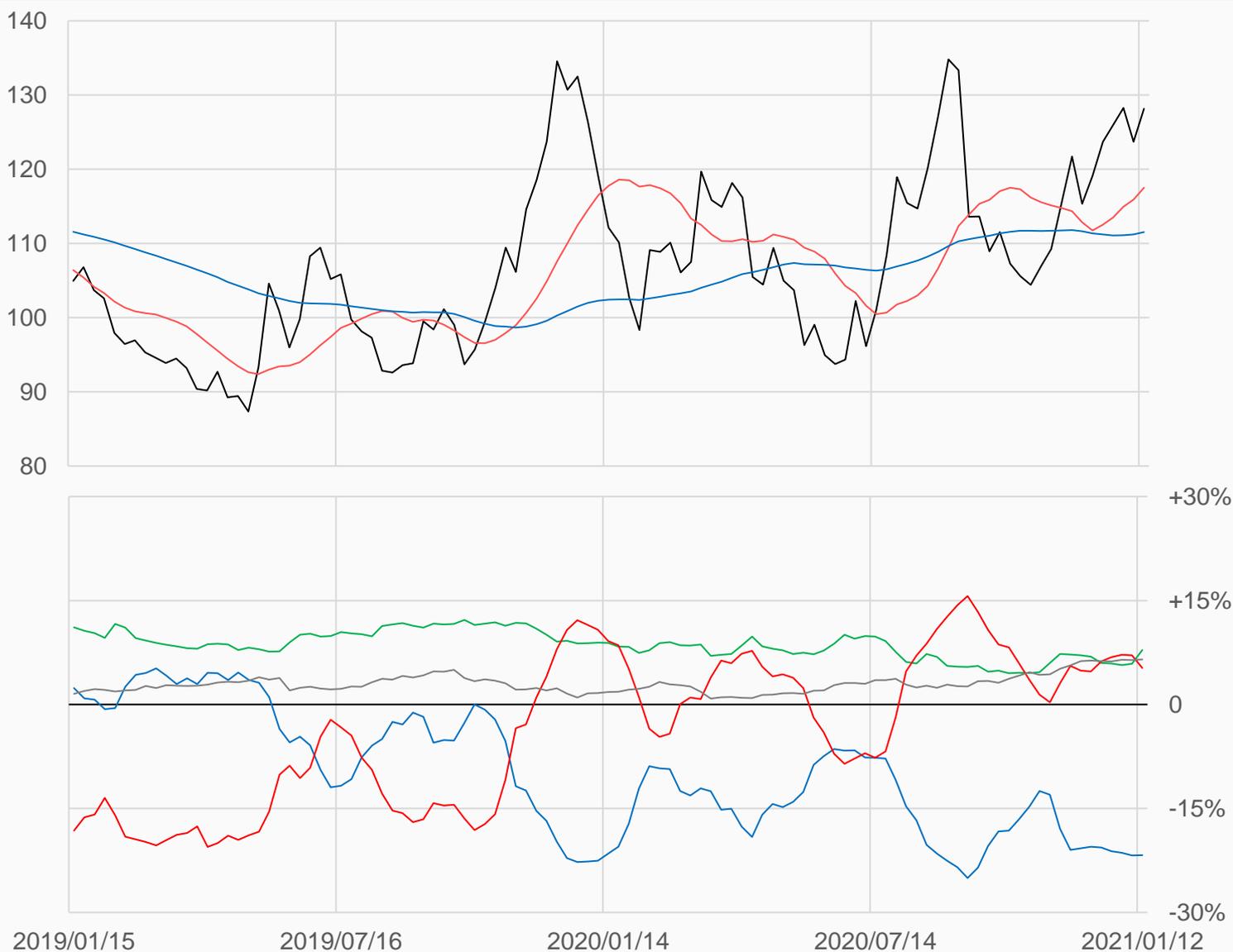
咖啡

可可較前一週上漲11點收在2527點，
管理基金多單減少3854口，空單減少2991口，
淨多單較前一週減少863口至26284口。

數據日期	前期OI	本期OI	增減	增減	週五收盤價	較前週變動
2021/01/12	310911	305452	-5459	-1.76%	128.15	↑ +4.45
分類	多單OI	增減	空單OI	增減	多空淨部位	淨部位變動
生產商	91675	-1831	158090	-3097	-66415	+1266
互換交易	60015	+5417	36020	-277	+23995	+5694
管理基金	66773	-5001	50676	+959	+16097	-5960
其他	72584	-3859	52716	-3782	+19868	-77

週五收盤價與13週與52週平均線

— KC — 13週 117.5 — 52週 111.5



淨部位佔總OI% 生產 -21.7% 互換 +7.9% 管理 +5.3% 其他 +6.5%

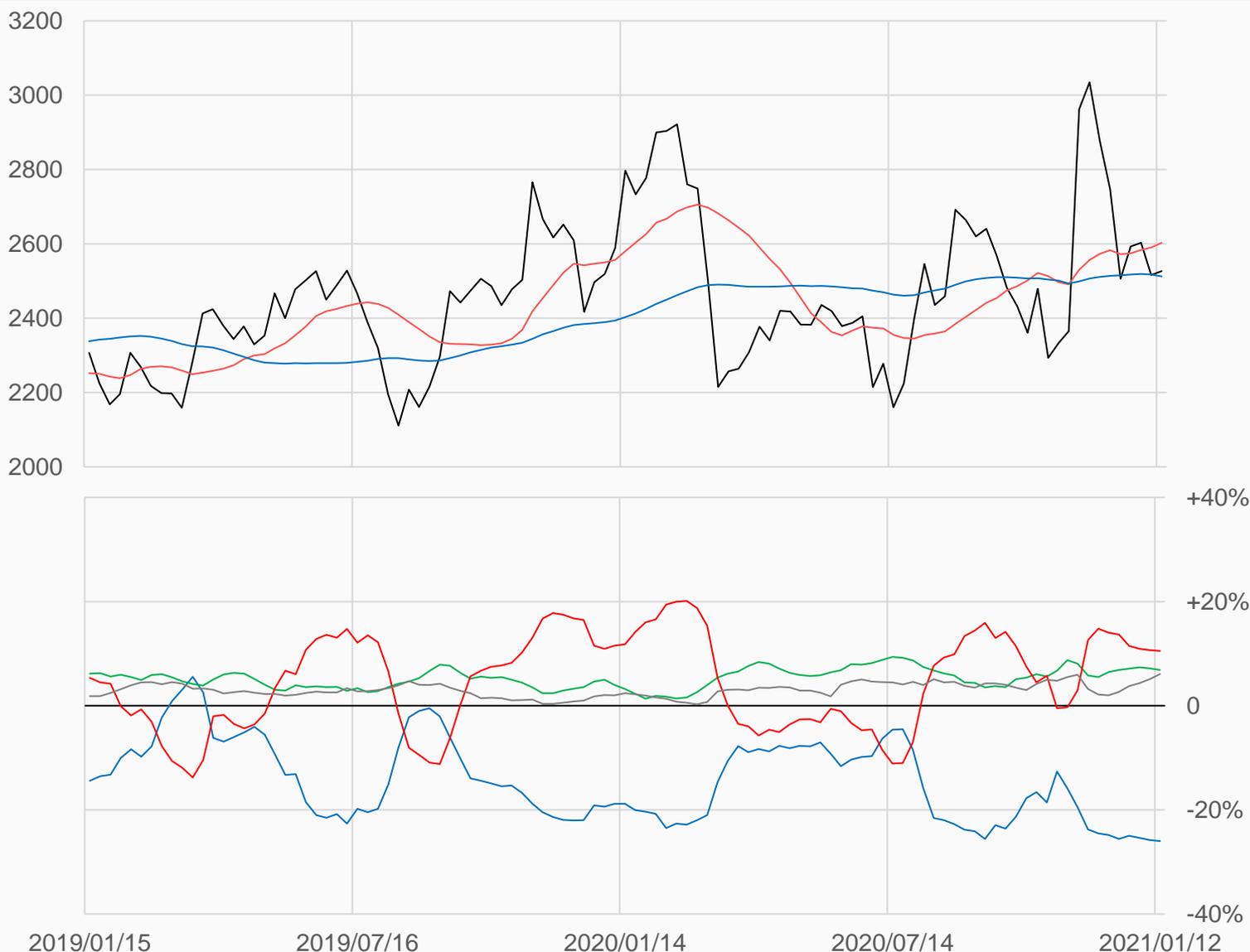
可可

咖啡較前一週上漲4.45點收在128.15點，
管理基金多單減少5001口，空單增加959口，
淨多單較前一週減少5960口至16097口。

數據日期	前期OI	本期OI	增減	增減	週五收盤價	較前週變動
2021/01/12	254195	250130	-4065	-1.60%	2527	↑ +11
分類	多單OI	增減	空單OI	增減	多空淨部位	淨部位變動
生產商	70665	+793	135685	+296	-65020	+497
互換交易	28329	-975	11091	+14	+17238	-989
管理基金	81785	-3854	55501	-2991	+26284	-863
其他	55399	+795	40199	-1475	+15200	+2270

週五收盤價與13週與52週平均線

— CC — 13週 2603 — 52週 2513



淨部位佔總OI% 生產 -26.0% 互換 +6.9% 管理 +10.5% 其他 +6.1%

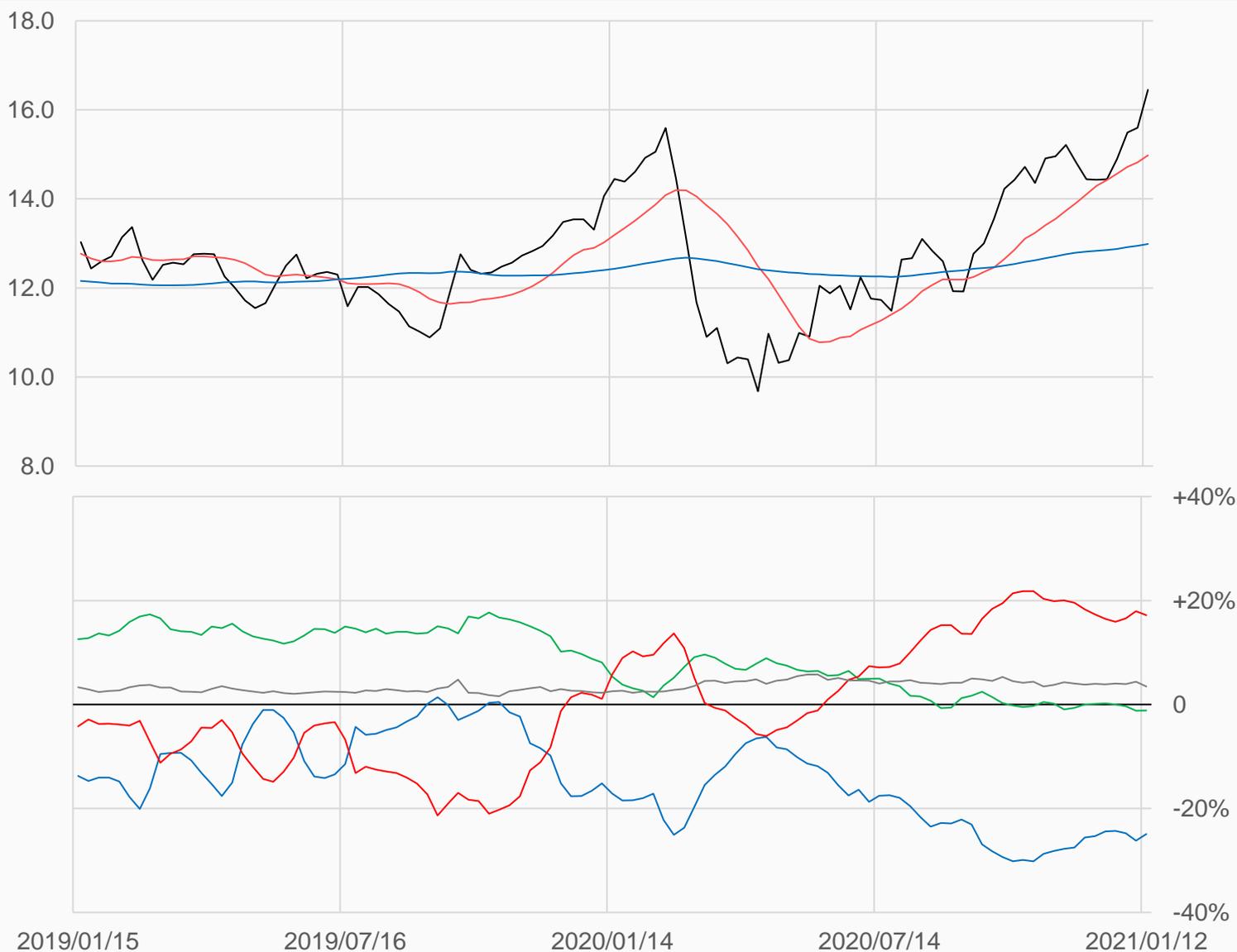
11號糖

11號糖較前一週上漲0.85點收在16.45點，
管理基金多單減少5606口，空單增加4185口，
淨多單較前一週減少9791口至219831口。

數據日期	前期OI	本期OI	增減	增減	週五收盤價	較前週變動
2021/01/12	1279025	1278094	-931	-0.07%	16.45	↑ +0.85
分類	多單OI	增減	空單OI	增減	多空淨部位	淨部位變動
生產商	368228	+15037	686775	-1375	-318547	+16412
互換交易	237960	-3592	252484	-4283	-14524	+691
管理基金	351884	-5606	132053	+4185	+219831	-9791
其他	210211	-7069	165675	+4545	+44536	-11614

週五收盤價與13週與52週平均線

— SB — 13週 14.98 — 52週 12.99



淨部位佔總OI% 生產 -24.9% 互換 -1.1% 管理 +17.2% 其他 +3.5%

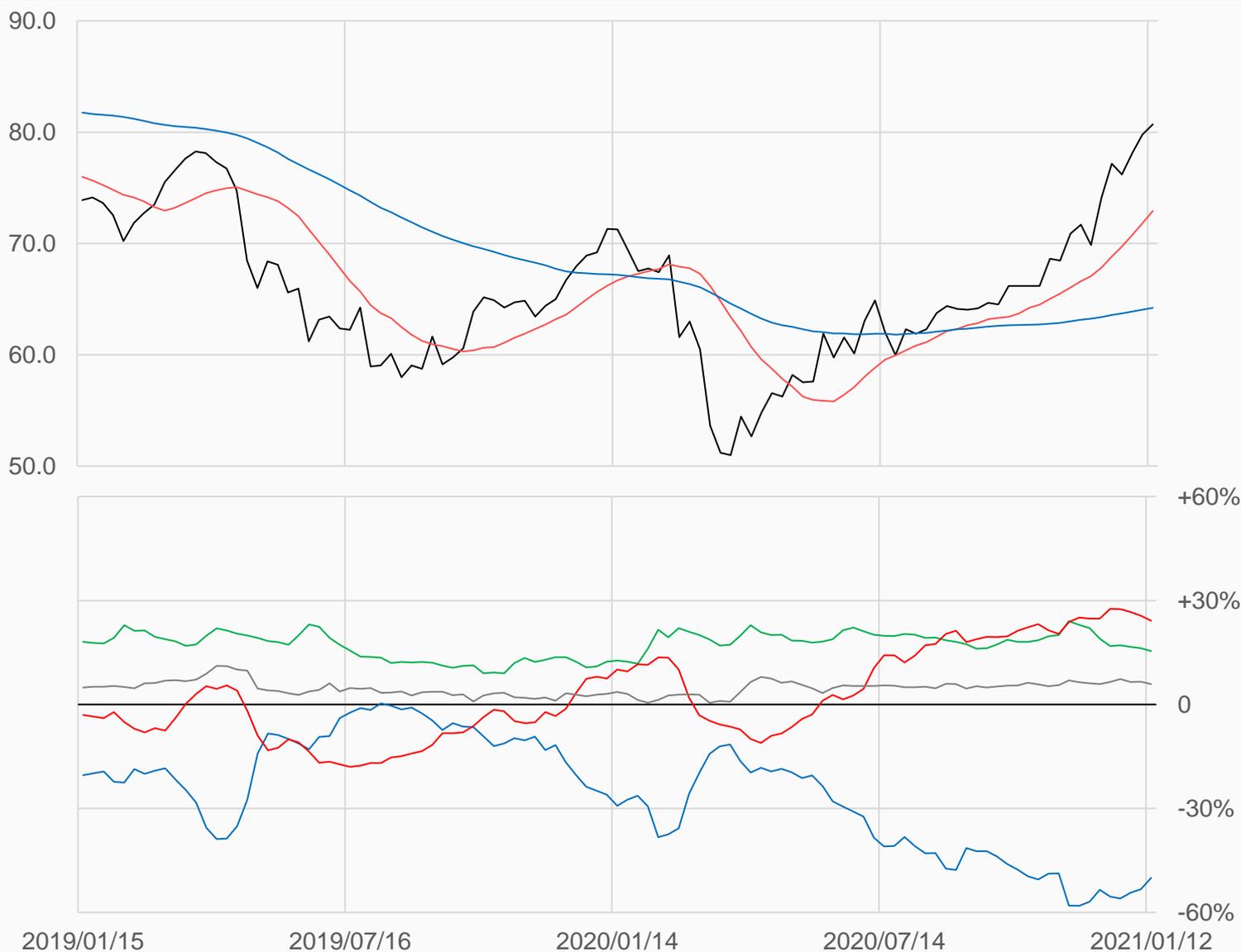
棉花

棉花較前一週上漲0.93點收在80.7點，
管理基金多單增加850口，空單增加1860口，
淨多單較前一週減少1010口至69702口。

數據日期	前期OI	本期OI	增減	增減	週五收盤價	較前週變動
2021/01/12	276018	288080	+12062	+4.37%	80.70	↑ +0.93
分類	多單OI	增減	空單OI	增減	多空淨部位	淨部位變動
生產商	40471	+5190	184648	+2298	-144177	+2892
互換交易	64240	+111	19889	+632	+44351	-521
管理基金	108597	+850	38895	+1860	+69702	-1010
其他	54824	+6173	37759	+7323	+17065	-1150

週五收盤價與13週與52週平均線

— CT — 13週 72.92 — 52週 64.22



淨部位佔總OI% 生產 -50.0% 互換 +15.4% 管理 +24.2% 其他 +5.9%