

CFTC 大額交易人持倉報告

永豐期貨顧問事業部編製

2024/1/2

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 | 111年金管期總字第007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 2023/12/26

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	98527	-1826	+5139	-912	+5.22%
	VX	345802	-78370	-26892	-22441	-7.78%
	ES	3136144	-46504	-373928	-58630	-11.92%
	NQ	314930	-1251	-44272	-619	-14.06%
債券	30年債	1525489	-45128	-359530	-14553	-23.57%
	10年債	5244731	-306981	-1426378	-25154	-27.20%
	5年債	5996860	-35412	-1968124	+7591	-32.82%
	2年債	3789462	-87478	-1527754	-4904	-40.32%
外匯	英鎊	206688	-2359	+26126	-3824	+12.64%
	美元	22071	+302	+1310	+1256	+5.94%
	綜美(含美)	1103038	+7280	+43728	-1466	+3.96%
	綜美(未含)	1080967	+6978	+42418	-2721	+3.92%
	瑞郎	51736	+2415	+2002	+1969	+3.87%
	紐幣	34914	+1259	+584	-1877	+1.67%
	歐元	795049	+8192	-22644	+3184	-2.85%
	澳幣	163556	+6294	-10892	-13257	-6.66%
	日圓	226562	+3012	-61543	+709	-27.16%
加幣	191343	-35849	-53888	-1916	-28.16%	

金融類投機部位每週變動表

數據日期 2023/12/26

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	74614	-4198	+16853	+5037	+22.59%
	黃金	685284	-16893	+135507	+3757	+19.77%
	白銀	150121	-4223	+17022	+799	+11.34%
	銅	204082	-4654	+14956	-1258	+7.33%
能源	無鉛汽油	333819	-15074	+67825	-1023	+20.32%
	輕原油	2016183	-21752	+125199	+15476	+6.21%
	熱燃油	306884	-14608	+18749	+931	+6.11%
	天然氣	1366555	-38837	-104762	+15695	-7.67%
肉類	活牛	374376	+547	+16902	+18	+4.51%
	活豬	281471	+12850	-5995	+2311	-2.13%
農產	粗米	12063	-499	+3886	+269	+32.21%
	黃豆粉	508260	-55976	+59233	-15623	+11.65%
	黃豆	752705	-74414	+4767	-5499	+0.63%
	黃豆油	504227	-3175	-49653	-17718	-9.85%
	玉米	1533323	-8327	-177626	+3098	-11.58%
	小麥	412546	+306	-59559	+5473	-14.44%
軟性	咖啡	269951	-701	+39761	-181	+14.73%
	可可	443406	+11100	+61722	-3345	+13.92%
	11號糖	1082449	+38927	+22160	-12475	+2.05%
	棉花	225710	+2237	-3847	-5099	-1.70%

mini 道瓊

mini道瓊較前一週上漲272點收在38012點，
 槓桿基金多單減少1367口，空單減少455口，
 淨多單較前一週減少15.07%或912口至5139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
2023/12/26	100353	98527	-1826	-1.82%	38012	↑ +272
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	31718	+749	58830	+5512	-27112	-4763
資產管理	27636	-935	4664	-970	+22972	+35
槓桿基金	23899	-1367	18760	-455	+5139	-912
其他	1527	+7	3849	-3813	-2322	+3820

週五收盤價與13週與52週平均線

— YM — 13週 35187 — 52週 34288



淨部位佔總OI% 經紀 -27.5% 資管 +23.3% 槓桿 +5.2% 其他 -2.4%

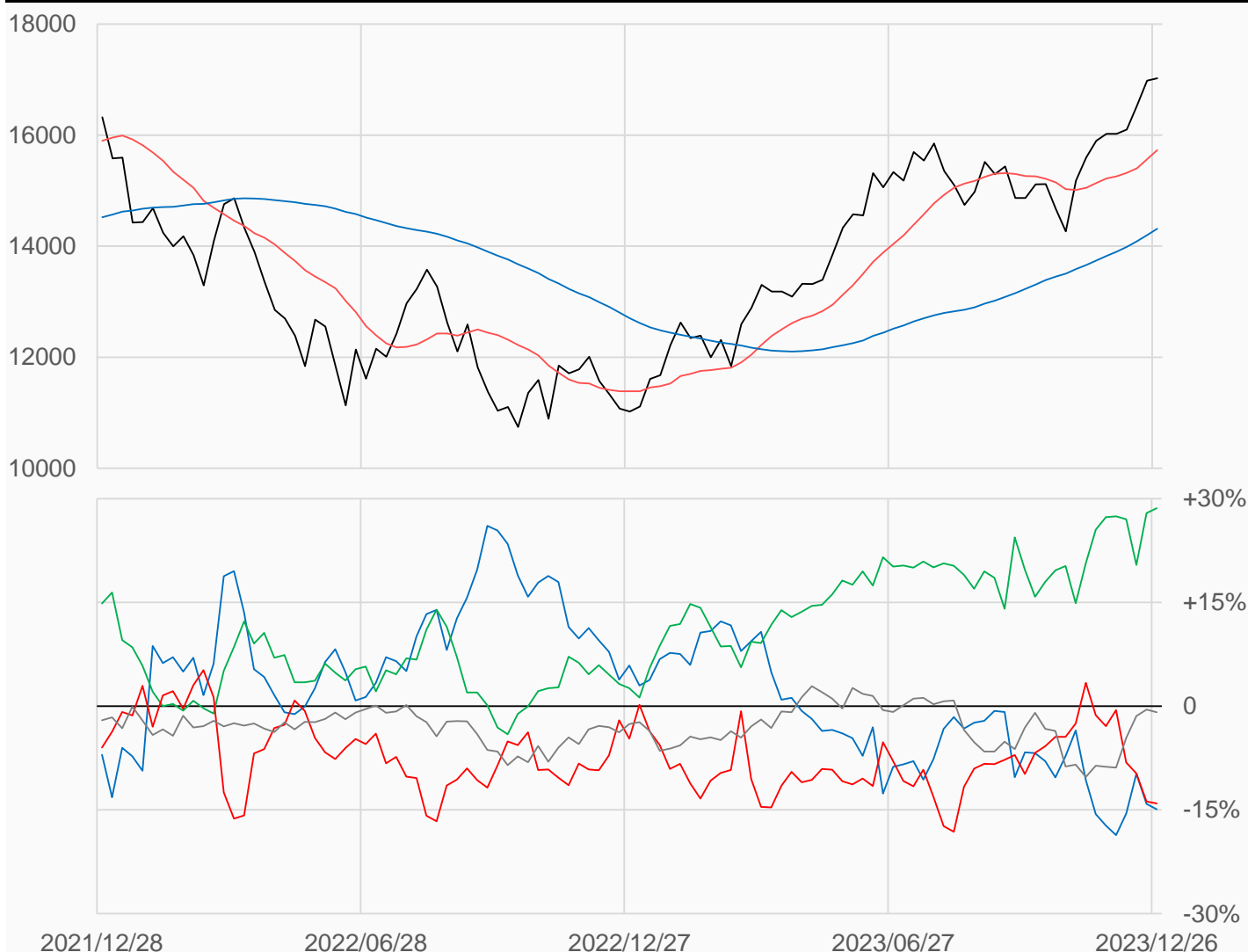
mini NQ

miniNQ較前一週上漲43.5點收在17023.5點，
 槓桿基金多單減少465口，空單增加154口，
 淨空單較前一週增加619口至44272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
2023/12/26	316181	314930	-1251	-0.40%	17023.50	↑ +43.50
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	71942	+79	118959	+2401	-47017	-2322
資產管理	115694	+785	25533	-1088	+90161	+1873
槓桿基金	74433	-465	118705	+154	-44272	-619
其他	10123	-2787	12920	-1513	-2797	-1274

週五收盤價與13週與52週平均線

— NQ — 13週 15731 — 52週 14315



淨部位佔總OI% 經紀 -14.9% 資管 +28.6% 槓桿 -14.1% 其他 -0.9%

mini S&P

miniS&P較前一週上漲14.75點收在4820點，
 槓桿基金多單減少50649口，空單增加7982口，
 淨空單較前一週增加58631口至373928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
2023/12/26	3182648	3136144	-46504	-1.46%	4820.00	↑ +14.75
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	500931	+30276	1000747	+15410	-499816	+14866
資產管理	1320107	-27255	450099	-22216	+870008	-5039
槓桿基金	894102	-50649	1268030	+7982	-373928	-58631
其他	111604	+9985	172454	-39532	-60850	+49517

週五收盤價與13週與52週平均線

— ES — 13週 4501.2 — 52週 4311.5



淨部位佔總OI% 經紀 -15.9% 資管 +27.7% 槓桿 -11.9% 其他 -1.9%

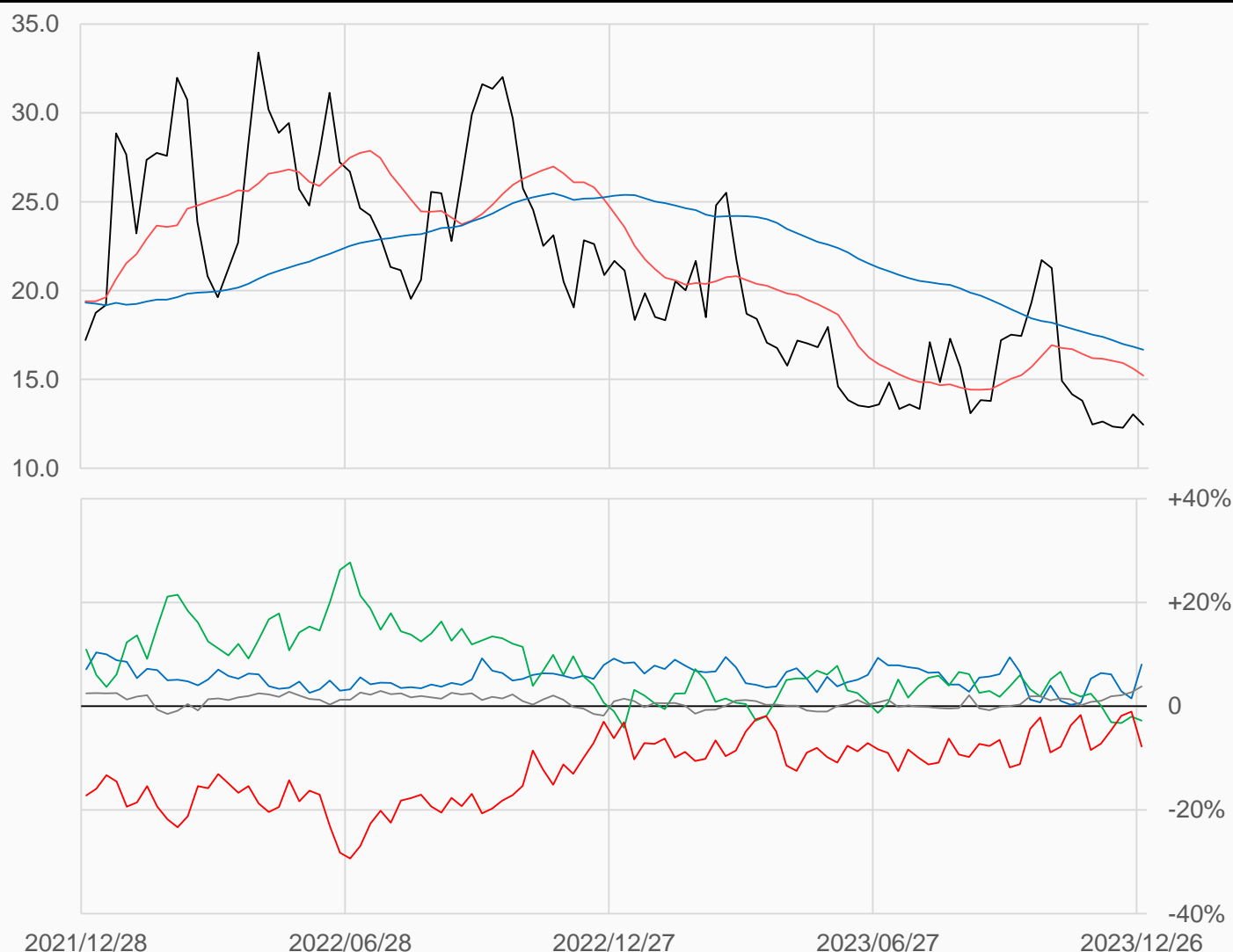
VIX

VIX較前一週下跌0.58點收在12.45點，
槓桿基金多單減少51450口，空單減少29009口，
淨空單較前一週增加22441口至26892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
2023/12/26	424172	345802	-78370	-18.48%	12.45	↓ -0.58
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	76631	-7096	48921	-28438	+27710	+21342
資產管理	111160	-14930	120885	-13788	-9725	-1142
槓桿基金	103703	-51450	130595	-29009	-26892	-22441
其他	29058	-4360	15899	-6118	+13159	+1758

週五收盤價與13週與52週平均線

— VX — 13週 15.218 — 52週 16.672



淨部位佔總OI% 經紀 +8.0% 資管 -2.8% 槓桿 -7.8% 其他 +3.8%

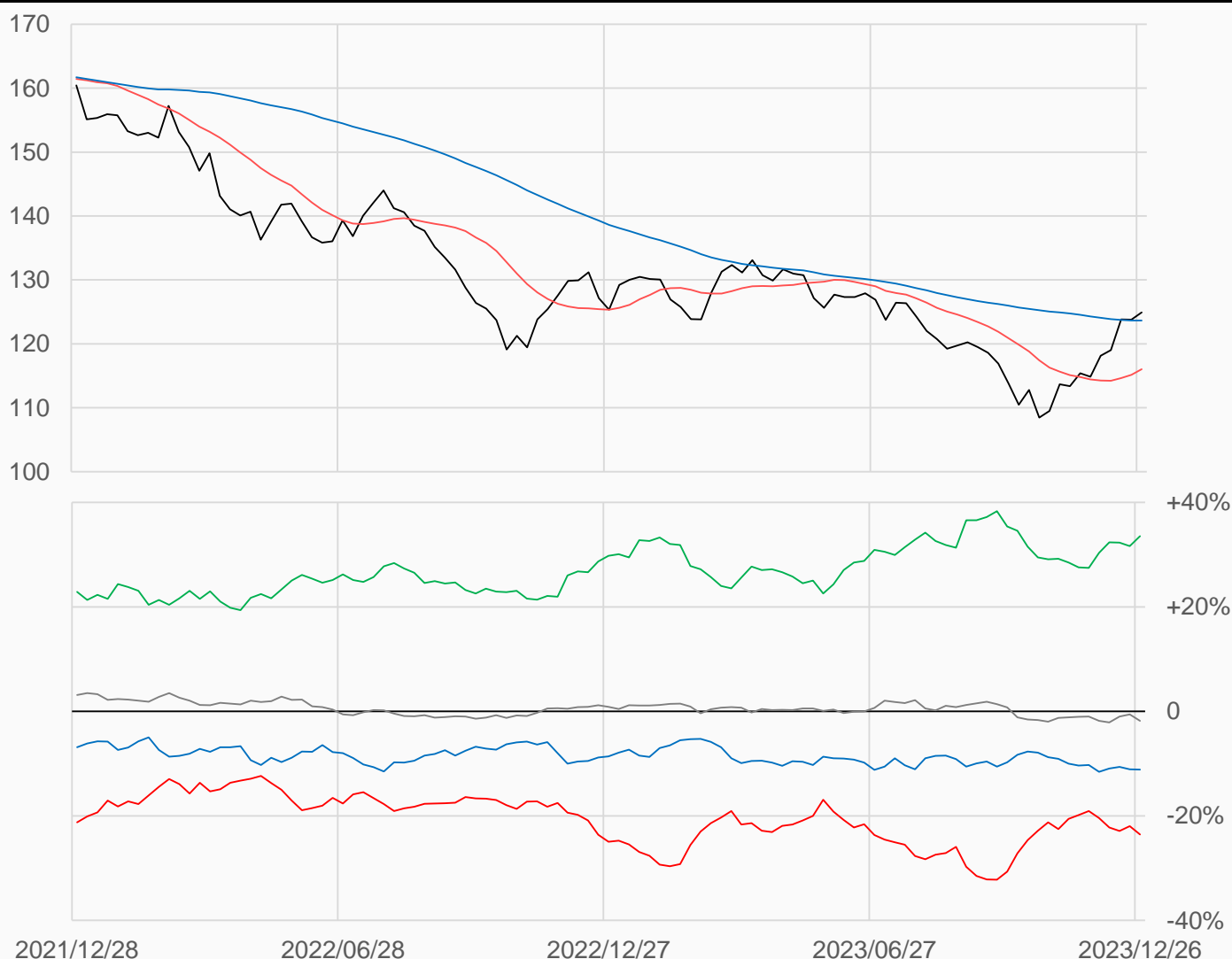
30年債

美國30年公債較前一週上漲1.1563點收在124.9375點，
 槓桿基金多單減少13614口，空單增加938口，
 淨空單較前一週增加14552口至359530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
2023/12/26	1570617	1525489	-45128	-2.87%	124 30/32	↑ +1 5/32
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	60060	-5156	230191	-9336	-170131	+4180
資產管理	969936	-4843	458517	-19271	+511419	+14428
槓桿基金	193857	-13614	553387	+938	-359530	-14552
其他	102036	-2638	129429	+15284	-27393	-17922

週五收盤價與13週與52週平均線

— US — 13週 116.02 — 52週 123.65



淨部位佔總OI% 經紀 -11.2% 資管 +33.5% 槓桿 -23.6% 其他 -1.8%

10年債

美國10年公債較前一週上漲0.2969點收在112.890625點，
 槓桿基金多單減少147898口，空單減少122744口，
 淨空單較前一週增加25154口至1426378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
2023/12/26	5551712	5244731	-306981	-5.53%	112 57/64	↑ + 19/64
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	370757	-64238	568064	-58890	-197307	-5348
資產管理	3112936	-62818	1829923	-112169	+1283013	+49351
槓桿基金	773156	-147898	2199534	-122744	-1426378	-25154
其他	542110	-48521	278937	+2974	+263173	-51495

週五收盤價與13週與52週平均線

— TY — 13週 109.06 — 52週 111.72



淨部位佔總OI% 經紀 -3.8% 資管 +24.5% 槓桿 -27.2% 其他 +5.0%

5年公債

美國5年公債較前一週上漲0.4297點收在108.671875點。

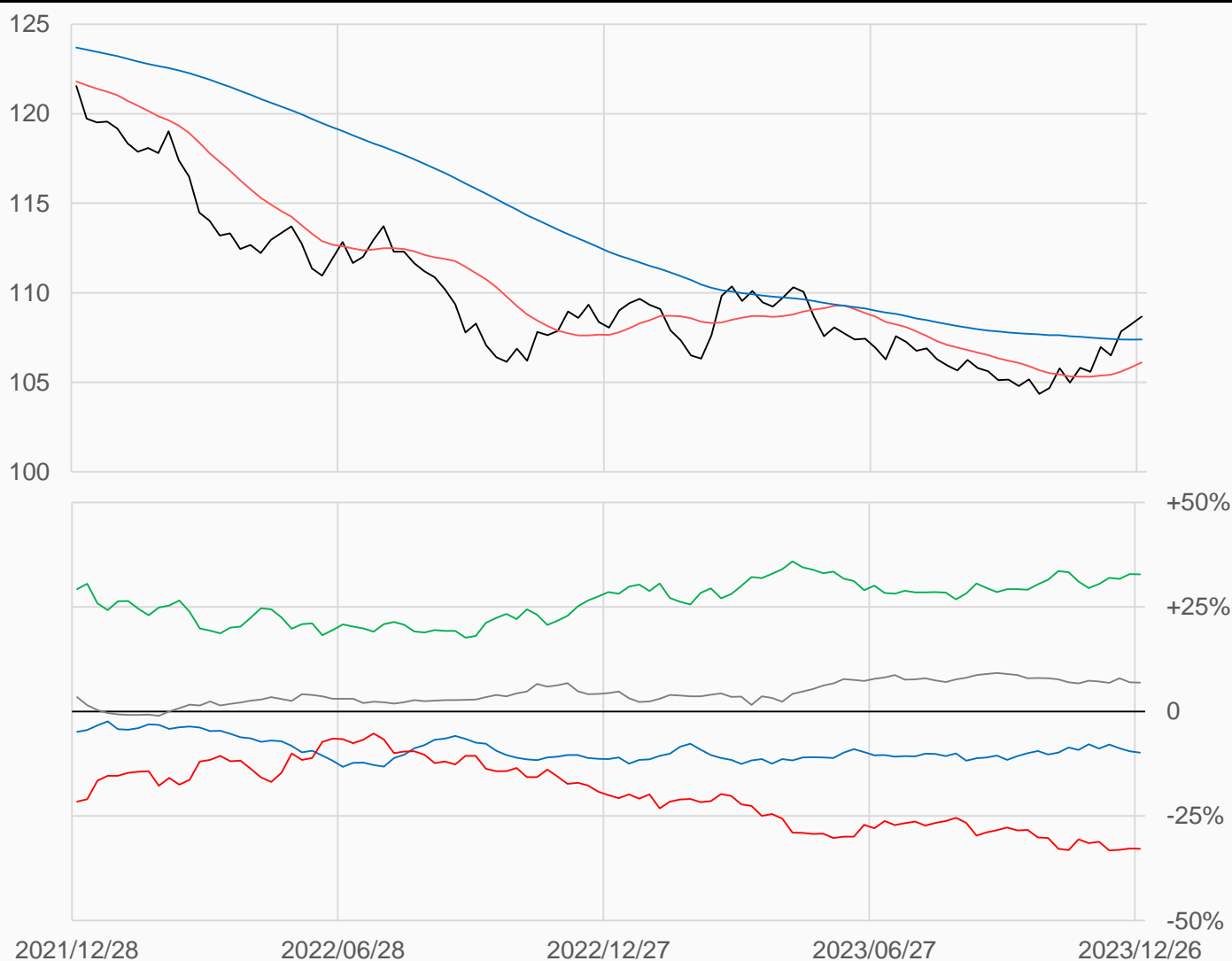
槓桿基金多單減少42757口，空單減少50346口，

淨空單較前一週減少7589口至1968124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
2023/12/26	6032272	5996860	-35412	-0.59%	108 86/128	↑ + 55/128
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	197893	+6662	787520	+21843	-589627	-15181
資產管理	3684476	-8309	1714799	+4681	+1969677	-12990
槓桿基金	1105023	-42757	3073147	-50346	-1968124	+7589
其他	554186	-7753	140567	+1458	+413619	-9211

週五收盤價與13週與52週平均線

— FV — 13週 106.11 — 52週 107.4



淨部位佔總OI% 經紀 -9.8% 資管 +32.8% 槓桿 -32.8% 其他 +6.9%

2年公債

美國2年公債較前一週上漲0.0156點收在102.8046875點，

槓桿基金多單減少63482口，空單減少58578口，

淨空單較前一週增加4904口至1527754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
2023/12/26	3876940	3789462	-87478	-2.26%	102 103/128	↑ + 2/128
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	132063	-6301	345462	+4288	-213399	-10589
資產管理	2002640	+7102	781536	-8276	+1221104	+15378
槓桿基金	845403	-63482	2373157	-58578	-1527754	-4904
其他	543226	-7504	159629	-4535	+383597	-2969

週五收盤價與13週與52週平均線

— TU — 13週 101.76 — 52週 102.11



淨部位佔總OI% 經紀 -5.6% 資管 +32.2% 槓桿 -40.3% 其他 +10.1%

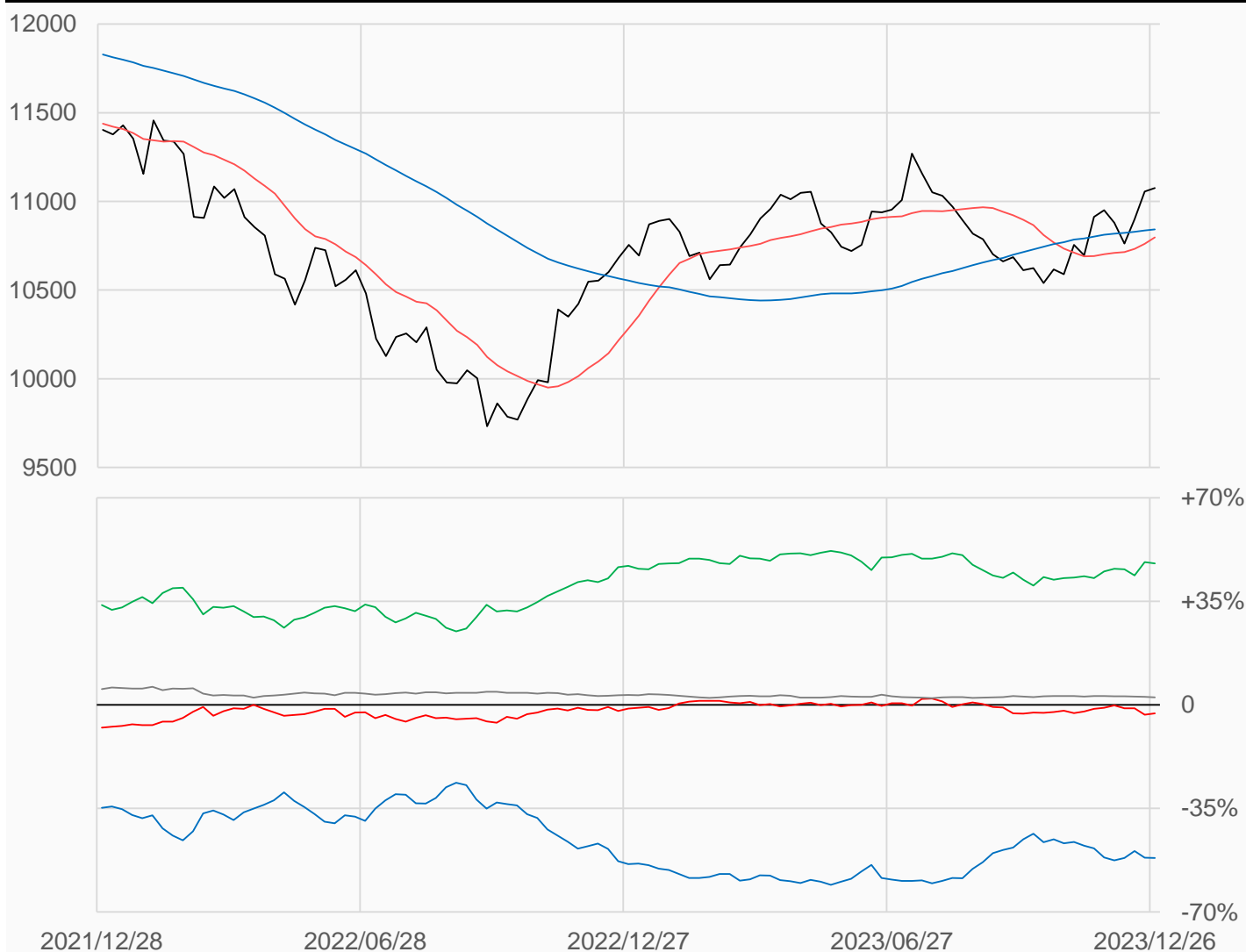
歐元

歐元較前一週上漲20點收在11075點，
 槓桿基金多單增加8165口，空單增加4981口，
 淨空單較前一週減少3184口至22644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
2023/12/26	786857	795049	+8192	+1.04%	11075.0	↑ +20.0
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	40670	+174	452486	+5493	-411816	-5319
資產管理	506824	+615	126425	-172	+380399	+787
槓桿基金	128998	+8165	151642	+4981	-22644	+3184
其他	33780	-1839	13521	-535	+20259	-1304

週五收盤價與13週與52週平均線

— EC — 13週 10796 — 52週 10841



淨部位佔總OI% 經紀 -51.8% 資管 +47.8% 槓桿 -2.8% 其他 +2.5%

日圓

日圓較前一週上漲60.5點收在7176點，
 槓桿基金多單增加2997口，空單增加2289口，
 淨空單較前一週減少708口至61543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
2023/12/26	223550	226562	+3012	+1.35%	7176.0	↑ +60.5
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	39170	-1905	11833	+3312	+27337	-5217
資產管理	72459	+1606	54750	-2399	+17709	+4005
槓桿基金	59624	+2997	121167	+2289	-61543	+708
其他	13951	+819	1435	+283	+12516	+536

週五收盤價與13週與52週平均線

— JY — 13週 6835.5 — 52週 7176.6



淨部位佔總OI% 經紀 +12.1% 資管 +7.8% 槓桿 -27.2% 其他 +5.5%

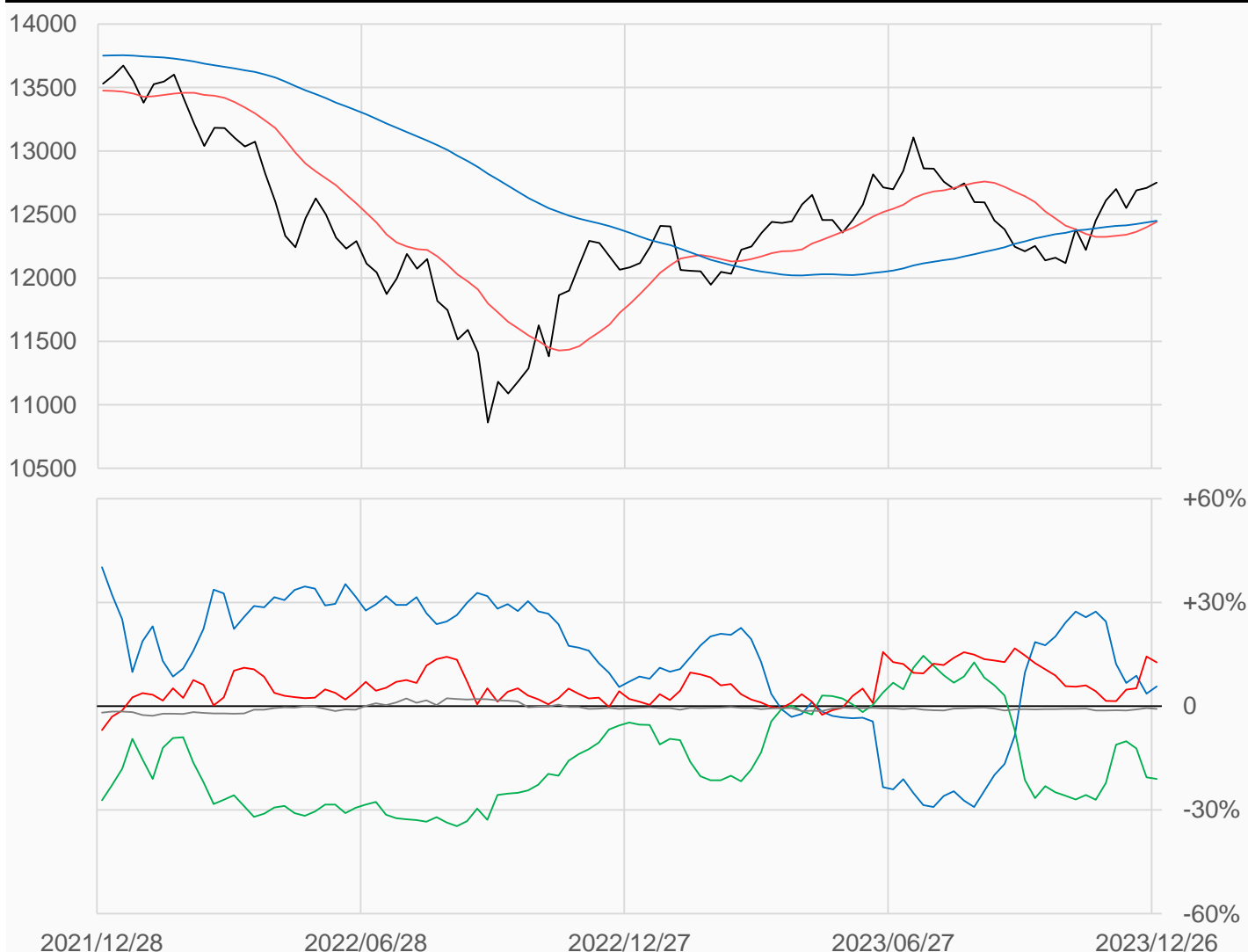
英鎊

英鎊較前一週上漲42點收在12751點，
 槓桿基金多單減少3185口，空單增加638口，
 淨多單較前一週減少3823口至26126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
2023/12/26	209047	206688	-2359	-1.13%	12751	↑ +42
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	38011	+4804	26210	+526	+11801	+4278
資產管理	49550	-5595	92999	-5125	-43449	-470
槓桿基金	85361	-3185	59235	+638	+26126	-3823
其他	1131	-471	2730	+9	-1599	-480

週五收盤價與13週與52週平均線

— BP — 13週 12441 — 52週 12450



淨部位佔總OI% 經紀 +5.7% 資管 -21.0% 槓桿 +12.6% 其他 -0.8%

瑞郎

瑞郎較前一週上漲193點收在11980點，
 槓桿基金多單增加1668口，空單減少301口，
 淨多單較前一週增加1969口至2002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
2023/12/26	49321	51736	+2415	+4.90%	11980	↑ +193
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	11609	-406	9106	+2823	+2503	-3229
資產管理	12584	+218	16030	-22	-3446	+240
槓桿基金	11779	+1668	9777	-301	+2002	+1969
其他	1616	+263	551	+120	+1065	+143

週五收盤價與13週與52週平均線

— SF — 13週 11372 — 52週 11195



淨部位佔總OI% 經紀 +4.8% 資管 -6.7% 槓桿 +3.9% 其他 +2.1%

加幣

加幣較前一週上漲11點收在7562.5點，
 槓桿基金多單增加2723口，空單增加4640口，
 淨空單較前一週增加1917口至53888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
2023/12/26	227192	191343	-35849	-15.78%	7562.5	↑ +11.0
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	59046	-53526	22408	-22612	+36638	-30914
資產管理	54706	+11571	55861	-14569	-1155	+26140
槓桿基金	30793	+2723	84681	+4640	-53888	-1917
其他	10363	-34	3295	+434	+7068	-468

週五收盤價與13週與52週平均線

— CD — 13週 7365.3 — 52週 7418.6



淨部位佔總OI% 經紀 +19.1% 資管 -0.6% 槓桿 -28.2% 其他 +3.7%

澳幣

澳幣較前一週上漲10點收在6830.5點，
 槓桿基金多單增加154口，空單增加13411口，
 淨空單較前一週增加13257口至10892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
2023/12/26	157262	163556	+6294	+4.00%	6830.5	↑ +10
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	57995	-2320	7501	+4270	+50494	-6590
資產管理	38686	+3626	92796	-7155	-54110	+10781
槓桿基金	31187	+154	42079	+13411	-10892	-13257
其他	7435	+4436	713	-628	+6722	+5064

週五收盤價與13週與52週平均線

— AD — 13週 6539.1 — 52週 6652.4



淨部位佔總OI% 經紀 +30.9% 資管 -33.1% 槓桿 -6.7% 其他 +4.1%

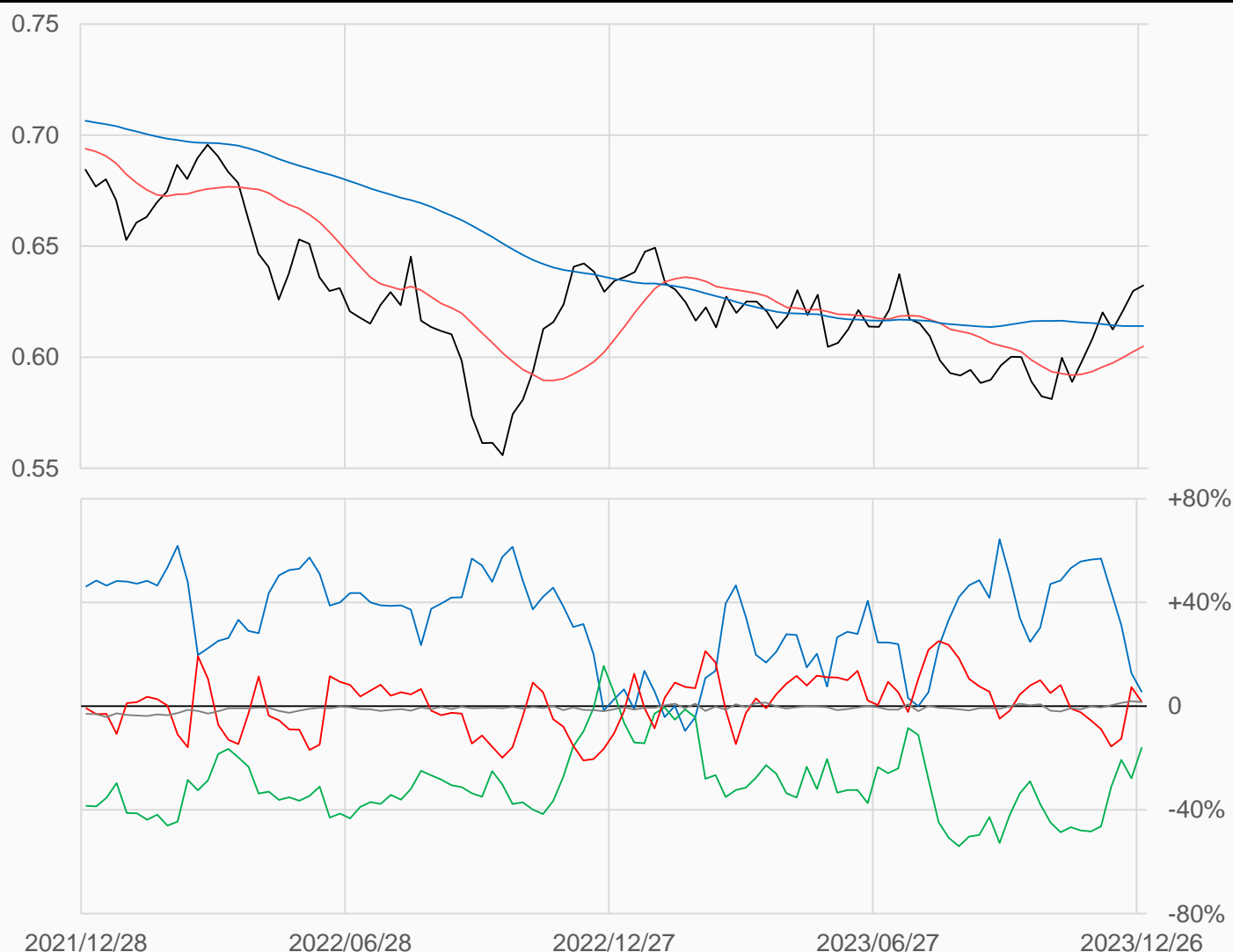
紐幣

紐幣較前一週上漲0.0025點收在0.6323點，
 槓桿基金多單減少604口，空單增加1273口，
 淨多單較前一週減少1877口至584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
2023/12/26	33655	34914	+1259	+3.74%	0.6323	▲ +0.0025
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	5577	-62	3621	+2258	+1956	-2320
資產管理	13054	+1821	18656	-1933	-5602	+3754
槓桿基金	10234	-604	9650	+1273	+584	-1877
其他	867	-248	330	-138	+537	-110

週五收盤價與13週與52週平均線

— NE — 13週 0.6049 — 52週 0.614



淨部位佔總OI% 經紀 +5.6% 資管 -16.0% 槓桿 +1.7% 其他 +1.5%

美元

美元較前一週下跌0.309點收在101.029點，
 槓桿基金多單增加1433口，空單增加178口，
 淨多單較前一週增加1255口至1310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
2023/12/26	21769	22071	+302	+1.39%	101.029	↓ -0.309
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	0	0	4243	-228	-4243	+228
資產管理	7287	-1531	2603	+317	+4684	-1848
槓桿基金	11336	+1433	10026	+178	+1310	+1255
其他	1049	+253	1847	-284	-798	+537

週五收盤價與13週與52週平均線

— DX — 13週 104.18 — 52週 103.25



淨部位佔總OI% 經紀 -19.2% 資管 +21.2% 槓桿 +5.9% 其他 -3.6%

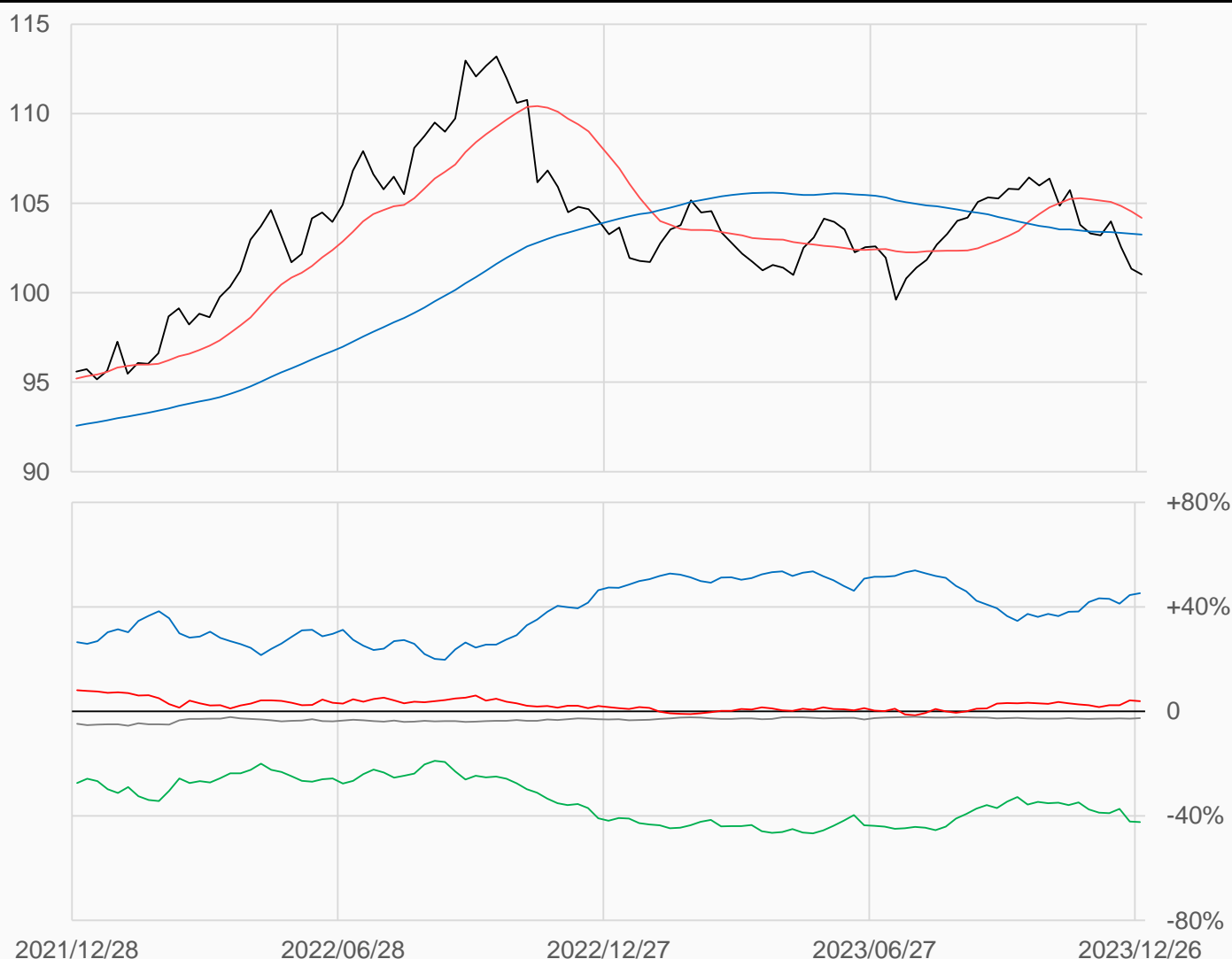
綜合美元 (不含美元)

綜合美元較前一週下跌0.309點收在101.029點，
槓桿基金多單增加7773口，空單增加10494口，
淨多單較前一週減少2721口至42418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
2023/12/26	1073989	1080967	+6978	+0.65%	101.029	↓ -0.309
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	562233.6	+5501	73394.43	-5162	+488839	+10663
資產管理	191491.5	-3372	649900.6	+1614	-458409	-4987
槓桿基金	231006.8	+7773	188589.2	+10494	+42418	-2721
其他	17642.25	-571	45861.23	-1920	-28219	+1349

週五收盤價與13週與52週平均線

— DXY — 13週 104.18 — 52週 103.25



淨部位佔總OI% 經紀 +45.2% 資管 -42.4% 槓桿 +3.9% 其他 -2.6%

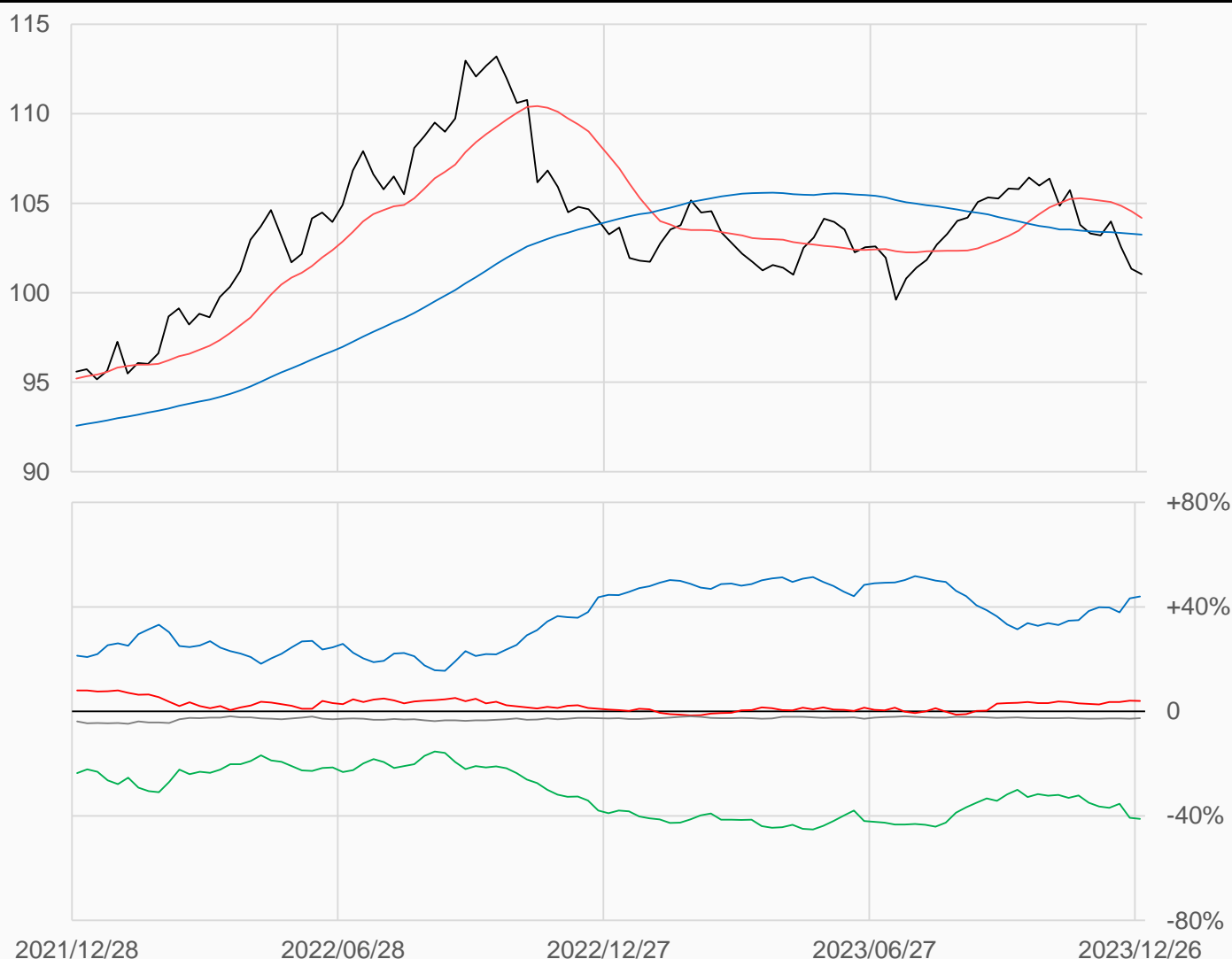
綜合美元 (含美元)

綜合美元較前一週下跌0.309點收在101.029點，
槓桿基金多單增加9206口，空單增加10672口，
淨多單較前一週減少1466口至43728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
2023/12/26	1095758	1103038	+7280	+0.66%	101.029	↓ -0.309
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	562233.6	+5501	77637.43	-5390	+484596	+10891
資產管理	198778.5	-4903	652503.6	+1931	-453725	-6835
槓桿基金	242342.8	+9206	198615.2	+10672	+43728	-1466
其他	18691.25	-318	47708.23	-2204	-29017	+1886

週五收盤價與13週與52週平均線

— DXX — 13週 104.18 — 52週 103.25



淨部位佔總OI% 經紀 +43.9% 資管 -41.1% 槓桿 +4.0% 其他 -2.6%

黃金

黃金較前一週上漲5.3點收在2062.4點，
管理基金多單增加155口，空單減少3603口，
淨多單較前一週增加3758口至135507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
2023/12/26	702177	685284	-16893	-2.41%	2062.4	↑ +5.3
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	22405	-4034	67270	-4003	-44865	-31
互換交易	128234	-4743	326384	+2766	-198150	-7509
管理基金	231319	+155	95812	-3603	+135507	+3758
其他	249301	-7885	167001	-13039	+82300	+5154

週五收盤價與13週與52週平均線

— GC — 13週 1988.2 — 52週 1945.3



淨部位佔總OI% 生產 -6.5% 互換 -28.9% 管理 +19.8% 其他 +12.0%

白銀

白銀較前一週下跌43.7點收在2385.3點，
管理基金多單增加375口，空單減少425口，
淨多單較前一週增加800口至17022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
2023/12/26	154345	150121	-4224	-2.74%	2385.3	↓ -43.7
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	5950	+51	42125	+540	-36175	-489
互換交易	35619	-1263	50844	+1091	-15225	-2354
管理基金	44620	+375	27598	-425	+17022	+800
其他	30398	-4068	17442	-4279	+12956	+211

週五收盤價與13週與52週平均線

— SI — 13週 2341.7 — 52週 2344



淨部位佔總OI% 生產 -24.1% 互換 -10.1% 管理 +11.3% 其他 +8.6%

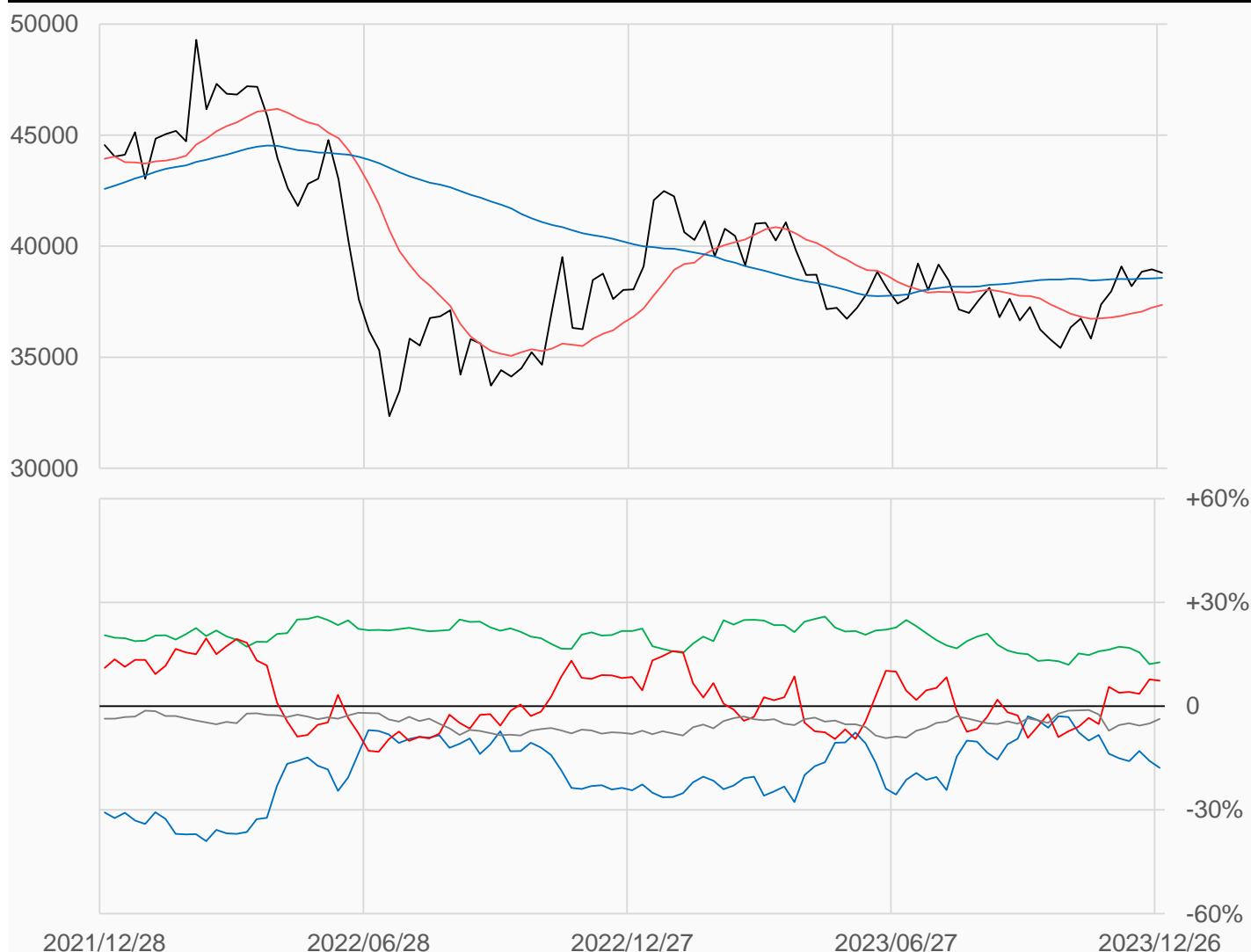
銅

銅較前一週下跌150點收在38805點，
 管理基金多單增加598口，空單增加1856口，
 淨多單較前一週減少1258口至14956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
2023/12/26	208736	204082	-4654	-2.23%	38805	↓ -150
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	21360	-454	57723	+2866	-36363	-3320
互換交易	47932	+176	21969	-413	+25963	+589
管理基金	89882	+598	74926	+1856	+14956	-1258
其他	29054	-1353	36572	-4335	-7518	+2982

週五收盤價與13週與52週平均線

— HG — 13週 37356 — 52週 38565



淨部位佔總OI% 生產 -17.8% 互換 +12.7% 管理 +7.3% 其他 -3.7%

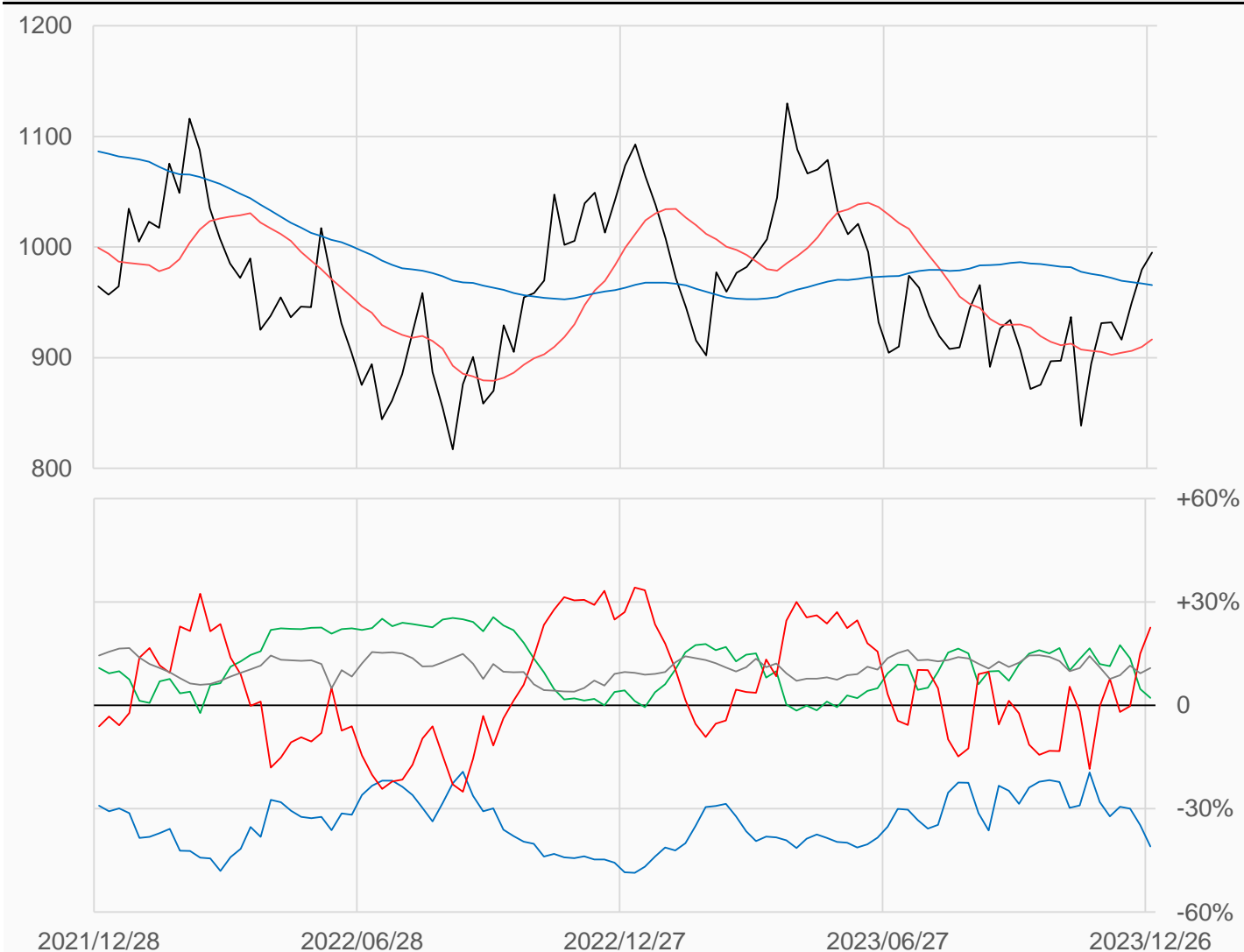
白金

白金較前一週上漲15.5點收在995點，
管理基金多單增加1632口，空單減少3405口，
淨多單較前一週增加5037口至16853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
2023/12/26	78812	74614	-4198	-5.33%	995.0	↑ +15.5
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	2916	-1330	33457	+1798	-30541	-3128
互換交易	14467	-2802	12873	-673	+1594	-2129
管理基金	36335	+1632	19482	-3405	+16853	+5037
其他	13365	-1219	5308	-1987	+8057	+768

週五收盤價與13週與52週平均線

— PL — 13週 916.51 — 52週 965.6



淨部位佔總OI% 生產 -40.9% 互換 +2.1% 管理 +22.6% 其他 +10.8%

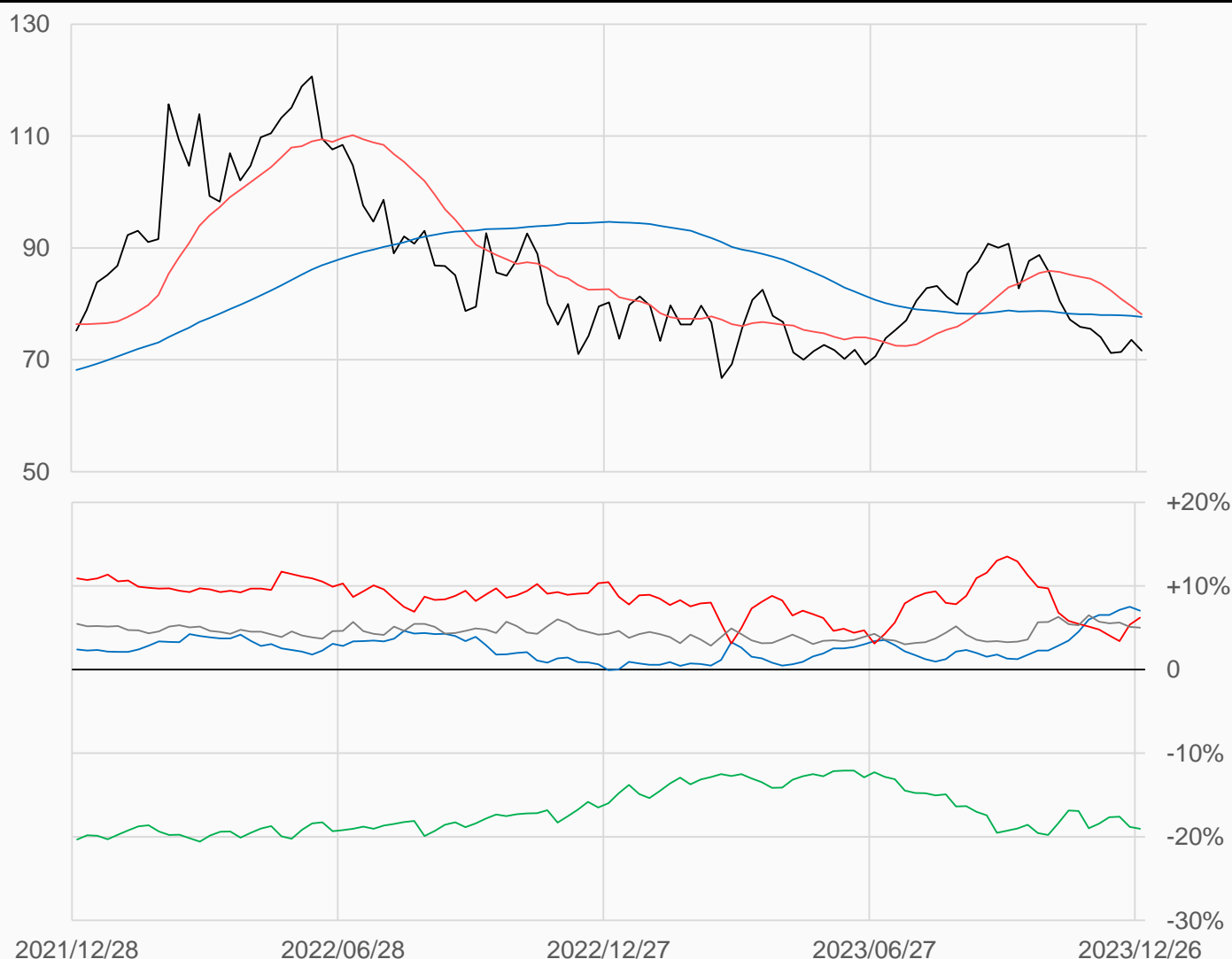
輕原油

輕原油較前一週下跌1.91點收在71.65點，
管理基金多單減少3947口，空單減少19423口，
淨多單較前一週增加15476口至125199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
2023/12/26	2037935	2016183	-21752	-1.07%	71.65	↓ -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	507773	-571	365555	+10231	+142218	-10802
互換交易	228041	-254	611889	+254	-383848	-508
管理基金	619384	-3947	494185	-19423	+125199	+15476
其他	581083	-1121	480010	+1743	+101073	-2864

週五收盤價與13週與52週平均線

— CL — 13週 78.14 — 52週 77.69



淨部位佔總OI% 生產 +7.1% 互換 -19.0% 管理 +6.2% 其他 +5.0%

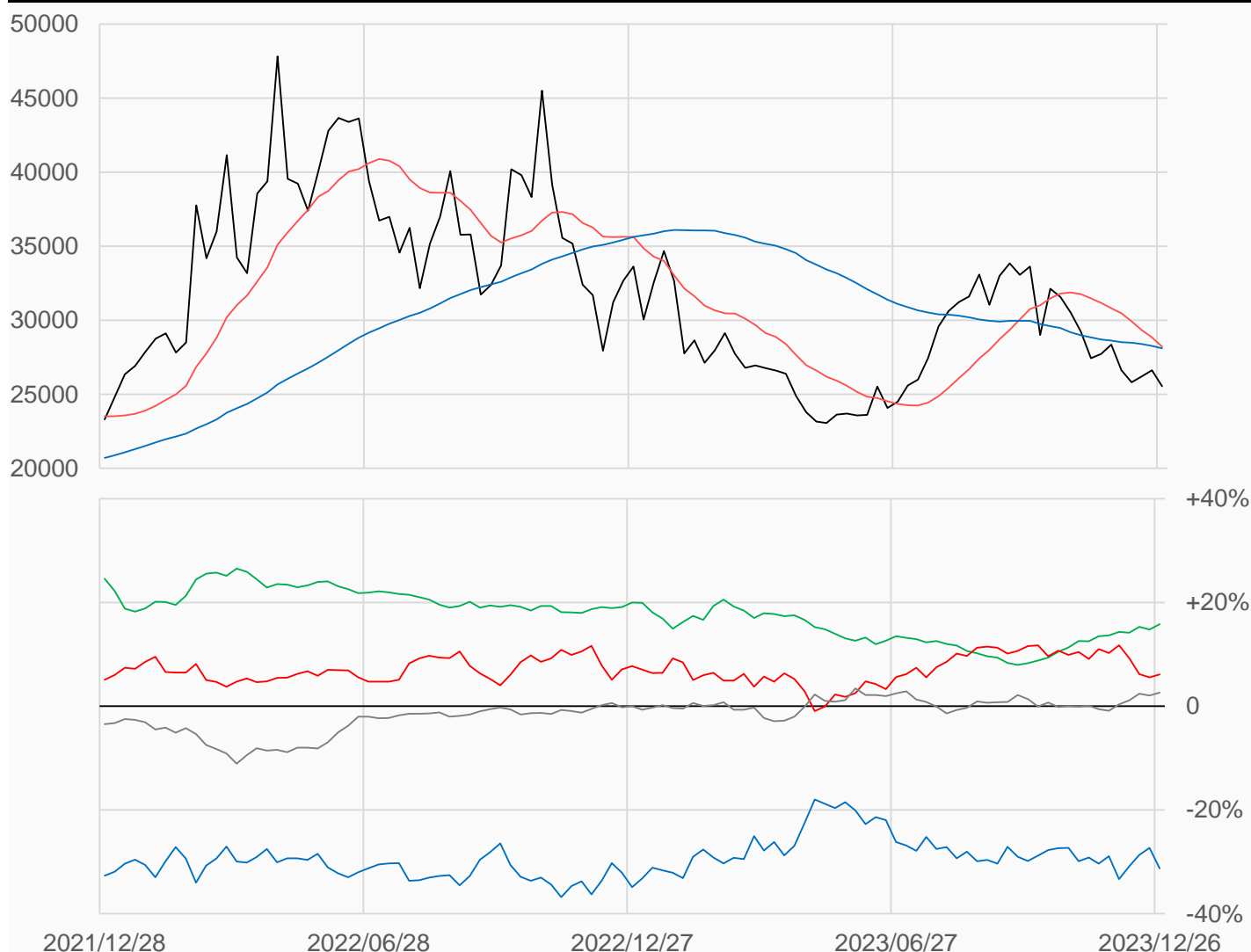
熱燃油

熱燃油較前一週下跌1081點收在25531點，
管理基金多單減少630口，空單減少1561口，
淨多單較前一週增加931口至18749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
2023/12/26	321493	306884	-14609	-4.54%	25531	↓ -1081
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	68828	-4387	164891	+3804	-96063	-8191
互換交易	63573	-2015	14994	-3120	+48579	+1105
管理基金	84762	-630	66013	-1561	+18749	+931
其他	40207	+2130	32169	+603	+8038	+1527

週五收盤價與13週與52週平均線

— HO — 13週 28211 — 52週 28108



淨部位佔總OI% 生產 -31.3% 互換 +15.8% 管理 +6.1% 其他 +2.6%

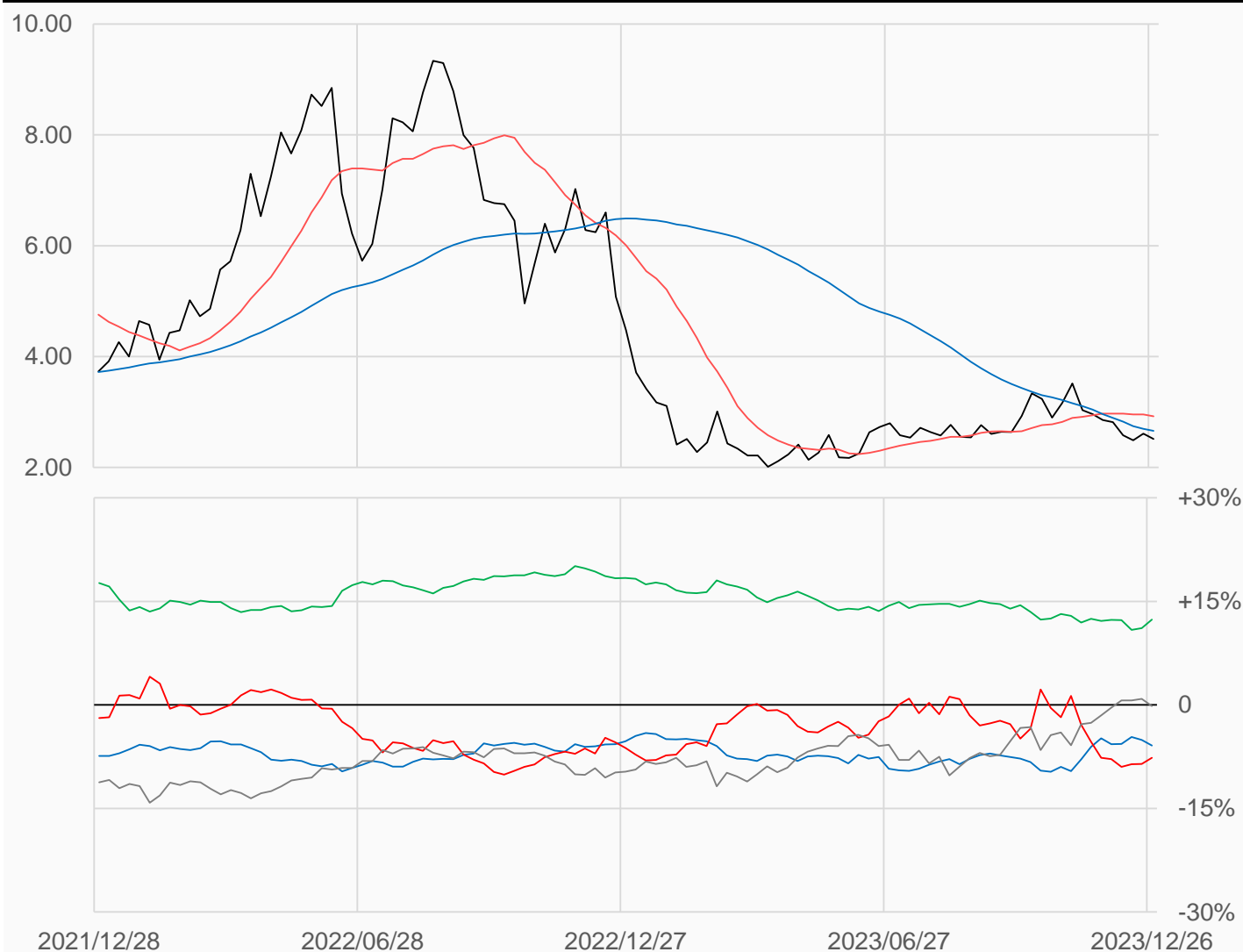
天然氣

天然氣較前一週下跌0.096點收在2.514點，
管理基金多單減少3385口，空單減少19080口，
淨空單較前一週減少15695口至104762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
2023/12/26	1405392	1366555	-38837	-2.76%	2.514	↓ -0.096
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	216048	-7405	296647	+1833	-80599	-9238
互換交易	276650	-1341	107821	-13706	+168829	+12365
管理基金	564102	-3385	668864	-19080	-104762	+15695
其他	244303	-23264	246745	-8607	-2442	-14657

週五收盤價與13週與52週平均線

— NG — 13週 2.9238 — 52週 2.6595



淨部位佔總OI% 生產 -5.9% 互換 +12.4% 管理 -7.7% 其他 -0.2%

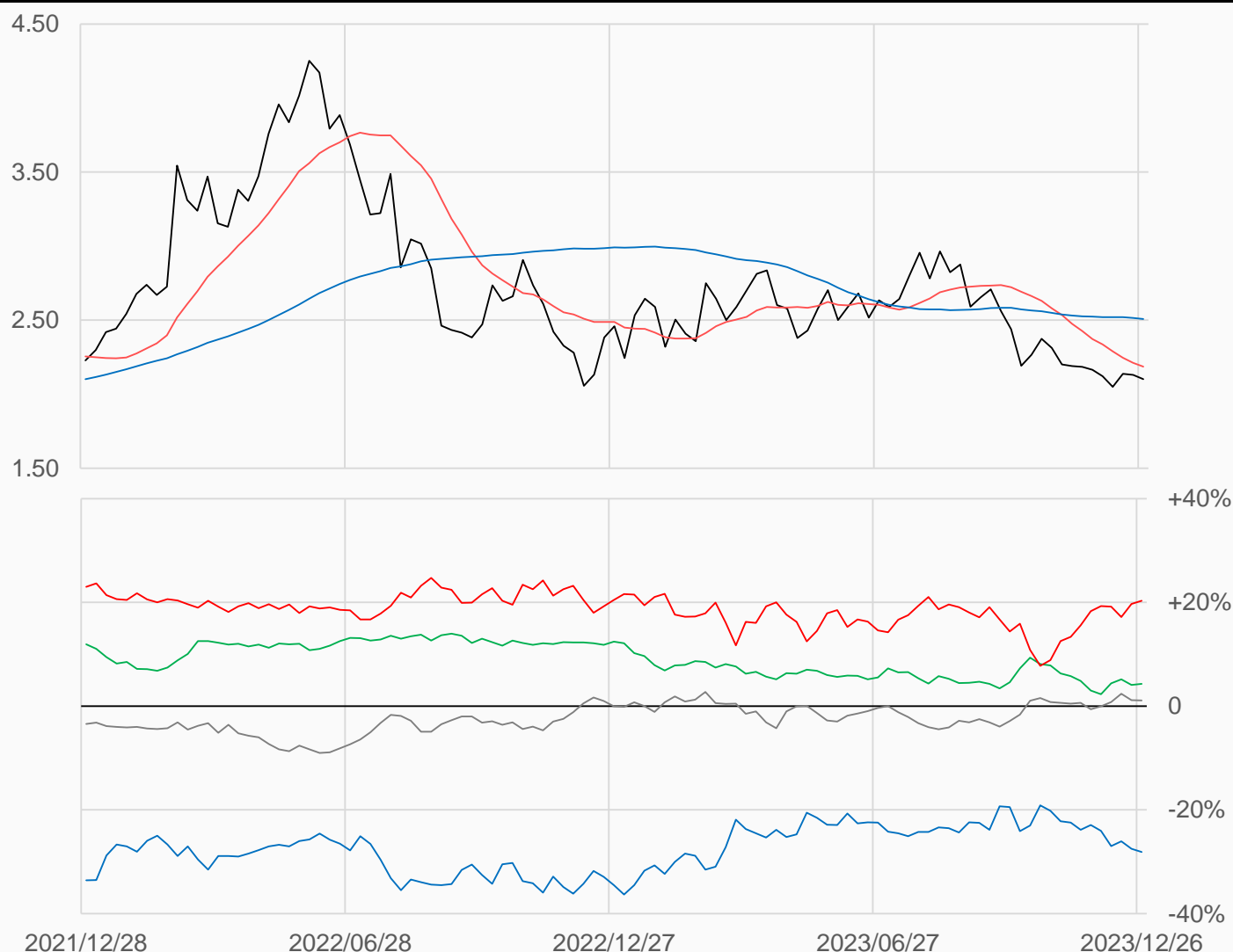
無鉛汽油

無鉛汽油較前一週下跌0.0275點收在2.1026點，
管理基金多單減少5203口，空單減少4180口，
淨多單較前一週減少1023口至67825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
2023/12/26	348893	333819	-15074	-4.32%	2.1026	↓ -0.0275
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	102051	+466	195896	-1558	-93845	+2024
互換交易	50556	-1799	36127	-1901	+14429	+102
管理基金	116034	-5203	48209	-4180	+67825	-1023
其他	40229	+1455	36585	+1765	+3644	-310

週五收盤價與13週與52週平均線

— RB — 13週 2.1865 — 52週 2.5087



淨部位佔總OI% 生產 -28.1% 互換 +4.3% 管理 +20.3% 其他 +1.1%

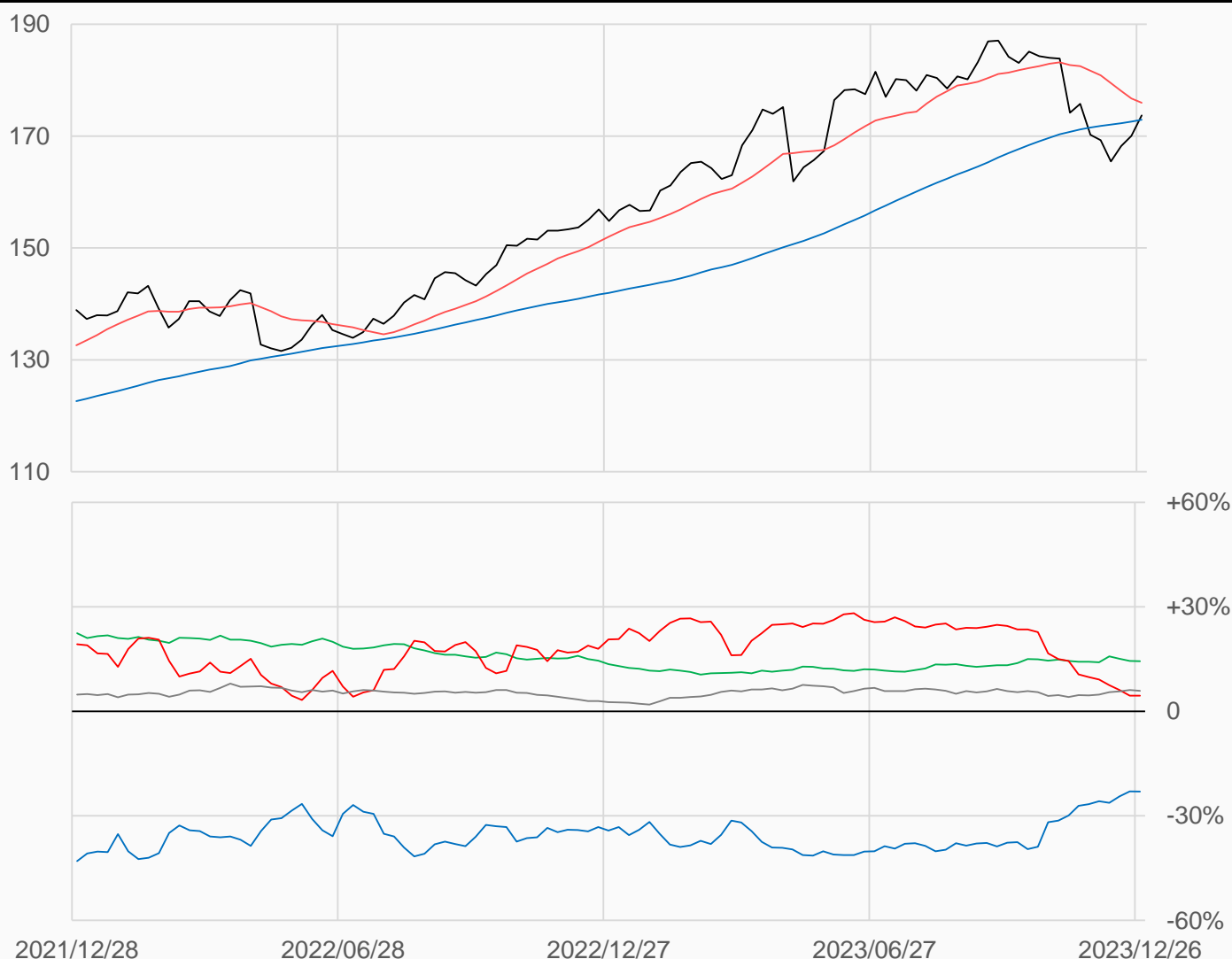
活牛

活牛較前一週上漲3.625點收在173.675點，
管理基金多單減少436口，空單減少454口，
淨多單較前一週增加18口至16902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
2023/12/26	373829	374376	+547	+0.15%	173.675	↑ +3.625
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	83653	+230	169885	+563	-86232	-333
互換交易	60035	+565	6035	+682	+54000	-117
管理基金	89133	-436	72231	-454	+16902	+18
其他	102122	-364	79936	+315	+22186	-679

週五收盤價與13週與52週平均線

— LC — 13週 175.94 — 52週 172.93



淨部位佔總OI% 生產 -23.0% 互換 +14.4% 管理 +4.5% 其他 +5.9%

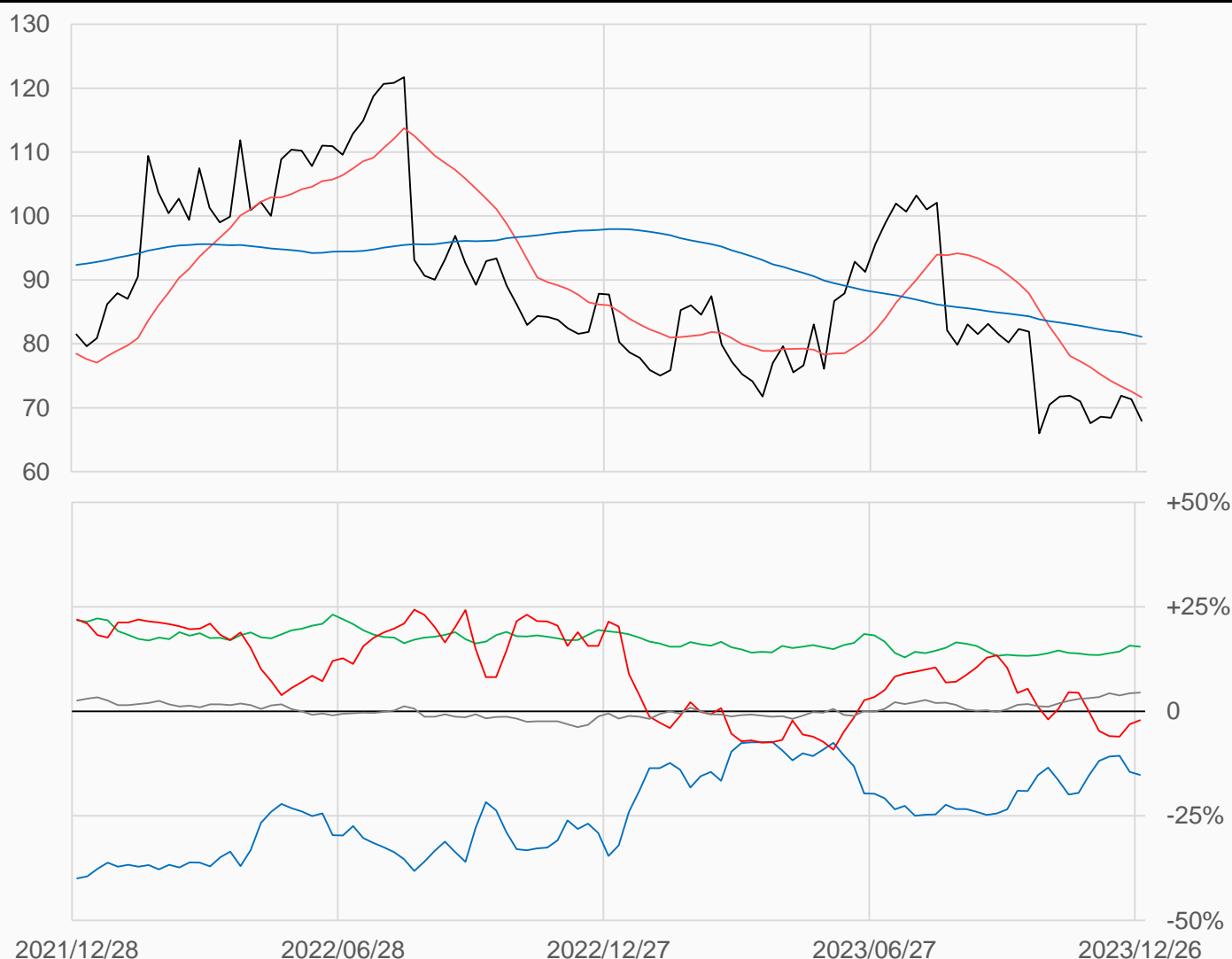
活豬

活豬較前一週下跌3.375點收在67.975點，
管理基金多單增加4140口，空單增加1829口，
淨空單較前一週減少2311口至5995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
2023/12/26	268622	281471	+12849	+4.78%	67.975	↓ -3.375
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	42193	+1830	84929	+5607	-42736	-3777
互換交易	56558	+1740	13050	+430	+43508	+1310
管理基金	76556	+4140	82551	+1829	-5995	+2311
其他	88270	+5867	75597	+4830	+12673	+1037

週五收盤價與13週與52週平均線

— LH — 13週 71.629 — 52週 81.113



淨部位佔總OI% 生產 -15.2% 互換 +15.5% 管理 -2.1% 其他 +4.5%

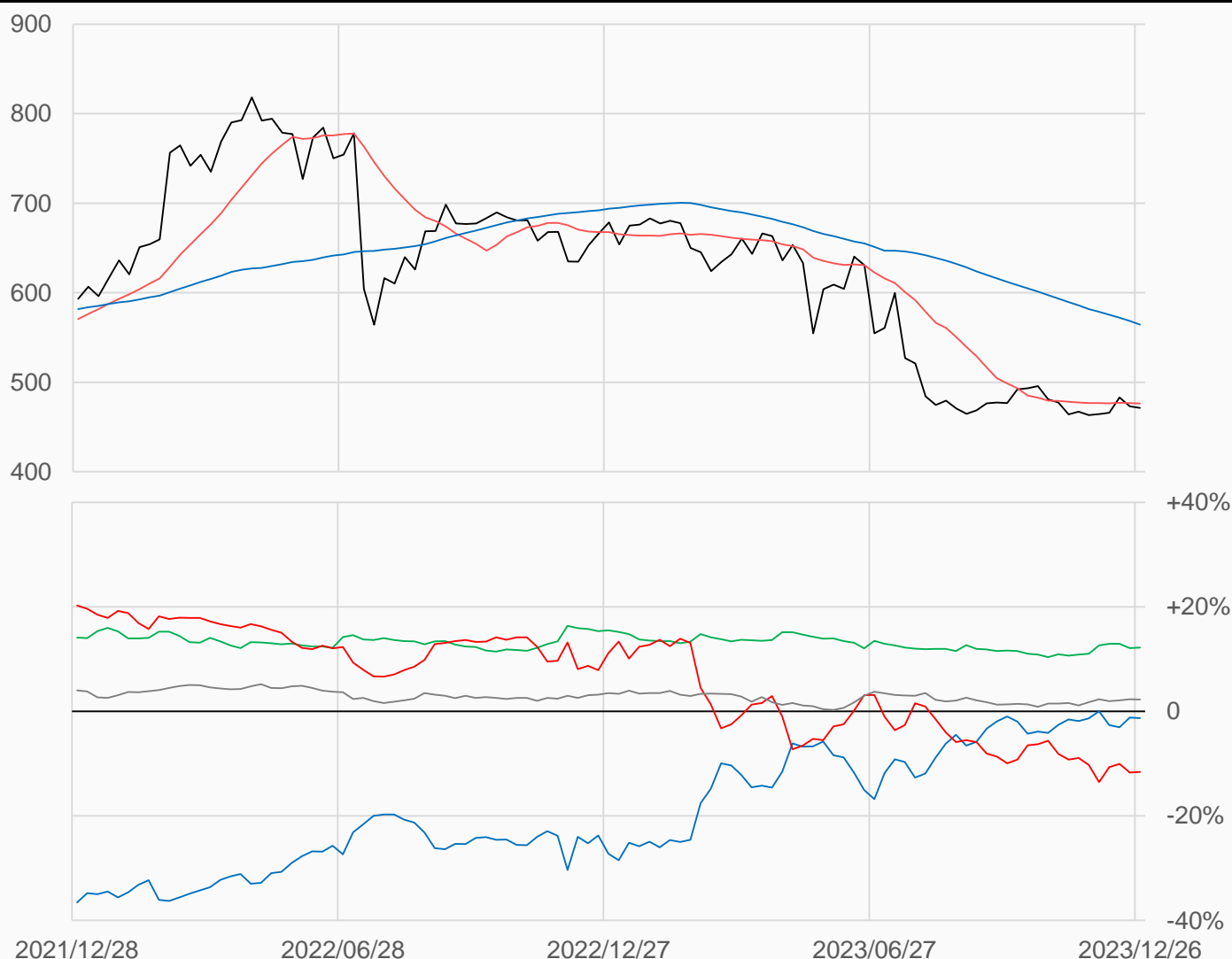
玉米

玉米較前一週下跌1.75點收在471.25點，
管理基金多單增加15956口，空單增加12858口，
淨空單較前一週減少3098口至177626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
2023/12/26	1541649	1533323	-8326	-0.54%	471.25	↓ -1.75
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	429062	+924	448498	+1717	-19436	-793
互換交易	225430	+1842	37923	+1136	+187507	+706
管理基金	375270	+15956	552896	+12858	-177626	+3098
其他	324217	-12282	289320	-11541	+34897	-741

週五收盤價與13週與52週平均線

— ZC — 13週 476.19 — 52週 564.33



淨部位佔總OI% 生產 -1.3% 互換 +12.2% 管理 -11.6% 其他 +2.3%

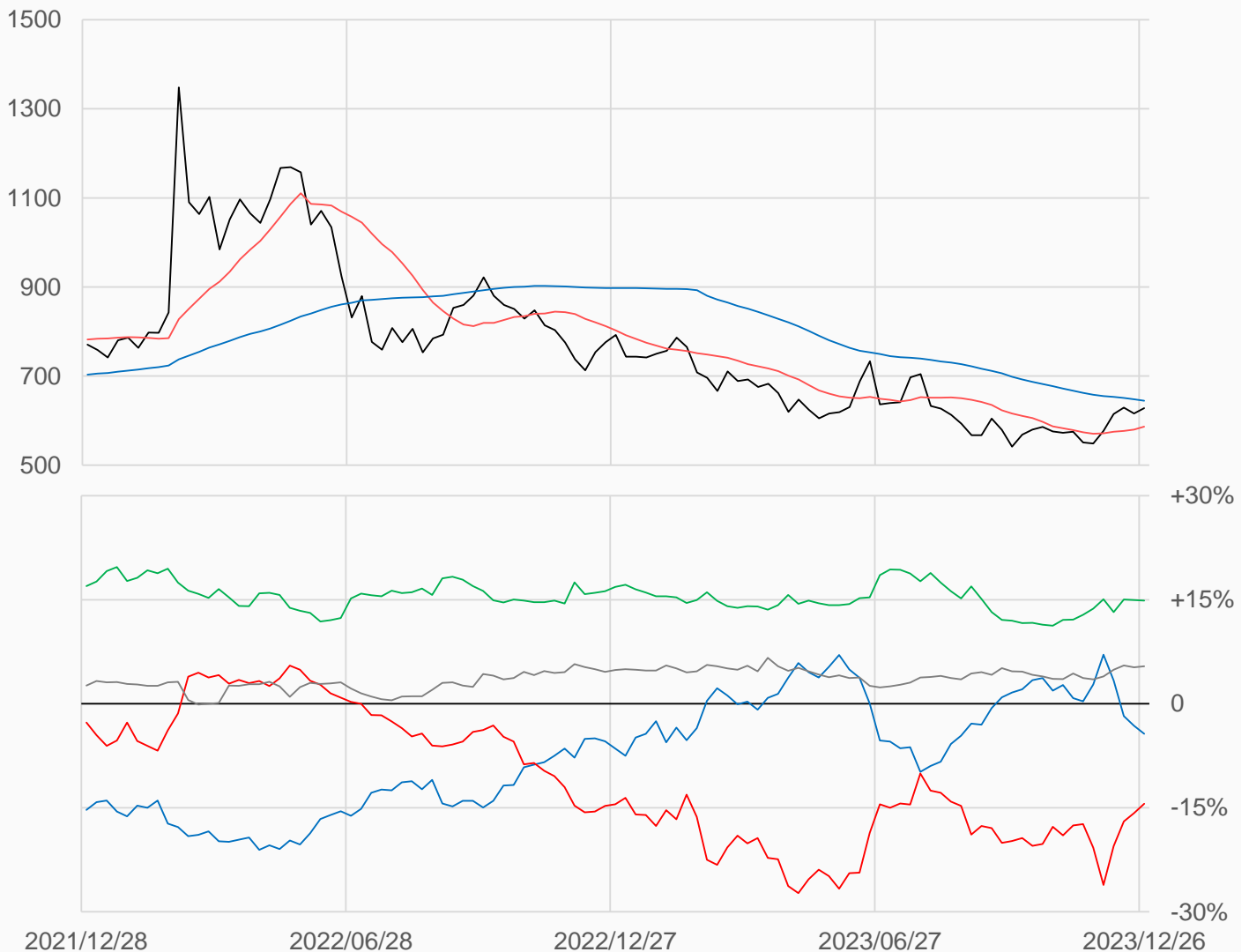
小麥

小麥較前一週上漲11.75點收在628點，
 管理基金多單增加8879口，空單增加3406口，
 淨空單較前一週減少5473口至59559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
2023/12/26	412241	412546	+305	+0.07%	628.00	↑ +11.75
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	65229	-3059	83068	+1706	-17839	-4765
互換交易	81644	-726	20252	-462	+61392	-264
管理基金	141063	+8879	200622	+3406	-59559	+5473
其他	93444	-2026	71230	-2528	+22214	+502

週五收盤價與13週與52週平均線

— ZW — 13週 586.33 — 52週 644.6



淨部位佔總OI% 生產 -4.3% 互換 +14.9% 管理 -14.4% 其他 +5.4%

黃豆

黃豆較前一週下跌6.25點收在1293.5點，
 管理基金多單減少12424口，空單減少6925口，
 淨多單較前一週減少5499口至4767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
2023/12/26	827119	752705	-74414	-9.00%	1293.50	↓ -6.25
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	245380	-21889	337872	-23379	-92492	+1490
互換交易	140278	-3905	34714	-8862	+105564	+4957
管理基金	174756	-12424	169989	-6925	+4767	-5499
其他	127574	-24863	136970	-19591	-9396	-5272

週五收盤價與13週與52週平均線

— ZS — 13週 1308.9 — 52週 1414.6



淨部位佔總OI% 生產 -12.3% 互換 +14.0% 管理 +0.6% 其他 -1.2%

黃豆油

黃豆油較前一週下跌0.69點收在47.84點，
管理基金多單減少1584口，空單增加16134口，
淨空單較前一週增加17718口至49653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
2023/12/26	507402	504227	-3175	-0.63%	47.84	↓ -0.69
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	143694	+5947	210851	-15604	-67157	+21551
互換交易	114328	-1937	16909	+389	+97419	-2326
管理基金	120673	-1584	170326	+16134	-49653	-17718
其他	92382	+442	78736	-877	+13646	+1319

週五收盤價與13週與52週平均線

— BO — 13週 51.561 — 52週 57.638



淨部位佔總OI% 生產 -13.3% 互換 +19.3% 管理 -9.8% 其他 +2.7%

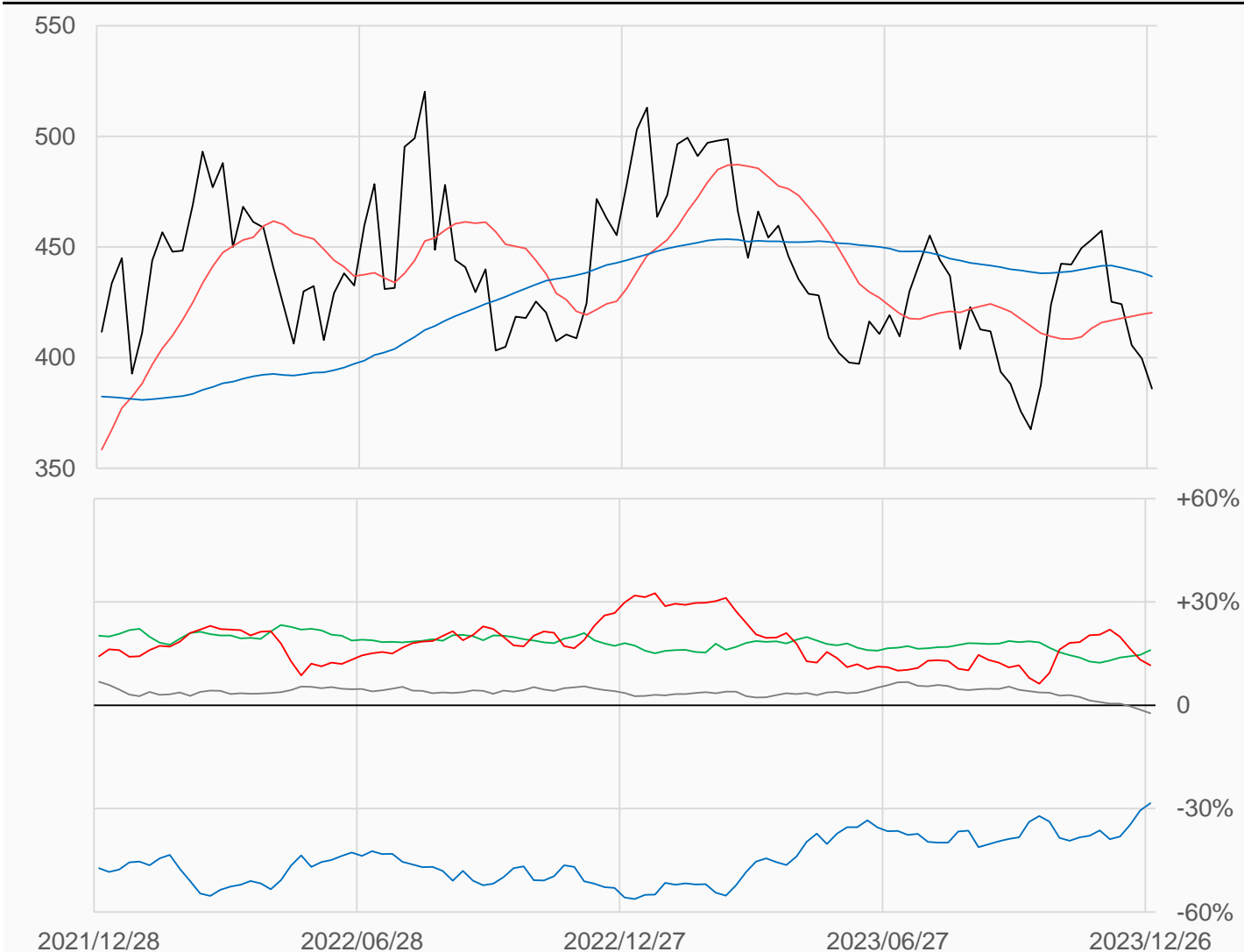
黃豆粉

黃豆粉較前一週下跌13.6點收在386點，
 管理基金多單減少10857口，空單增加4766口，
 淨多單較前一週減少15623口至59233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
2023/12/26	564236	508260	-55976	-9.92%	386.0	↓ -13.6
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	109704	-4943	254142	-32564	-144438	+27621
互換交易	91456	-1377	9963	-98	+81493	-1279
管理基金	153054	-10857	93821	+4766	+59233	-15623
其他	102552	-26492	114175	-22001	-11623	-4491

週五收盤價與13週與52週平均線

— SM — 13週 420.34 — 52週 436.69



淨部位佔總OI% 生產 -28.4% 互換 +16.0% 管理 +11.7% 其他 -2.3%

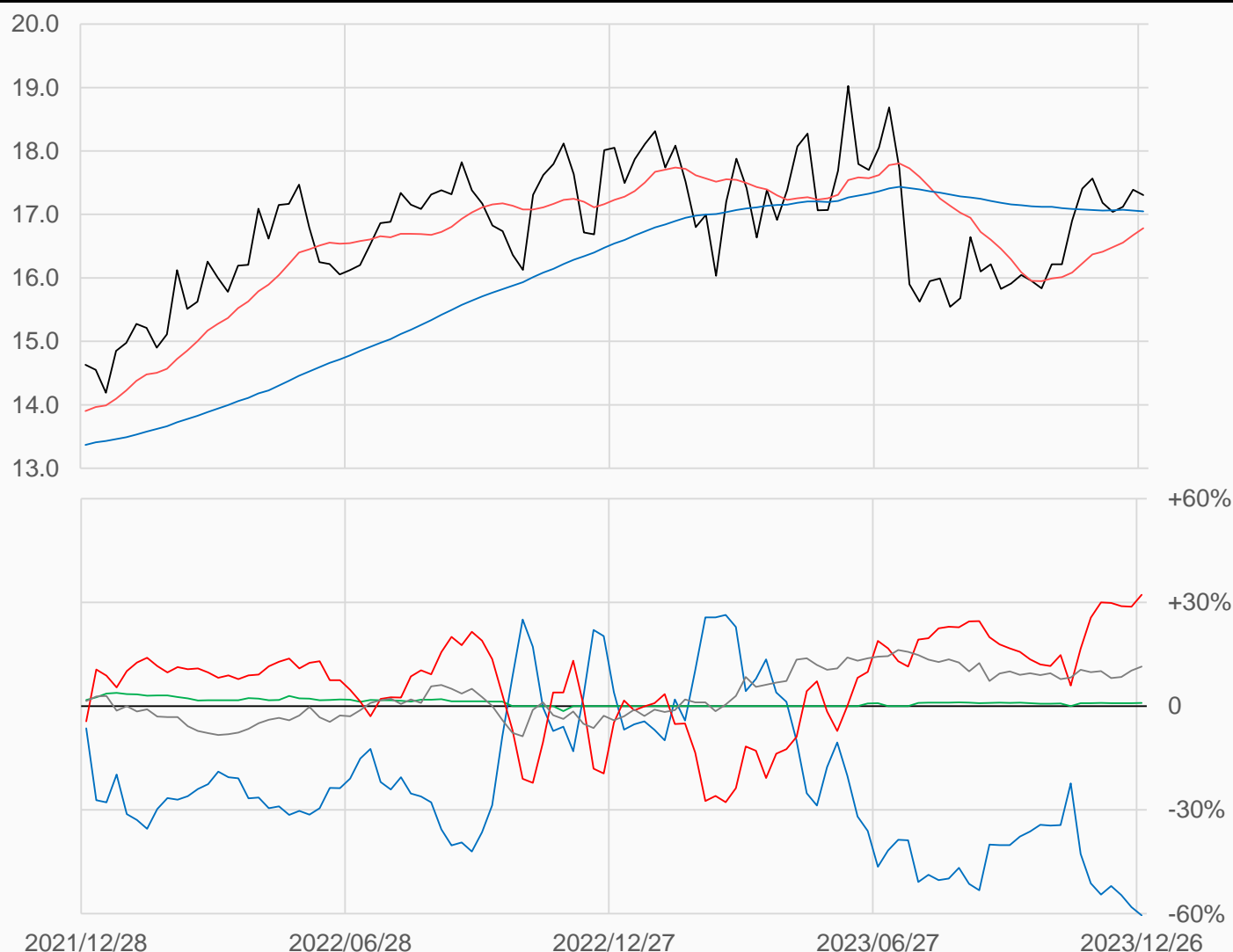
粗米

粗米較前一週下跌0.085點收在17.305點，
管理基金多單增加269口，空單增加0口，
淨多單較前一週增加269口至3886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
2023/12/26	12562	12063	-499	-3.97%	17.305	↓ -0.085
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	3236	-79	10536	-77	-7300	-2
互換交易	113	0	0	0	+113	0
管理基金	4180	+269	294	0	+3886	+269
其他	1821	-283	439	-376	+1382	+93

週五收盤價與13週與52週平均線

— RR — 13週 16.783 — 52週 17.048



淨部位佔總OI% 生產 -60.5% 互換 +0.9% 管理 +32.2% 其他 +11.5%

咖啡

咖啡較前一週下跌4.5點收在188.3點，
管理基金多單增加1547口，空單增加1728口，
淨多單較前一週減少181口至39761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
2023/12/26	270652	269951	-701	-0.26%	188.30	↓ -4.50
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	48270	-363	114662	-2385	-66392	+2022
互換交易	48136	+455	29542	+975	+18594	-520
管理基金	87647	+1547	47886	+1728	+39761	-181
其他	74109	-1741	67890	-301	+6219	-1440

週五收盤價與13週與52週平均線

— KC — 13週 175.7 — 52週 172.2



淨部位佔總OI% 生產 -24.6% 互換 +6.9% 管理 +14.7% 其他 +2.3%

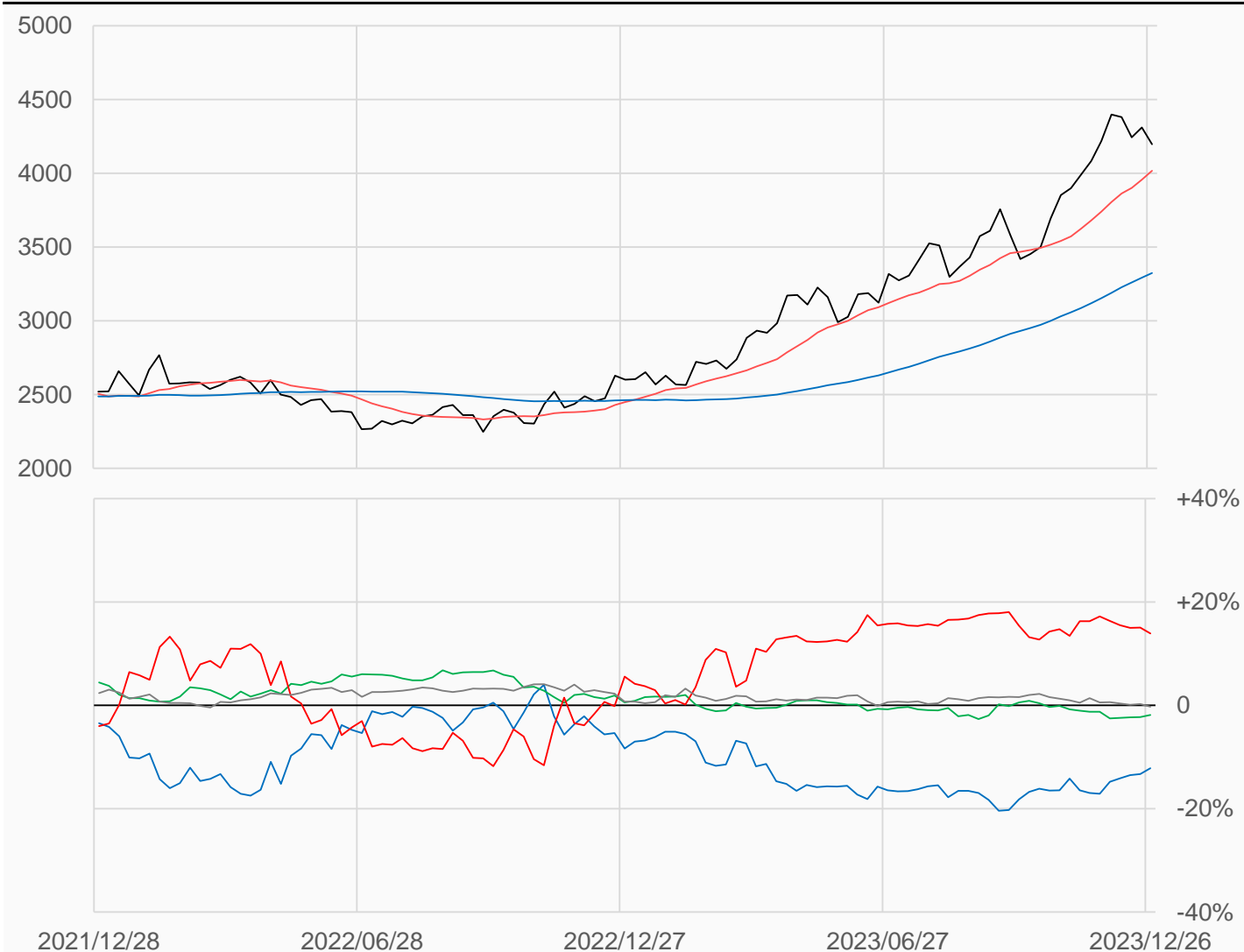
可可

可可較前一週下跌115點收在4196點，
管理基金多單增加4216口，空單增加7562口，
淨多單較前一週減少3346口至61722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
2023/12/26	432306	443406	+11100	+2.57%	4196	↓ -115
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	99877	+3721	153816	+187	-53939	+3534
互換交易	25948	+1520	34113	-248	-8165	+1768
管理基金	180237	+4216	118515	+7562	+61722	-3346
其他	121419	+1527	122672	+3920	-1253	-2393

週五收盤價與13週與52週平均線

— CC — 13週 4016.8 — 52週 3323.6



淨部位佔總OI% 生產 -12.2% 互換 -1.8% 管理 +13.9% 其他 -0.3%

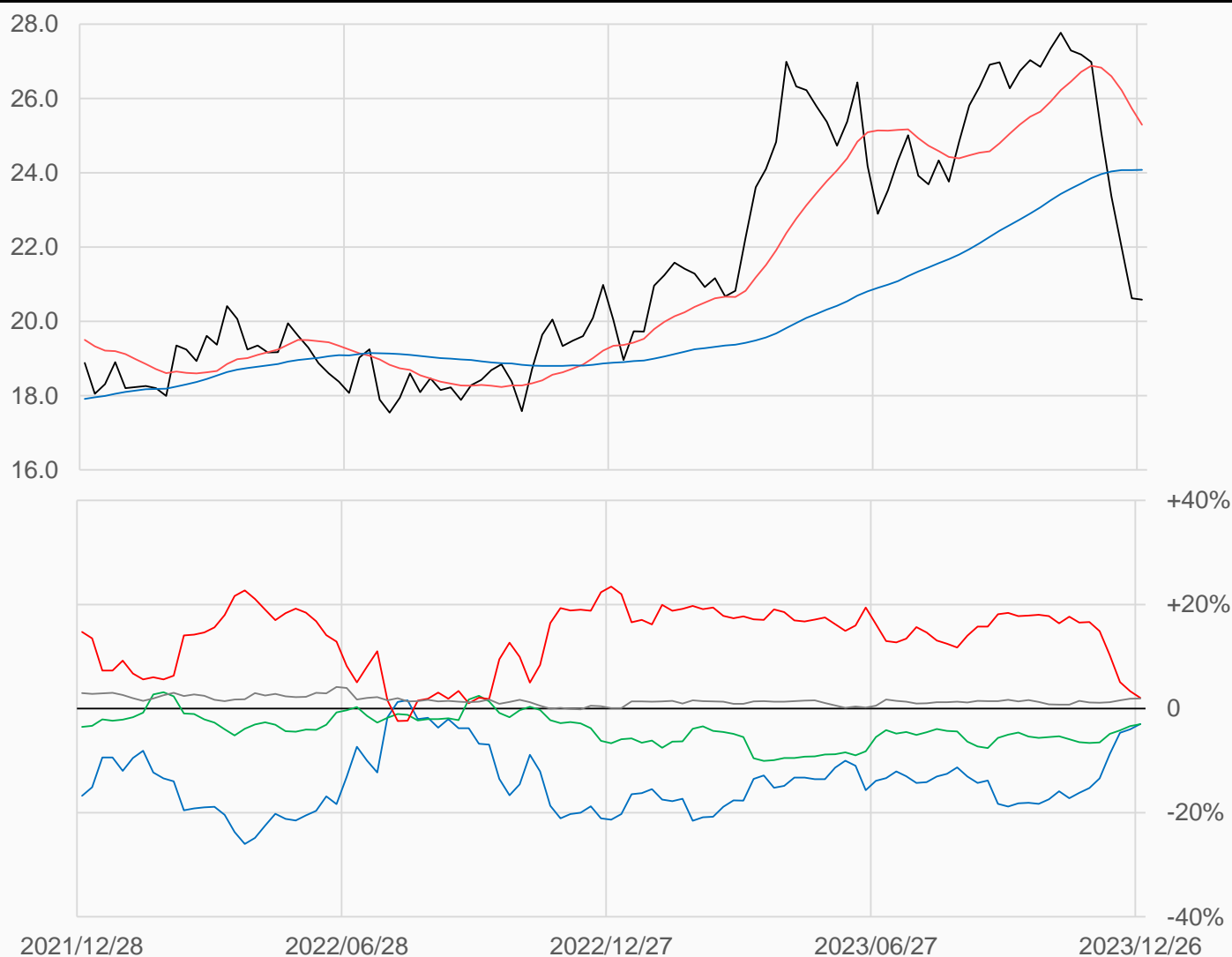
11號糖

11號糖較前一週下跌0.04點收在20.58點，
管理基金多單減少361口，空單增加12114口，
淨多單較前一週減少12475口至22160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
2023/12/26	1043522	1082449	+38927	+3.73%	20.58	↓ -0.04
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	378334	+20455	410209	+10560	-31875	+9895
互換交易	183735	+8324	216233	+5447	-32498	+2877
管理基金	195344	-361	173184	+12114	+22160	-12475
其他	245048	+10548	224053	+9444	+20995	+1104

週五收盤價與13週與52週平均線

— SB — 13週 25.294 — 52週 24.077



淨部位佔總OI% 生產 -2.9% 互換 -3.0% 管理 +2.0% 其他 +1.9%

棉花

棉花較前一週上漲1.24點收在81點，
管理基金多單減少696口，空單增加4403口，
淨空單較前一週增加5099口至3847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
2023/12/26	223473	225710	+2237	+1.00%	81.00	↑ +1.24
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	39964	-139	79740	-2998	-39776	+2859
互換交易	61564	+1656	28685	+1180	+32879	+476
管理基金	61983	-696	65830	+4403	-3847	-5099
其他	49105	+1754	38752	-464	+10353	+2218

週五收盤價與13週與52週平均線

— CT — 13週 81.268 — 52週 82.946



淨部位佔總OI% 生產 -17.6% 互換 +14.6% 管理 -1.7% 其他 +4.6%