

# CFTC 大額交易人持倉報告

永豐期貨顧問事業部編製

2024/1/9

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 2024/01/02

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	103391	+4864	+13061	+7922	+12.63%
	VX	335960	-9842	-10094	+16798	-3.00%
	NQ	308131	-6799	-36170	+8103	-11.74%
	ES	3061078	-75066	-403315	-29387	-13.18%
債券	30年債	1572037	+46548	-418512	-58582	-26.62%
	10年債	5287646	+42915	-1495093	-68716	-28.28%
	5年債	6067664	+70804	-1977082	-8959	-32.58%
	2年債	3799946	+10484	-1490681	+37073	-39.23%
外匯	美元	23956	+1885	+3550	+2240	+14.82%
	英鎊	208030	+1342	+25697	-429	+12.35%
	紐幣	39218	+4304	+1696	+1112	+4.32%
	瑞郎	56656	+4920	+1657	-343	+2.92%
	綜美(含美)	1124874	+21632	+30374	-13209	+2.70%
	綜美(未含)	1100918	+19747	+26824	-15449	+2.44%
	歐元	810765	+15716	-10122	+12523	-1.25%
	澳幣	169454	+5898	-5122	+5770	-3.02%
加幣	197817	+6474	-53394	+494	-26.99%	
日圓	222063	-4499	-61995	-453	-27.92%	

# 金融類投機部位每週變動表

數據日期 2024/01/02

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	77798	+3184	+23546	+6693	+30.27%
	黃金	700881	+15598	+137516	+2009	+19.62%
	白銀	153882	+3760	+15952	-1069	+10.37%
	銅	208027	+3945	+10068	-4889	+4.84%
能源	無鉛汽油	333947	+128	+69301	+1476	+20.75%
	熱燃油	305232	-1652	+18965	+215	+6.21%
	輕原油	2037205	+21022	+89330	-35869	+4.38%
	天然氣	1409557	+43002	-78451	+26311	-5.57%
肉類	活牛	378657	+4281	+17415	+513	+4.60%
	活豬	305634	+24163	-17602	-11607	-5.76%
農產	粗米	11955	-108	+3999	+113	+33.45%
	黃豆粉	489873	-18387	+43039	-16194	+8.79%
	黃豆	789479	+36774	-11629	-16396	-1.47%
	黃豆油	521118	+16891	-50554	-901	-9.70%
	玉米	1601347	+68024	-197326	-19699	-12.32%
	小麥	416057	+3510	-60277	-719	-14.49%
軟性	咖啡	273788	+3837	+41077	+1316	+15.00%
	可可	455299	+11893	+62942	+1219	+13.82%
	11號糖	1116902	+34452	+18197	-3962	+1.63%
	棉花	228039	+2329	-4388	-542	-1.92%

# mini 道瓊

mini道瓊較前一週下跌293點收在37719點，  
 槓桿基金多單增加5554口，空單減少2368口，  
 淨多單較前一週增加154.15%或7922口至13061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
2024/01/02	98527	103391	+4864	+4.94%	37719	↓ -293
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	30894	-824	62714	+3884	-31820	-4708
資產管理	27778	+142	8397	+3733	+19381	-3591
槓桿基金	29453	+5554	16392	-2368	+13061	+7922
其他	1453	-74	3116	-733	-1663	+659

週五收盤價與13週與52週平均線

— YM — 13週 35504 — 52週 34364



淨部位佔總OI% 經紀 -30.8% 資管 +18.7% 槓桿 +12.6% 其他 -1.6%

# mini NQ

miniNQ較前一週下跌563.25點收在16460.25點，  
 槓桿基金多單減少1291口，空單減少9393口，  
 淨空單較前一週減少8102口至36170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
2024/01/02	314930	308131	-6799	-2.16%	16460.25	↓ -563.25
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	62486	-9456	117763	-1196	-55277	-8260
資產管理	120453	+4759	32325	+6792	+88128	-2033
槓桿基金	73142	-1291	109312	-9393	-36170	+8102
其他	8784	-1339	12758	-162	-3974	-1177

週五收盤價與13週與52週平均線

— NQ — 13週 15835 — 52週 14418



淨部位佔總OI% 經紀 -17.9% 資管 +28.6% 槓桿 -11.7% 其他 -1.3%

# mini S&P

miniS&P較前一週下跌85.25點收在4734.75點，  
 槓桿基金多單減少110697口，空單減少81310口，  
 淨空單較前一週增加29387口至403315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
2024/01/02	3136144	3061078	-75066	-2.39%	4734.75	↓ -85.25
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	466850	-34081	1027390	+26643	-560540	-60724
資產管理	1387066	+66959	440296	-9803	+946770	+76762
槓桿基金	783405	-110697	1186720	-81310	-403315	-29387
其他	108007	-3597	168661	-3793	-60654	+196

週五收盤價與13週與52週平均線

— ES — 13週 4531.4 — 52週 4327.3



淨部位佔總OI% 經紀 -18.3% 資管 +30.9% 槓桿 -13.2% 其他 -2.0%

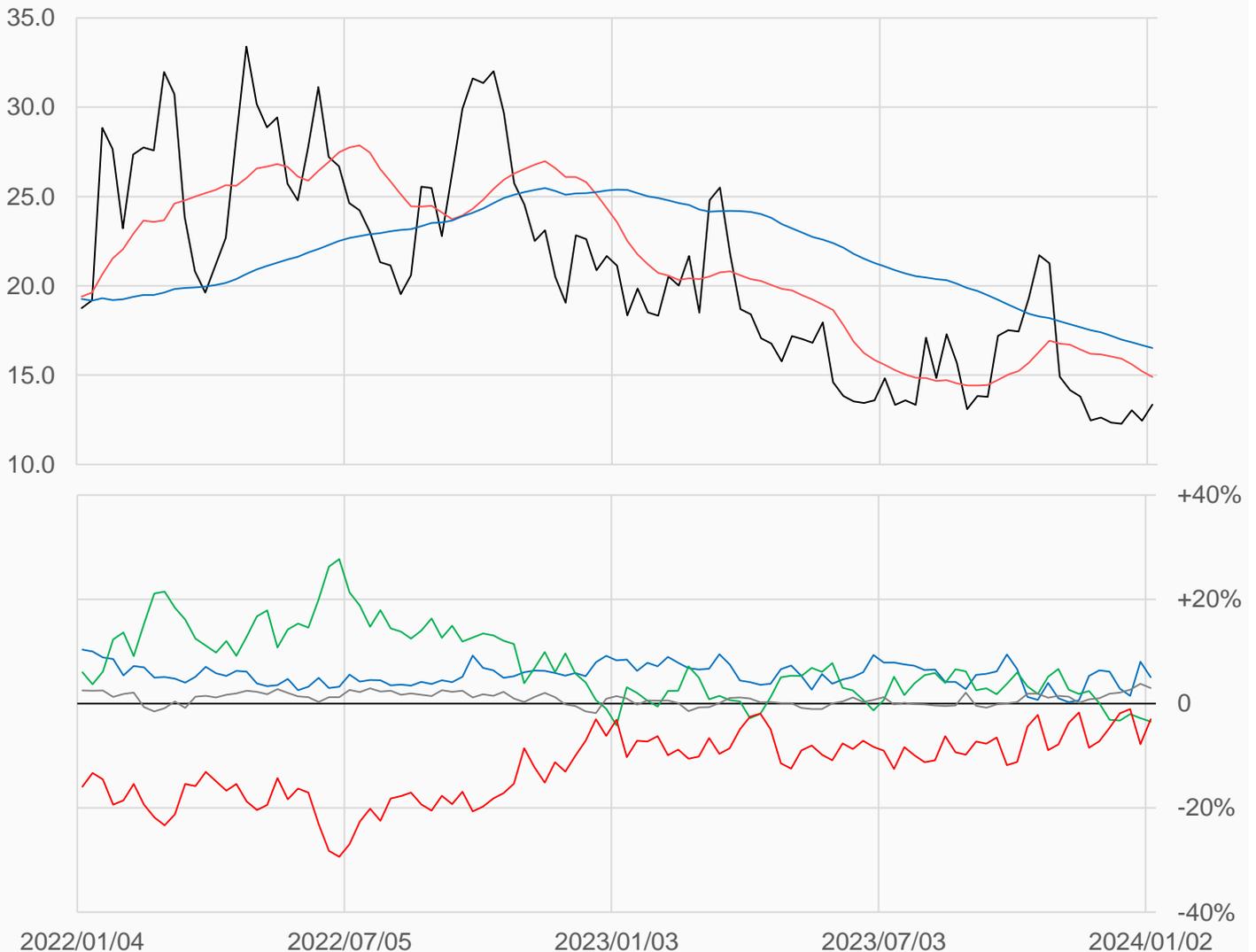
# VIX

VIX較前一週上漲0.9點收在13.35點，  
槓桿基金多單增加5753口，空單減少11045口，  
淨空單較前一週減少16798口至10094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
2024/01/02	345802	335960	-9842	-2.85%	13.35	↑ +0.90
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	67789	-8842	50854	+1933	+16935	-10775
資產管理	109905	-1255	121448	+563	-11543	-1818
槓桿基金	109456	+5753	119550	-11045	-10094	+16798
其他	24192	-4866	14226	-1673	+9966	-3193

週五收盤價與13週與52週平均線

— VX — 13週 14.902 — 52週 16.522



淨部位佔總OI% 經紀 +5.0% 資管 -3.4% 槓桿 -3.0% 其他 +3.0%

# 30年債

美國30年公債較前一週下跌2.9063點收在122.03125點，  
 槓桿基金多單減少2380口，空單增加56602口，  
 淨空單較前一週增加58982口至418512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
2024/01/02	1525489	1572037	+46548	+3.05%	122 1/32	↓ -2 29/32
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	66426	+6366	241781	+11590	-175355	-5224
資產管理	1000957	+31021	466671	+8154	+534286	+22867
槓桿基金	191477	-2380	609989	+56602	-418512	-58982
其他	110898	+8862	102175	-27254	+8723	+36116

週五收盤價與13週與52週平均線

— US — 13週 116.91 — 52週 123.52



淨部位佔總OI% 經紀 -11.2% 資管 +34.0% 槓桿 -26.6% 其他 +0.6%

# 10年債

美國10年公債較前一週下跌1.1719點收在111.71875點。

槓桿基金多單減少3205口，空單增加65510口。

淨空單較前一週增加68715口至1495093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
2024/01/02	5244731	5287646	+42915	+0.82%	111 46/64	↓ -1 11/64
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	374864	+4107	580181	+12117	-205317	-8010
資產管理	3160386	+47450	1834680	+4757	+1325706	+42693
槓桿基金	769951	-3205	2265044	+65510	-1495093	-68715
其他	557469	+15359	231051	-47886	+326418	+63245

週五收盤價與13週與52週平均線

— TY — 13週 109.44 — 52週 111.67



淨部位佔總OI% 經紀 -3.9% 資管 +25.1% 槓桿 -28.3% 其他 +6.2%

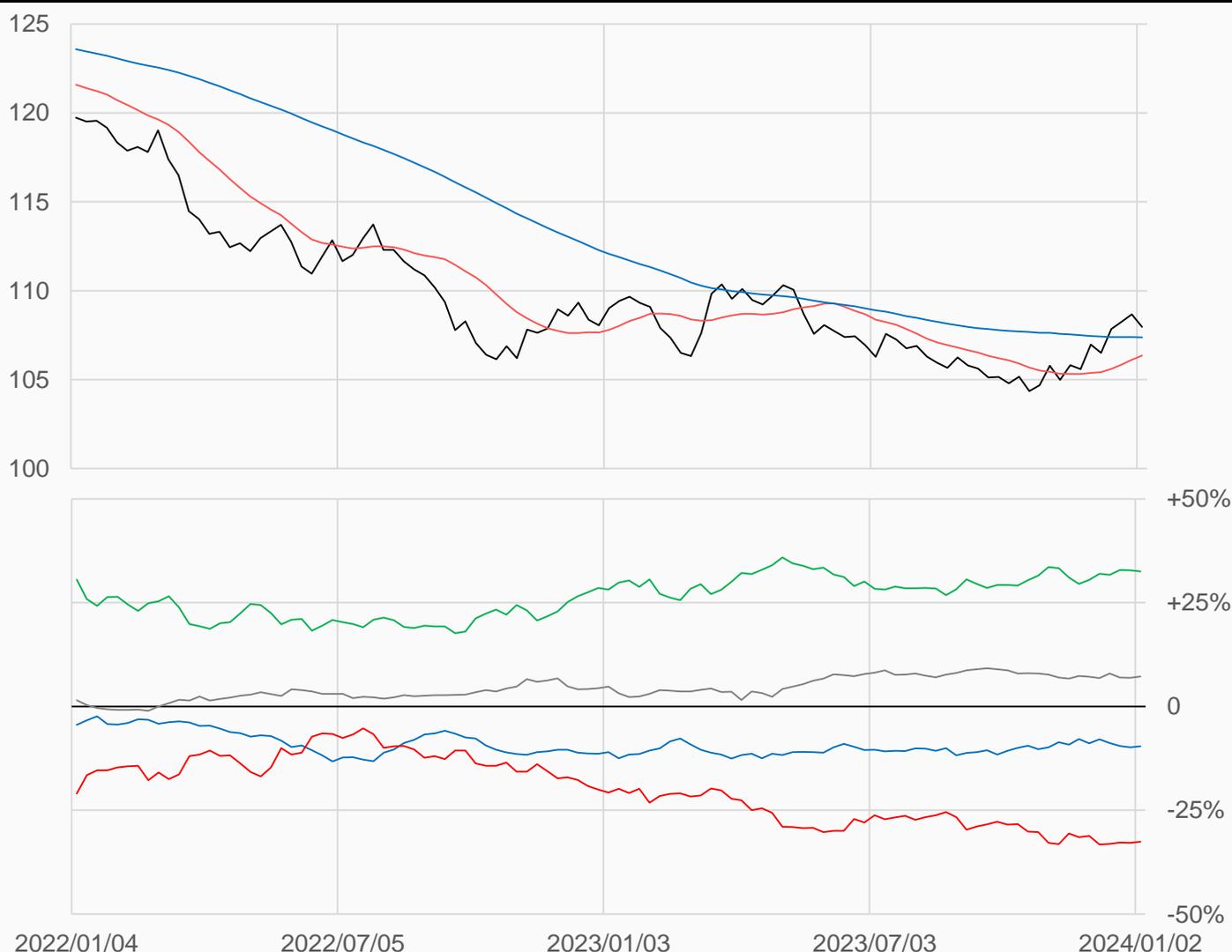
# 5年公債

美國5年公債較前一週下跌0.7031點收在107.96875點，  
 槓桿基金多單增加19401口，空單增加28359口，  
 淨空單較前一週增加8958口至1977082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
2024/01/02	5996860	6067664	+70804	+1.18%	107 124/128	↓ - 90/128
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	206412	+8519	787656	+136	-581244	+8383
資產管理	3719637	+35161	1744301	+29502	+1975336	+5659
槓桿基金	1124424	+19401	3101506	+28359	-1977082	-8958
其他	574890	+20704	134213	-6354	+440677	+27058

週五收盤價與13週與52週平均線

— FV — 13週 106.35 — 52週 107.38



淨部位佔總OI% 經紀 -9.6% 資管 +32.6% 槓桿 -32.6% 其他 +7.3%

# 2年公債

美國2年公債較前一週下跌0.1563點收在102.6484375點，

槓桿基金多單增加18327口，空單減少18746口，

淨空單較前一週減少37073口至1490681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
2024/01/02	3789462	3799946	+10484	+0.28%	102 83/128	↓ - 20/128
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	134998	+2935	378183	+32721	-243185	-29786
資產管理	2009531	+6891	766247	-15289	+1243284	+22180
槓桿基金	863730	+18327	2354411	-18746	-1490681	+37073
其他	540270	-2956	163676	+4047	+376594	-7003

週五收盤價與13週與52週平均線

— TU — 13週 101.87 — 52週 102.1



淨部位佔總OI% 經紀 -6.4% 資管 +32.7% 槓桿 -39.2% 其他 +9.9%

# 歐元

歐元較前一週下跌98點收在10977點，  
 槓桿基金多單增加12715口，空單增加193口，  
 淨空單較前一週減少12522口至10122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
2024/01/02	795049	810765	+15716	+1.98%	10977.0	↓ -98.0
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	42566	+1896	472893	+20407	-430327	-18511
資產管理	506591	-233	123232	-3193	+383359	+2960
槓桿基金	141713	+12715	151835	+193	-10122	+12522
其他	33641	-139	15105	+1584	+18536	-1723

週五收盤價與13週與52週平均線

— EC — 13週 10824 — 52週 10847



淨部位佔總OI% 經紀 -53.1% 資管 +47.3% 槓桿 -1.2% 其他 +2.3%

# 日圓

日圓較前一週下跌186.5點收在6989.5點，  
 槓桿基金多單減少2904口，空單減少2452口，  
 淨空單較前一週增加452口至61995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
2024/01/02	226562	222063	-4499	-1.99%	6989.5	↓ -186.5
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	36719	-2451	12549	+716	+24170	-3167
資產管理	75566	+3107	51368	-3382	+24198	+6489
槓桿基金	56720	-2904	118715	-2452	-61995	-452
其他	12126	-1825	1188	-247	+10938	-1578

週五收盤價與13週與52週平均線

— JY — 13週 6852.3 — 52週 7164.1



淨部位佔總OI% 經紀 +10.9% 資管 +10.9% 槓桿 -27.9% 其他 +4.9%

# 英鎊

英鎊較前一週下跌23點收在12728點，  
槓桿基金多單增加1182口，空單增加1611口，  
淨多單較前一週減少429口至25697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
2024/01/02	206688	208030	+1342	+0.65%	12728	↓ -23
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	42539	+4528	21609	-4601	+20930	+9129
資產管理	47571	-1979	94618	+1619	-47047	-3598
槓桿基金	86543	+1182	60846	+1611	+25697	-429
其他	1146	+15	2597	-133	-1451	+148

週五收盤價與13週與52週平均線

— BP — 13週 12478 — 52週 12461



淨部位佔總OI% 經紀 +10.1% 資管 -22.6% 槓桿 +12.4% 其他 -0.7%

# 瑞郎

瑞郎較前一週下跌123點收在11857點，  
 槓桿基金多單增加1598口，空單增加1943口，  
 淨多單較前一週減少345口至1657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
2024/01/02	51736	56656	+4920	+9.51%	11857	↓ -123
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	9990	-1619	9872	+766	+118	-2385
資產管理	15630	+3046	17913	+1883	-2283	+1163
槓桿基金	13377	+1598	11720	+1943	+1657	-345
其他	1616	0	2065	+1514	-449	-1514

週五收盤價與13週與52週平均線

— SF — 13週 11432 — 52週 11214



淨部位佔總OI% 經紀 +0.2% 資管 -4.0% 槓桿 +2.9% 其他 -0.8%

# 加幣

加幣較前一週下跌71.5點收在7491點，  
槓桿基金多單增加687口，空單增加193口，  
淨空單較前一週減少494口至53394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
2024/01/02	191343	197817	+6474	+3.38%	7491.0	↓ -71.5
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	54655	-4391	35815	+13407	+18840	-17798
資產管理	65028	+10322	52439	-3422	+12589	+13744
槓桿基金	31480	+687	84874	+193	-53394	+494
其他	10543	+180	2639	-656	+7904	+836

週五收盤價與13週與52週平均線

— CD — 13週 7377.7 — 52週 7419.5



淨部位佔總OI% 經紀 +9.5% 資管 +6.4% 槓桿 -27.0% 其他 +4.0%

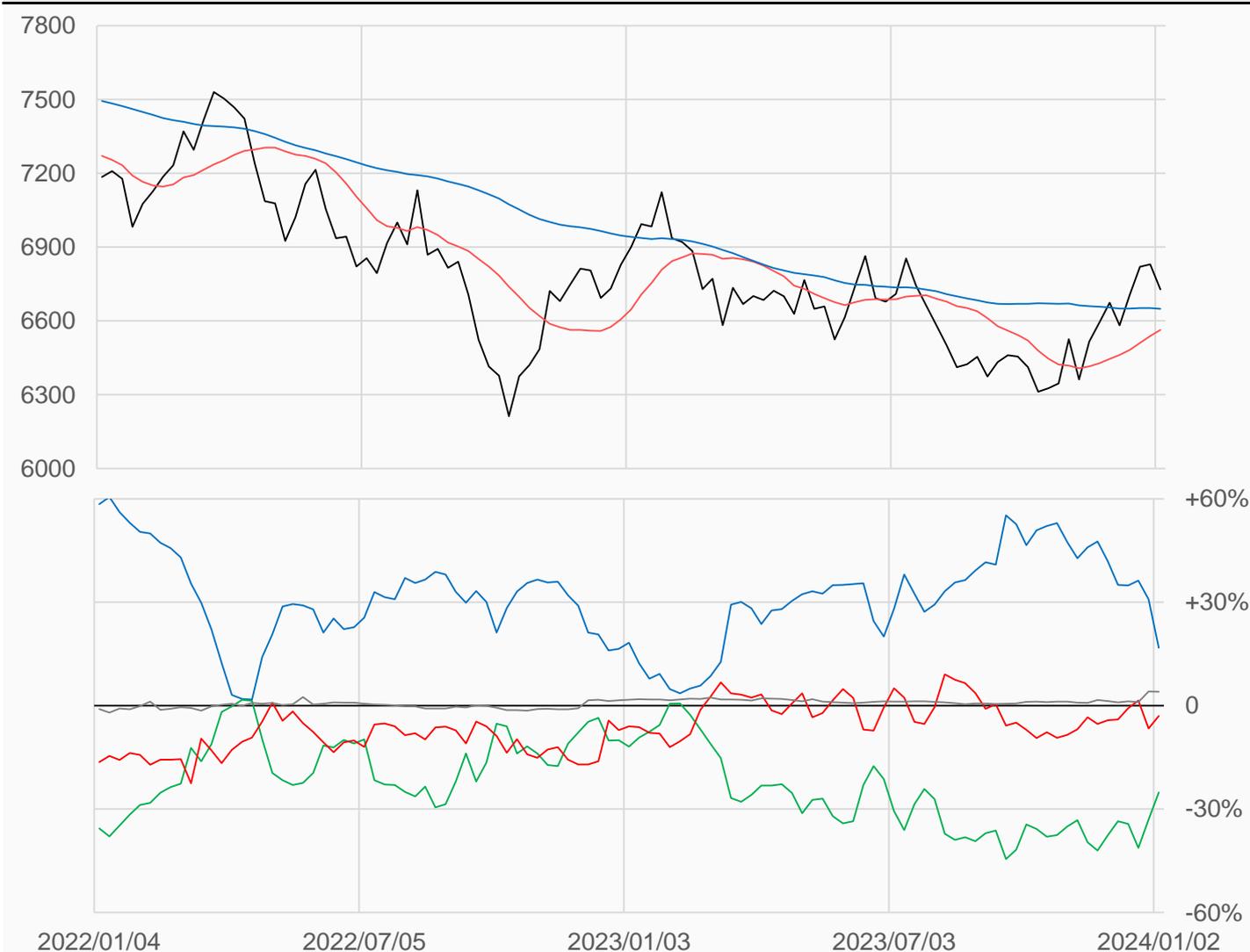
# 澳幣

澳幣較前一週下跌102點收在6728.5點，  
 槓桿基金多單增加6508口，空單增加738口，  
 淨空單較前一週減少5770口至5122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
2024/01/02	163556	169454	+5898	+3.61%	6728.5	↓ -102
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	49941	-8054	21469	+13968	+28472	-22022
資產管理	45382	+6696	88040	-4756	-42658	+11452
槓桿基金	37695	+6508	42817	+738	-5122	+5770
其他	7505	+70	653	-60	+6852	+130

週五收盤價與13週與52週平均線

— AD — 13週 6563.5 — 52週 6649.1



淨部位佔總OI% 經紀 +16.8% 資管 -25.2% 槓桿 -3.0% 其他 +4.0%

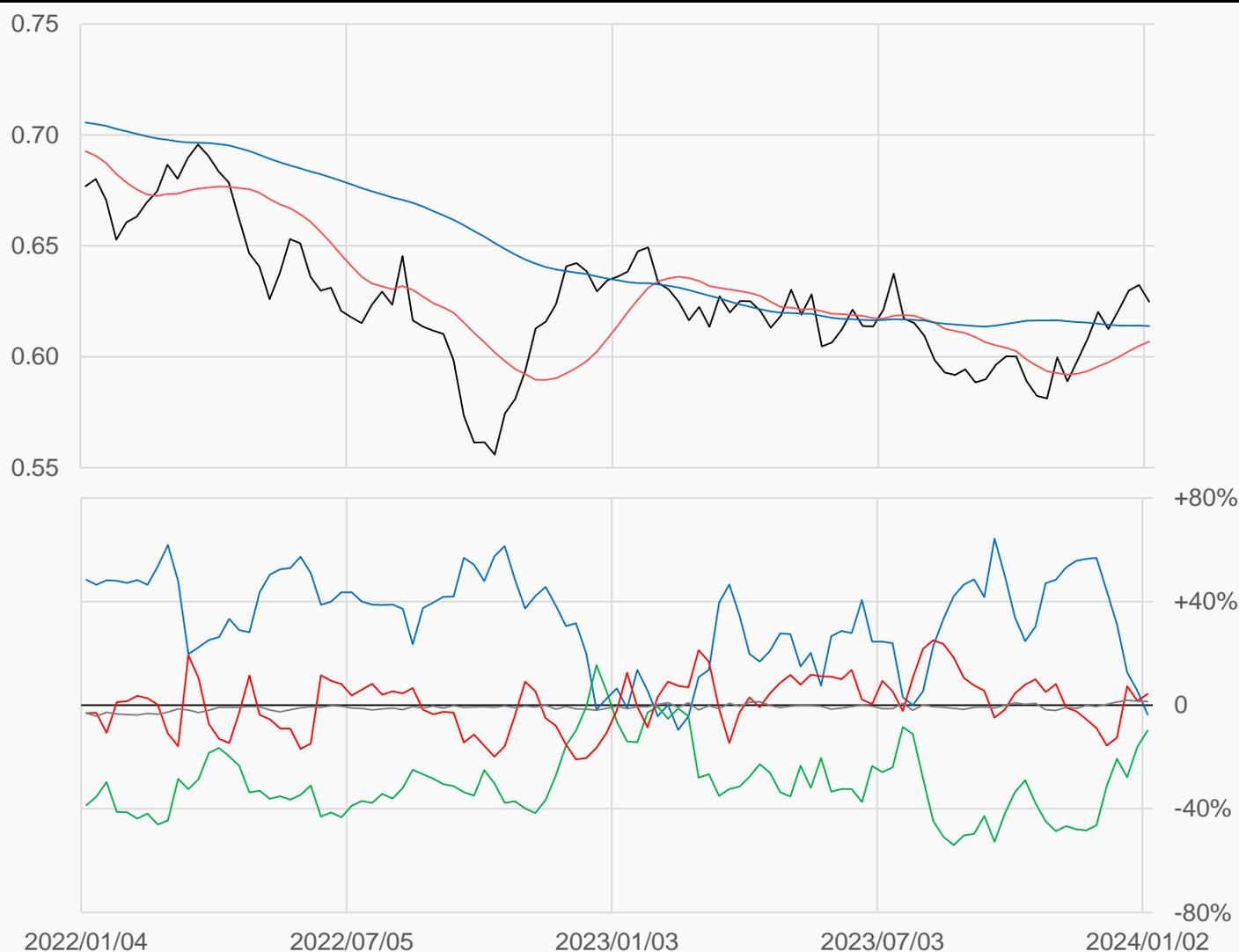
# 紐幣

紐幣較前一週下跌0.0076點收在0.6247點，  
 槓桿基金多單增加1774口，空單增加662口，  
 淨多單較前一週增加1112口至1696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
2024/01/02	34914	39218	+4304	+12.33%	0.6247	↓ -0.0076
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	5457	-120	6849	+3228	-1392	-3348
資產管理	15236	+2182	19078	+422	-3842	+1760
槓桿基金	12008	+1774	10312	+662	+1696	+1112
其他	865	-2	312	-18	+553	+16

週五收盤價與13週與52週平均線

— NE — 13週 0.6068 — 52週 0.6138



淨部位佔總OI% 經紀 -3.5% 資管 -9.8% 槓桿 +4.3% 其他 +1.4%

# 美元

美元較前一週上漲1.1點收在102.129點，  
 槓桿基金多單增加3513口，空單增加1273口，  
 淨多單較前一週增加2240口至3550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
2024/01/02	22071	23956	+1885	+8.54%	102.129	↑ +1.100
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	4089	-154	-4089	+154
資產管理	5478	-1809	3357	+754	+2121	-2563
槓桿基金	14849	+3513	11299	+1273	+3550	+2240
其他	1158	+109	1937	+90	-779	+19

週五收盤價與13週與52週平均線

— DX — 13週 103.9 — 52週 103.22



淨部位佔總OI% 經紀 -17.1% 資管 +8.9% 槓桿 +14.8% 其他 -3.3%

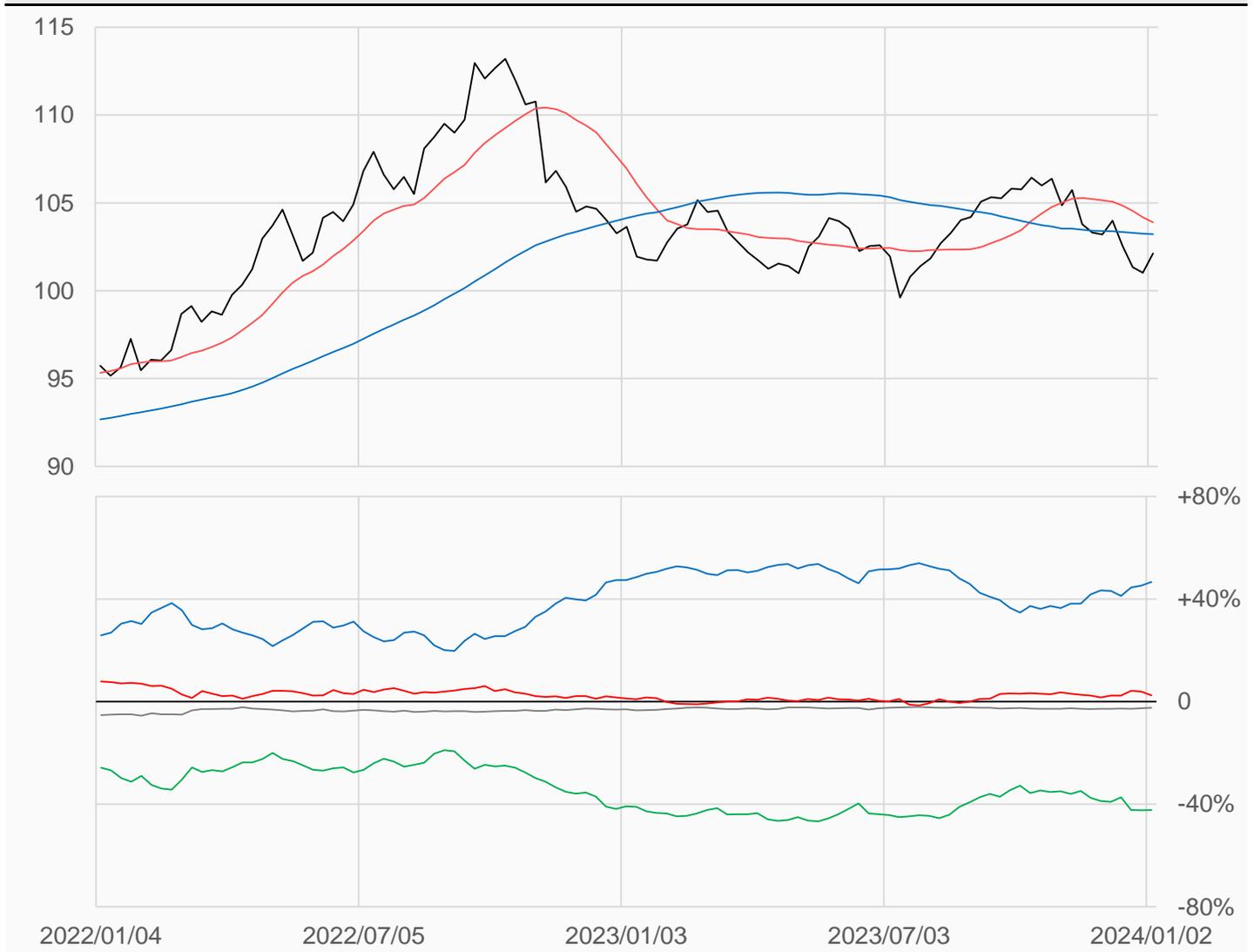
# 綜合美元 (不含美元)

綜合美元較前一週上漲1.1點收在102.129點，  
槓桿基金多單增加158口，空單增加15608口，  
淨多單較前一週減少15449口至26824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
2024/01/02	1081171	1100918	+19747	+1.83%	102.129	↑ +1.100
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	589055.4	+26480	74902.25	+1567	+514153	+24914
資產管理	186692.3	-4814	651801	+1634	-465109	-6448
槓桿基金	231035.2	+158	204211.5	+15608	+26824	-15449
其他	19536.84	+1888	45335.64	-522	-25799	+2409

週五收盤價與13週與52週平均線

— DXY — 13週 103.9 — 52週 103.22



淨部位佔總OI% 經紀 +46.7% 資管 -42.2% 槓桿 +2.4% 其他 -2.3%

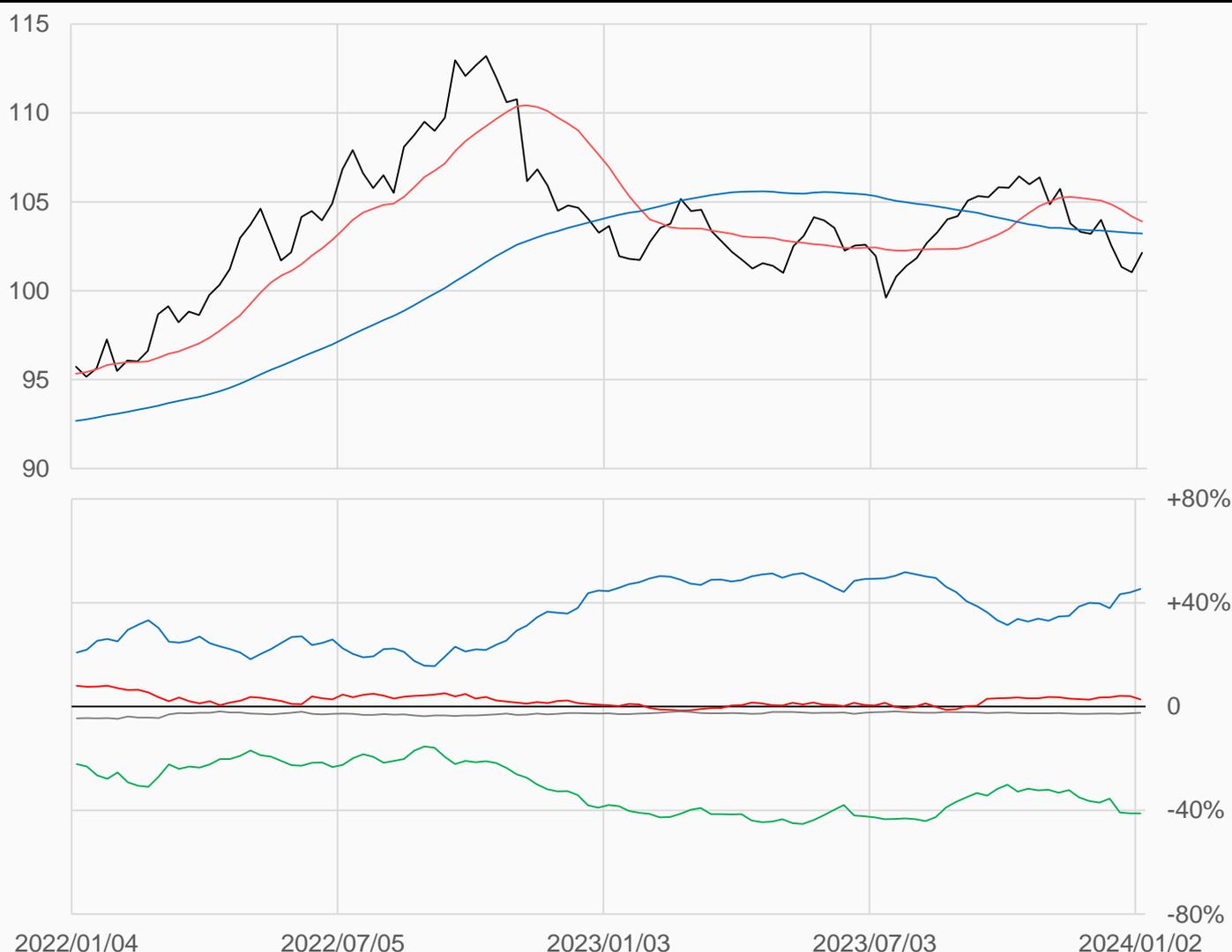
# 綜合美元 (含美元)

綜合美元較前一週上漲1.1點收在102.129點，  
槓桿基金多單增加3671口，空單增加16881口，  
淨多單較前一週減少13209口至30374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
2024/01/02	1103242	1124874	+21632	+1.96%	102.129	↑ +1.100
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	589055.4	+26480	78991.25	+1413	+510064	+25068
資產管理	192170.3	-6623	655158	+2388	-462988	-9011
槓桿基金	245884.2	+3671	215510.5	+16881	+30374	-13209
其他	20694.84	+1997	47272.64	-432	-26578	+2428

週五收盤價與13週與52週平均線

— DXX — 13週 103.9 — 52週 103.22



淨部位佔總OI% 經紀 +45.3% 資管 -41.2% 槓桿 +2.7% 其他 -2.4%

# 黃金

黃金較前一週下跌20點收在2042.4點，  
管理基金多單增加4713口，空單增加2704口，  
淨多單較前一週增加2009口至137516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
2024/01/02	685284	700881	+15597	+2.28%	2042.4	↓ -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	23294	+889	64884	-2386	-41590	+3275
互換交易	131772	+3538	336341	+9957	-204569	-6419
管理基金	236032	+4713	98516	+2704	+137516	+2009
其他	254760	+5459	174187	+7186	+80573	-1727

週五收盤價與13週與52週平均線

— GC — 13週 2004.5 — 52週 1948.8



淨部位佔總OI% 生產 -5.9% 互換 -29.2% 管理 +19.6% 其他 +11.5%

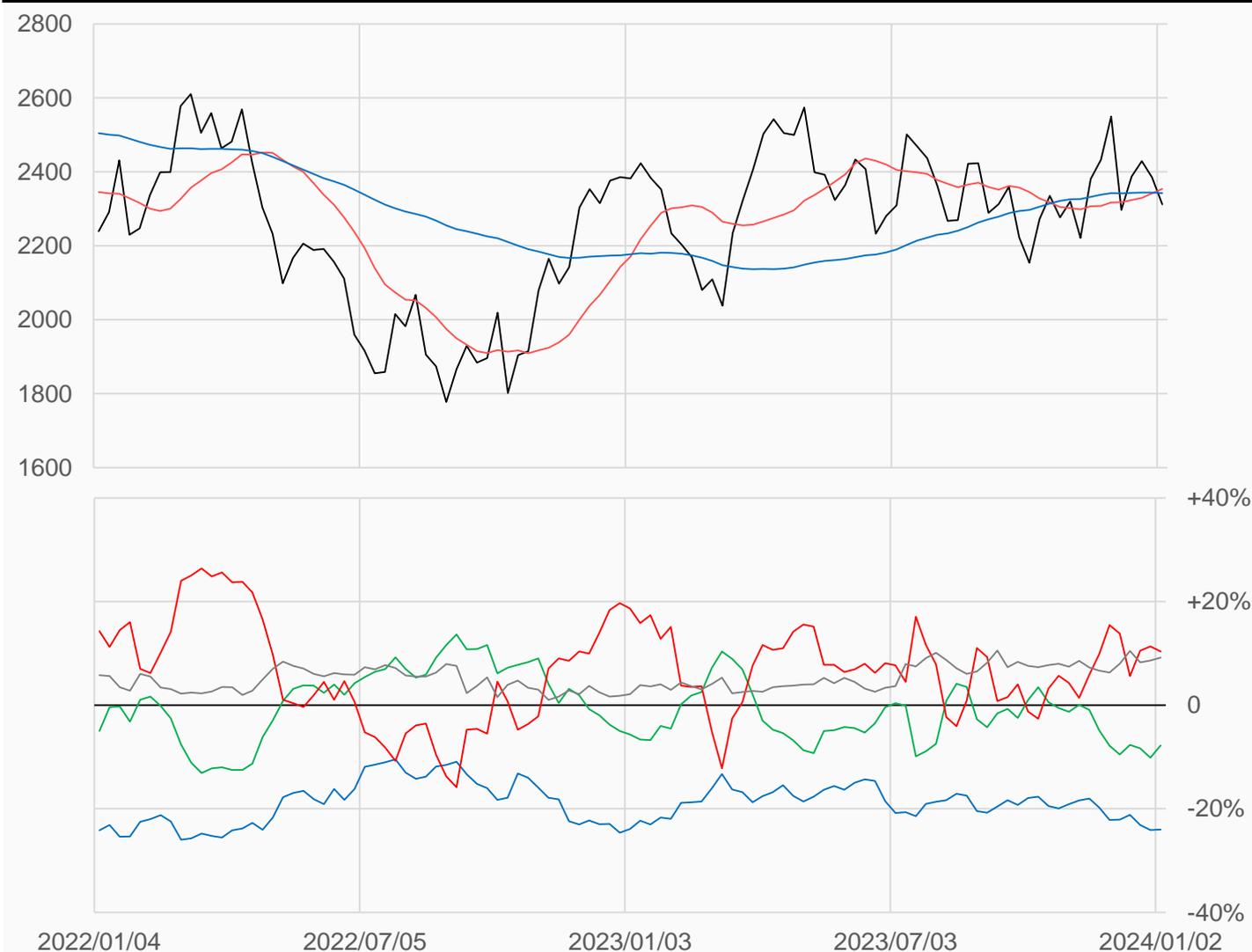
# 白銀

白銀較前一週下跌73.1點收在2312.2點，  
管理基金多單增加2931口，空單增加4001口，  
淨多單較前一週減少1070口至15952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
2024/01/02	150121	153882	+3761	+2.51%	2312.2	↓ -73.1
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	6341	+391	43231	+1106	-36890	-715
互換交易	37306	+1687	49252	-1592	-11946	+3279
管理基金	47551	+2931	31599	+4001	+15952	-1070
其他	32416	+2018	18260	+818	+14156	+1200

週五收盤價與13週與52週平均線

— SI — 13週 2353.9 — 52週 2342.7



淨部位佔總OI% 生產 -24.0% 互換 -7.8% 管理 +10.4% 其他 +9.2%

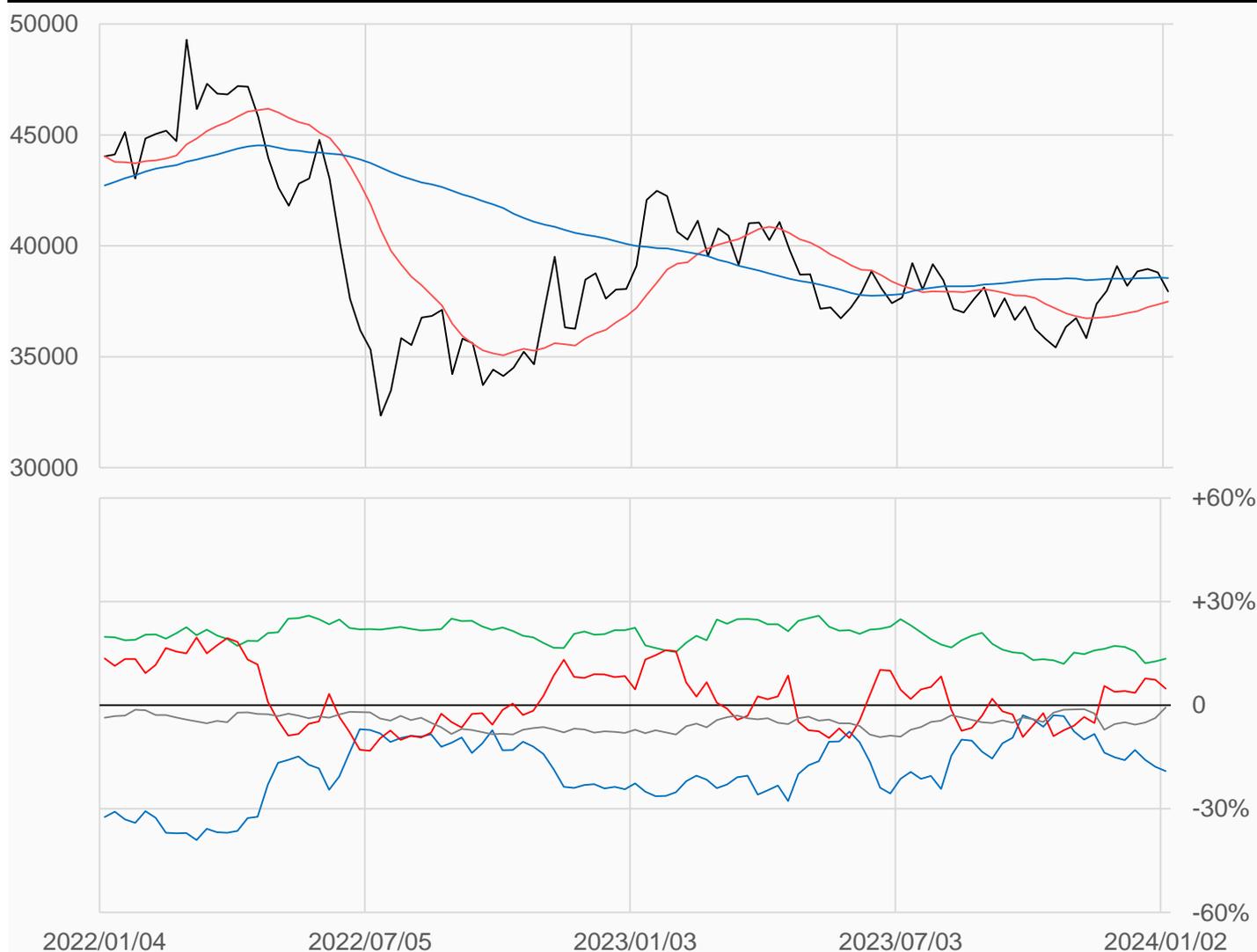
# 銅

銅較前一週下跌860點收在37945點，  
 管理基金多單減少533口，空單增加4355口，  
 淨多單較前一週減少4888口至10068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
2024/01/02	204082	208027	+3945	+1.93%	37945	↓ -860
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	18154	-3206	57876	+153	-39722	-3359
互換交易	50140	+2208	22183	+214	+27957	+1994
管理基金	89349	-533	79281	+4355	+10068	-4888
其他	33828	+4774	35202	-1370	-1374	+6144

週五收盤價與13週與52週平均線

— HG — 13週 37487 — 52週 38543



淨部位佔總OI% 生產 -19.1% 互換 +13.4% 管理 +4.8% 其他 -0.7%

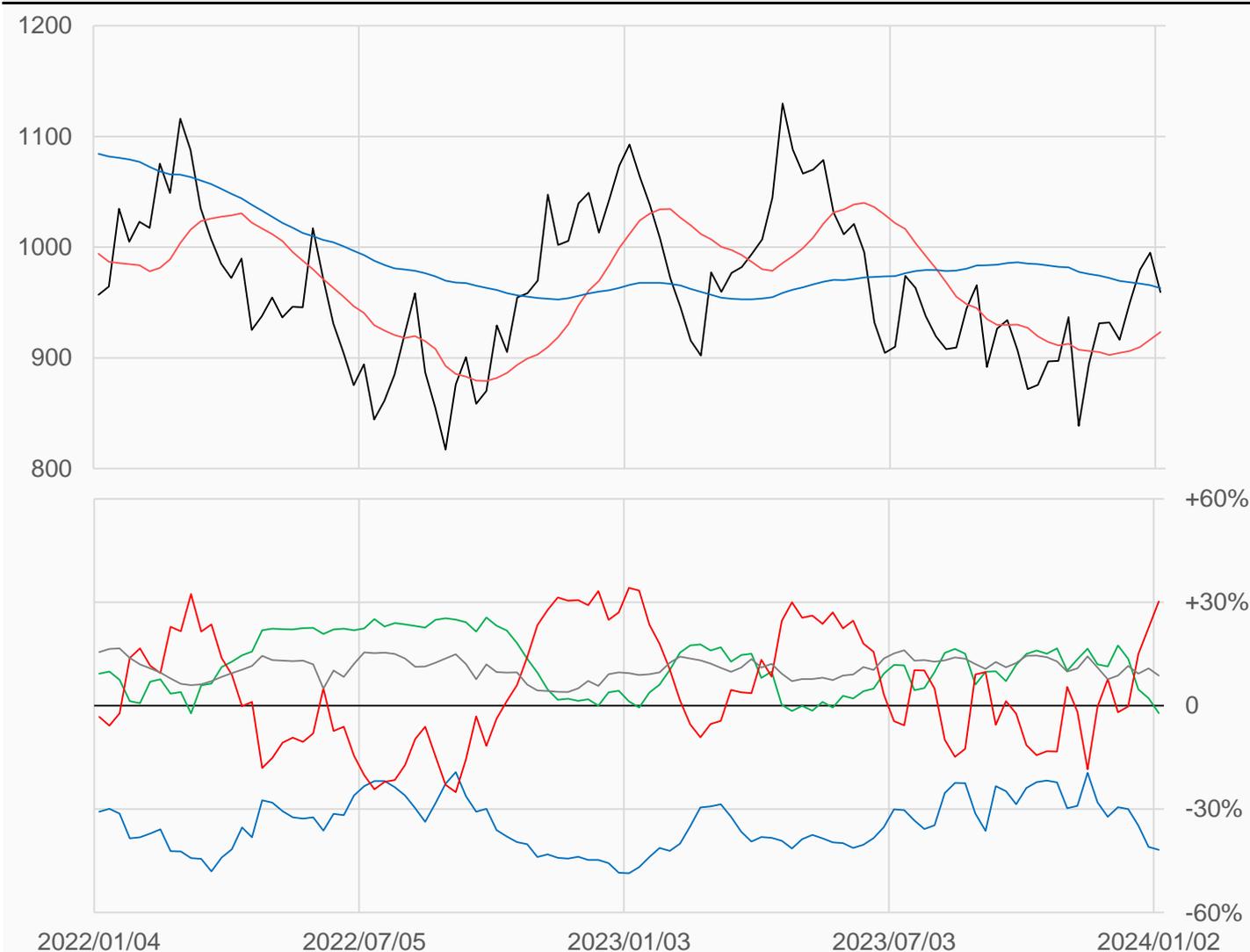
# 白金

白金較前一週下跌35.7點收在959.3點，  
管理基金多單增加6541口，空單減少152口，  
淨多單較前一週增加6693口至23546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
2024/01/02	74614	77798	+3184	+4.27%	959.3	↓ -35.7
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	2662	-254	35218	+1761	-32556	-2015
互換交易	12772	-1695	14439	+1566	-1667	-3261
管理基金	42876	+6541	19330	-152	+23546	+6693
其他	12345	-1020	5524	+216	+6821	-1236

週五收盤價與13週與52週平均線

— PL — 13週 923.25 — 52週 963.04



淨部位佔總OI% 生產 -41.8% 互換 -2.1% 管理 +30.3% 其他 +8.8%

# 輕原油

輕原油較前一週上漲2.16點收在73.81點，  
管理基金多單增加540口，空單增加36409口，  
淨多單較前一週減少35869口至89330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
2024/01/02	2016183	2037205	+21022	+1.04%	73.81	↑ +2.16
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	512732	+4959	355911	-9644	+156821	+14603
互換交易	234878	+6837	609019	-2870	-374141	+9707
管理基金	619924	+540	530594	+36409	+89330	-35869
其他	582836	+1753	479328	-682	+103508	+2435

週五收盤價與13週與52週平均線

— CL — 13週 77.449 — 52週 77.691



淨部位佔總OI% 生產 +7.7% 互換 -18.4% 管理 +4.4% 其他 +5.1%

# 熱燃油

熱燃油較前一週上漲554點收在26085點，  
管理基金多單減少628口，空單減少844口，  
淨多單較前一週增加216口至18965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
2024/01/02	306884	305232	-1652	-0.54%	26085	↑ +554
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	72289	+3461	166118	+1227	-93829	+2234
互換交易	64427	+854	13570	-1424	+50857	+2278
管理基金	84134	-628	65169	-844	+18965	+216
其他	38816	-1391	29343	-2826	+9473	+1435

週五收盤價與13週與52週平均線

— HO — 13週 27986 — 52週 28032



淨部位佔總OI% 生產 -30.7% 互換 +16.7% 管理 +6.2% 其他 +3.1%

# 天然氣

天然氣較前一週上漲0.379點收在2.893點，  
管理基金多單增加26351口，空單增加40口，  
淨空單較前一週減少26311口至78451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
2024/01/02	1366555	1409557	+43002	+3.15%	2.893	↑ +0.379
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	214401	-1647	311174	+14527	-96773	-16174
互換交易	293129	+16479	118420	+10599	+174709	+5880
管理基金	590453	+26351	668904	+40	-78451	+26311
其他	251944	+7641	265879	+19134	-13935	-11493

週五收盤價與13週與52週平均線

— NG — 13週 2.8896 — 52週 2.6438



淨部位佔總OI% 生產 -6.9% 互換 +12.4% 管理 -5.6% 其他 -1.0%

# 無鉛汽油

無鉛汽油較前一週上漲0.0029點收在2.1055點，  
管理基金多單減少659口，空單減少2135口，  
淨多單較前一週增加1476口至69301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
2024/01/02	333819	333947	+128	+0.04%	2.1055	↑ +0.0029
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	101437	-614	204700	+8804	-103263	-9418
互換交易	51344	+788	31488	-4639	+19856	+5427
管理基金	115375	-659	46074	-2135	+69301	+1476
其他	42450	+2221	35554	-1031	+6896	+3252

週五收盤價與13週與52週平均線

— RB — 13週 2.1798 — 52週 2.506



淨部位佔總OI% 生產 -30.9% 互換 +5.9% 管理 +20.8% 其他 +2.1%

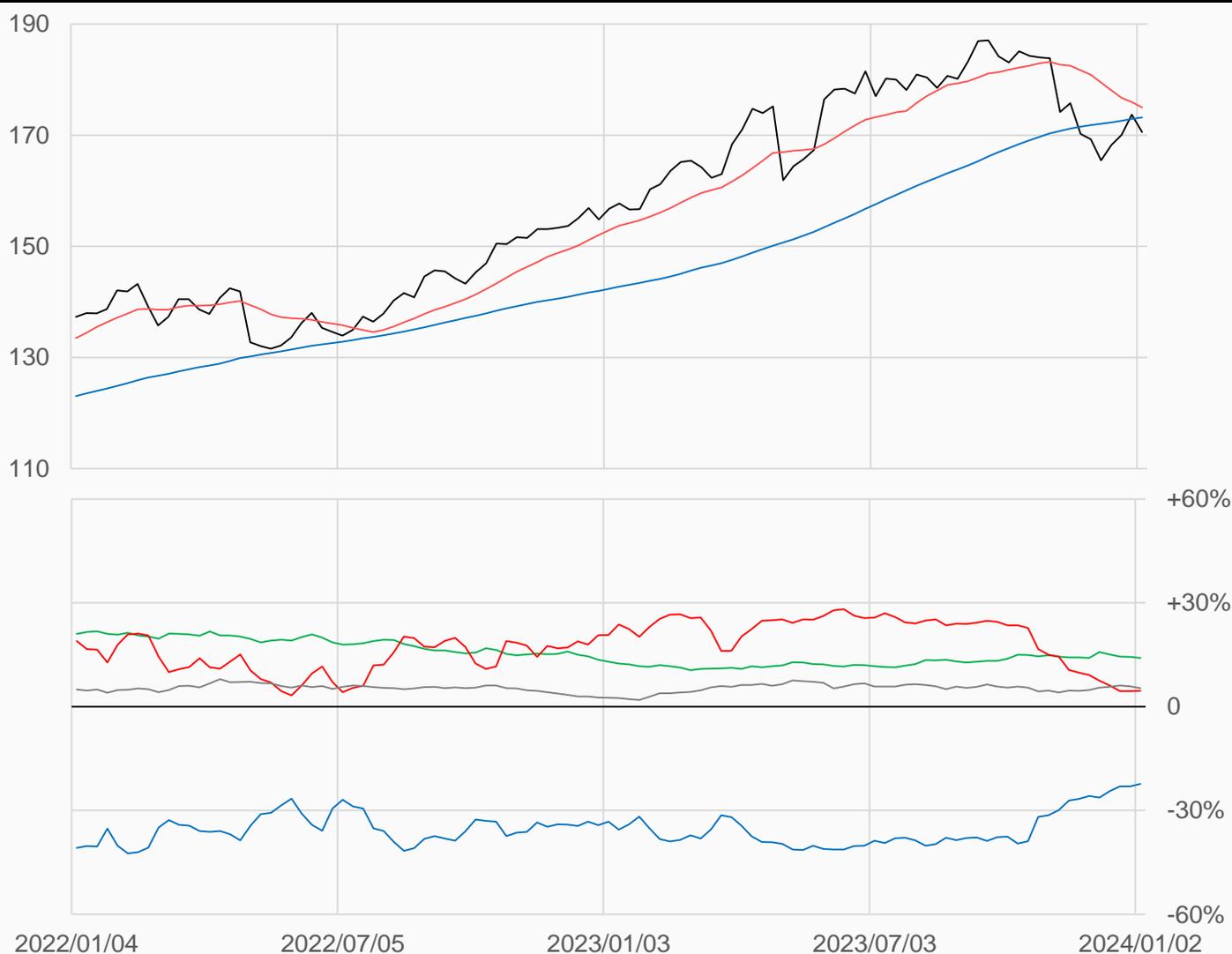
# 活牛

活牛較前一週下跌3.1點收在170.575點，  
管理基金多單增加6252口，空單增加5739口，  
淨多單較前一週增加513口至17415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
2024/01/02	374376	378657	+4281	+1.14%	170.575	↓ -3.100
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	81602	-2051	166100	-3785	-84498	+1734
互換交易	60208	+173	6933	+898	+53275	-725
管理基金	95385	+6252	77970	+5739	+17415	+513
其他	103291	+1169	83072	+3136	+20219	-1967

週五收盤價與13週與52週平均線

— LC — 13週 174.98 — 52週 173.2



淨部位佔總OI% 生產 -22.3% 互換 +14.1% 管理 +4.6% 其他 +5.3%

# 活豬

活豬較前一週上漲2.025點收在70點，  
管理基金多單增加2831口，空單增加14438口，  
淨空單較前一週增加11607口至17602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
2024/01/02	281471	305634	+24163	+8.58%	70.000	↑ +2.025
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	52212	+10019	85571	+642	-33359	+9377
互換交易	60823	+4265	16065	+3015	+44758	+1250
管理基金	79387	+2831	96989	+14438	-17602	-11607
其他	91932	+3662	79739	+4142	+12193	-480

週五收盤價與13週與52週平均線

— LH — 13週 70.681 — 52週 80.915



淨部位佔總OI% 生產 -10.9% 互換 +14.6% 管理 -5.8% 其他 +4.0%

# 玉米

玉米較前一週下跌10.5點收在460.75點，  
管理基金多單增加13719口，空單增加33419口，  
淨空單較前一週增加19700口至197326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
2024/01/02	1533323	1601347	+68024	+4.44%	460.75	↓ -10.50
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	447740	+18678	445507	-2991	+2233	+21669
互換交易	239526	+14096	43362	+5439	+196164	+8657
管理基金	388989	+13719	586315	+33419	-197326	-19700
其他	345678	+21461	312220	+22900	+33458	-1439

週五收盤價與13週與52週平均線

— ZC — 13週 473.79 — 52週 560.62



淨部位佔總OI% 生產 +0.1% 互換 +12.2% 管理 -12.3% 其他 +2.1%

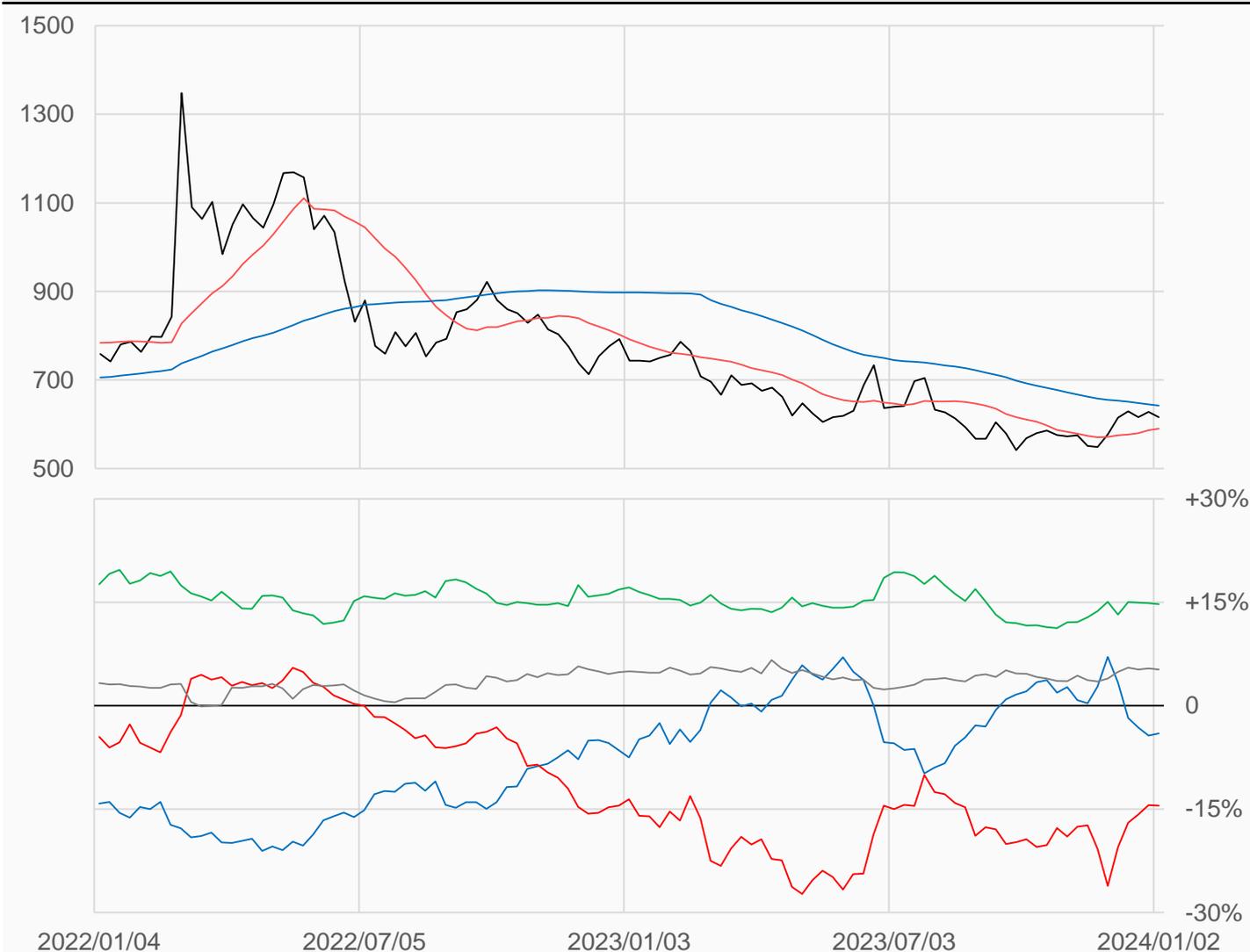
# 小麥

小麥較前一週下跌12點收在616點，  
 管理基金多單增加288口，空單增加1006口，  
 淨空單較前一週增加718口至60277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
2024/01/02	412546	416057	+3511	+0.85%	616.00	↓ -12.00
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	67775	+2546	84520	+1452	-16745	+1094
互換交易	81401	-243	20118	-134	+61283	-109
管理基金	141351	+288	201628	+1006	-60277	-718
其他	96122	+2678	74281	+3051	+21841	-373

週五收盤價與13週與52週平均線

— ZW — 13週 590 — 52週 642.14



淨部位佔總OI% 生產 -4.0% 互換 +14.7% 管理 -14.5% 其他 +5.2%

# 黃豆

黃豆較前一週下跌43.75點收在1249.75點，  
管理基金多單增加6716口，空單增加23112口，  
淨空單較前一週增加16396口至11629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
2024/01/02	752705	789479	+36774	+4.89%	1249.75	↓ -43.75
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	258281	+12901	336237	-1635	-77956	+14536
互換交易	142311	+2033	32510	-2204	+109801	+4237
管理基金	181472	+6716	193101	+23112	-11629	-16396
其他	150668	+23094	156276	+19306	-5608	+3788

週五收盤價與13週與52週平均線

— ZS — 13週 1307.7 — 52週 1409.7



淨部位佔總OI% 生產 -9.9% 互換 +13.9% 管理 -1.5% 其他 -0.7%

# 黃豆油

黃豆油較前一週下跌0.67點收在47.17點，  
 管理基金多單增加13035口，空單增加13936口，  
 淨空單較前一週增加901口至50554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
2024/01/02	504227	521118	+16891	+3.35%	47.17	↓ -0.67
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	148407	+4713	212600	+1749	-64193	+2964
互換交易	115474	+1146	19495	+2586	+95979	-1440
管理基金	133708	+13035	184262	+13936	-50554	-901
其他	91646	-736	75983	-2753	+15663	+2017

週五收盤價與13週與52週平均線

— BO — 13週 50.782 — 52週 57.32



淨部位佔總OI% 生產 -12.3% 互換 +18.4% 管理 -9.7% 其他 +3.0%

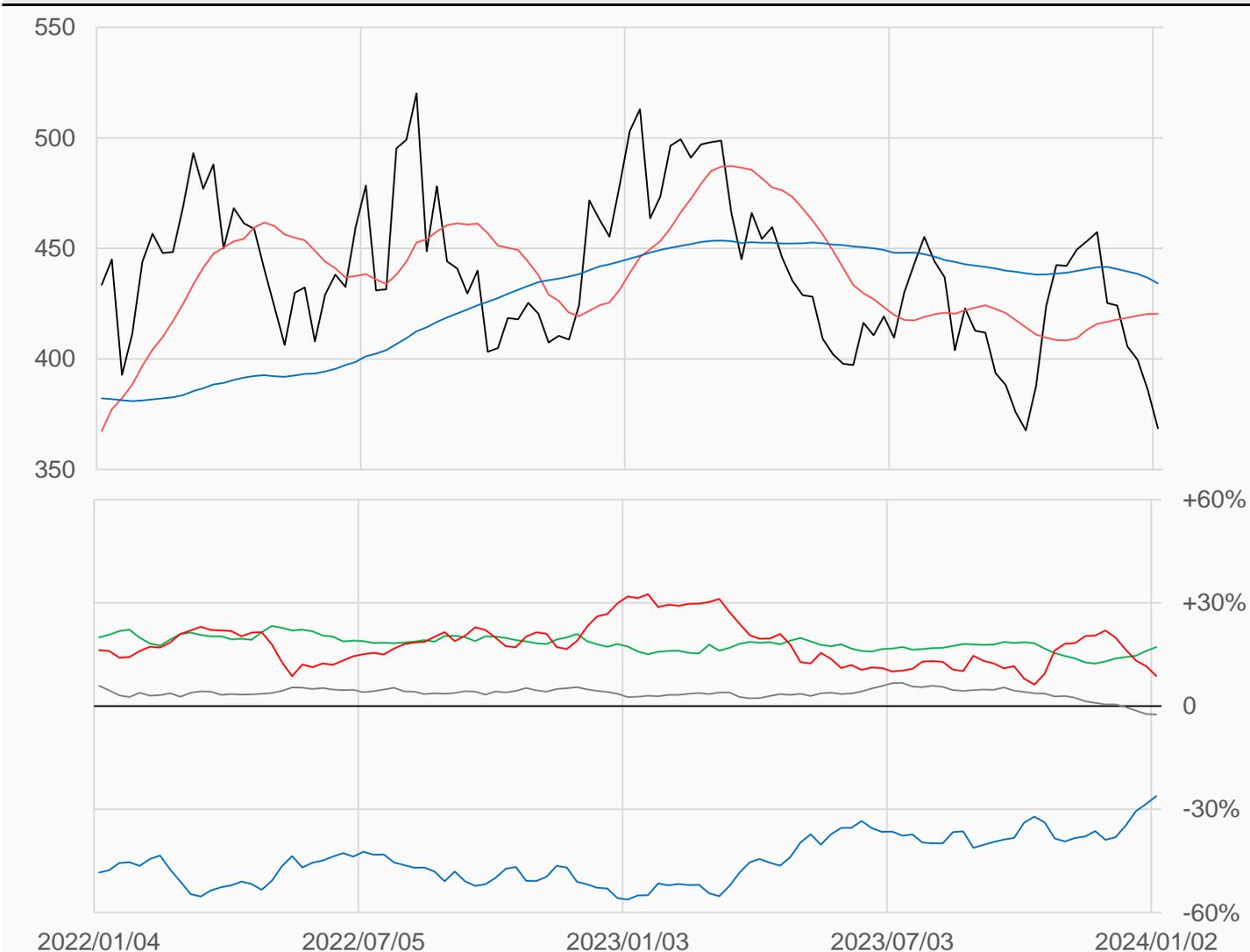
# 黃豆粉

黃豆粉較前一週下跌17.4點收在368.6點，  
管理基金多單減少6828口，空單增加9366口，  
淨多單較前一週減少16194口至43039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
2024/01/02	508260	489873	-18387	-3.62%	368.6	↓ -17.4
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	113029	+3325	240994	-13148	-127965	+16473
互換交易	94746	+3290	10544	+581	+84202	+2709
管理基金	146226	-6828	103187	+9366	+43039	-16194
其他	88659	-13893	100581	-13594	-11922	-299

週五收盤價與13週與52週平均線

— SM — 13週 420.42 — 52週 434.11



淨部位佔總OI% 生產 -26.1% 互換 +17.2% 管理 +8.8% 其他 -2.4%

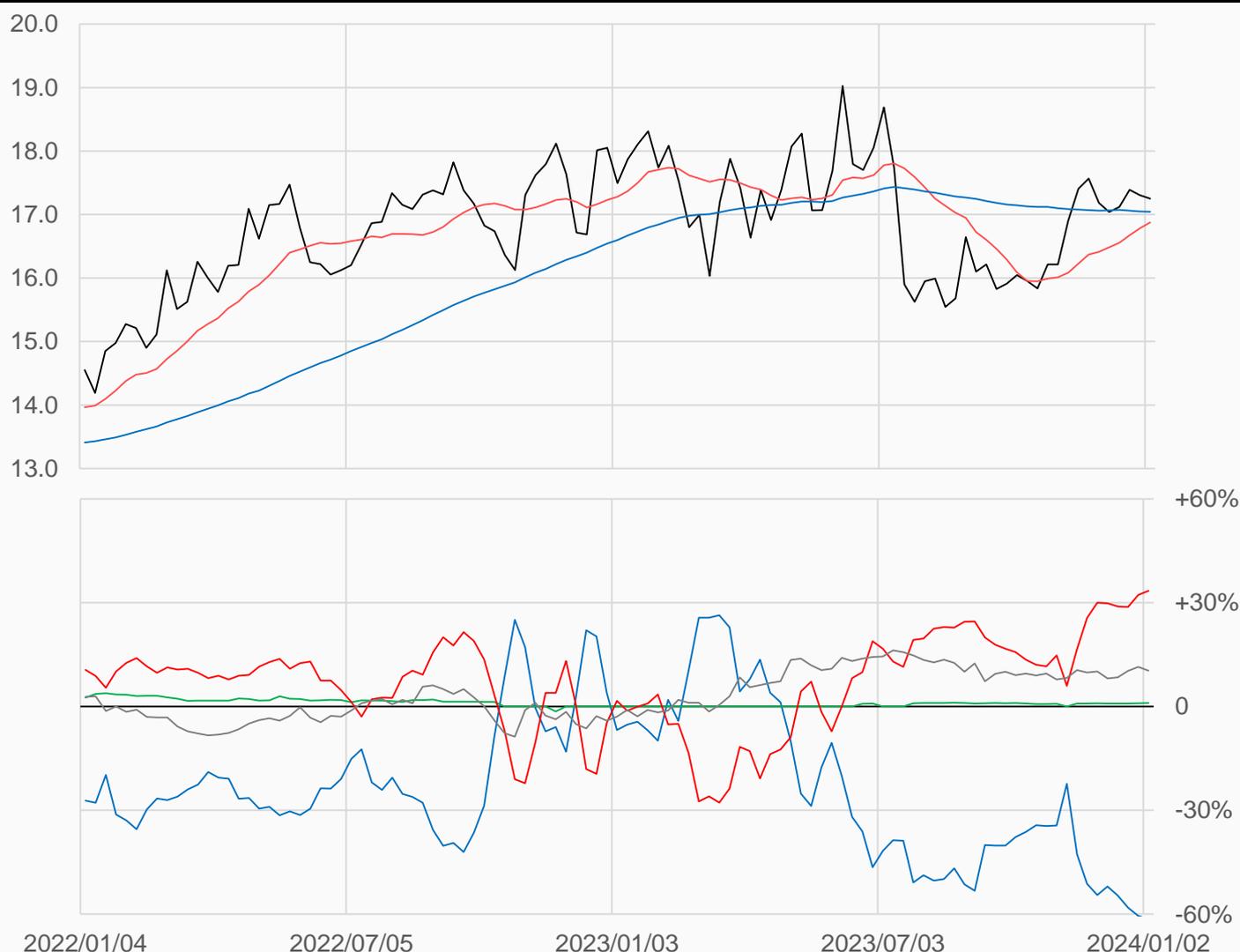
# 粗米

粗米較前一週下跌0.055點收在17.25點，  
管理基金多單增加195口，空單增加82口，  
淨多單較前一週增加113口至3999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
2024/01/02	12063	11955	-108	-0.90%	17.250	↓ -0.055
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	3098	-138	10440	-96	-7342	-42
互換交易	175	+62	58	+58	+117	+4
管理基金	4375	+195	376	+82	+3999	+113
其他	1569	-252	333	-106	+1236	-146

週五收盤價與13週與52週平均線

— RR — 13週 16.875 — 52週 17.043



淨部位佔總OI% 生產 -61.4% 互換 +1.0% 管理 +33.5% 其他 +10.3%

# 咖啡

咖啡較前一週下跌5.5點收在182.8點，  
管理基金多單增加3272口，空單增加1956口，  
淨多單較前一週增加1316口至41077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
2024/01/02	269951	273788	+3837	+1.42%	182.80	↓ -5.50
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	49750	+1480	114769	+107	-65019	+1373
互換交易	48037	-99	30399	+857	+17638	-956
管理基金	90919	+3272	49842	+1956	+41077	+1316
其他	74584	+475	69547	+1657	+5037	-1182

週五收盤價與13週與52週平均線

— KC — 13週 178.53 — 52週 172.67



淨部位佔總OI% 生產 -23.7% 互換 +6.4% 管理 +15.0% 其他 +1.8%

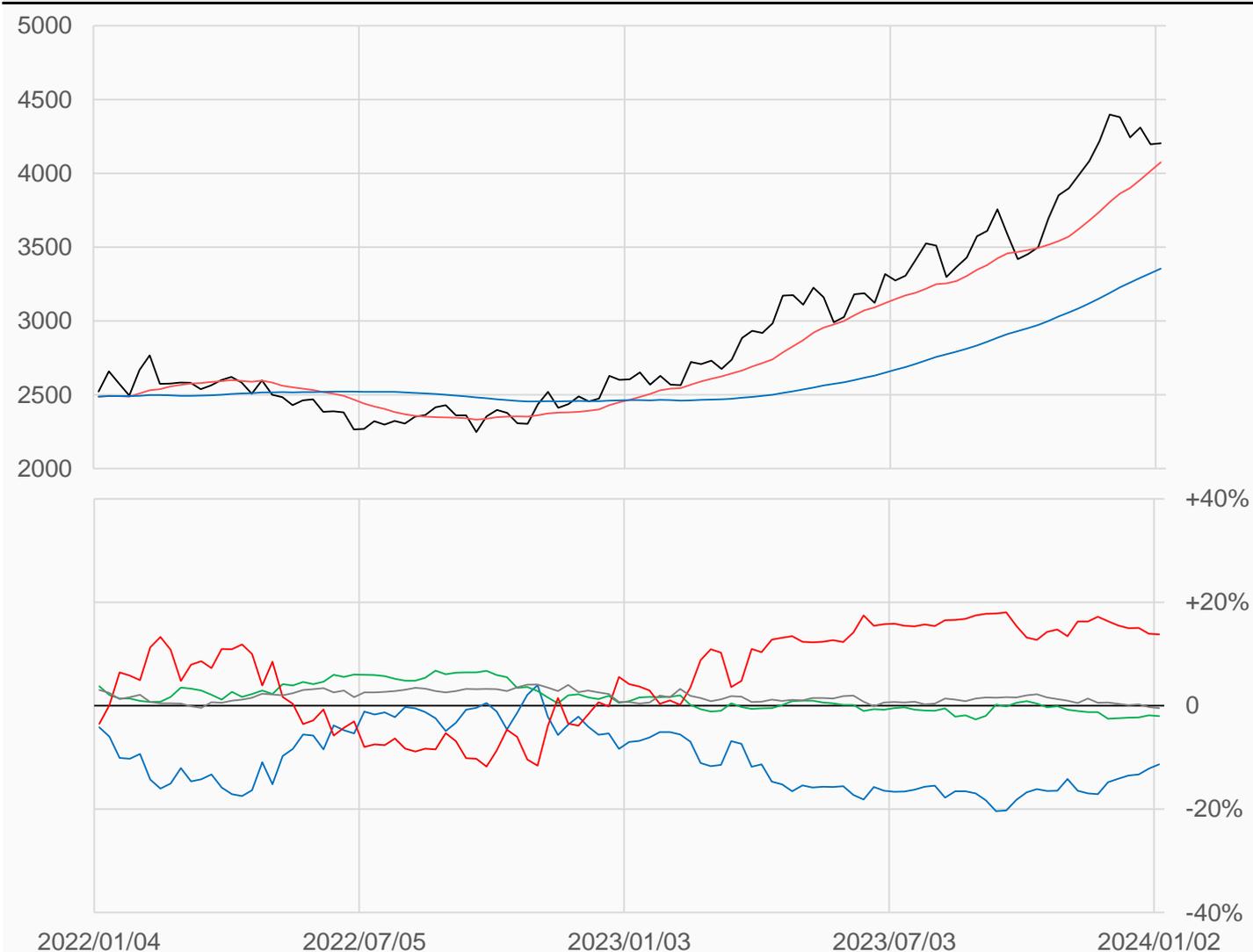
# 可可

可可較前一週上漲8點收在4204點，  
管理基金多單增加8090口，空單增加6870口，  
淨多單較前一週增加1220口至62942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
2024/01/02	443406	455299	+11893	+2.68%	4204	↑ +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	103317	+3440	154904	+1088	-51587	+2352
互換交易	26055	+107	35357	+1244	-9302	-1137
管理基金	188327	+8090	125385	+6870	+62942	+1220
其他	121946	+527	124091	+1419	-2145	-892

週五收盤價與13週與52週平均線

— CC — 13週 4074.6 — 52週 3354.3



淨部位佔總OI% 生產 -11.3% 互換 -2.0% 管理 +13.8% 其他 -0.5%

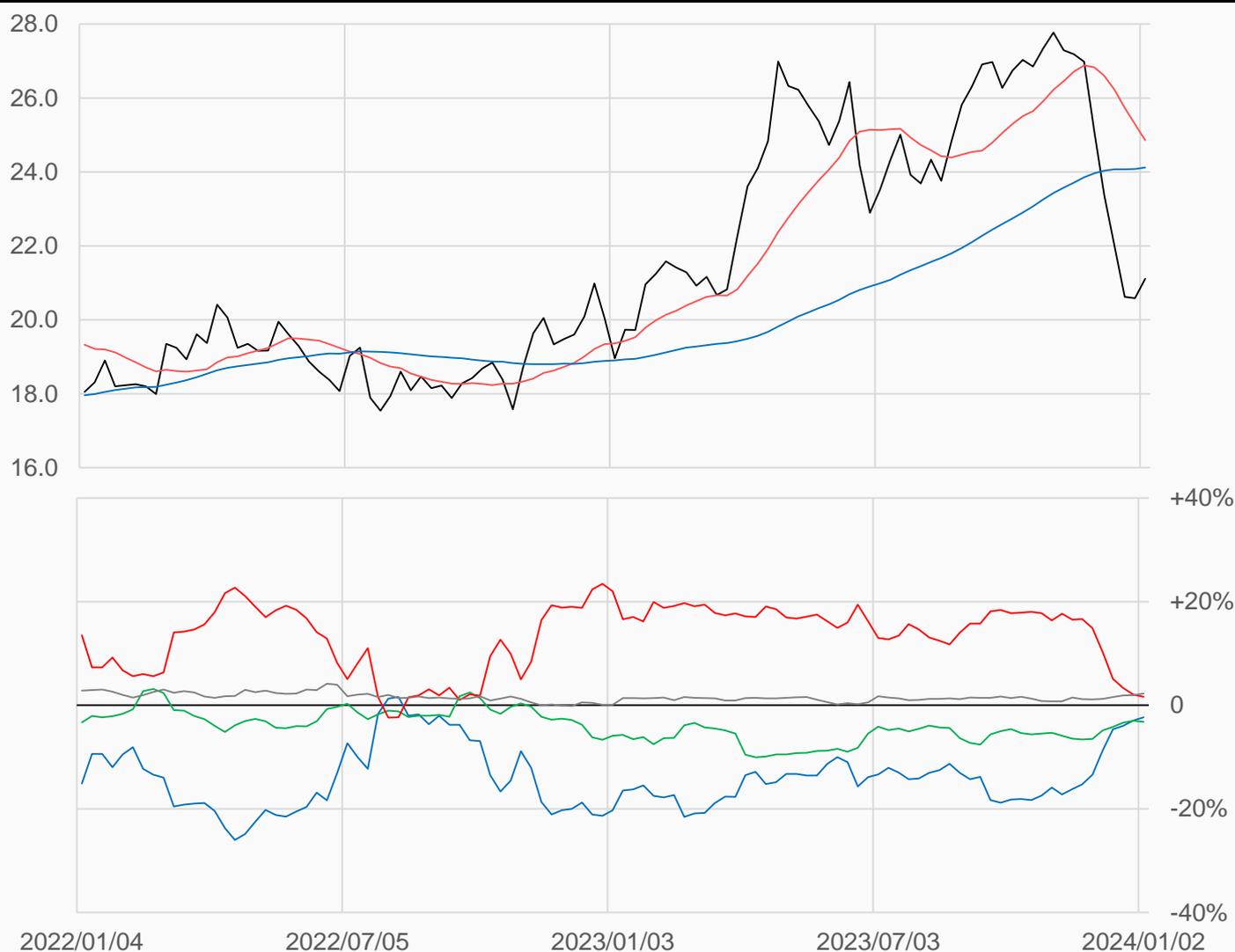
# 11號糖

11號糖較前一週上漲0.53點收在21.11點，  
 管理基金多單減少1378口，空單增加2585口，  
 淨多單較前一週減少3963口至18197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
2024/01/02	1082449	1116902	+34453	+3.18%	21.11	↑ +0.53
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	406707	+28373	432906	+22697	-26199	+5676
互換交易	186485	+2750	222234	+6001	-35749	-3251
管理基金	193966	-1378	175769	+2585	+18197	-3963
其他	249400	+4352	224457	+404	+24943	+3948

週五收盤價與13週與52週平均線

— SB — 13週 24.861 — 52週 24.118



淨部位佔總OI% 生產 -2.3% 互換 -3.2% 管理 +1.6% 其他 +2.2%

# 棉花

棉花較前一週下跌0.81點收在80.19點，  
管理基金多單減少387口，空單增加154口，  
淨空單較前一週增加541口至4388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
2024/01/02	225710	228039	+2329	+1.03%	80.19	↓ -0.81
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	39223	-741	79952	+212	-40729	-953
互換交易	61703	+139	29470	+785	+32233	-646
管理基金	61596	-387	65984	+154	-4388	-541
其他	52501	+3396	39304	+552	+13197	+2844

週五收盤價與13週與52週平均線

— CT — 13週 80.756 — 52週 82.841



淨部位佔總OI% 生產 -17.9% 互換 +14.1% 管理 -1.9% 其他 +5.8%