

# CFTC 大額交易人持倉報告

永豐期貨顧問事業部編製

2024/1/22

資料來源：CFTC官網、精誠資訊DQII

# 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 2024/01/16

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	98187	-5155	+17074	-82	+17.39%
	VX	359265	+4093	-14586	+3296	-4.06%
	ES	3105637	+38504	-313001	+16047	-10.08%
	NQ	313804	-2574	-33811	+2267	-10.77%
債券	30年債	1597914	-18820	-420161	+4230	-26.29%
	10年債	5429277	+44199	-1519307	-70444	-27.98%
	5年債	6208265	+116144	-1892958	-14242	-30.49%
	2年債	3946735	+123192	-1431122	+49584	-36.26%
外匯	英鎊	209044	+10090	+24197	-1849	+11.58%
	澳幣	173954	+7388	+8287	+1833	+4.76%
	紐幣	38469	-73	+897	-2341	+2.33%
	綜美(未含)	1099770	+31614	+19963	+6343	+1.82%
	綜美(含美)	1123313	+31249	+19468	+3907	+1.73%
	瑞郎	57101	+1398	-107	-166	-0.19%
	歐元	809764	+22503	-9492	-6319	-1.17%
	美元	23543	-365	-495	-2436	-2.10%
	日圓	245035	+13316	-44079	+6200	-17.99%
	加幣	178079	-5345	-33184	+2611	-18.63%

# 金融類投機部位每週變動表

數據日期 2024/01/16

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	黃金	668529	+3242	+100634	-5653	+15.05%
	白銀	154103	+2225	+6030	-1856	+3.91%
	白金	79159	+3520	+681	-16403	+0.86%
	銅	240498	+15088	-25309	-8555	-10.52%
能源	無鉛汽油	356461	+12492	+59220	-2885	+16.61%
	熱燃油	341629	+19504	+22698	-3034	+6.64%
	輕原油	2084231	+25127	+90160	-20969	+4.33%
	天然氣	1426894	+2320	-7369	+38105	-0.52%
肉類	活牛	375863	+1693	+12993	-777	+3.46%
	活豬	295768	+11271	-1807	+4782	-0.61%
農產	粗米	11056	-234	+3184	-47	+28.80%
	黃豆粉	547287	+31762	-4079	-14539	-0.75%
	黃豆油	572643	+30412	-47011	-402	-8.21%
	黃豆	874503	+40876	-76797	-45549	-8.78%
	玉米	1852331	+138434	-260542	-29819	-14.07%
	小麥	458510	+31203	-68575	-10586	-14.96%
軟性	咖啡	264296	-5251	+42728	+586	+16.17%
	可可	476440	+21337	+63701	+4585	+13.37%
	11號糖	1080547	-25972	+14788	-1105	+1.37%
	棉花	240743	+6224	-2016	+4857	-0.84%

# mini 道瓊

mini道瓊較前一週上漲253點收在38045點，  
 槓桿基金多單減少1741口，空單減少1659口，  
 淨多單較前一週減少0.48%或82口至17074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
2024/01/16	103342	98187	-5155	-4.99%	38045	↑ +253
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	31011	+72	54814	-7525	-23803	+7597
資產管理	20896	-2084	11327	+1495	+9569	-3579
槓桿基金	30720	-1741	13646	-1659	+17074	-82
其他	1231	-1460	4294	+1350	-3063	-2810

週五收盤價與13週與52週平均線

— YM — 13週 36178 — 52週 34517



淨部位佔總OI% 經紀 -24.2% 資管 +9.7% 槓桿 +17.4% 其他 -3.1%

# mini NQ

miniNQ較前一週上漲469.25點收在17438.5點，  
 槓桿基金多單增加5839口，空單增加3572口，  
 淨空單較前一週減少2267口至33811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
2024/01/16	316378	313804	-2574	-0.81%	17438.50	↑ +469.25
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	62883	-285	111077	-3844	-48194	+3559
資產管理	116966	-1885	32141	+657	+84825	-2542
槓桿基金	82955	+5839	116766	+3572	-33811	+2267
其他	10061	-2467	13527	-2821	-3466	+354

週五收盤價與13週與52週平均線

— NQ — 13週 16191 — 52週 14632



淨部位佔總OI% 經紀 -15.4% 資管 +27.0% 槓桿 -10.8% 其他 -1.1%



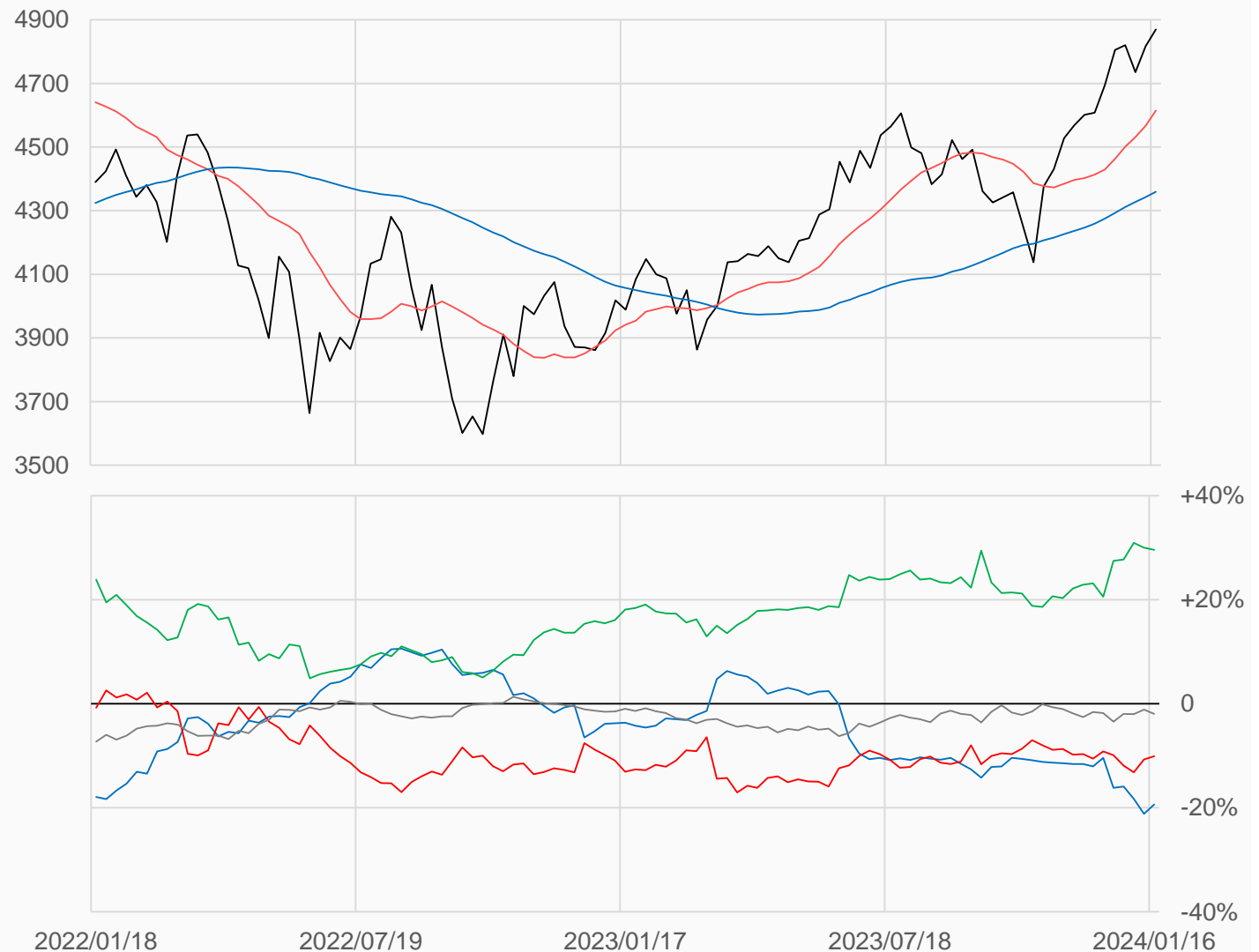
# mini S&P

miniS&P較前一週上漲53點收在4869.5點，  
 槓桿基金多單增加20619口，空單增加4572口，  
 淨空單較前一週減少16047口至313001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
2024/01/16	3067133	3105637	+38504	+1.26%	4869.50	▲ +53.00
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	434500	+13400	1036527	-33966	-602027	+47366
資產管理	1372452	+6044	453382	+7105	+919070	-1061
槓桿基金	851914	+20619	1164915	+4572	-313001	+16047
其他	135130	+11482	195372	+36596	-60242	-25114

週五收盤價與13週與52週平均線

— ES — 13週 4614.5 — 52週 4359.6



淨部位佔總OI% 經紀 -19.4% 資管 +29.6% 槓桿 -10.1% 其他 -1.9%

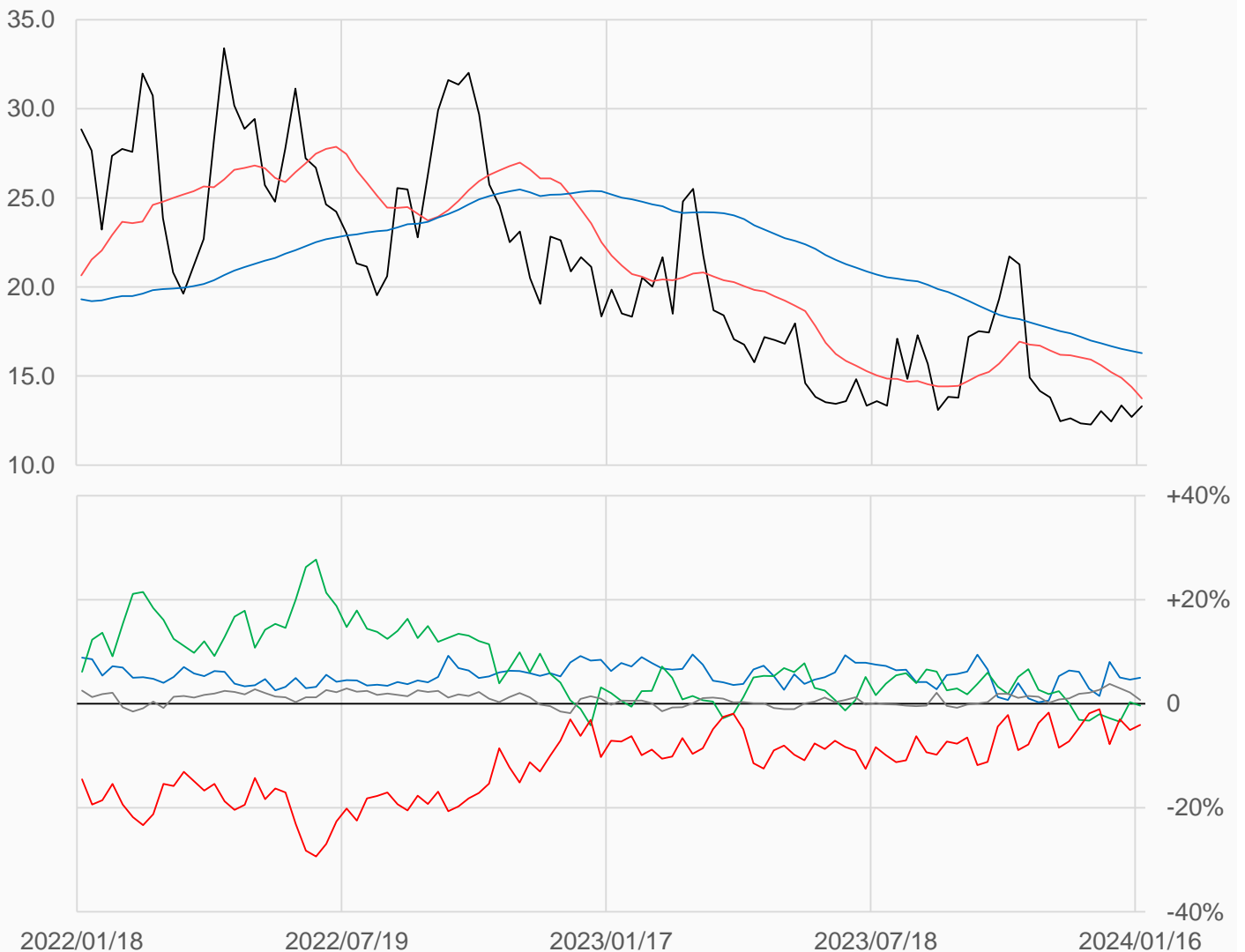
# VIX

VIX較前一週上漲0.6點收在13.3點，  
槓桿基金多單增加266口，空單減少3030口，  
淨空單較前一週減少3296口至14586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
2024/01/16	355172	359265	+4093	+1.15%	13.30	↑ +0.60
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	74498	+4099	56581	+2551	+17917	+1548
資產管理	124208	+5147	125512	+7459	-1304	-2312
槓桿基金	117457	+266	132043	-3030	-14586	+3296
其他	16734	-5863	14082	-934	+2652	-4929

週五收盤價與13週與52週平均線

— VX — 13週 13.746 — 52週 16.287



淨部位佔總OI% 經紀 +5.0% 資管 -0.4% 槓桿 -4.1% 其他 +0.7%

# 30年債

美國30年公債較前一週下跌2.875點收在120點，  
 槓桿基金多單減少14230口，空單減少18459口，  
 淨空單較前一週減少4229口至420161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
2024/01/16	1616734	1597914	-18820	-1.16%	120	↓ -2 28/32
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	72423	-3788	244852	-6986	-172429	+3198
資產管理	998917	+1301	479593	+11613	+519324	-10312
槓桿基金	197849	-14230	618010	-18459	-420161	+4229
其他	118021	-2181	104985	-3464	+13036	+1283

週五收盤價與13週與52週平均線

— US — 13週 118.57 — 52週 123.18



淨部位佔總OI% 經紀 -10.8% 資管 +32.5% 槓桿 -26.3% 其他 +0.8%

# 10年債

美國10年公債較前一週下跌1.4688點收在111.125點，  
 槓桿基金多單減少31620口，空單增加38823口，  
 淨空單較前一週增加70443口至1519307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
2024/01/16	5385078	5429277	+44199	+0.82%	111 8/64	↓ -1 30/64
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	415360	+35651	622278	+25085	-206918	+10566
資產管理	3221294	+69367	1835677	-7510	+1385617	+76877
槓桿基金	838678	-31620	2357985	+38823	-1519307	-70443
其他	522768	-24050	244029	-989	+278739	-23061

週五收盤價與13週與52週平均線

— TY — 13週 110.21 — 52週 111.55



淨部位佔總OI% 經紀 -3.8% 資管 +25.5% 槓桿 -28.0% 其他 +5.1%

# 5年公債

美國5年公債較前一週下跌1.0938點收在107.6796875點，  
 槓桿基金多單增加23479口，空單增加37722口，  
 淨空單較前一週增加14243口至1892958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
2024/01/16	6092121	6208265	+116144	+1.91%	107 87/128	↓ -1 12/128
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	207823	+5732	876373	+34406	-668550	-28674
資產管理	3775977	+84018	1802379	+41721	+1973598	+42297
槓桿基金	1199511	+23479	3092469	+37722	-1892958	-14243
其他	582388	+11186	143838	-1908	+438550	+13094

週五收盤價與13週與52週平均線

— FV — 13週 106.89 — 52週 107.33



淨部位佔總OI% 經紀 -10.8% 資管 +31.8% 槓桿 -30.5% 其他 +7.1%

# 2年公債

美國2年公債較前一週下跌0.543點收在102.57421875點，

槓桿基金多單增加99108口，空單增加49524口，

淨空單較前一週減少49584口至1431122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
2024/01/16	3823543	3946735	+123192	+3.22%	102 74/128	↓ - 70/128
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	136734	-968	441342	+22266	-304608	-23234
資產管理	2056419	+35446	807533	+38529	+1248886	-3083
槓桿基金	971596	+99108	2402718	+49524	-1431122	+49584
其他	531271	-2440	157352	+5623	+373919	-8063

週五收盤價與13週與52週平均線

— TU — 13週 102.11 — 52週 102.1



淨部位佔總OI% 經紀 -7.7% 資管 +31.6% 槓桿 -36.3% 其他 +9.5%

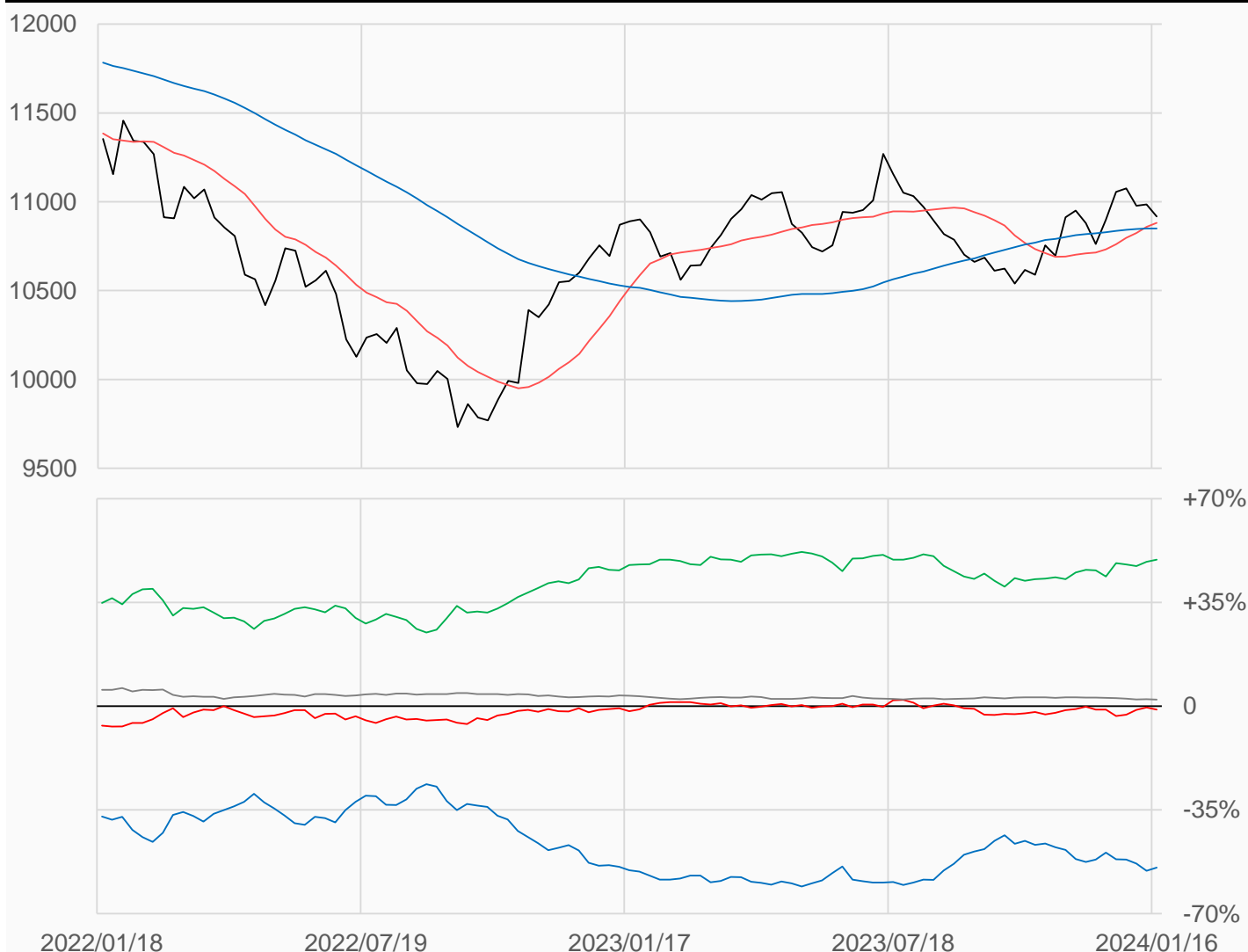
# 歐元

歐元較前一週下跌67點收在10917.5點，  
 槓桿基金多單增加428口，空單增加6747口，  
 淨空單較前一週增加6319口至9492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
2024/01/16	787261	809764	+22503	+2.86%	10917.5	↓ -67.0
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	40363	+2292	481754	+6370	-441391	-4078
資產管理	528248	+21199	127932	+4390	+400316	+16809
槓桿基金	124808	+428	134300	+6747	-9492	-6319
其他	32274	-340	14299	+418	+17975	-758

週五收盤價與13週與52週平均線

— EC — 13週 10881 — 52週 10850



淨部位佔總OI% 經紀 -54.5% 資管 +49.4% 槓桿 -1.2% 其他 +2.2%

# 日圓

日圓較前一週下跌164.5點收在6808.5點，  
 槓桿基金多單增加2802口，空單減少3398口，  
 淨空單較前一週減少6200口至44079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
2024/01/16	231719	245035	+13316	+5.75%	6808.5	↓ -164.5
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	53389	+9937	14725	+1028	+38664	+8909
資產管理	74830	+479	79767	+13254	-4937	-12775
槓桿基金	59463	+2802	103542	-3398	-44079	+6200
其他	16158	+2396	2308	-1480	+13850	+3876

週五收盤價與13週與52週平均線

— JY — 13週 6874.7 — 52週 7128.3



淨部位佔總OI% 經紀 +15.8% 資管 -2.0% 槓桿 -18.0% 其他 +5.7%



# 英鎊

英鎊較前一週下跌51點收在12702點，  
 槓桿基金多單增加5375口，空單增加7224口，  
 淨多單較前一週減少1849口至24197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
2024/01/16	198954	209044	+10090	+5.07%	12702	↓ -51
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	36807	-2915	23524	+3267	+13283	-6182
資產管理	54319	+5781	89552	-4025	-35233	+9806
槓桿基金	86119	+5375	61922	+7224	+24197	-1849
其他	1163	+20	3184	-55	-2021	+75

週五收盤價與13週與52週平均線

— BP — 13週 12567 — 52週 12477



淨部位佔總OI% 經紀 +6.4% 資管 -16.9% 槓桿 +11.6% 其他 -1.0%

# 瑞郎

瑞郎較前一週下跌233點收在11575.5點，  
 槓桿基金多單增加1156口，空單增加1323口，  
 淨空單較前一週增加167口至107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
2024/01/16	55703	57101	+1398	+2.51%	11576	↓ -233
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	8378	-262	10621	+390	-2243	-652
資產管理	16151	-992	17302	-52	-1151	-940
槓桿基金	13725	+1156	13832	+1323	-107	-167
其他	1634	+161	1600	0	+34	+161

週五收盤價與13週與52週平均線

— SF — 13週 11504 — 52週 11245



淨部位佔總OI% 經紀 -3.9% 資管 -2.0% 槓桿 -0.2% 其他 +0.1%

# 加幣

加幣較前一週下跌17.5點收在7449點，  
 槓桿基金多單減少4689口，空單減少7301口，  
 淨空單較前一週減少2612口至33184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
2024/01/16	183424	178079	-5345	-2.91%	7449.0	↓ -17.5
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	52781	+609	38425	-5685	+14356	+6294
資產管理	56839	-2163	56430	+7704	+409	-9867
槓桿基金	22443	-4689	55627	-7301	-33184	+2612
其他	10821	+1282	2380	-215	+8441	+1497

週五收盤價與13週與52週平均線

— CD — 13週 7399.6 — 52週 7418.9



淨部位佔總OI% 經紀 +8.1% 資管 +0.2% 槓桿 -18.6% 其他 +4.7%

# 澳幣

澳幣較前一週下跌93點收在6607.5點，  
 槓桿基金多單增加7301口，空單增加5467口，  
 淨多單較前一週增加1834口至8287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
2024/01/16	166566	173954	+7388	+4.44%	6607.5	↓ -93
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	54463	+3434	13100	-12850	+41363	+16284
資產管理	43032	-2161	108398	+13234	-65366	-15395
槓桿基金	40851	+7301	32564	+5467	+8287	+1834
其他	7250	-281	1035	+452	+6215	-733

週五收盤價與13週與52週平均線

— AD — 13週 6614.9 — 52週 6636.3



淨部位佔總OI% 經紀 +23.8% 資管 -37.6% 槓桿 +4.8% 其他 +3.6%

# 紐幣

紐幣較前一週下跌0.0134點收在0.6113點，  
 槓桿基金多單減少1202口，空單增加1139口，  
 淨多單較前一週減少2341口至897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
2024/01/16	38542	38469	-73	-0.19%	0.6113	↓ -0.0134
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	6146	+118	5075	-1691	+1071	+1809
資產管理	14579	+407	19773	+353	-5194	+54
槓桿基金	11194	-1202	10297	+1139	+897	-2341
其他	453	-326	110	+110	+343	-436

週五收盤價與13週與52週平均線

— NE — 13週 0.6118 — 52週 0.6128



淨部位佔總OI% 經紀 +2.8% 資管 -13.5% 槓桿 +2.3% 其他 +0.9%

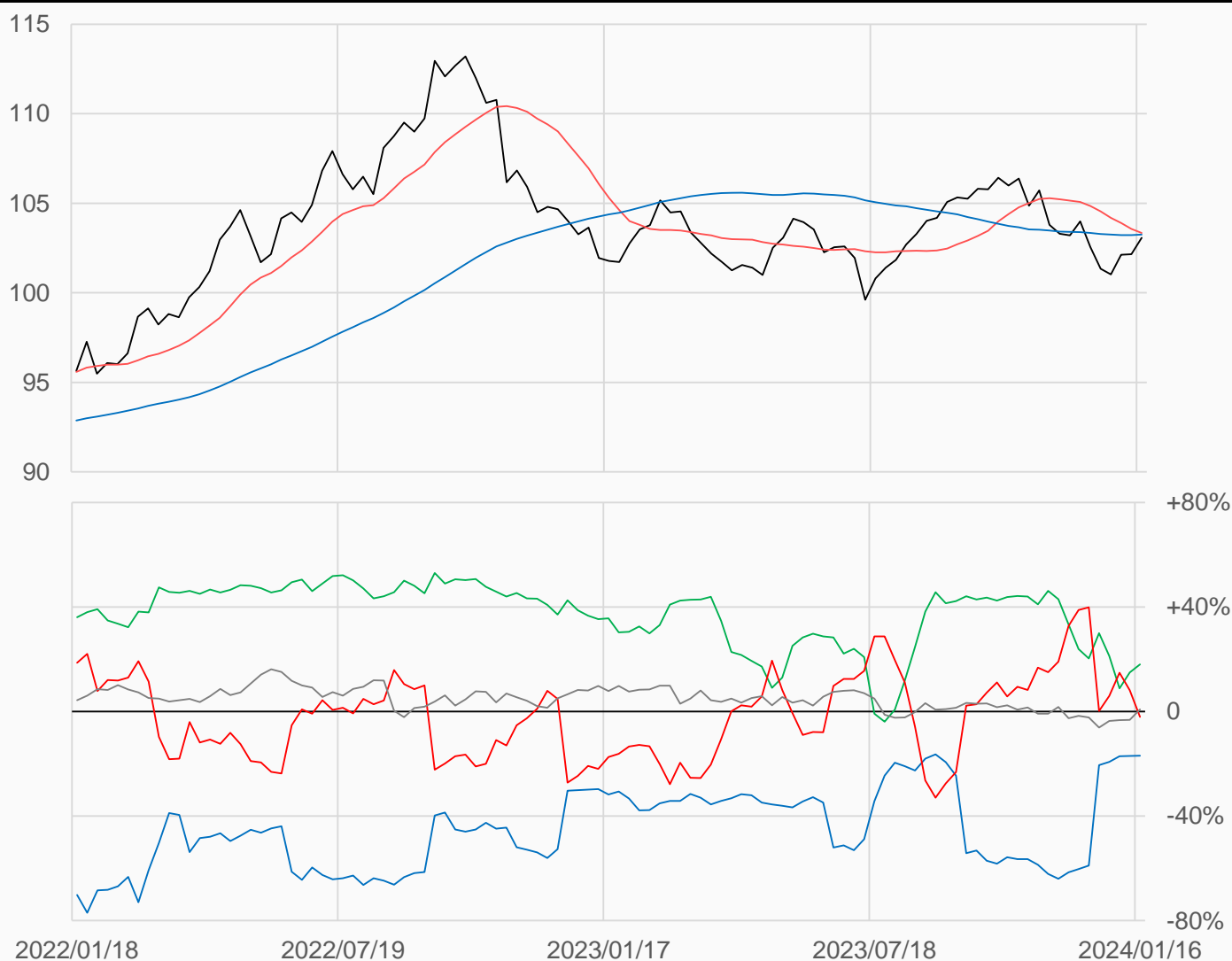
# 美元

美元較前一週上漲0.918點收在103.069點，  
 槓桿基金多單減少2293口，空單增加143口，  
 淨空單較前一週增加2436口至495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
2024/01/16	23908	23543	-365	-1.53%	103.069	↑ +0.918
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	64	+64	4035	-34	-3971	+98
資產管理	7441	+700	3187	+21	+4254	+679
槓桿基金	10818	-2293	11313	+143	-495	-2436
其他	2404	+824	2209	-141	+195	+965

週五收盤價與13週與52週平均線

— DX — 13週 103.35 — 52週 103.25



淨部位佔總OI% 經紀 -16.9% 資管 +18.1% 槓桿 -2.1% 其他 +0.8%

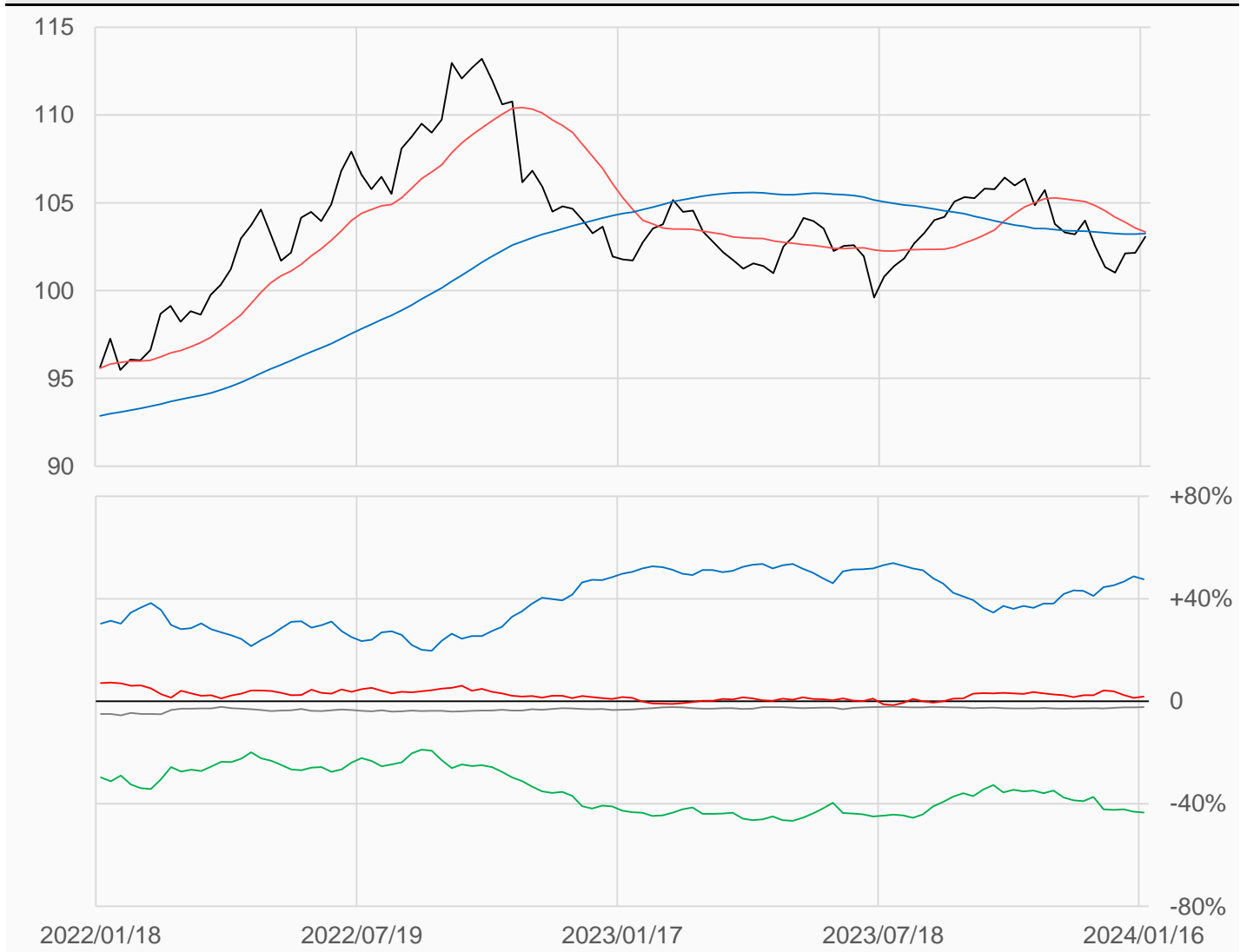
# 綜合美元 (不含美元)

綜合美元較前一週上漲0.918點收在103.069點，  
槓桿基金多單增加8225口，空單增加1882口，  
淨多單較前一週增加6343口至19963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
2024/01/16	1068156	1099770	+31614	+2.96%	103.069	↑ +0.918
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	598345	+7280	74679.15	+4604	+523666	+2676
資產管理	198566.3	+8905	675949.7	+26411	-477383	-17507
槓桿基金	202900.8	+8225	182937.9	+1882	+19963	+6343
其他	18779.64	+193	44395.59	+217	-25616	-24

週五收盤價與13週與52週平均線

— DXY — 13週 103.35 — 52週 103.25



淨部位佔總OI% 經紀 +47.6% 資管 -43.4% 槓桿 +1.8% 其他 -2.3%

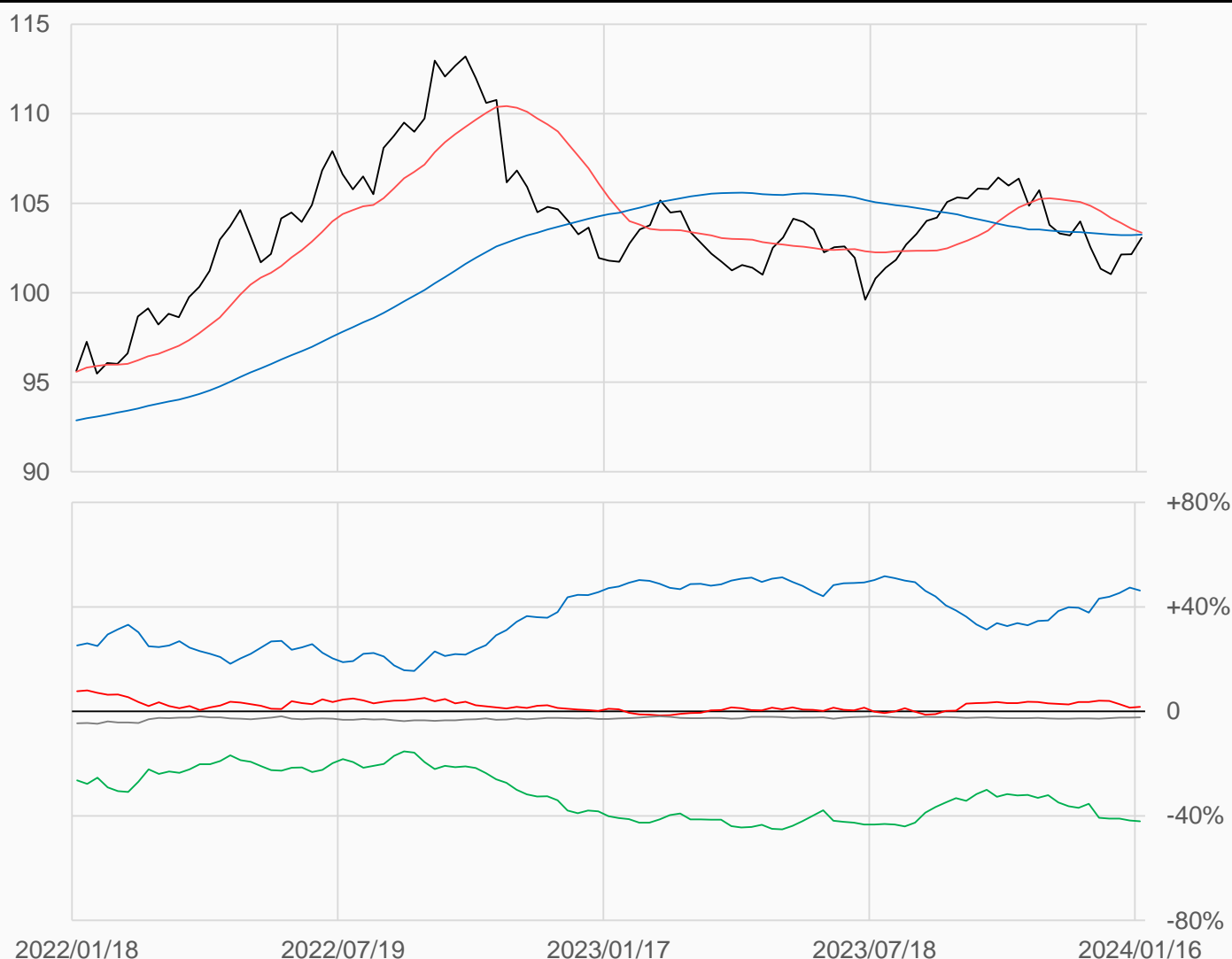
# 綜合美元 (含美元)

綜合美元較前一週上漲0.918點收在103.069點，  
槓桿基金多單增加5932口，空單增加2025口，  
淨多單較前一週增加3907口至19468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
2024/01/16	1092064	1123313	+31249	+2.86%	103.069	↑ +0.918
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	598409	+7344	78714.15	+4570	+519695	+2774
資產管理	206007.3	+9605	679136.7	+26432	-473129	-16828
槓桿基金	213718.8	+5932	194250.9	+2025	+19468	+3907
其他	21183.64	+1017	46604.59	+76	-25421	+941

週五收盤價與13週與52週平均線

— DXX — 13週 103.35 — 52週 103.25



淨部位佔總OI% 經紀 +46.3% 資管 -42.1% 槓桿 +1.7% 其他 -2.3%



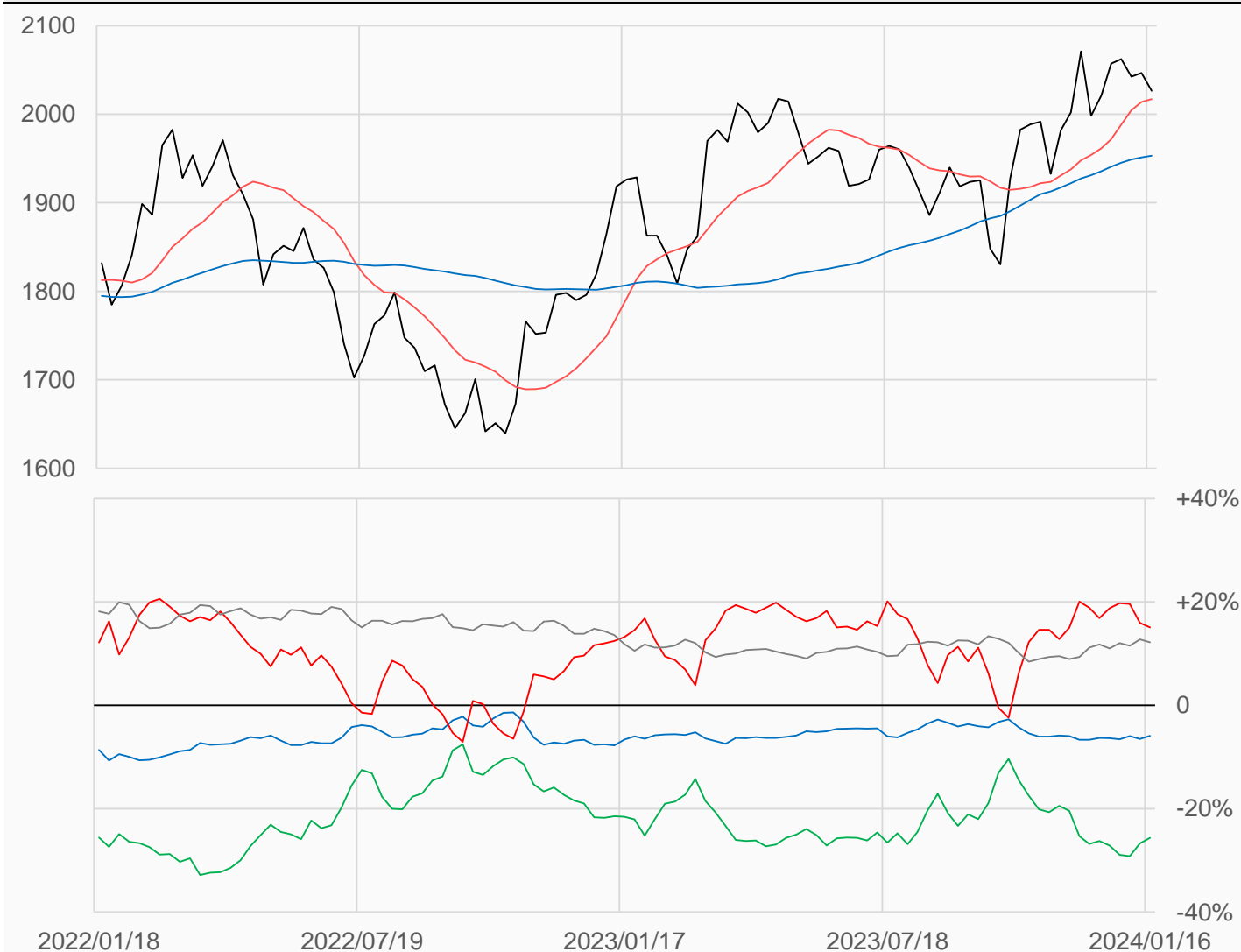
# 黃金

黃金較前一週下跌20.2點收在2026.5點，  
管理基金多單增加3055口，空單增加8709口，  
淨多單較前一週減少5654口至100634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
2024/01/16	665286	668529	+3243	+0.49%	2026.5	↓ -20.2
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	21639	+1097	61122	-2910	-39483	+4007
互換交易	135438	+3885	306923	-2269	-171485	+6154
管理基金	209091	+3055	108457	+8709	+100634	-5654
其他	246994	-4034	165380	-793	+81614	-3241

週五收盤價與13週與52週平均線

— GC — 13週 2017.1 — 52週 1953.2



淨部位佔總OI% 生產 -5.9% 互換 -25.7% 管理 +15.1% 其他 +12.2%

# 白銀

白銀較前一週下跌59.1點收在2257.1點，  
管理基金多單增加167口，空單增加2023口，  
淨多單較前一週減少1856口至6030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
2024/01/16	151878	154103	+2225	+1.46%	2257.1	↓ -59.1
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	6455	-64	42367	-228	-35912	+164
互換交易	36950	-972	41762	-1403	-4812	+431
管理基金	42065	+167	36035	+2023	+6030	-1856
其他	36233	+2421	20696	+1920	+15537	+501

週五收盤價與13週與52週平均線

— SI — 13週 2351.2 — 52週 2338.2



淨部位佔總OI% 生產 -23.3% 互換 -3.1% 管理 +3.9% 其他 +10.1%

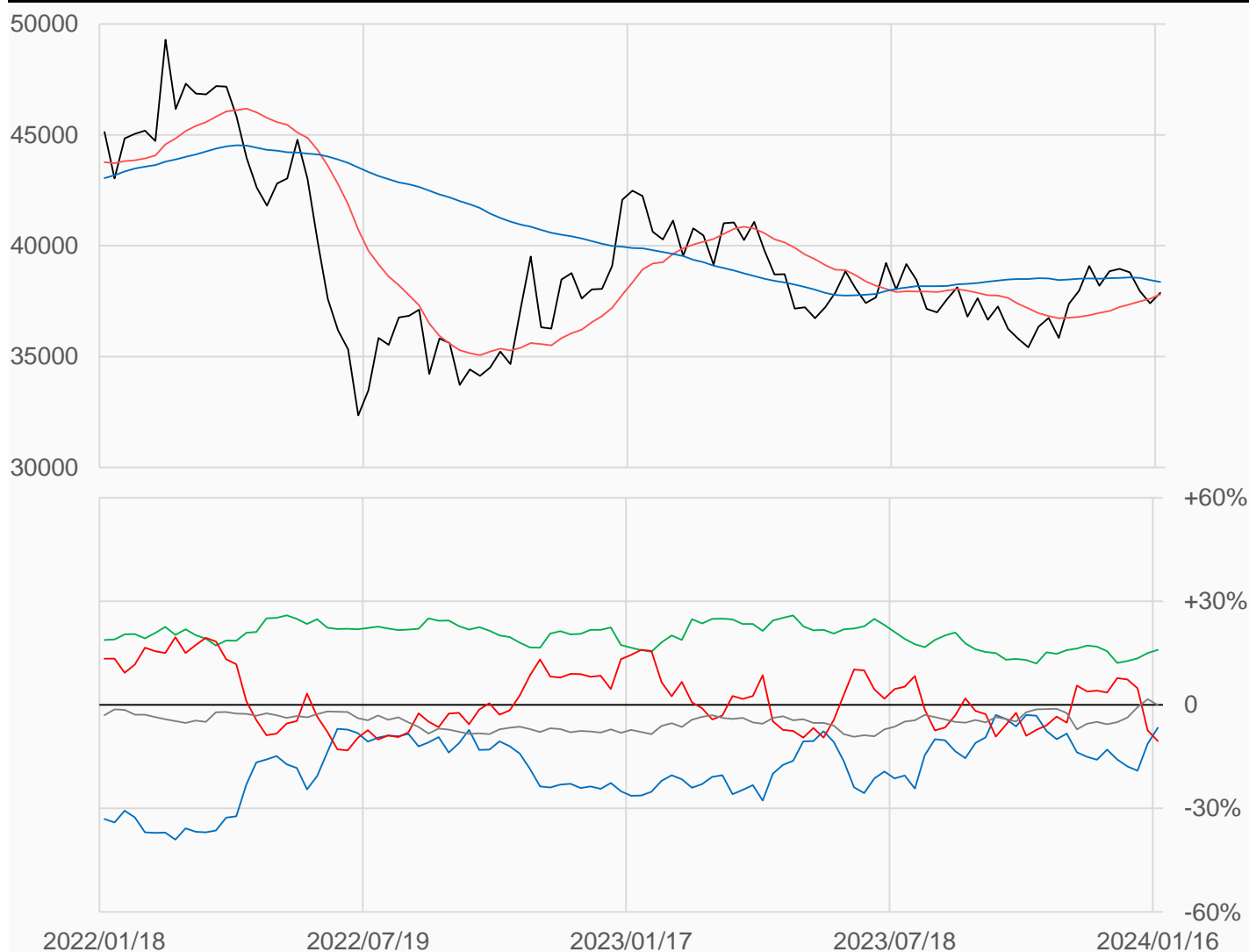
# 銅

銅較前一週上漲470點收在37870點，  
 管理基金多單減少2834口，空單增加5721口，  
 淨空單較前一週增加8555口至25309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
2024/01/16	225409	240498	+15089	+6.69%	37870	↑ +470
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	43097	+11691	58997	+2125	-15900	+9566
互換交易	55530	+4927	17163	+449	+38367	+4478
管理基金	80279	-2834	105588	+5721	-25309	-8555
其他	45461	+2734	45534	+6541	-73	-3807

週五收盤價與13週與52週平均線

— HG — 13週 37798 — 52週 38365



淨部位佔總OI% 生產 -6.6% 互換 +16.0% 管理 -10.5% 其他 -0.0%

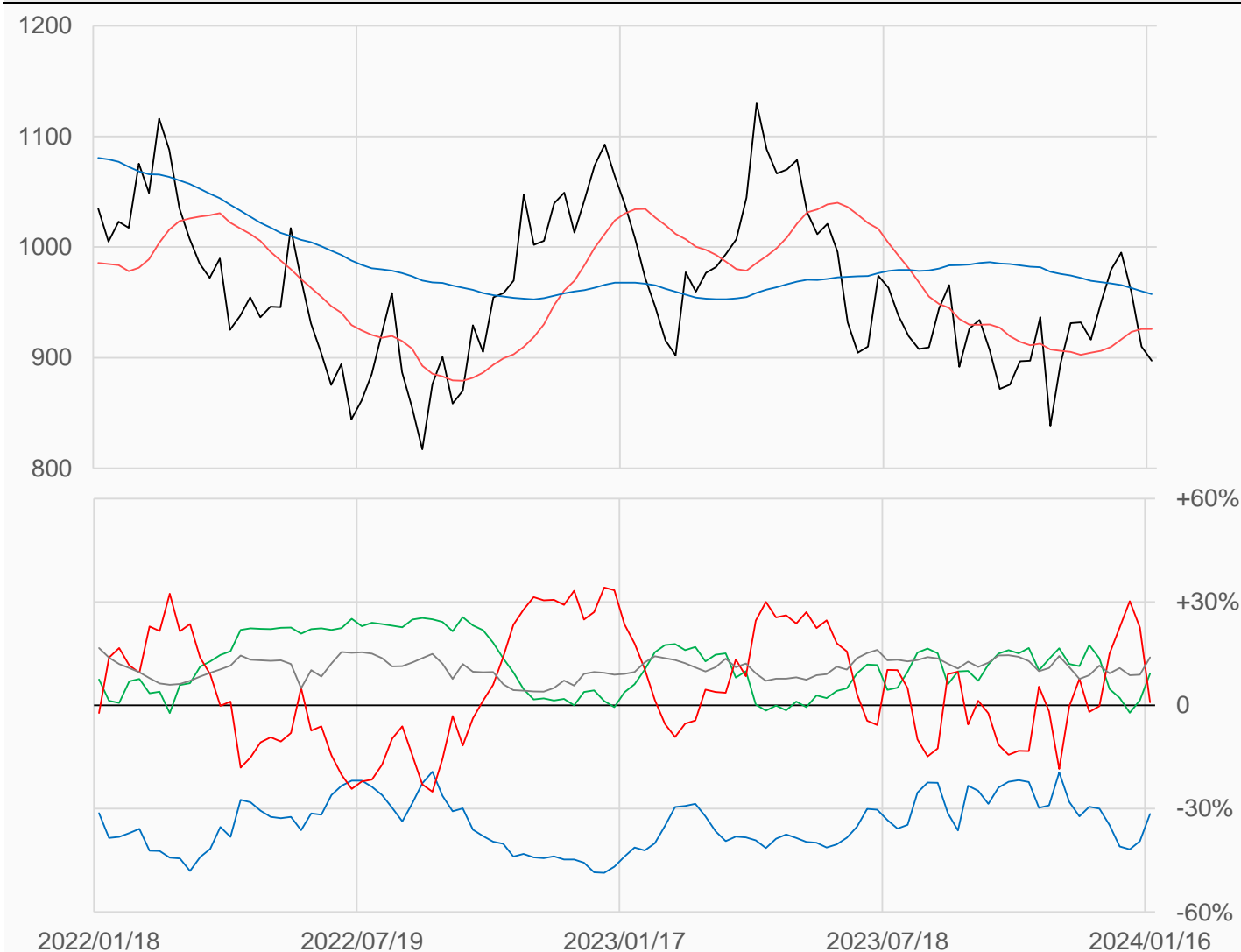
# 白金

白金較前一週下跌12.8點收在897.3點，  
管理基金多單減少6901口，空單增加9502口，  
淨多單較前一週減少16403口至681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
2024/01/16	75639	79159	+3520	+4.65%	897.3	↓ -12.8
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	3599	+334	28593	-4497	-24994	+4831
互換交易	16942	+3529	9666	-2658	+7276	+6187
管理基金	31851	-6901	31170	+9502	+681	-16403
其他	17114	+4869	6122	+629	+10992	+4240

週五收盤價與13週與52週平均線

— PL — 13週 925.95 — 52週 957.38



淨部位佔總OI% 生產 -31.6% 互換 +9.2% 管理 +0.9% 其他 +13.9%

# 輕原油

輕原油較前一週上漲0.73點收在73.41點，  
 管理基金多單減少27872口，空單減少6903口，  
 淨多單較前一週減少20969口至90160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
2024/01/16	2059105	2084231	+25126	+1.22%	73.41	↑ +0.73
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	550804	+19002	387275	+5283	+163529	+13719
互換交易	232163	-3659	606724	+4398	-374561	-8057
管理基金	591702	-27872	501542	-6903	+90160	-20969
其他	625686	+36191	526370	+23249	+99316	+12942

週五收盤價與13週與52週平均線

— CL — 13週 75.115 — 52週 77.401



淨部位佔總OI% 生產 +7.8% 互換 -18.0% 管理 +4.3% 其他 +4.8%

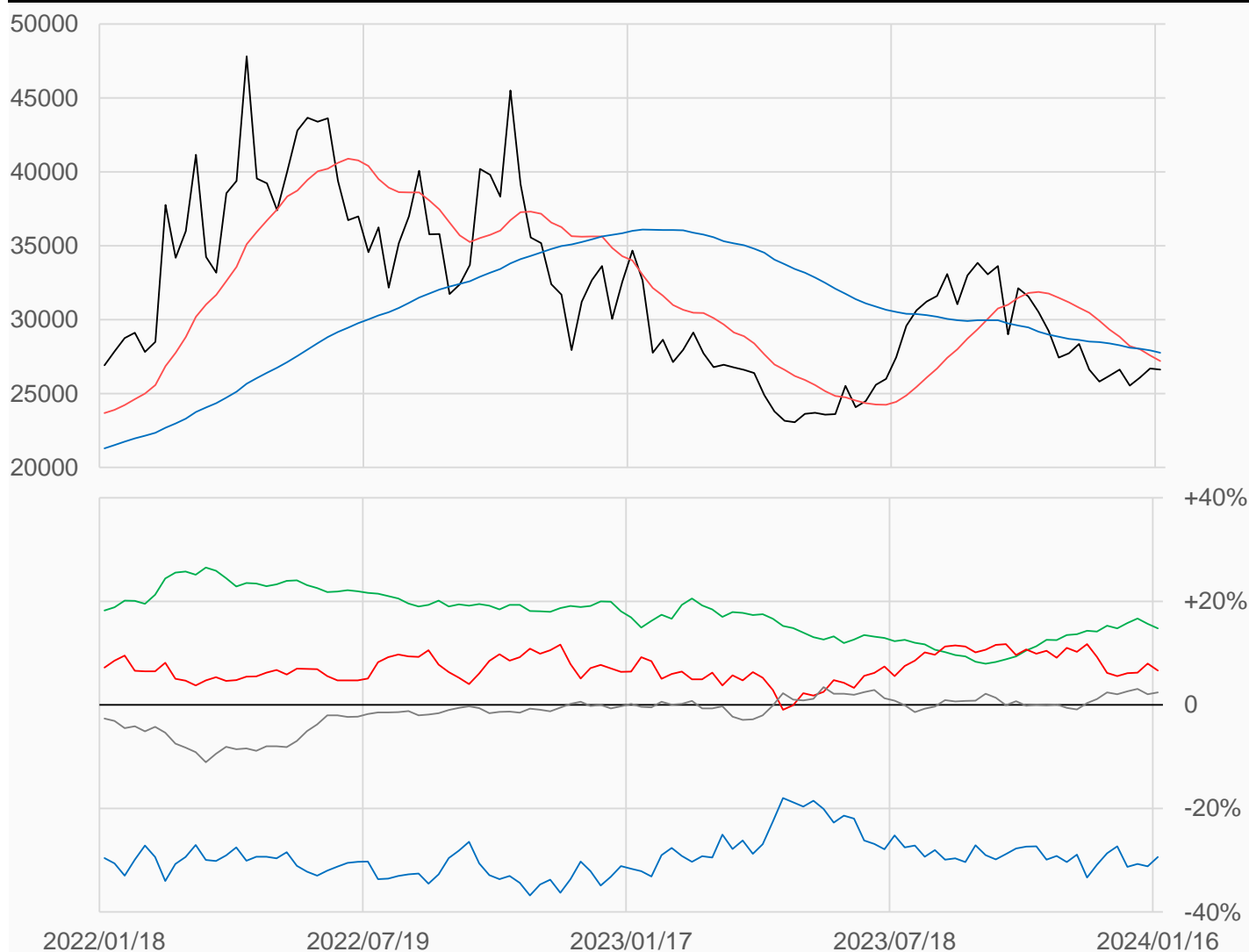
# 熱燃油

熱燃油較前一週下跌72點收在26621點，  
 管理基金多單增加4485口，空單增加7518口，  
 淨多單較前一週減少3033口至22698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
2024/01/16	322126	341629	+19503	+6.05%	26621	↓ -72
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	81571	+6797	181939	+6758	-100368	+39
互換交易	67215	+1703	16668	+1505	+50547	+198
管理基金	92311	+4485	69613	+7518	+22698	-3033
其他	50367	+2931	42069	+1184	+8298	+1747

週五收盤價與13週與52週平均線

— HO — 13週 27188 — 52週 27764



淨部位佔總OI% 生產 -29.4% 互換 +14.8% 管理 +6.6% 其他 +2.4%

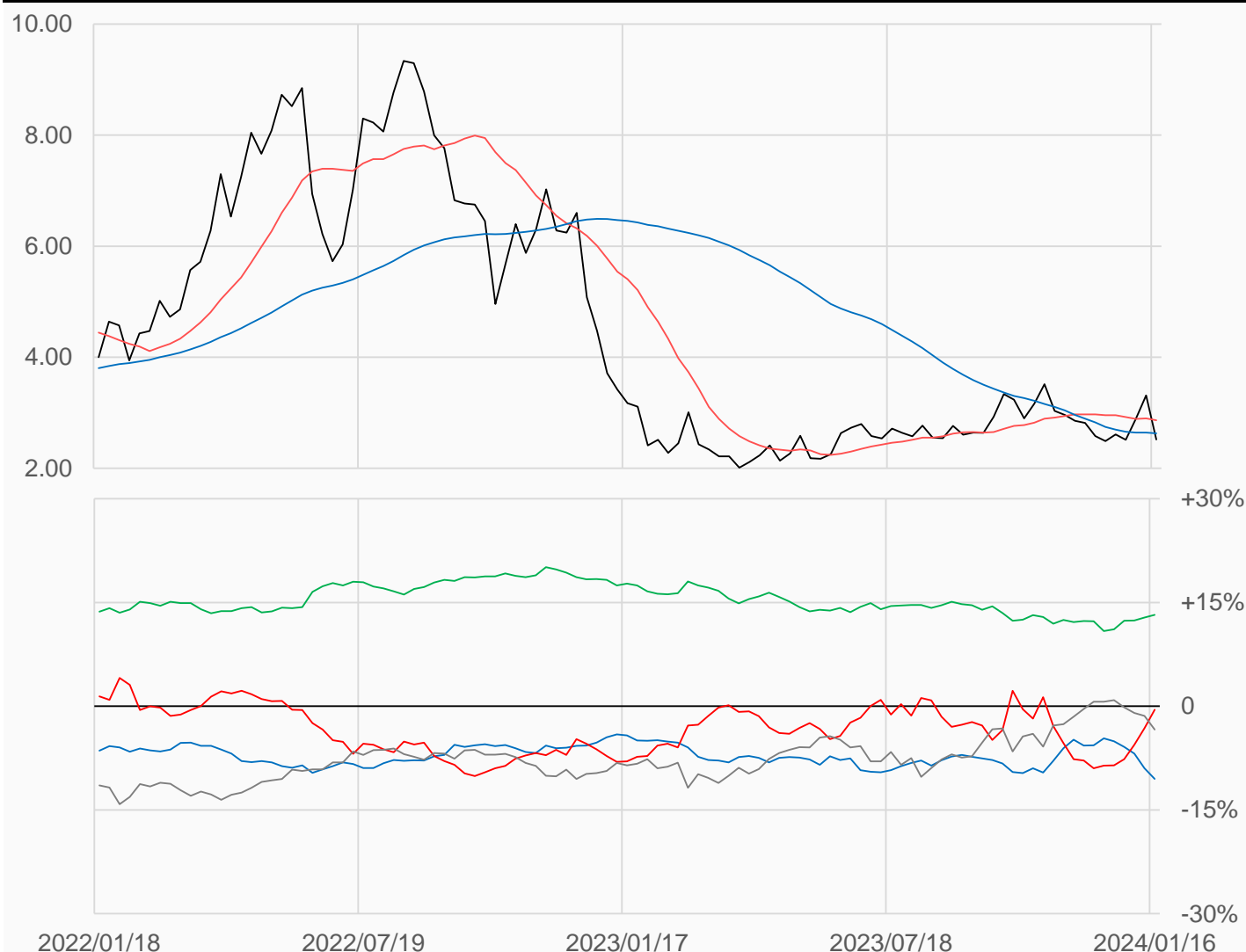
# 天然氣

天然氣較前一週下跌0.794點收在2.519點，  
管理基金多單增加19068口，空單減少19037口，  
淨空單較前一週減少38105口至7369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
2024/01/16	1424575	1426894	+2319	+0.16%	2.519	↓ -0.794
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	207847	-4460	357892	+17574	-150045	-22034
互換交易	318181	+6803	129915	+881	+188266	+5922
管理基金	628257	+19068	635626	-19037	-7369	+38105
其他	212052	-21708	260215	+6490	-48163	-28198

週五收盤價與13週與52週平均線

— NG — 13週 2.8663 — 52週 2.6291



淨部位佔總OI% 生產 -10.5% 互換 +13.2% 管理 -0.5% 其他 -3.4%

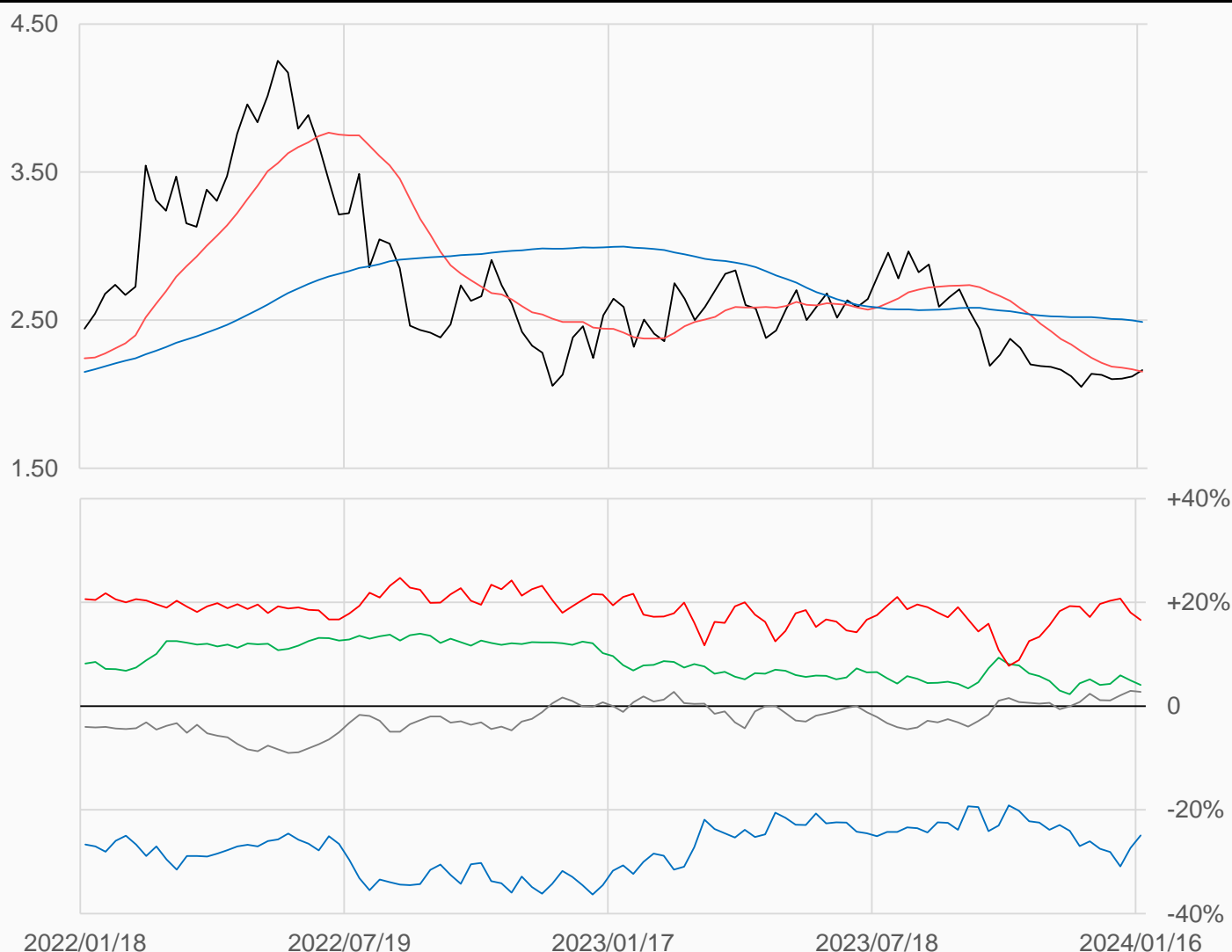
# 無鉛汽油

無鉛汽油較前一週上漲0.0425點收在2.1628點，  
管理基金多單增加3396口，空單增加6281口，  
淨多單較前一週減少2885口至59220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
2024/01/16	343969	356461	+12492	+3.63%	2.1628	↑ +0.0425
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	117033	+6994	205781	+1690	-88748	+5304
互換交易	52650	+1947	38004	+4361	+14646	-2414
管理基金	118401	+3396	59181	+6281	+59220	-2885
其他	45903	+420	36106	+777	+9797	-357

週五收盤價與13週與52週平均線

— RB — 13週 2.1524 — 52週 2.4888



淨部位佔總OI% 生產 -24.9% 互換 +4.1% 管理 +16.6% 其他 +2.7%



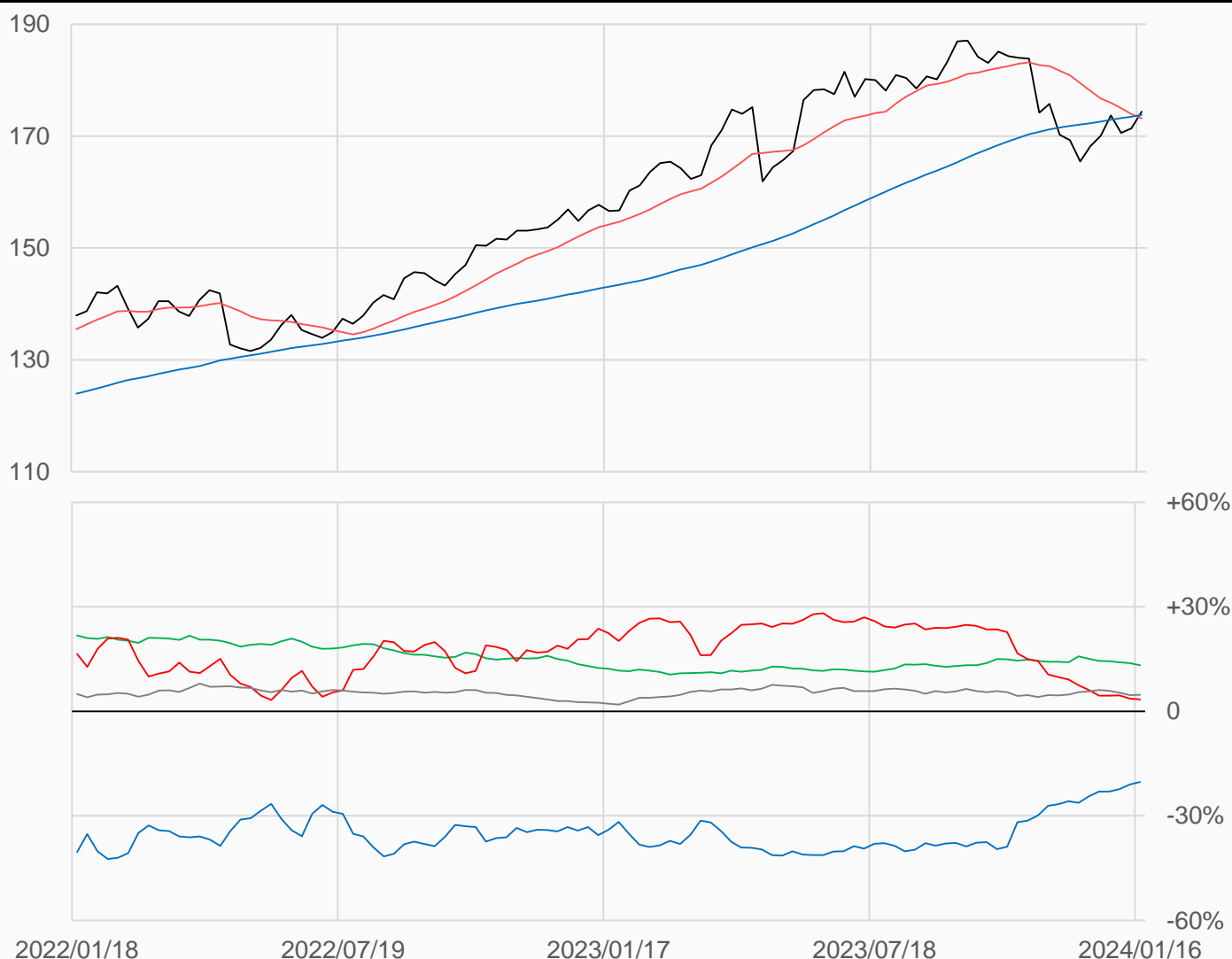
# 活牛

活牛較前一週上漲3點收在174.375點，  
管理基金多單增加2046口，空單增加2823口，  
淨多單較前一週減少777口至12993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
2024/01/16	374170	375863	+1693	+0.45%	174.375	↑ +3.000
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	88545	+945	164779	-1415	-76234	+2360
互換交易	55006	-2343	5265	-99	+49741	-2244
管理基金	93115	+2046	80122	+2823	+12993	-777
其他	98854	+1031	80947	+599	+17907	+432

週五收盤價與13週與52週平均線

— LC — 13週 173.16 — 52週 173.8



淨部位佔總OI% 生產 -20.3% 互換 +13.2% 管理 +3.5% 其他 +4.8%

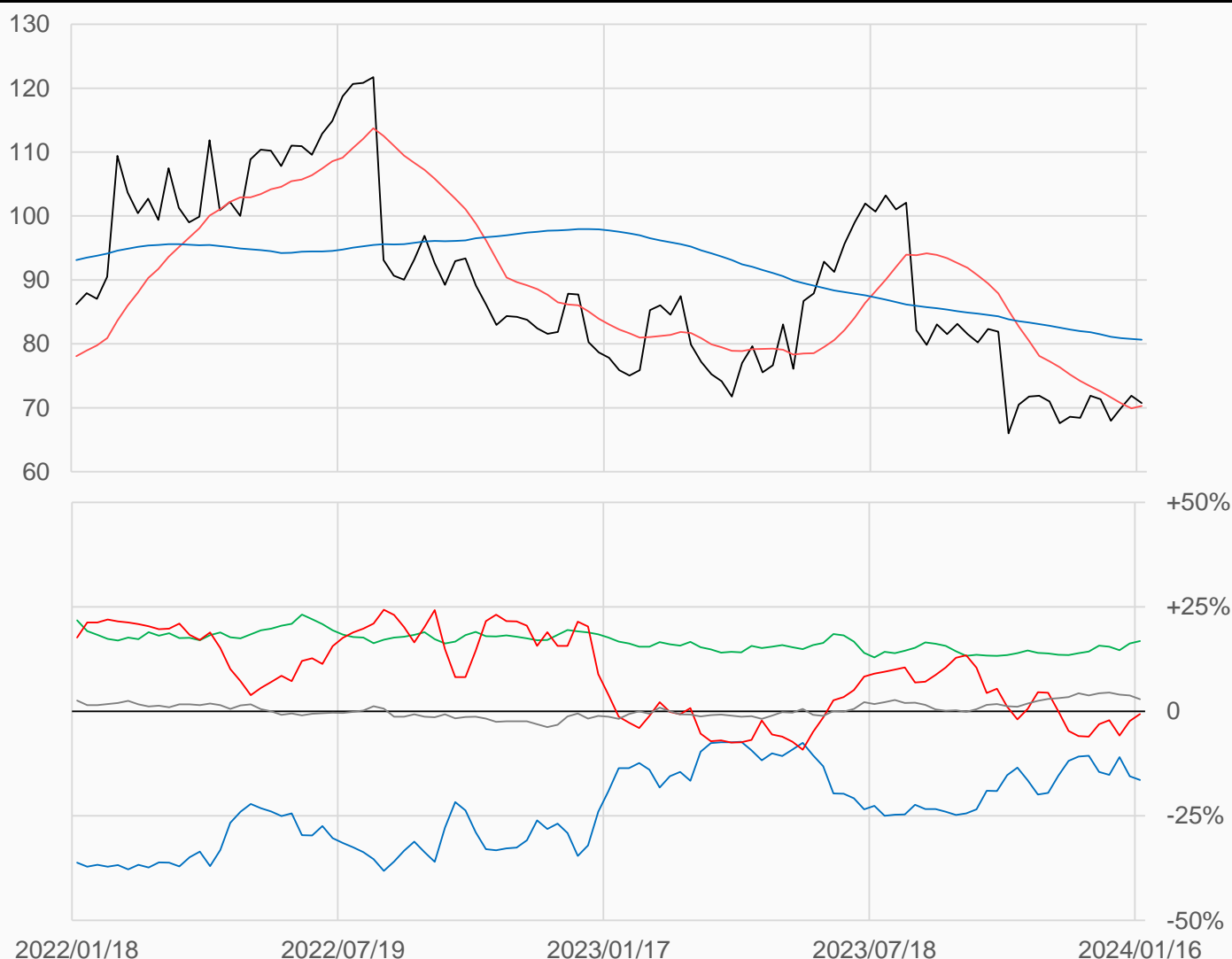
# 活豬

活豬較前一週下跌1.15點收在70.75點，  
管理基金多單增加2178口，空單減少2604口，  
淨空單較前一週減少4782口至1807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
2024/01/16	284498	295768	+11270	+3.96%	70.750	↓ -1.150
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	39275	+593	87937	+5088	-48662	-4495
互換交易	60031	+3928	10359	+475	+49672	+3453
管理基金	82213	+2178	84020	-2604	-1807	+4782
其他	95477	+5817	86973	+8183	+8504	-2366

週五收盤價與13週與52週平均線

— LH — 13週 70.275 — 52週 80.649



淨部位佔總OI% 生產 -16.5% 互換 +16.8% 管理 -0.6% 其他 +2.9%

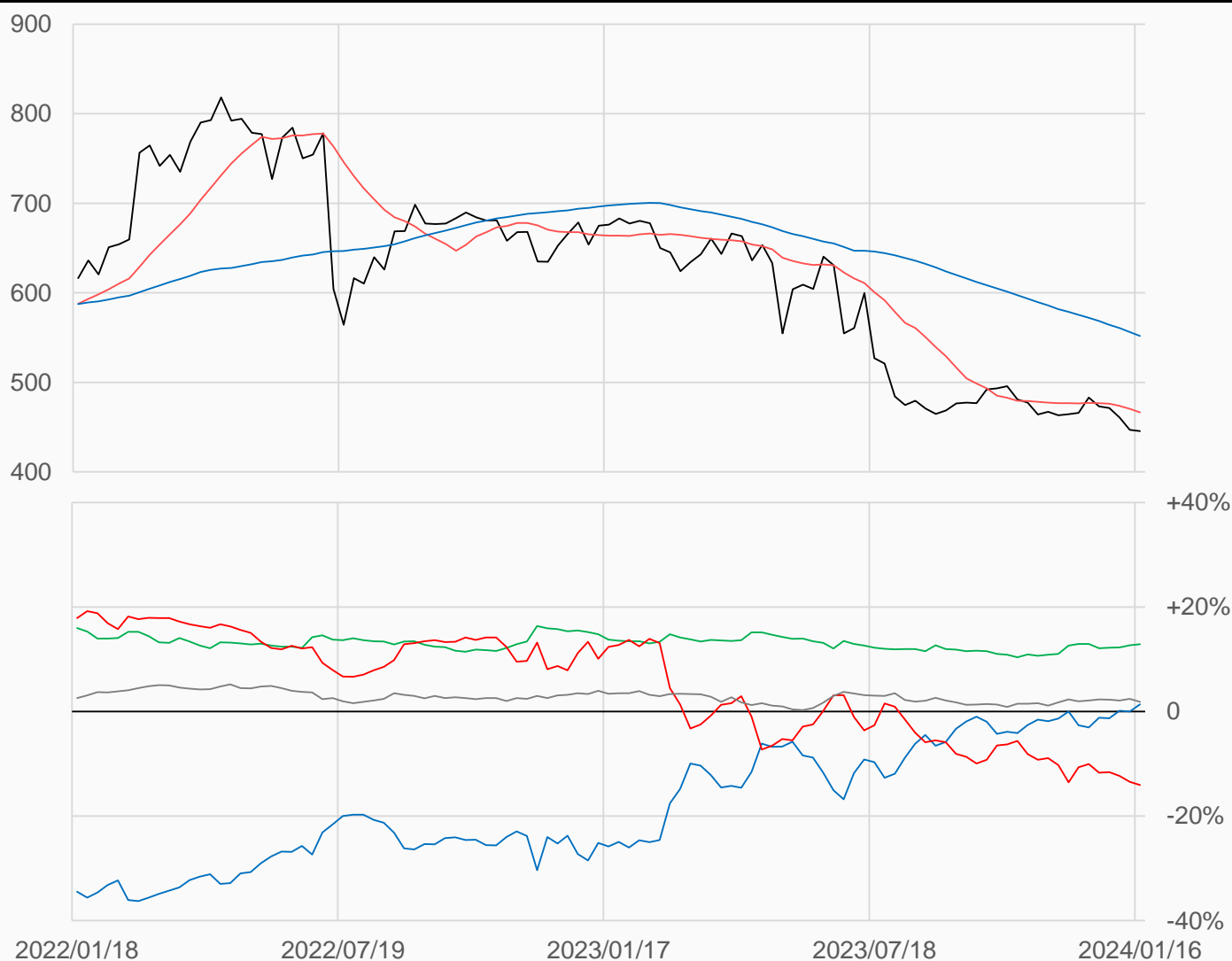
# 玉米

玉米較前一週下跌1.5點收在445.5點，  
管理基金多單增加19029口，空單增加48848口，  
淨空單較前一週增加29819口至260542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
2024/01/16	1713898	1852331	+138433	+8.08%	445.50	↓ -1.50
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	513620	+45269	488171	+20111	+25449	+25158
互換交易	290102	+27417	51496	+6257	+238606	+21160
管理基金	427562	+19029	688104	+48848	-260542	-29819
其他	431220	+42863	396652	+49536	+34568	-6673

週五收盤價與13週與52週平均線

— ZC — 13週 466.38 — 52週 551.79



淨部位佔總OI% 生產 +1.4% 互換 +12.9% 管理 -14.1% 其他 +1.9%

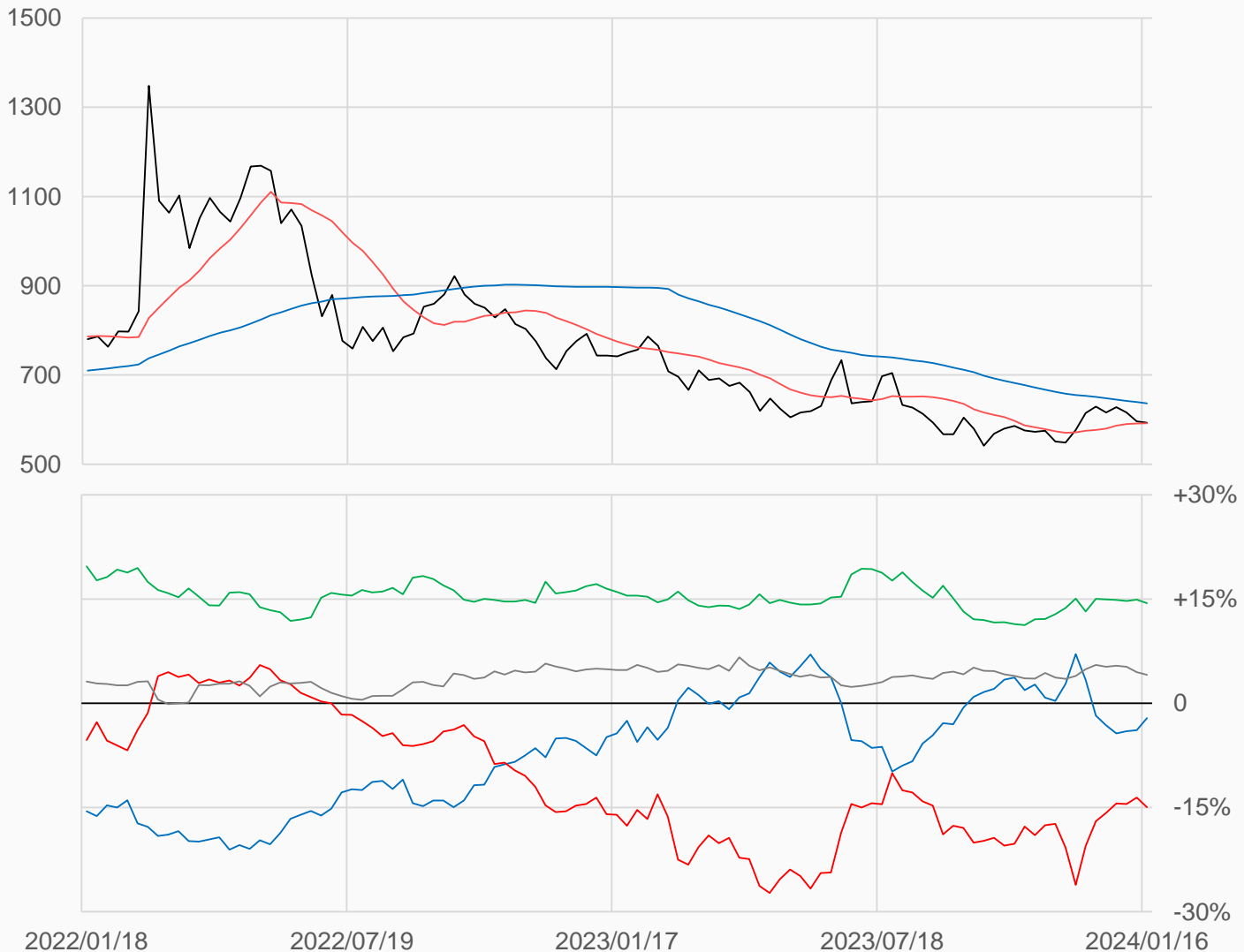
# 小麥

小麥較前一週下跌2.75點收在593.25點，  
 管理基金多單增加9646口，空單增加20233口，  
 淨空單較前一週增加10587口至68575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
2024/01/16	427307	458510	+31203	+7.30%	593.25	↓ -2.75
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	76198	+10036	86048	+3298	-9850	+6738
互換交易	88692	+4243	22540	+1782	+66152	+2461
管理基金	157205	+9646	225780	+20233	-68575	-10587
其他	103422	+5837	84700	+6214	+18722	-377

週五收盤價與13週與52週平均線

— ZW — 13週 591.81 — 52週 636.45



淨部位佔總OI% 生產 -2.1% 互換 +14.4% 管理 -15.0% 其他 +4.1%

# 黃豆

黃豆較前一週上漲7.5點收在1213.25點，  
管理基金多單減少1070口，空單增加44479口，  
淨空單較前一週增加45549口至76797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
2024/01/16	833627	874503	+40876	+4.90%	1213.25	↑ +7.50
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	294067	+22128	305026	-30851	-10959	+52979
互換交易	157090	+10381	33692	+2639	+123398	+7742
管理基金	177584	-1070	254381	+44479	-76797	-45549
其他	190496	+12355	206328	+23760	-15832	-11405

週五收盤價與13週與52週平均線

— ZS — 13週 1295.1 — 52週 1397.7



淨部位佔總OI% 生產 -1.3% 互換 +14.1% 管理 -8.8% 其他 -1.8%

# 黃豆油

黃豆油較前一週下跌0.85點收在46.9點，  
 管理基金多單增加9717口，空單增加10120口，  
 淨空單較前一週增加403口至47011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
2024/01/16	542231	572643	+30412	+5.61%	46.90	↓ -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	152420	+5474	236240	+15290	-83820	-9816
互換交易	132304	+10859	19548	+2137	+112756	+8722
管理基金	153819	+9717	200830	+10120	-47011	-403
其他	102138	+3792	87669	+3257	+14469	+535

週五收盤價與13週與52週平均線

— BO — 13週 49.698 — 52週 56.732



淨部位佔總OI% 生產 -14.6% 互換 +19.7% 管理 -8.2% 其他 +2.5%

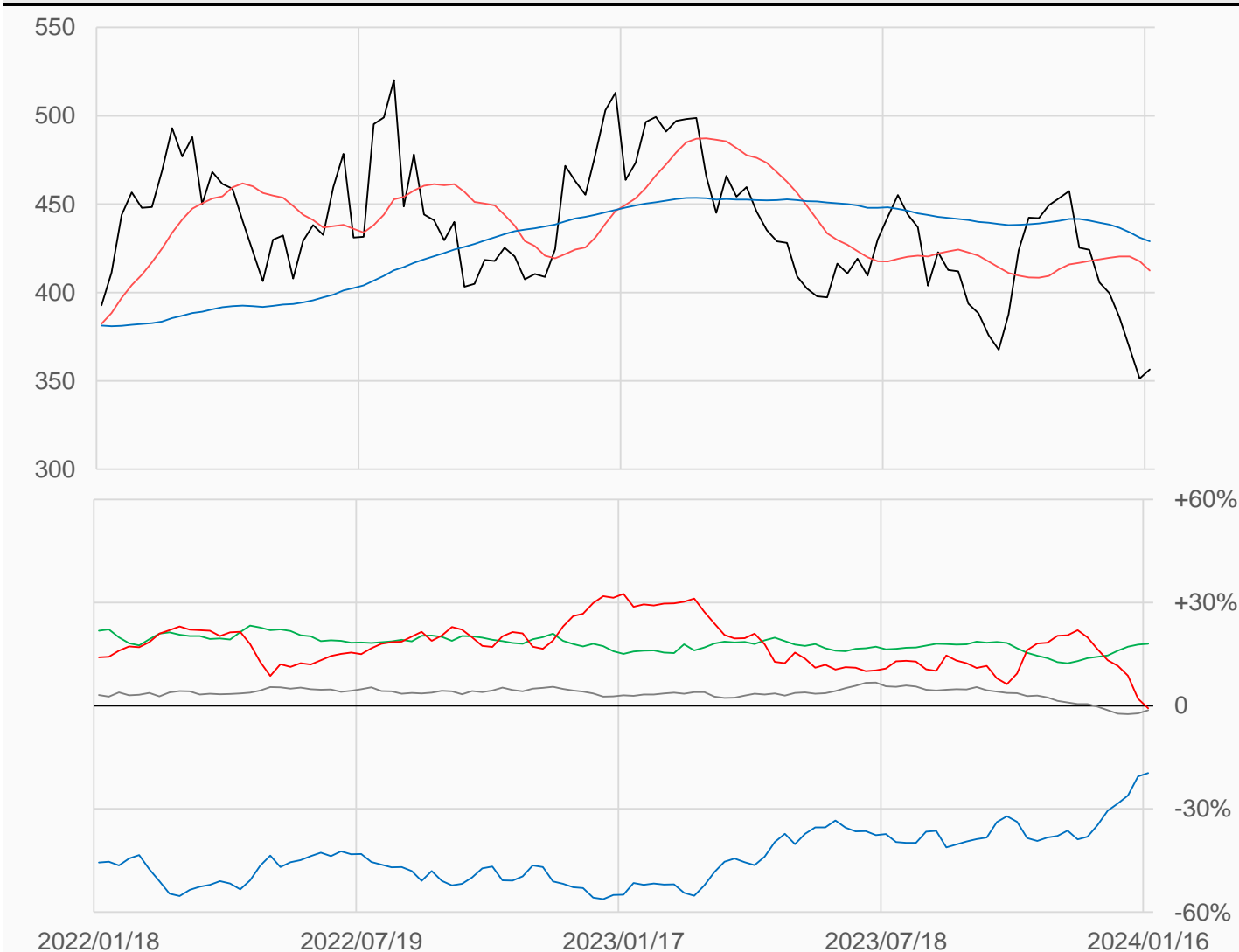
# 黃豆粉

黃豆粉較前一週上漲5.2點收在356.5點，  
 管理基金多單增加2616口，空單增加17156口，  
 淨空單較前一週增加14540口至4079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
2024/01/16	515526	547287	+31761	+6.16%	356.5	↑ +5.2
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	143107	+10051	250151	+11274	-107044	-1223
互換交易	108540	+7833	9640	+815	+98900	+7018
管理基金	134565	+2616	138644	+17156	-4079	-14540
其他	106802	+6707	114013	+2636	-7211	+4071

週五收盤價與13週與52週平均線

— SM — 13週 412.44 — 52週 428.93



淨部位佔總OI% 生產 -19.6% 互換 +18.1% 管理 -0.7% 其他 -1.3%

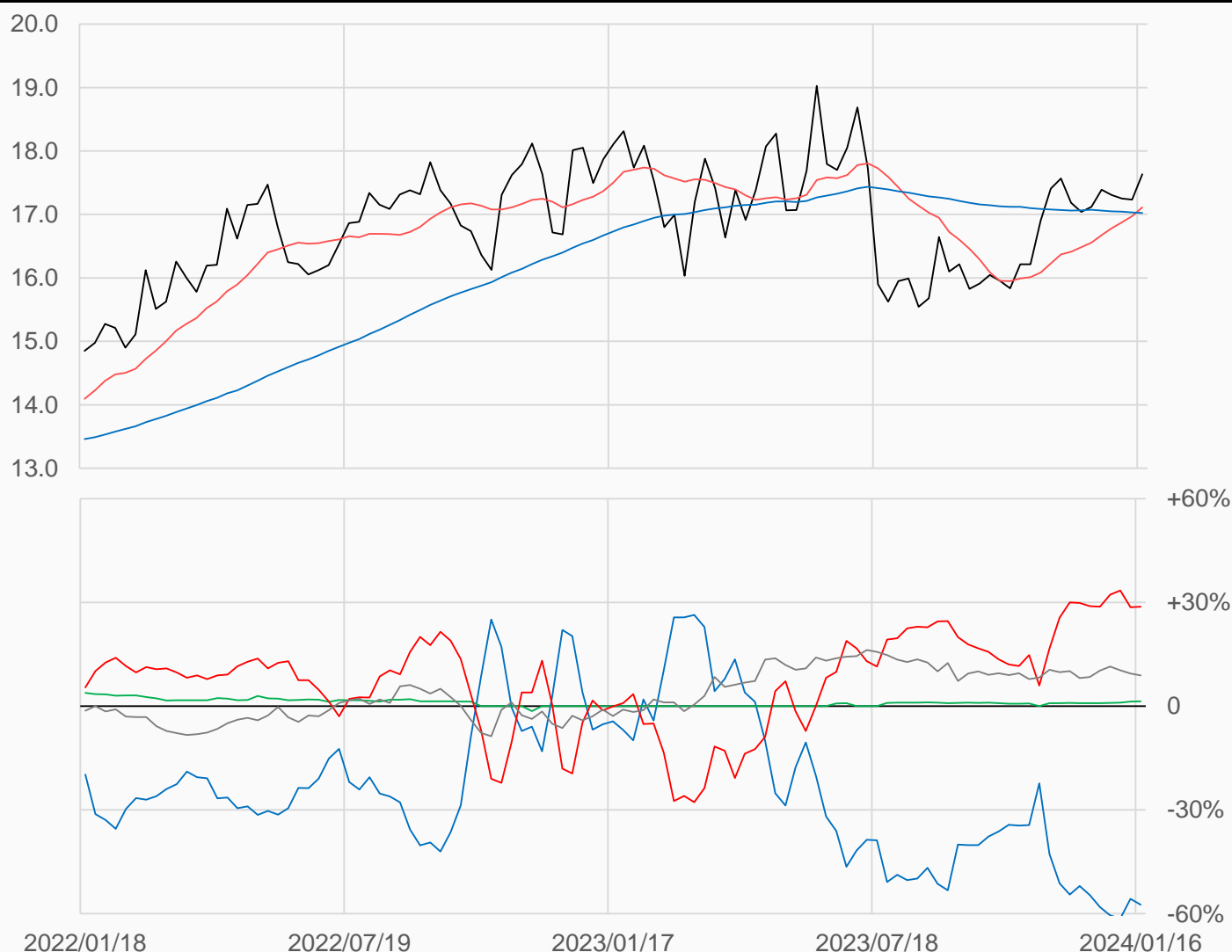
# 粗米

粗米較前一週上漲0.4點收在17.635點，  
 管理基金多單增加14口，空單增加61口，  
 淨多單較前一週減少47口至3184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
2024/01/16	11290	11056	-234	-2.07%	17.635	↑ +0.400
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	2692	-291	9037	-240	-6345	-51
互換交易	214	+7	59	+3	+155	+4
管理基金	3760	+14	576	+61	+3184	-47
其他	1744	-78	763	+6	+981	-84

週五收盤價與13週與52週平均線

— RR — 13週 17.112 — 52週 17.022



淨部位佔總OI% 生產 -57.4% 互換 +1.4% 管理 +28.8% 其他 +8.9%



# 咖啡

咖啡較前一週上漲5.15點收在185.15點，  
管理基金多單增加1807口，空單增加1222口，  
淨多單較前一週增加585口至42728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
2024/01/16	269546	264296	-5250	-1.95%	185.15	↑ +5.15
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	50634	-221	113728	-856	-63094	+635
互換交易	40069	-4280	29028	-810	+11041	-3470
管理基金	92704	+1807	49976	+1222	+42728	+585
其他	70253	-2823	62337	-5466	+7916	+2643

週五收盤價與13週與52週平均線

— KC — 13週 181.99 — 52週 173.8



淨部位佔總OI% 生產 -23.9% 互換 +4.2% 管理 +16.2% 其他 +3.0%

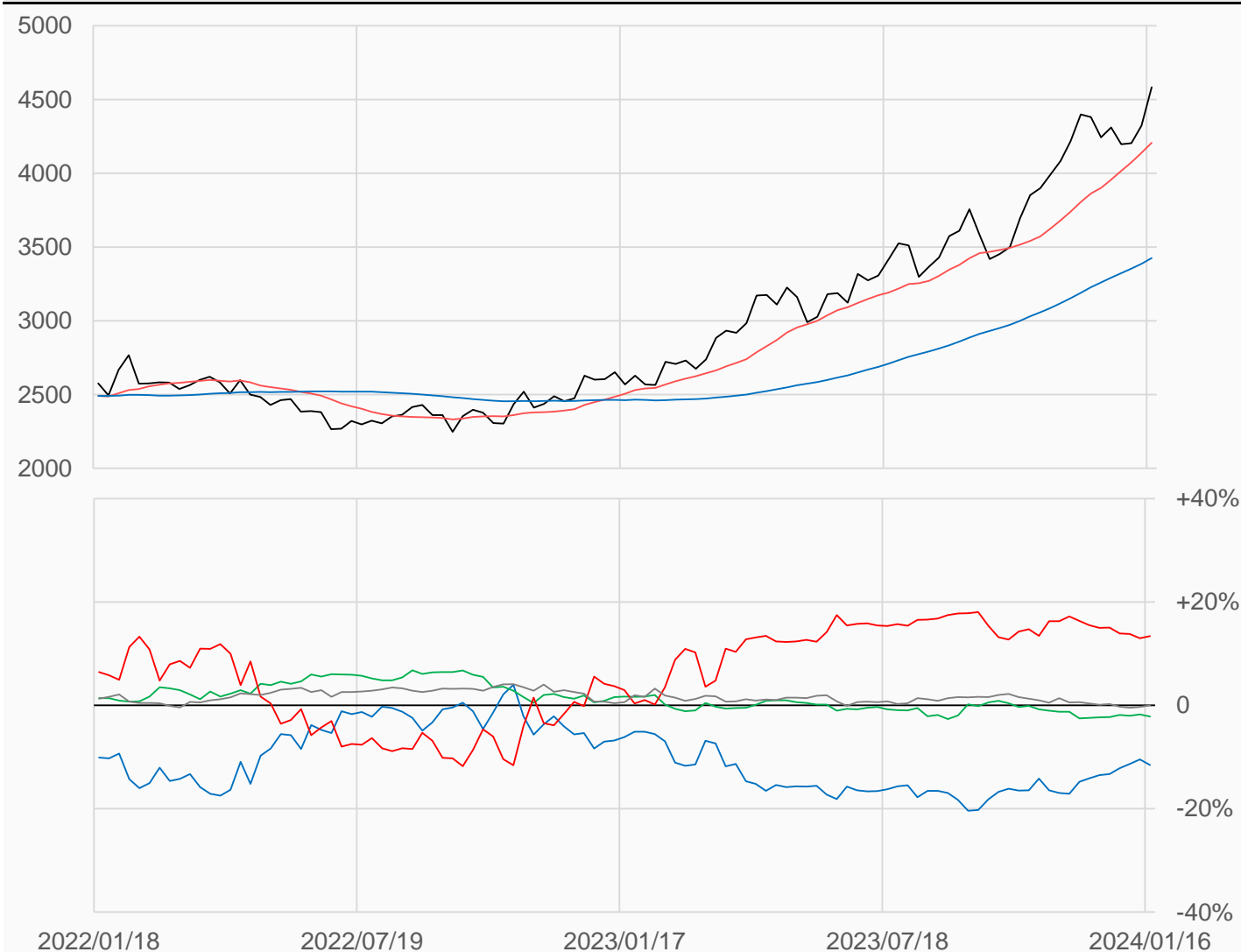
# 可可

可可較前一週上漲260點收在4583點，  
管理基金多單增加11689口，空單增加7104口，  
淨多單較前一週增加4585口至63701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
2024/01/16	455103	476440	+21337	+4.69%	4583	↑ +260
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	108662	-670	163650	+6598	-54988	-7268
互換交易	26381	-920	36768	+1356	-10387	-2276
管理基金	196204	+11689	132503	+7104	+63701	+4585
其他	127369	+9510	127335	+8055	+34	+1455

週五收盤價與13週與52週平均線

— CC — 13週 4206.4 — 52週 3425.2



淨部位佔總OI% 生產 -11.5% 互換 -2.2% 管理 +13.4% 其他 +0.0%

# 11號糖

11號糖較前一週上漲1.96點收在23.57點，  
管理基金多單減少8522口，空單減少7418口，  
淨多單較前一週減少1104口至14788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
2024/01/16	1106520	1080547	-25973	-2.35%	23.57	↑ +1.96
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	400442	+1152	403379	-5150	-2937	+6302
互換交易	174163	-7674	232193	+5218	-58030	-12892
管理基金	179275	-8522	164487	-7418	+14788	-1104
其他	244987	-12812	221863	-11620	+23124	-1192

週五收盤價與13週與52週平均線

— SB — 13週 24.192 — 52週 24.229



淨部位佔總OI% 生產 -0.3% 互換 -5.4% 管理 +1.4% 其他 +2.1%

# 棉花

棉花較前一週上漲2.64點收在83.95點，  
管理基金多單增加2976口，空單減少1880口，  
淨空單較前一週減少4856口至2016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
2024/01/16	234519	240743	+6224	+2.65%	83.95	↑ +2.64
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	43046	+1420	88037	+5826	-44991	-4406
互換交易	62270	+940	31539	+1752	+30731	-812
管理基金	65489	+2976	67505	-1880	-2016	+4856
其他	57301	+1978	40891	+1333	+16410	+645

週五收盤價與13週與52週平均線

— CT — 13週 80.51 — 52週 82.769



淨部位佔總OI% 生產 -18.7% 互換 +12.8% 管理 -0.8% 其他 +6.8%