

# CFTC 大額交易人持倉報告

永豐期貨顧問事業部編製

2024/2/26

資料來源：CFTC官網、精誠資訊DQII、奇狐全球版

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 2024/02/20

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	102403	-1063	+8662	-2711	+8.46%
	VX	341280	-21190	-18798	+2987	-5.51%
	NQ	331700	-14655	-34974	+2583	-10.54%
	ES	3353425	-103357	-424565	-35585	-12.66%
債券	30年債	1606189	-33689	-375411	+17531	-23.37%
	10年債	5880805	-51668	-1425308	+97252	-24.24%
	5年債	6361605	+88214	-1854042	+53042	-29.14%
	2年債	4124430	+38571	-1458688	+27792	-35.37%
外匯	紐幣	40954	-877	+8004	+1972	+19.54%
	英鎊	227528	-253	+27549	-5089	+12.11%
	澳幣	217248	+3937	+10327	+3603	+4.75%
	綜美(未含)	1099551	-22735	+27842	-25694	+2.53%
	綜美(含美)	1129552	-25005	+17850	-28368	+1.58%
	歐元	807166	-19435	-14485	+21081	-1.79%
	瑞郎	70755	+7164	-3534	-2018	-4.99%
	加幣	174395	-2945	-21155	+9207	-12.13%
	日圓	334668	+729	-62899	+1698	-18.79%
美元	30001	-2270	-9992	-2675	-33.31%	

# 金融類投機部位每週變動表

數據日期 2024/02/20

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	567260	-8924	+64348	+17948	+11.34%
	白銀	172844	-3939	+5363	+14995	+3.10%
	銅	258436	-25231	-8807	+33503	-3.41%
	白金	92492	-5013	-5683	+8483	-6.14%
能源	無鉛汽油	391100	+2383	+61425	-715	+15.71%
	輕原油	2098421	-124149	+134150	+18493	+6.39%
	熱燃油	371335	-14568	+22371	-4218	+6.02%
	天然氣	1621710	+43010	-158673	-30258	-9.78%
肉類	活豬	320544	-3701	+48173	+14382	+15.03%
	活牛	376767	+3626	+50533	+8061	+13.41%
農產	粗米	12777	+115	+4421	+148	+34.60%
	黃豆粉	598616	+1444	-30684	-3090	-5.13%
	黃豆油	604371	+399	-52841	-17401	-8.74%
	黃豆	1037578	+32351	-136677	-2178	-13.17%
	小麥	455296	+6878	-68524	-12852	-15.05%
	玉米	2053885	+15037	-340732	-26391	-16.59%
軟性	棉花	306043	+14970	+86079	+14522	+28.13%
	咖啡	235982	-16205	+45829	-4710	+19.42%
	可可	407268	-17481	+42773	-3764	+10.50%
	11號糖	1007162	-147428	+56937	-3057	+5.65%

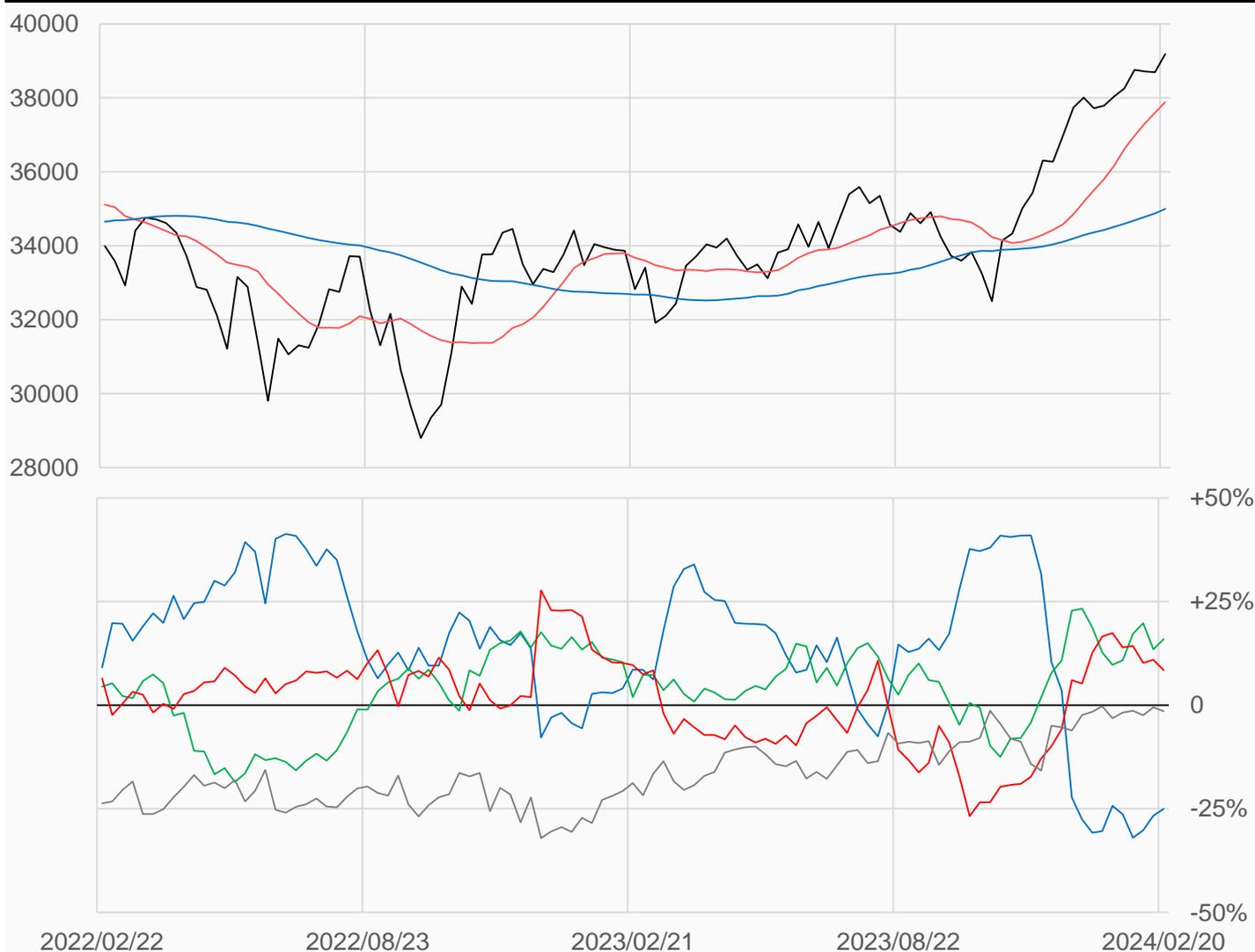
# mini 道瓊

mini道瓊較前一週上漲492點收在39189點，  
 槓桿基金多單減少1039口，空單增加1672口，  
 淨多單較前一週減少23.84%或2711口至8662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
2024/02/20	103466	102403	-1063	-1.03%	39189	↑ +492
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	34149	+359	59803	-1549	-25654	+1908
資產管理	24707	+1456	8412	-892	+16295	+2348
槓桿基金	26831	-1039	18169	+1672	+8662	-2711
其他	1947	-721	3410	+244	-1463	-965

週五收盤價與13週與52週平均線

— YM — 13週 37885 — 52週 34998



淨部位佔總OI% 經紀 -25.1% 資管 +15.9% 槓桿 +8.5% 其他 -1.4%

# mini NQ

miniNQ較前一週上漲247點收在17991點，  
 槓桿基金多單減少6005口，空單減少8588口，  
 淨空單較前一週減少2583口至34974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
2024/02/20	346355	331700	-14655	-4.23%	17991.00	↑ +247.00
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	61155	-3380	125025	-10791	-63870	+7411
資產管理	123340	-2865	28687	+1572	+94653	-4437
槓桿基金	92458	-6005	127432	-8588	-34974	+2583
其他	8359	-3648	9750	+3475	-1391	-7123

週五收盤價與13週與52週平均線

— NQ — 13週 17120 — 52週 15159



淨部位佔總OI% 經紀 -19.3% 資管 +28.5% 槓桿 -10.5% 其他 -0.4%

# mini S&P

miniS&P較前一週上漲81.75點收在5101.5點，  
 槓桿基金多單減少78801口，空單減少43216口，  
 淨空單較前一週增加35585口至424565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
2024/02/20	3456782	3353425	-103357	-2.99%	5101.50	↑ +81.75
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	566882	-13197	1104021	-15334	-537139	+2137
資產管理	1350195	+21	404397	-17074	+945798	+17095
槓桿基金	979365	-78801	1403930	-43216	-424565	-35585
其他	142871	-13148	191472	-18566	-48601	+5418

週五收盤價與13週與52週平均線

— ES — 13週 4846.8 — 52週 4449.3



淨部位佔總OI% 經紀 -16.0% 資管 +28.2% 槓桿 -12.7% 其他 -1.4%

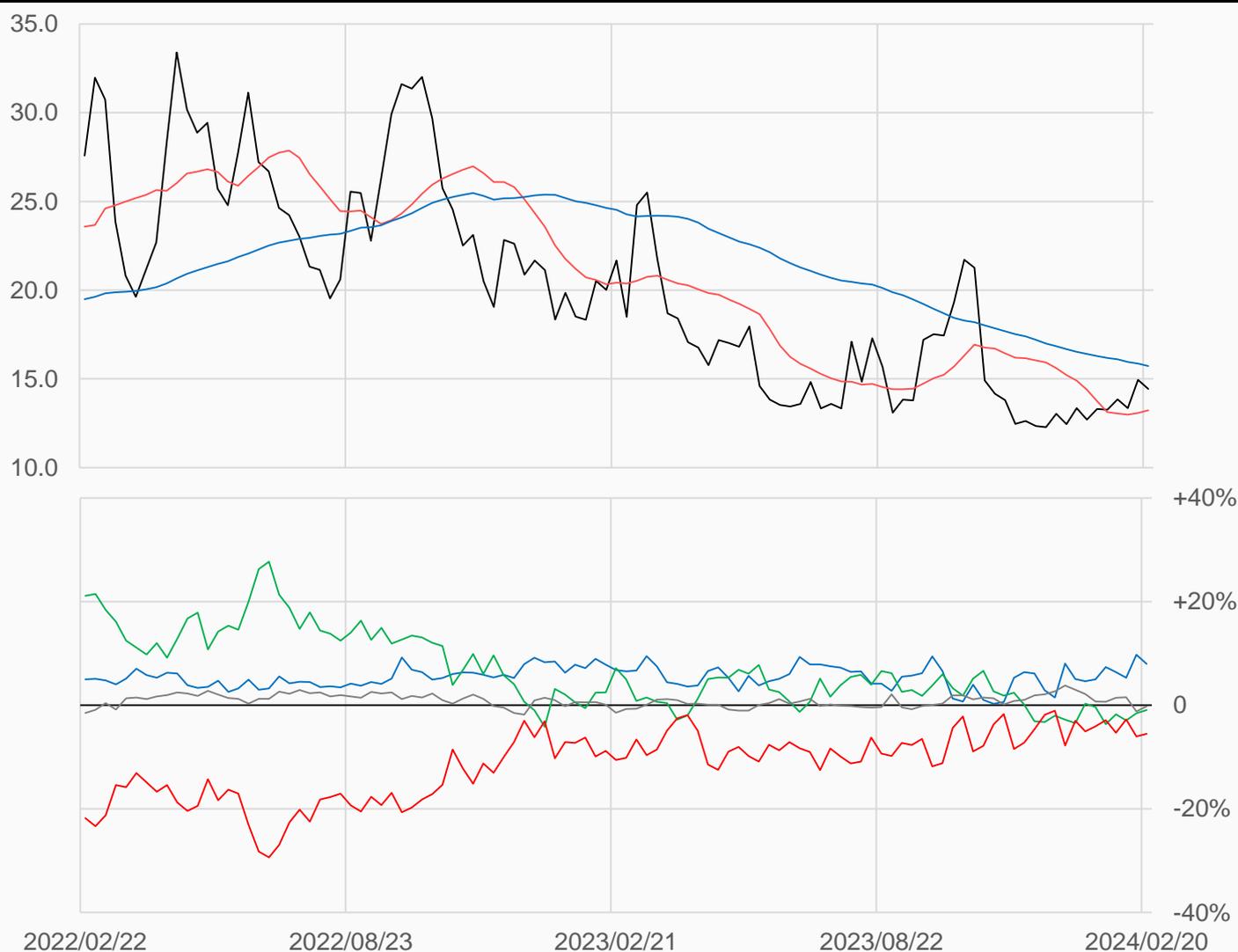
# VIX

VIX較前一週下跌0.52點收在14.43點，  
 槓桿基金多單減少10386口，空單減少13373口，  
 淨空單較前一週減少2987口至18798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
2024/02/20	362470	341280	-21190	-5.85%	14.43	↓ -0.52
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	63727	-13668	36568	-5512	+27159	-8156
資產管理	115663	+6415	118810	+4023	-3147	+2392
槓桿基金	121750	-10386	140548	-13373	-18798	+2987
其他	14670	-2713	15467	-6202	-797	+3489

週五收盤價與13週與52週平均線

— VX — 13週 13.225 — 52週 15.725



淨部位佔總OI% 經紀 +8.0% 資管 -0.9% 槓桿 -5.5% 其他 -0.2%

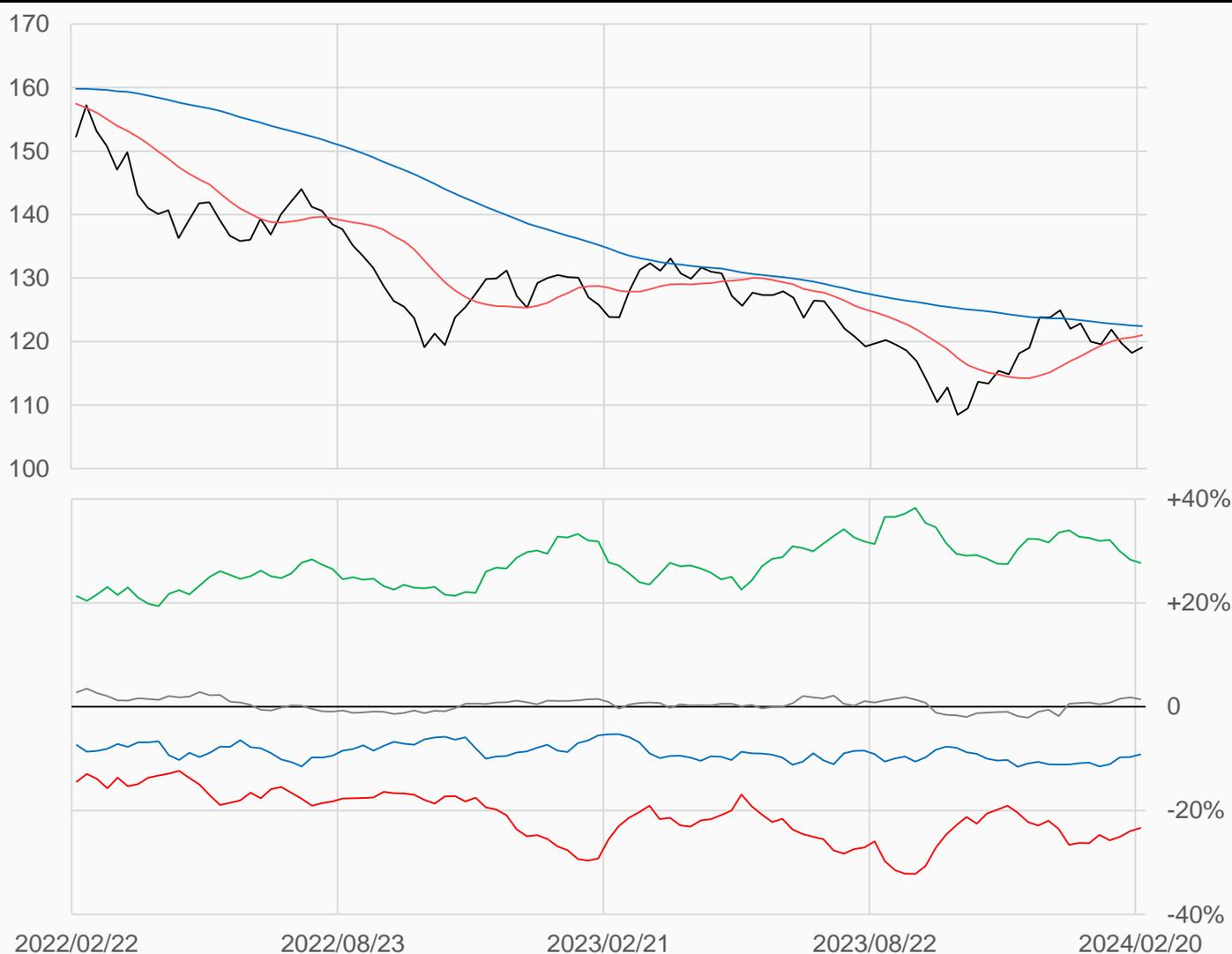
# 30年債

美國30年公債較前一週上漲0.8438點收在119.0625點，  
 槓桿基金多單減少4799口，空單減少22331口，  
 淨空單較前一週減少17532口至375411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
2024/02/20	1639878	1606189	-33689	-2.05%	119 2/32	↑ + 27/32
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	77337	-3036	225212	-14078	-147875	+11042
資產管理	952763	-18892	507674	+734	+445089	-19626
槓桿基金	233341	-4799	608752	-22331	-375411	+17532
其他	113803	-4617	90537	+1357	+23266	-5974

週五收盤價與13週與52週平均線

— US — 13週 121.01 — 52週 122.44



淨部位佔總OI% 經紀 -9.2% 資管 +27.7% 槓桿 -23.4% 其他 +1.4%

# 10年債

美國10年公債較前一週上漲0.125點收在109.875點，  
 槓桿基金多單增加5593口，空單減少91659口，  
 淨空單較前一週減少97252口至1425308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
2024/02/20	5932473	5880805	-51668	-0.87%	109 56/64	↑ + 8/64
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	460997	-19	766033	+76137	-305036	-76156
資產管理	3212481	-17791	1917154	-3959	+1295327	-13832
槓桿基金	1074133	+5593	2499441	-91659	-1425308	+97252
其他	673926	-16124	308808	-20177	+365118	+4053

週五收盤價與13週與52週平均線

— TY — 13週 111.25 — 52週 111.33



淨部位佔總OI% 經紀 -5.2% 資管 +22.0% 槓桿 -24.2% 其他 +6.2%

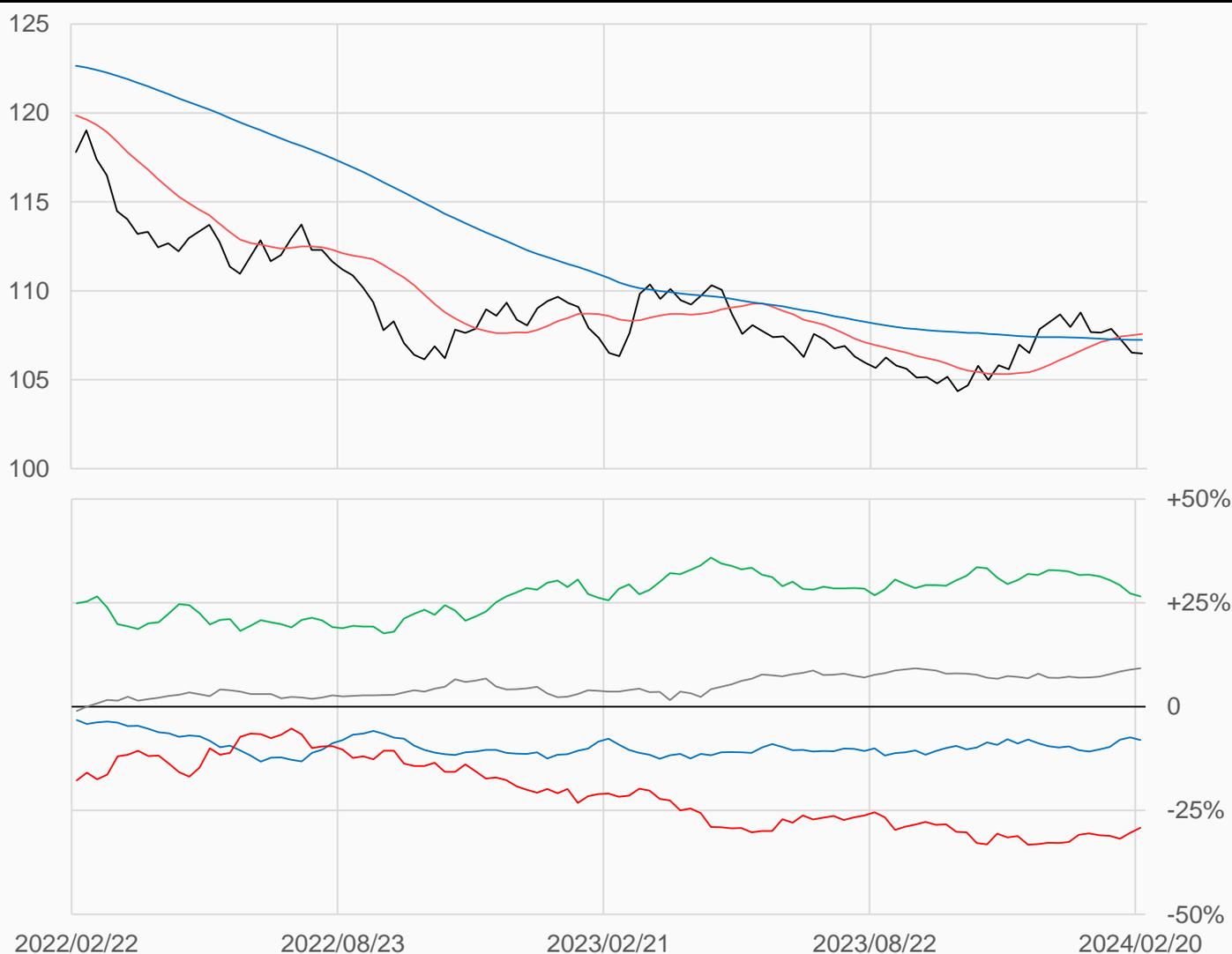
# 5年公債

美國5年公債較前一週下跌0.0391點收在106.4765625點，  
 槓桿基金多單增加53998口，空單增加956口，  
 淨空單較前一週減少53042口至1854042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
2024/02/20	6273391	6361605	+88214	+1.41%	106 61/128	↓ - 5/128
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	295346	+7318	805108	+52079	-509762	-44761
資產管理	3769045	+925	2080029	+22638	+1689016	-21713
槓桿基金	1196283	+53998	3050325	+956	-1854042	+53042
其他	697892	+40319	109058	+9854	+588834	+30465

週五收盤價與13週與52週平均線

— FV — 13週 107.57 — 52週 107.24



淨部位佔總OI% 經紀 -8.0% 資管 +26.6% 槓桿 -29.1% 其他 +9.3%

# 2年公債

美國2年公債較前一週下跌0.0742點收在101.8828125點，  
 槓桿基金多單減少26588口，空單減少54381口，  
 淨空單較前一週減少27793口至1458688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
2024/02/20	4085859	4124430	+38571	+0.94%	101 113/128	↓ - 10/128
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	163241	+1471	556544	+63294	-393303	-61823
資產管理	2205262	+44440	876840	+14515	+1328422	+29925
槓桿基金	913008	-26588	2371696	-54381	-1458688	+27793
其他	573120	+16748	177572	+5147	+395548	+11601

週五收盤價與13週與52週平均線

— TU — 13週 102.43 — 52週 102.1



淨部位佔總OI% 經紀 -9.5% 資管 +32.2% 槓桿 -35.4% 其他 +9.6%

# 歐元

歐元較前一週上漲43.5點收在10833點，  
 槓桿基金多單增加886口，空單減少20194口，  
 淨空單較前一週減少21080口至14485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
2024/02/20	826601	807166	-19435	-2.35%	10833.0	↑ +43.5
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	57445	+304	406282	-4550	-348837	+4854
資產管理	496879	-22329	176638	+6625	+320241	-28954
槓桿基金	136262	+886	150747	-20194	-14485	+21080
其他	35825	+560	14445	-726	+21380	+1286

週五收盤價與13週與52週平均線

— EC — 13週 10897 — 52週 10858



淨部位佔總OI% 經紀 -43.2% 資管 +39.7% 槓桿 -1.8% 其他 +2.6%

# 日圓

日圓較前一週下跌17.5點收在6670點，  
 槓桿基金多單減少898口，空單減少2596口，  
 淨空單較前一週減少1698口至62899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
2024/02/20	333939	334668	+729	+0.22%	6670.0	↓ -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	135871	+9437	19720	-288	+116151	+9725
資產管理	67594	-7604	131890	+3336	-64296	-10940
槓桿基金	68145	-898	131044	-2596	-62899	+1698
其他	19066	+1558	4303	+478	+14763	+1080

週五收盤價與13週與52週平均線

— JY — 13週 6885.8 — 52週 7047.9



淨部位佔總OI% 經紀 +34.7% 資管 -19.2% 槓桿 -18.8% 其他 +4.4%

# 英鎊

英鎊較前一週上漲68點收在12677點，  
 槓桿基金多單減少6122口，空單減少1033口，  
 淨多單較前一週減少5089口至27549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
2024/02/20	227781	227528	-253	-0.11%	12677	↑ +68
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	46403	+1673	34385	+5984	+12018	-4311
資產管理	60648	+260	99004	-3775	-38356	+4035
槓桿基金	88426	-6122	60877	-1033	+27549	-5089
其他	1252	-689	4311	+7	-3059	-696

週五收盤價與13週與52週平均線

— BP — 13週 12681 — 52週 12529



淨部位佔總OI% 經紀 +5.3% 資管 -16.9% 槓桿 +12.1% 其他 -1.3%

# 瑞郎

瑞郎較前一週下跌11點收在11374點，  
槓桿基金多單增加3409口，空單增加5427口，  
淨空單較前一週增加2018口至3534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
2024/02/20	63591	70755	+7164	+11.27%	11374	↓ -11
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	23590	+3258	6463	+308	+17127	+2950
資產管理	17510	+1067	23391	+1585	-5881	-518
槓桿基金	18216	+3409	21750	+5427	-3534	-2018
其他	1851	+196	0	0	+1851	+196

週五收盤價與13週與52週平均線

— SF — 13週 11604 — 52週 11310



淨部位佔總OI% 經紀 +24.2% 資管 -8.3% 槓桿 -5.0% 其他 +2.6%

# 加幣

加幣較前一週下跌5.5點收在7409.5點，  
 槓桿基金多單減少143口，空單減少9350口，  
 淨空單較前一週減少9207口至21155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
2024/02/20	177340	174395	-2945	-1.66%	7409.5	↓ -5.5
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	55237	-1934	26874	+2839	+28363	-4773
資產管理	52014	+553	67646	+5625	-15632	-5072
槓桿基金	25117	-143	46272	-9350	-21155	+9207
其他	10870	-130	3182	-47	+7688	-83

週五收盤價與13週與52週平均線

— CD — 13週 7454.2 — 52週 7416.5



淨部位佔總OI% 經紀 +16.3% 資管 -9.0% 槓桿 -12.1% 其他 +4.4%

# 澳幣

澳幣較前一週上漲31點收在6569.5點，  
 槓桿基金多單增加2583口，空單減少1019口，  
 淨多單較前一週增加3602口至10327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
2024/02/20	213311	217248	+3937	+1.85%	6569.5	↑ +31
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	98870	+2372	4089	+843	+94781	+1529
資產管理	38350	-1216	139141	+4086	-100791	-5302
槓桿基金	52855	+2583	42528	-1019	+10327	+3602
其他	6679	-502	466	-13	+6213	-489

週五收盤價與13週與52週平均線

— AD — 13週 6646.8 — 52週 6601



淨部位佔總OI% 經紀 +43.6% 資管 -46.4% 槓桿 +4.8% 其他 +2.9%

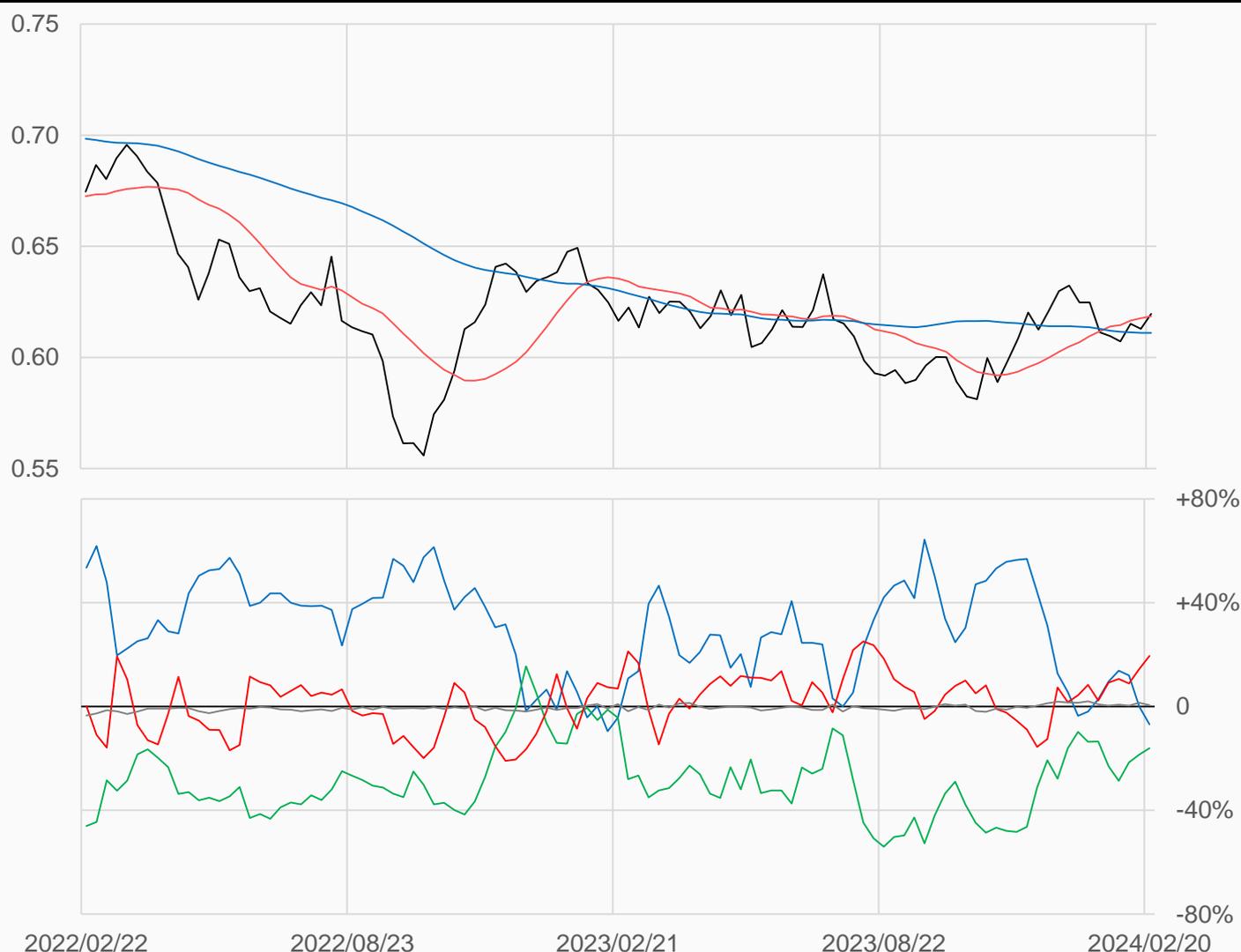
# 紐幣

紐幣較前一週上漲0.0068點收在0.6196點，  
 槓桿基金多單增加936口，空單減少1036口，  
 淨多單較前一週增加1972口至8004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
2024/02/20	41831	40954	-877	-2.10%	0.6196	▲ +0.0068
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	4584	-650	7409	+2195	-2825	-2845
資產管理	13441	-918	20007	-2118	-6566	+1200
槓桿基金	17502	+936	9498	-1036	+8004	+1972
其他	843	-6	629	+396	+214	-402

週五收盤價與13週與52週平均線

— NE — 13週 0.6185 — 52週 0.6111



淨部位佔總OI% 經紀 -6.9% 資管 -16.0% 槓桿 +19.5% 其他 +0.5%

# 美元

美元較前一週下跌0.323點收在103.859點，  
 槓桿基金多單減少3959口，空單減少1285口，  
 淨空單較前一週增加2674口至9992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
2024/02/20	32271	30001	-2270	-7.03%	103.859	↓ -0.323
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	115	+115	3602	0	-3487	+115
資產管理	14675	+1140	2347	-803	+12328	+1943
槓桿基金	9739	-3959	19731	-1285	-9992	-2674
其他	1524	+194	1981	-19	-457	+213

週五收盤價與13週與52週平均線

— DX — 13週 102.96 — 52週 103.29



淨部位佔總OI% 經紀 -11.6% 資管 +41.1% 槓桿 -33.3% 其他 -1.5%

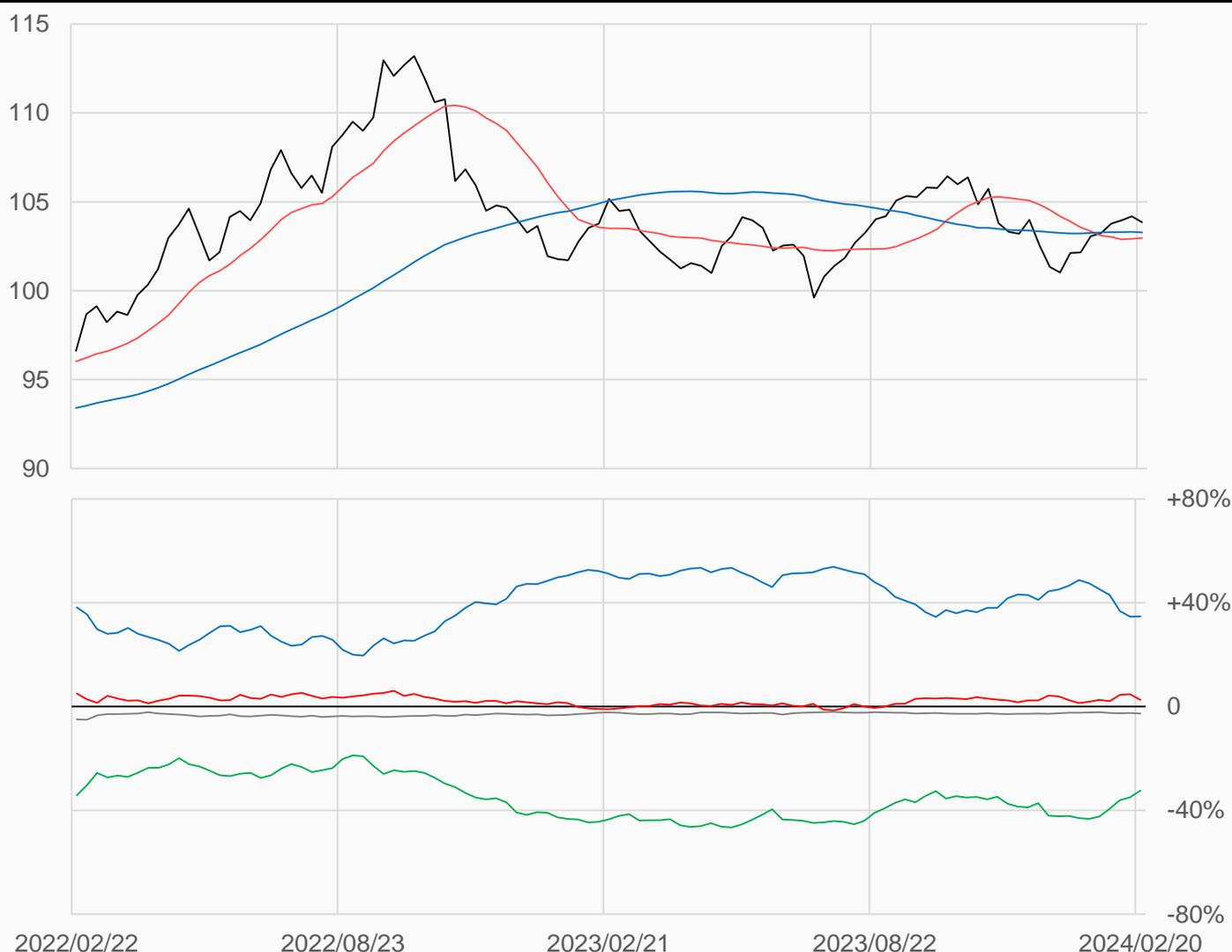
# 綜合美元 (不含美元)

綜合美元較前一週下跌0.323點收在103.859點，  
槓桿基金多單減少25456口，空單增加238口，  
淨多單較前一週減少25694口至27842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
2024/02/20	1122285	1099551	-22735	-2.03%	103.859	↓ -0.323
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	497159.6	-4199	115643.5	+2680	+381516	-6879
資產管理	268334.8	+8876	624055.7	-28082	-355721	+36958
槓桿基金	224363.7	-25456	196521.5	+238	+27842	-25694
其他	19130.3	-772	48394.65	+855	-29264	-1627

週五收盤價與13週與52週平均線

— DXY — 13週 102.96 — 52週 103.29



淨部位佔總OI% 經紀 +34.7% 資管 -32.4% 槓桿 +2.5% 其他 -2.7%

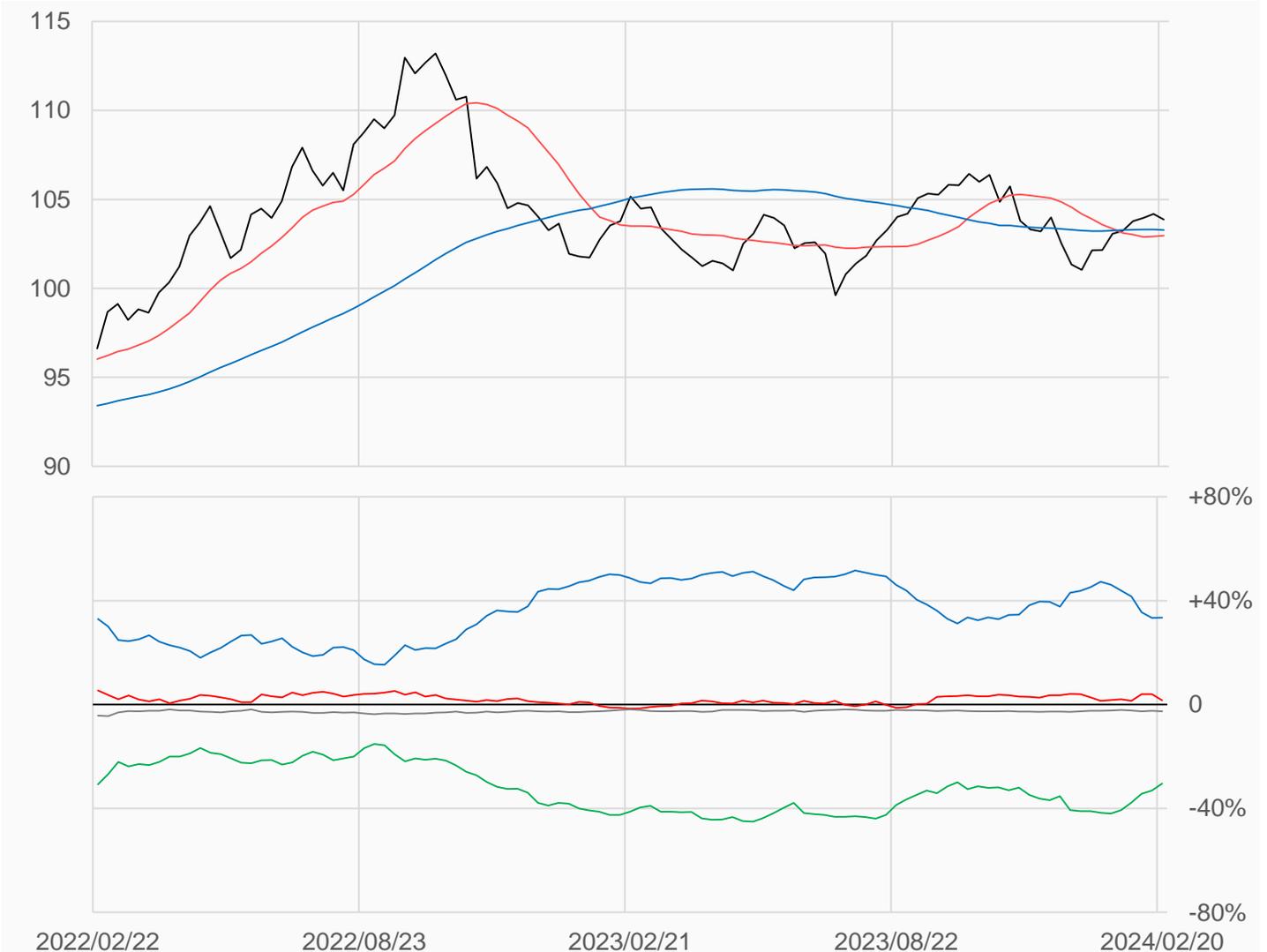
# 綜合美元 (含美元)

綜合美元較前一週下跌0.323點收在103.859點，  
槓桿基金多單減少29415口，空單減少1047口，  
淨多單較前一週減少28368口至17850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
2024/02/20	1154556	1129552	-25005	-2.17%	103.859	↓ -0.323
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	497274.6	-4084	119245.5	+2680	+378029	-6764
資產管理	283009.8	+10016	626402.7	-28885	-343393	+38901
槓桿基金	234102.7	-29415	216252.5	-1047	+17850	-28368
其他	20654.3	-578	50375.65	+836	-29721	-1414

週五收盤價與13週與52週平均線

— DXX — 13週 102.96 — 52週 103.29



淨部位佔總OI% 經紀 +33.5% 資管 -30.4% 槓桿 +1.6% 其他 -2.6%

# 黃金

黃金較前一週上漲25.3點收在2049.4點，  
管理基金多單減少1488口，空單減少19436口，  
淨多單較前一週增加17948口至64348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
2024/02/20	576184	567260	-8924	-1.55%	2049.4	↑ +25.3
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	19813	-4666	56963	+1197	-37150	-5863
互換交易	129939	+1954	253858	+4727	-123919	-2773
管理基金	164664	-1488	100316	-19436	+64348	+17948
其他	206161	-886	127962	+3767	+78199	-4653

週五收盤價與13週與52週平均線

— GC — 13週 2037.7 — 52週 1969.7



淨部位佔總OI% 生產 -6.5% 互換 -21.8% 管理 +11.3% 其他 +13.8%

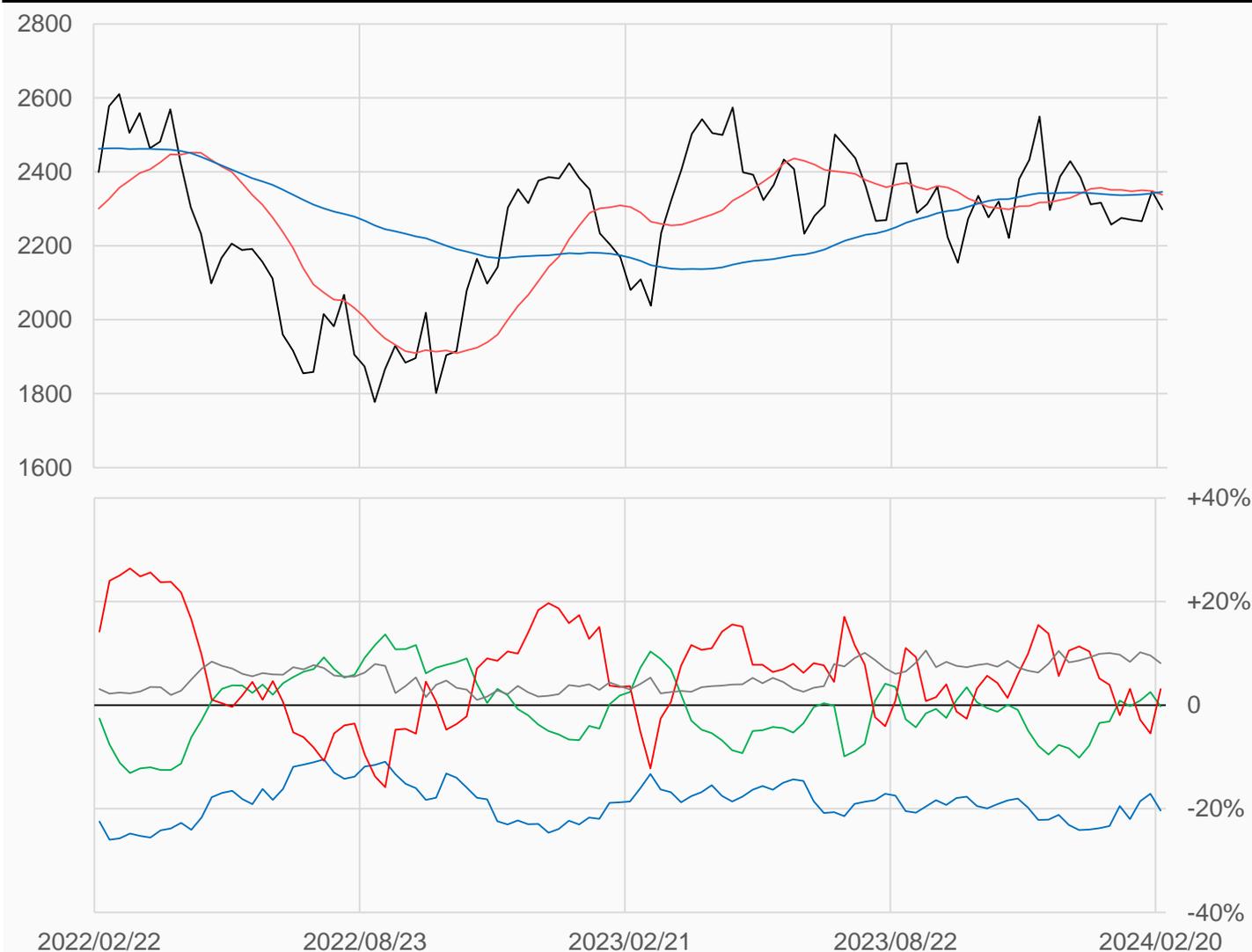
# 白銀

白銀較前一週下跌49.3點收在2298.2點，  
管理基金多單增加5009口，空單減少9986口，  
淨多單較前一週增加14995口至5363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
2024/02/20	176783	172844	-3939	-2.23%	2298.2	↓ -49.3
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	8886	-1557	44033	+3415	-35147	-4972
互換交易	43705	-1078	44093	+3833	-388	-4911
管理基金	48655	+5009	43292	-9986	+5363	+14995
其他	38764	-4307	24753	-1342	+14011	-2965

週五收盤價與13週與52週平均線

— SI — 13週 2337.9 — 52週 2346.3



淨部位佔總OI% 生產 -20.3% 互換 -0.2% 管理 +3.1% 其他 +8.1%

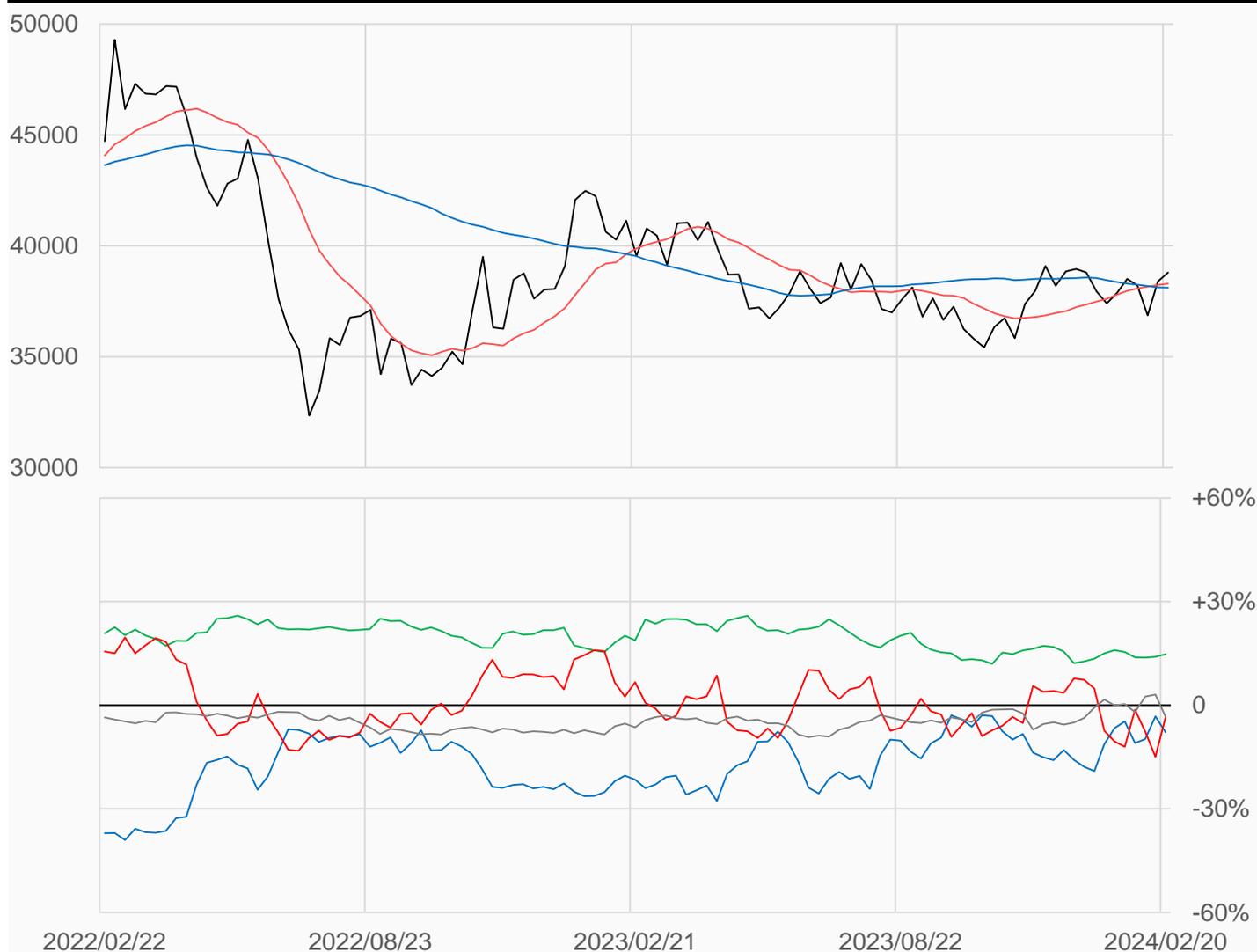
# 銅

銅較前一週上漲415點收在38800點，  
 管理基金多單增加2406口，空單減少31096口，  
 淨空單較前一週減少33502口至8807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
2024/02/20	283667	258436	-25231	-8.89%	38800	↑ +415
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	40012	-8543	60333	+2636	-20321	-11179
互換交易	57062	-718	18796	+809	+38266	-1527
管理基金	97441	+2406	106248	-31096	-8807	+33502
其他	46550	-16805	55389	+768	-8839	-17573

週五收盤價與13週與52週平均線

— HG — 13週 38298 — 52週 38113



淨部位佔總OI% 生產 -7.9% 互換 +14.8% 管理 -3.4% 其他 -3.4%

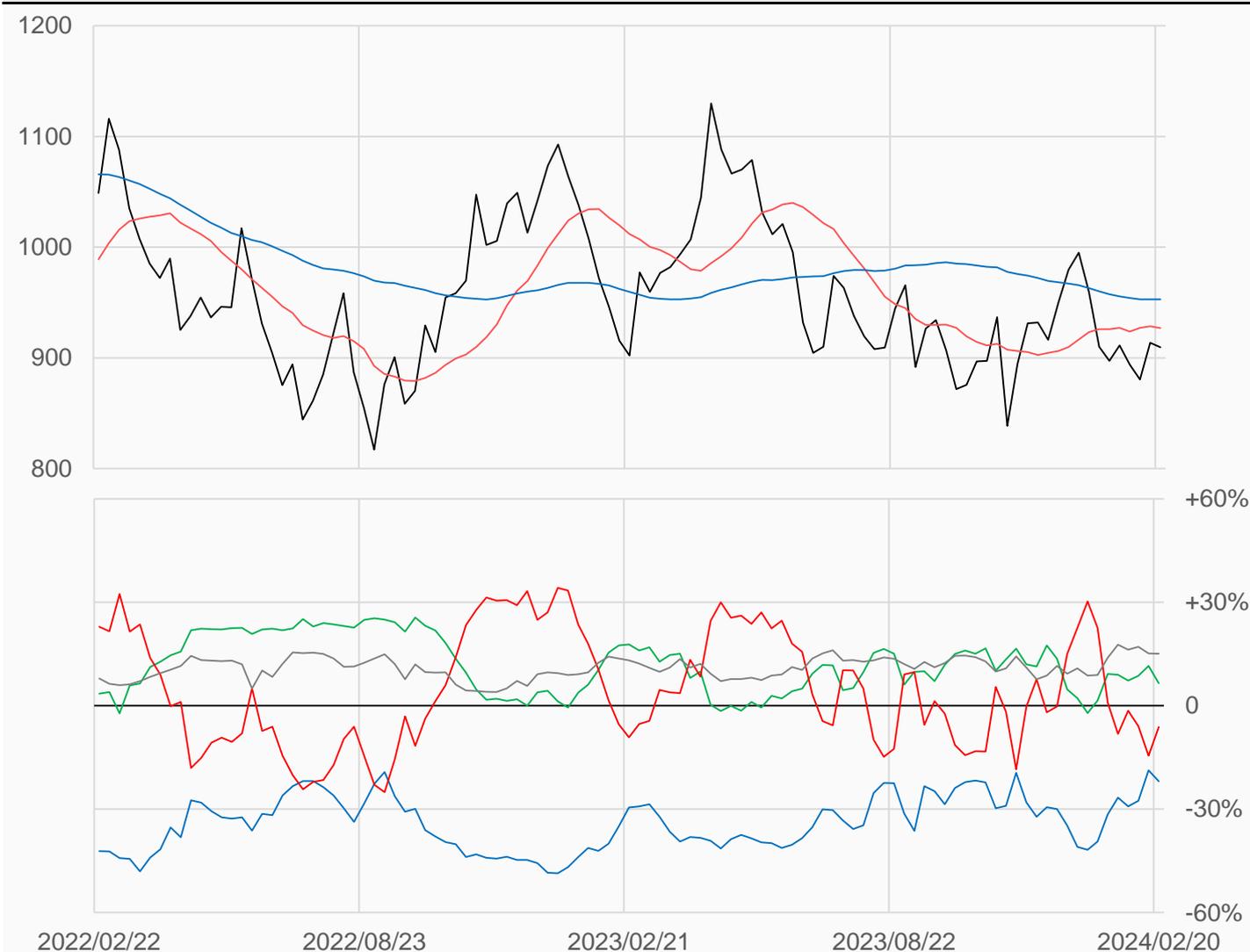
# 白金

白金較前一週下跌3.9點收在909.6點，  
管理基金多單增加3223口，空單減少5259口，  
淨空單較前一週減少8482口至5683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
2024/02/20	97505	92492	-5013	-5.14%	909.6	↓ -3.9
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	5347	-1144	25679	+899	-20332	-2043
互換交易	17068	-3486	11079	+1796	+5989	-5282
管理基金	40646	+3223	46329	-5259	-5683	+8482
其他	20111	-2403	6131	-1601	+13980	-802

週五收盤價與13週與52週平均線

— PL — 13週 926.76 — 52週 952.89



淨部位佔總OI% 生產 -22.0% 互換 +6.5% 管理 -6.1% 其他 +15.1%

# 輕原油

輕原油較前一週下跌1.97點收在76.49點，  
 管理基金多單減少29601口，空單減少48093口，  
 淨多單較前一週增加18492口至134150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
2024/02/20	2222570	2098421	-124149	-5.59%	76.49	↓ -1.97
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	543354	-12313	388625	+4155	+154729	-16468
互換交易	206109	-26951	599108	-22474	-392999	-4477
管理基金	680648	-29601	546498	-48093	+134150	+18492
其他	575961	-57867	500963	-54858	+74998	-3009

週五收盤價與13週與52週平均線

— CL — 13週 74.129 — 52週 77.331



淨部位佔總OI% 生產 +7.4% 互換 -18.7% 管理 +6.4% 其他 +3.6%

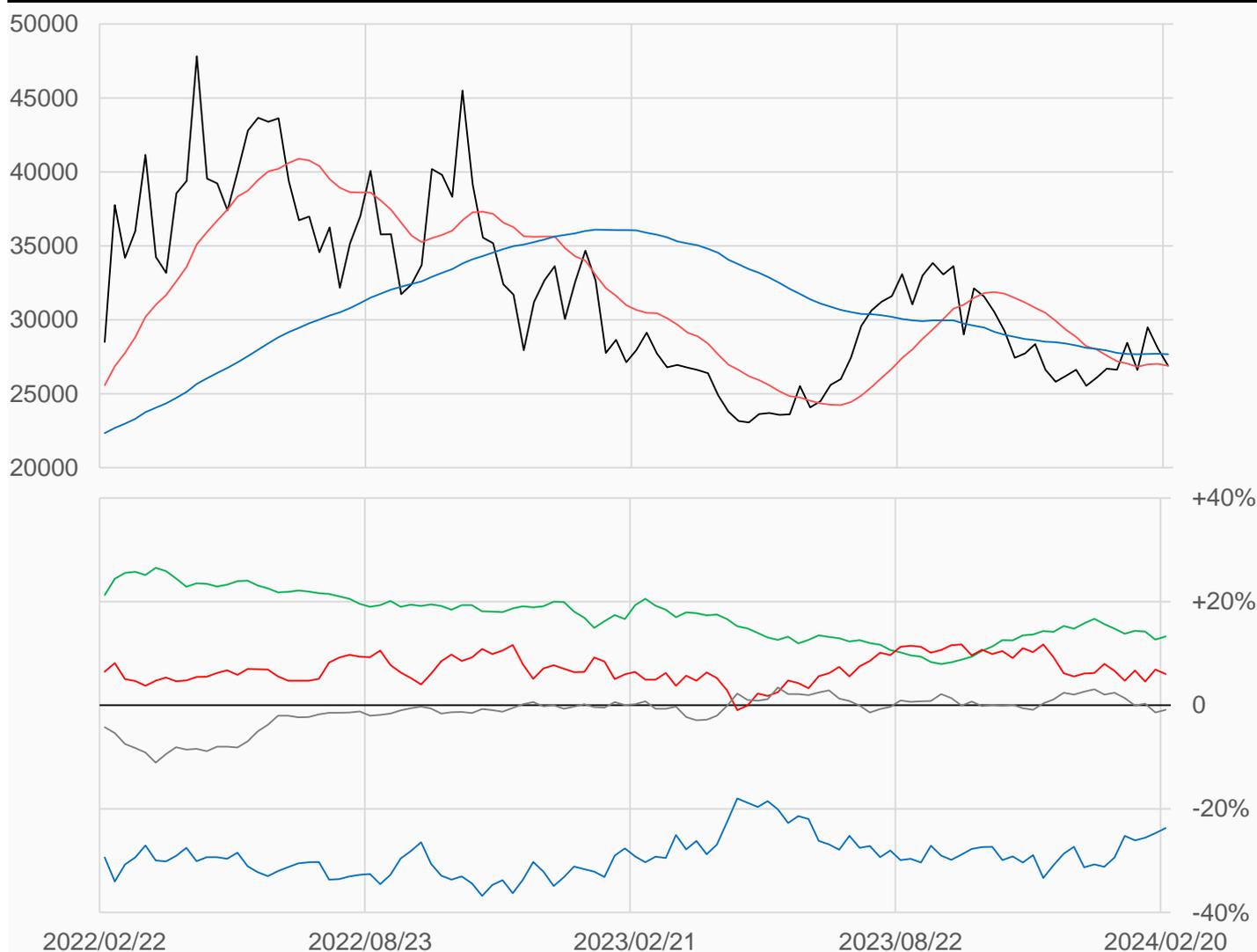
# 熱燃油

熱燃油較前一週下跌1169點收在26897點，  
管理基金多單減少5565口，空單減少1347口，  
淨多單較前一週減少4218口至22371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
2024/02/20	385903	371335	-14568	-3.78%	26897	↓ -1169
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	106083	-11318	194094	-18551	-88011	+7233
互換交易	71388	+424	22061	-90	+49327	+514
管理基金	94298	-5565	71927	-1347	+22371	-4218
其他	49612	+3885	52887	+1780	-3275	+2105

週五收盤價與13週與52週平均線

— HO — 13週 26896 — 52週 27675



淨部位佔總OI% 生產 -23.7% 互換 +13.3% 管理 +6.0% 其他 -0.9%

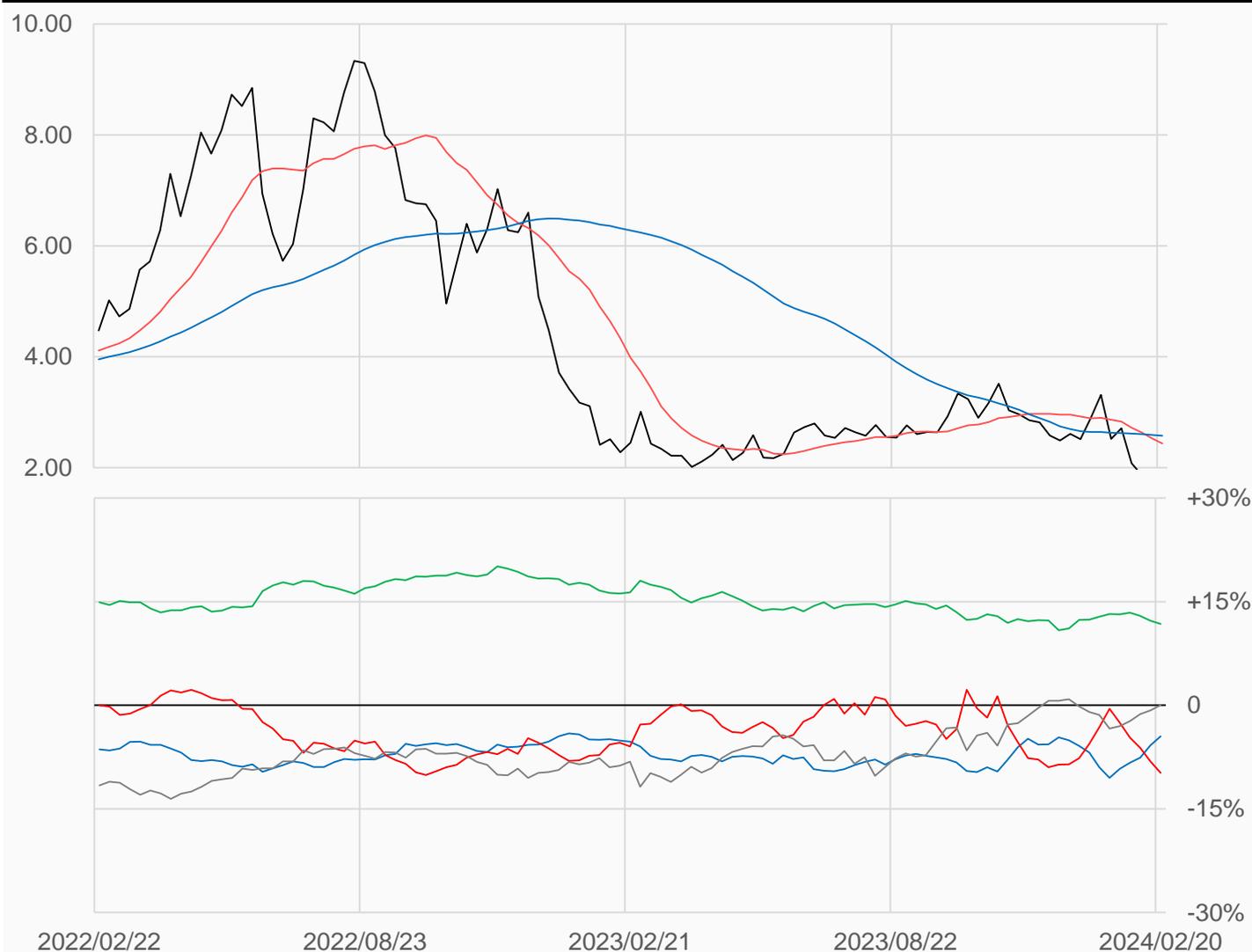
# 天然氣

天然氣較前一週上漲0.09點收在1.699點，  
 管理基金多單減少7263口，空單增加22994口，  
 淨空單較前一週增加30257口至158673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
2024/02/20	1578699	1621710	+43011	+2.72%	1.699	↑ +0.090
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	233276	+14208	306399	-4560	-73123	+18768
互換交易	337233	+1555	146202	+3690	+191031	-2135
管理基金	663141	-7263	821814	+22994	-158673	-30257
其他	303538	+31115	303017	+18664	+521	+12451

週五收盤價與13週與52週平均線

— NG — 13週 2.4381 — 52週 2.5753



淨部位佔總OI% 生產 -4.5% 互換 +11.8% 管理 -9.8% 其他 +0.0%

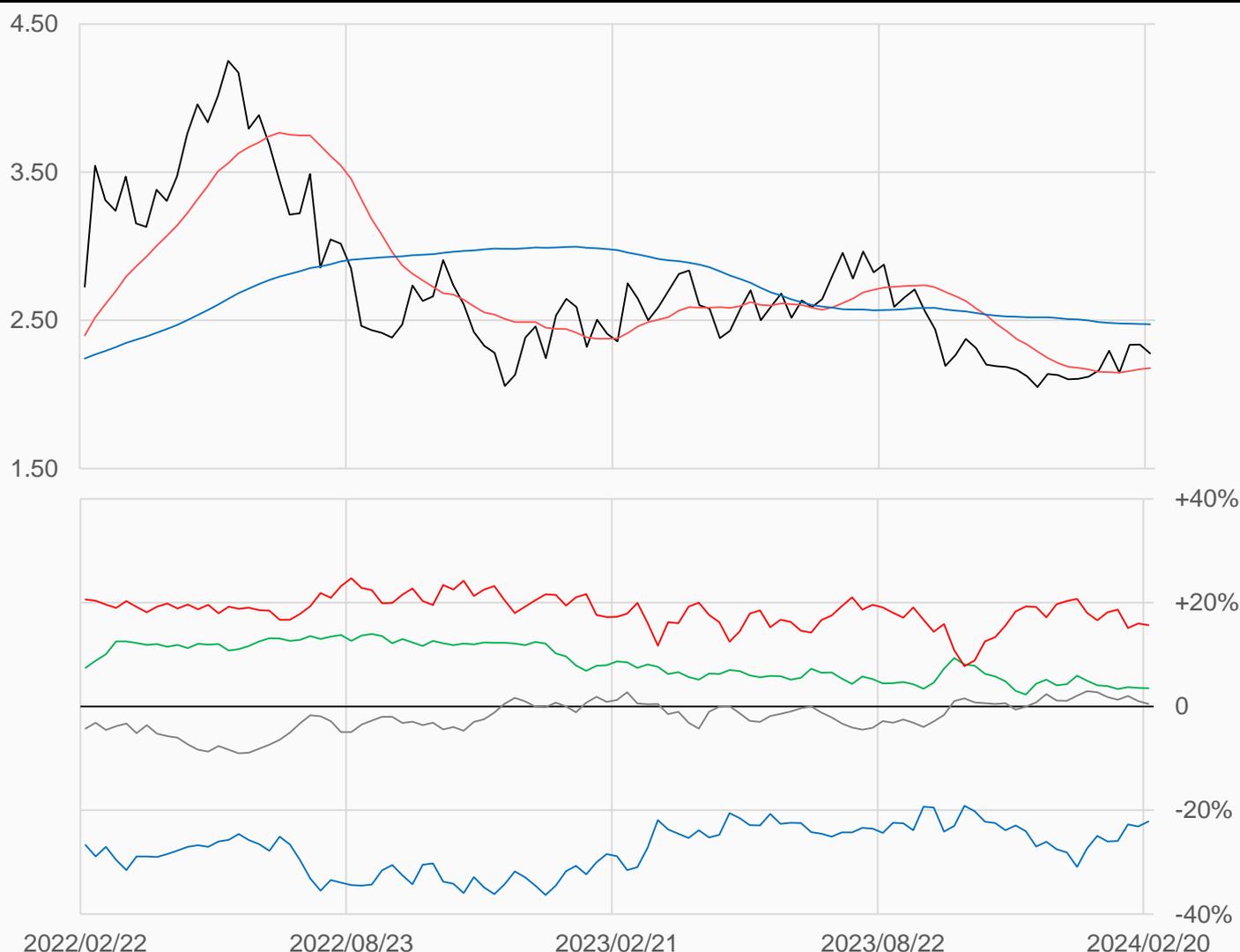
# 無鉛汽油

無鉛汽油較前一週下跌0.0593點收在2.2767點，  
管理基金多單減少1383口，空單減少668口，  
淨多單較前一週減少715口至61425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
2024/02/20	388717	391100	+2383	+0.61%	2.2767	↓ -0.0593
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	130829	+1542	217449	-1756	-86620	+3298
互換交易	57242	+1386	43452	+1503	+13790	-117
管理基金	132697	-1383	71272	-668	+61425	-715
其他	45787	+1964	43927	+4203	+1860	-2239

週五收盤價與13週與52週平均線

— RB — 13週 2.1783 — 52週 2.4736



淨部位佔總OI% 生產 -22.1% 互換 +3.5% 管理 +15.7% 其他 +0.5%

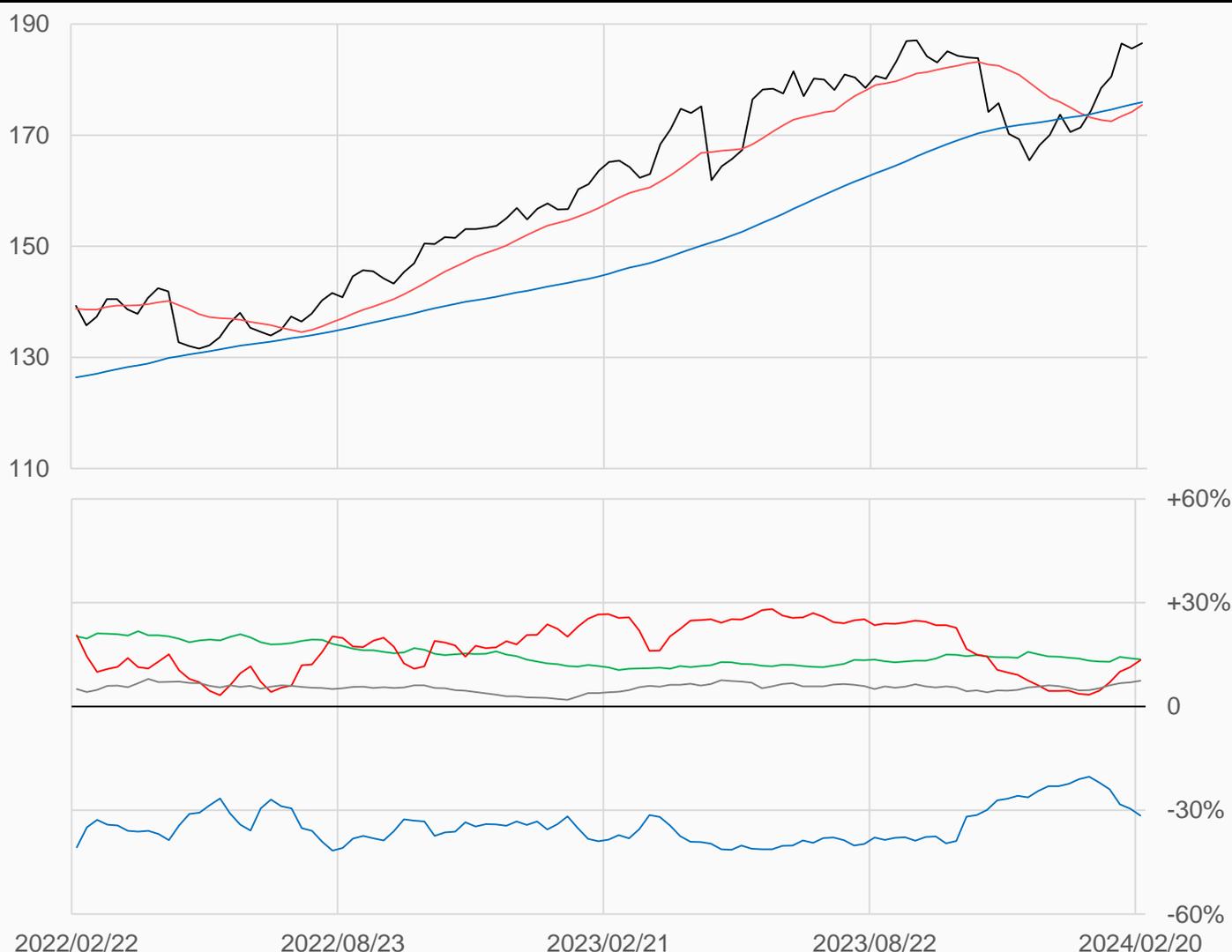
# 活牛

活牛較前一週上漲0.95點收在186.55點，  
 管理基金多單增加7501口，空單減少560口，  
 淨多單較前一週增加8061口至50533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
2024/02/20	373141	376767	+3626	+0.97%	186.550	↑ +0.950
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	72444	-1612	191338	+7278	-118894	-8890
互換交易	56680	-277	5235	+354	+51445	-631
管理基金	115636	+7501	65103	-560	+50533	+8061
其他	96593	-1017	68677	-2833	+27916	+1816

週五收盤價與13週與52週平均線

— LC — 13週 175.44 — 52週 175.93



淨部位佔總OI% 生產 -31.6% 互換 +13.7% 管理 +13.4% 其他 +7.4%

# 活豬

活豬較前一週上漲2.2點收在87.2點，  
 管理基金多單增加13370口，空單減少1012口，  
 淨多單較前一週增加14382口至48173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
2024/02/20	324245	320544	-3701	-1.14%	87.200	↑ +2.200
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	29905	-8544	137817	+8189	-107912	-16733
互換交易	68314	+2601	13185	+971	+55129	+1630
管理基金	100069	+13370	51896	-1012	+48173	+14382
其他	100742	-11362	86074	-13501	+14668	+2139

週五收盤價與13週與52週平均線

— LH — 13週 73.631 — 52週 80.615



淨部位佔總OI% 生產 -33.7% 互換 +17.2% 管理 +15.0% 其他 +4.6%

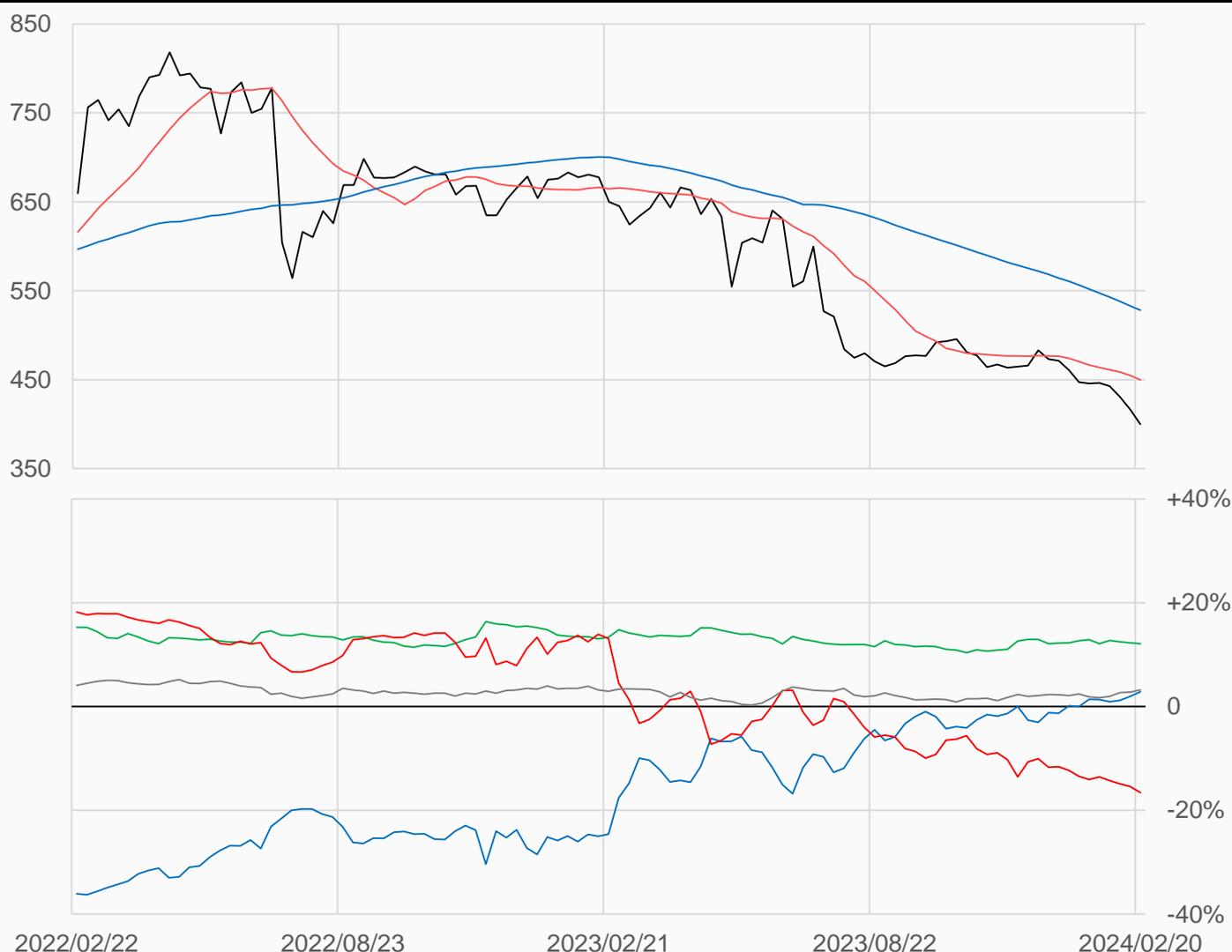
# 玉米

玉米較前一週下跌16.75點收在399.75點，  
管理基金多單減少9276口，空單增加17115口，  
淨空單較前一週增加26391口至340732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
2024/02/20	2038849	2053885	+15036	+0.74%	399.75	↓ -16.75
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	553010	+13094	494668	-5042	+58342	+18136
互換交易	303505	-1904	55075	-152	+248430	-1752
管理基金	486635	-9276	827367	+17115	-340732	-26391
其他	506851	+8782	440857	-196	+65994	+8978

週五收盤價與13週與52週平均線

— ZC — 13週 449.73 — 52週 528.08



淨部位佔總OI% 生產 +2.8% 互換 +12.1% 管理 -16.6% 其他 +3.2%

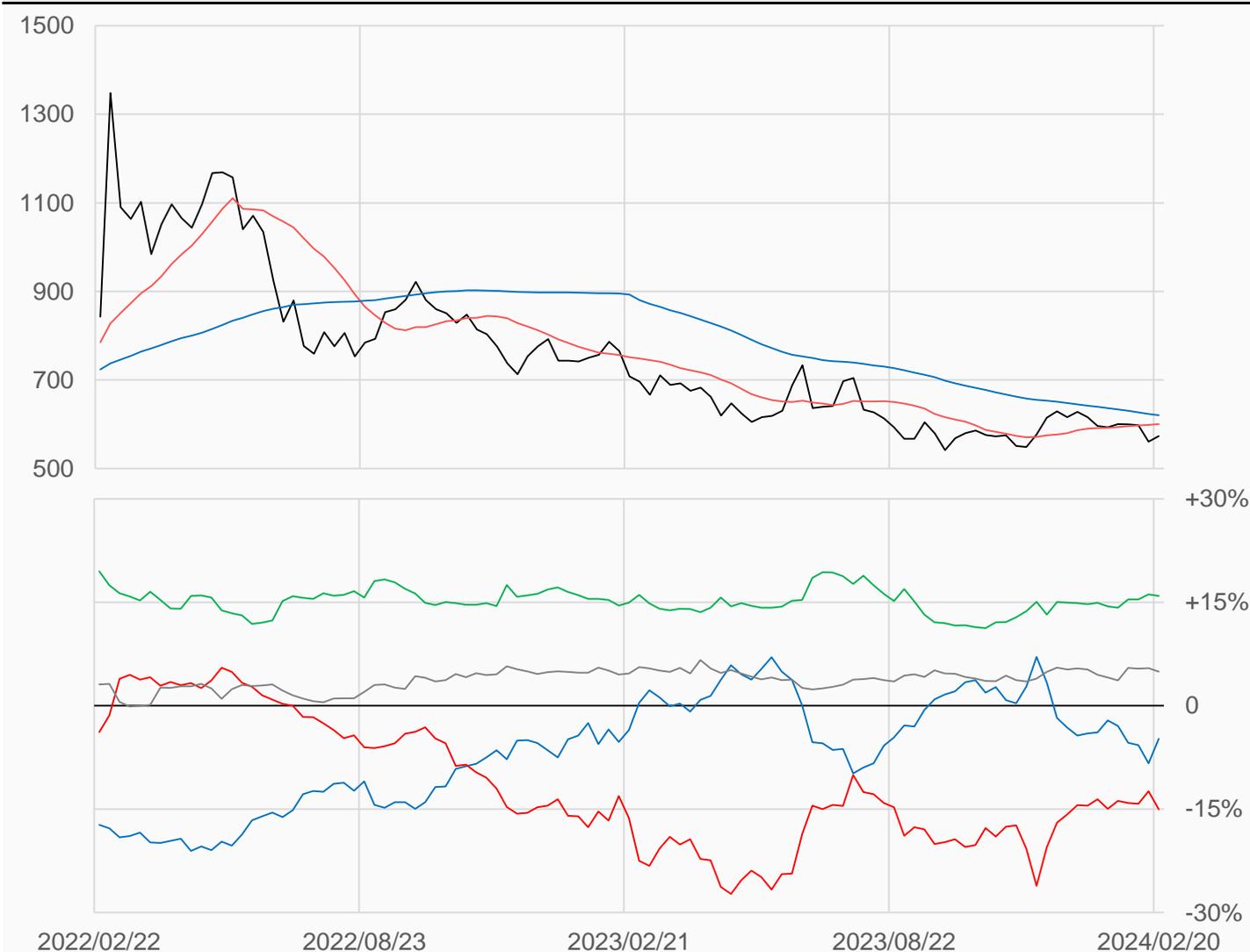
# 小麥

小麥較前一週上漲13點收在573.5點，  
 管理基金多單增加5098口，空單增加17950口，  
 淨空單較前一週增加12852口至68524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
2024/02/20	448418	455296	+6878	+1.53%	573.50	↑ +13.00
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	58663	+3638	80543	-11894	-21880	+15532
互換交易	99170	-194	26693	-242	+72477	+48
管理基金	159442	+5098	227966	+17950	-68524	-12852
其他	104436	-2719	81957	-769	+22479	-1950

週五收盤價與13週與52週平均線

— ZW — 13週 600.19 — 52週 620.4



淨部位佔總OI% 生產 -4.8% 互換 +15.9% 管理 -15.1% 其他 +4.9%

# 黃豆

黃豆較前一週下跌39.25點收在1133點，  
 管理基金多單減少10291口，空單減少8114口，  
 淨空單較前一週增加2177口至136677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
2024/02/20	1005227	1037578	+32351	+3.22%	1133.00	↓ -39.25
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	368392	+18865	331998	+18389	+36394	+476
互換交易	160907	-2320	30685	-1970	+130222	-350
管理基金	186510	-10291	323187	-8114	-136677	-2177
其他	261777	+26754	278568	+23513	-16791	+3241

週五收盤價與13週與52週平均線

— ZS — 13週 1238 — 52週 1364



淨部位佔總OI% 生產 +3.5% 互換 +12.6% 管理 -13.2% 其他 -1.6%

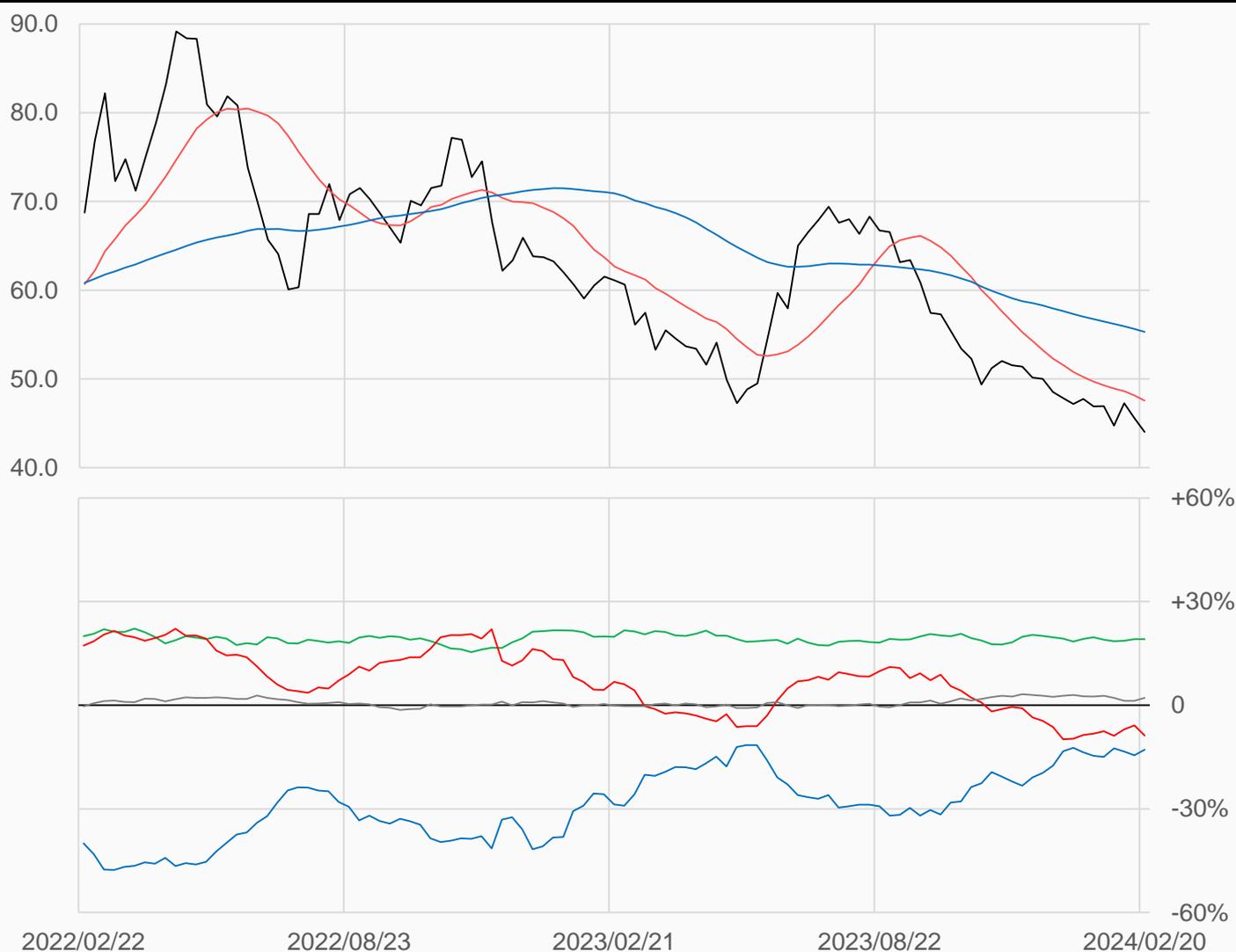
# 黃豆油

黃豆油較前一週下跌1.57點收在44.02點，  
管理基金多單減少8466口，空單增加8935口，  
淨空單較前一週增加17401口至52841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
2024/02/20	603973	604371	+398	+0.07%	44.02	↓ -1.57
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	153599	-1224	231541	-11051	-77942	+9827
互換交易	134880	-861	19280	-840	+115600	-21
管理基金	181336	-8466	234177	+8935	-52841	-17401
其他	105153	+10958	92354	+5833	+12799	+5125

週五收盤價與13週與52週平均線

— BO — 13週 47.556 — 52週 55.303



淨部位佔總OI% 生產 -12.9% 互換 +19.1% 管理 -8.7% 其他 +2.1%

# 黃豆粉

黃豆粉較前一週下跌14.1點收在331.5點，  
 管理基金多單增加15口，空單增加3107口，  
 淨空單較前一週增加3092口至30684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
2024/02/20	597172	598616	+1444	+0.24%	331.5	↓ -14.1
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	166592	+3594	238995	-1981	-72403	+5575
互換交易	109182	-2714	11206	+2547	+97976	-5261
管理基金	141478	+15	172162	+3107	-30684	-3092
其他	128230	+1209	141511	-2088	-13281	+3297

週五收盤價與13週與52週平均線

— SM — 13週 372.85 — 52週 414.94



淨部位佔總OI% 生產 -12.1% 互換 +16.4% 管理 -5.1% 其他 -2.2%

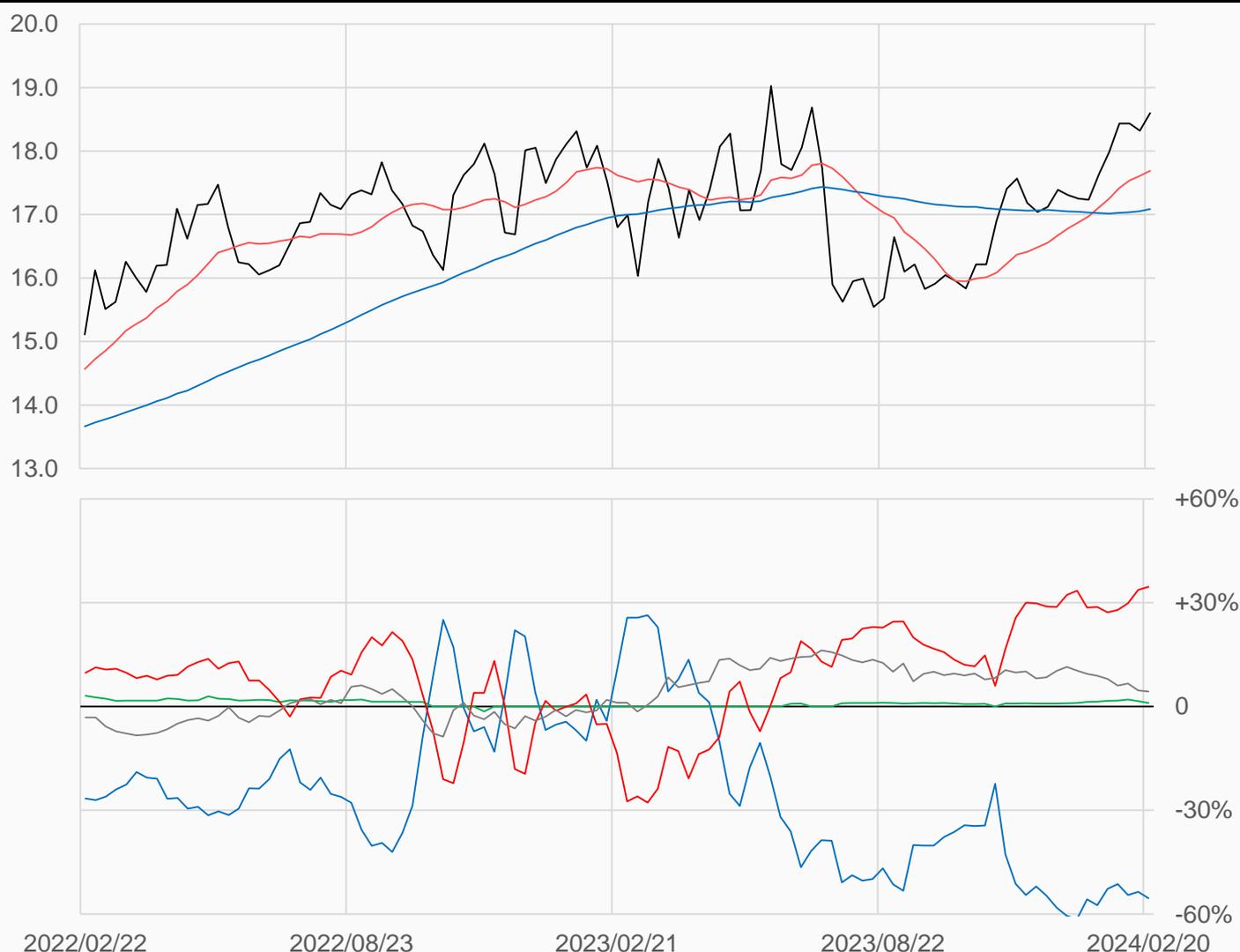
# 粗米

粗米較前一週上漲0.28點收在18.6點，  
 管理基金多單增加183口，空單增加35口，  
 淨多單較前一週增加148口至4421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
2024/02/20	12661	12777	+116	+0.92%	18.600	↑ +0.280
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	2548	+18	9631	+324	-7083	-306
互換交易	161	-80	29	-12	+132	-68
管理基金	5291	+183	870	+35	+4421	+148
其他	1663	-218	1110	-183	+553	-35

週五收盤價與13週與52週平均線

— RR — 13週 17.687 — 52週 17.086



淨部位佔總OI% 生產 -55.4% 互換 +1.0% 管理 +34.6% 其他 +4.3%

# 咖啡

咖啡較前一週下跌9.4點收在179.9點，  
管理基金多單減少1699口，空單增加3011口，  
淨多單較前一週減少4710口至45829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
2024/02/20	252187	235982	-16205	-6.43%	179.90	↓ -9.40
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	45945	-7654	113414	-12165	-67469	+4511
互換交易	38687	-1027	25285	-1622	+13402	+595
管理基金	95449	-1699	49620	+3011	+45829	-4710
其他	48224	-4317	40493	-4598	+7731	+281

週五收盤價與13週與52週平均線

— KC — 13週 189.3 — 52週 174.83



淨部位佔總OI% 生產 -28.6% 互換 +5.7% 管理 +19.4% 其他 +3.3%

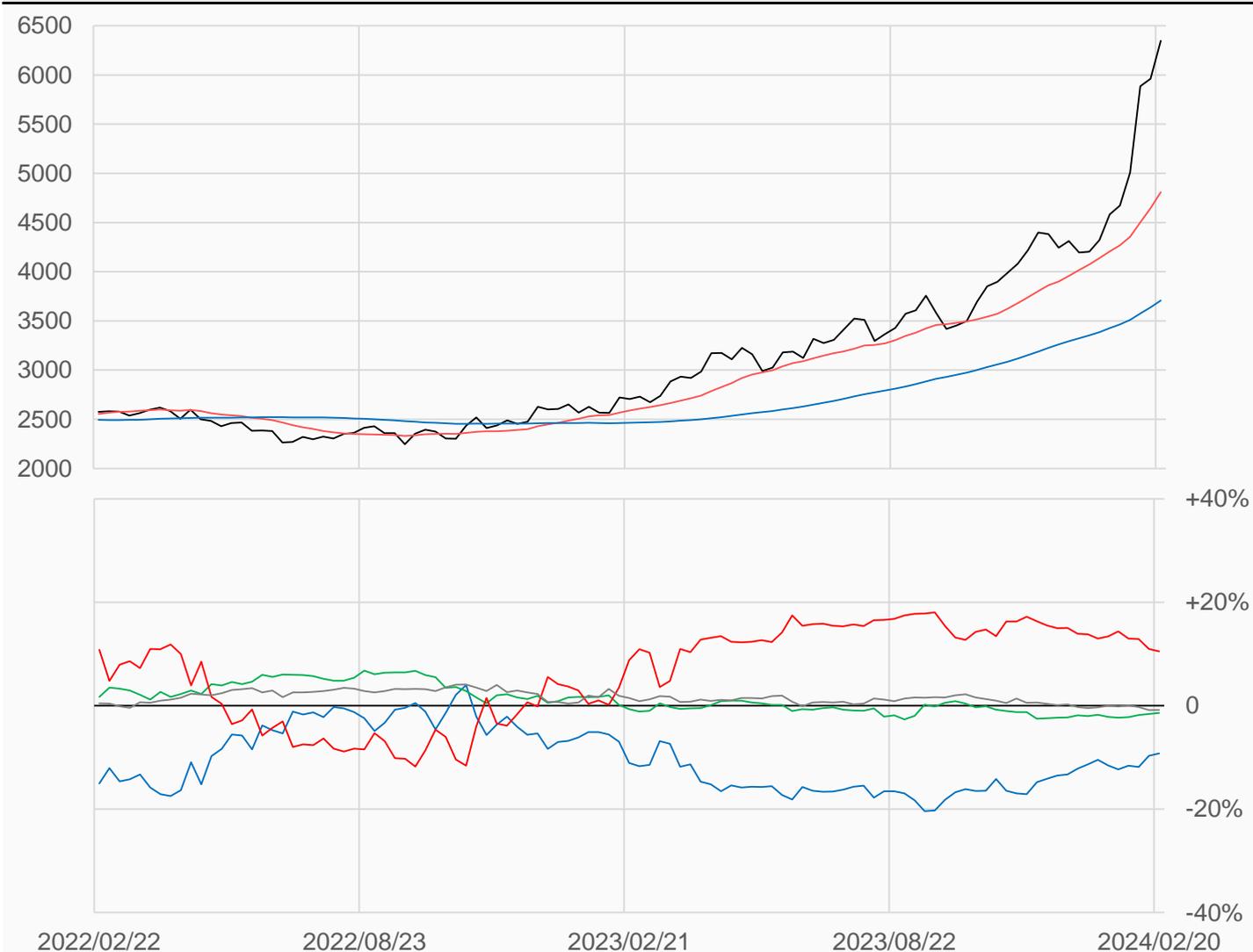
# 可可

可可較前一週上漲386點收在6347點，  
管理基金多單減少5178口，空單減少1415口，  
淨多單較前一週減少3763口至42773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
2024/02/20	424748	407268	-17480	-4.12%	6347	↑ +386
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	95997	-10491	133558	-14140	-37561	+3649
互換交易	21187	+814	26962	-218	-5775	+1032
管理基金	156172	-5178	113399	-1415	+42773	-3763
其他	117626	-2054	121079	-2238	-3453	+184

週五收盤價與13週與52週平均線

— CC — 13週 4808.8 — 52週 3707.6



淨部位佔總OI% 生產 -9.2% 互換 -1.4% 管理 +10.5% 其他 -0.8%

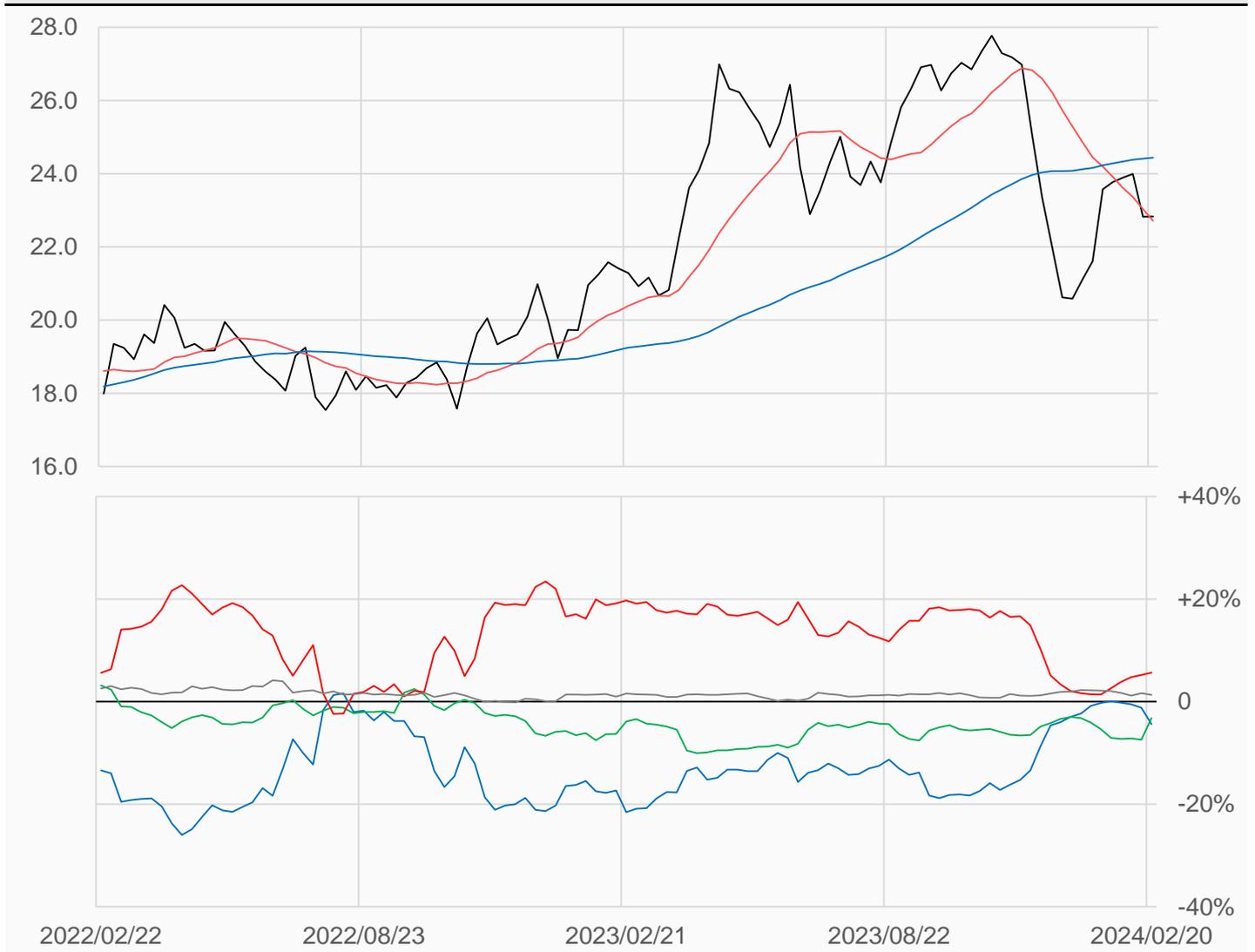
# 11號糖

11號糖較前一週上漲0.01點收在22.83點，  
 管理基金多單減少1367口，空單增加1690口，  
 淨多單較前一週減少3057口至56937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
2024/02/20	1154590	1007162	-147428	-12.77%	22.83	↑ +0.01
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	356320	-59902	400822	-29020	-44502	-30882
互換交易	170687	-10543	202773	-64130	-32086	+53587
管理基金	229284	-1367	172347	+1690	+56937	-3057
其他	175178	-71092	161799	-65598	+13379	-5494

週五收盤價與13週與52週平均線

— SB — 13週 22.71 — 52週 24.437



淨部位佔總OI% 生產 -4.4% 互換 -3.2% 管理 +5.7% 其他 +1.3%

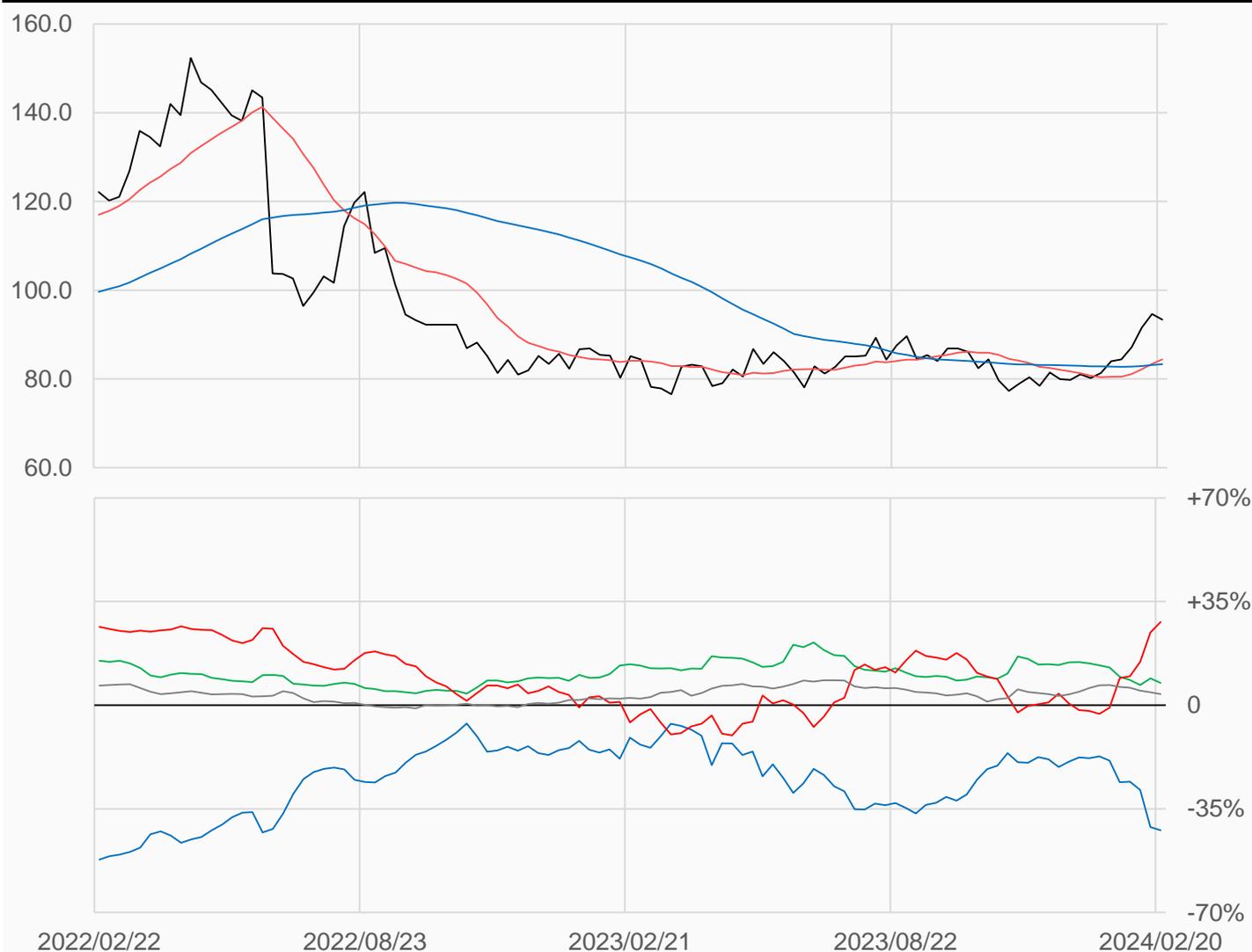
# 棉花

棉花較前一週下跌1.26點收在93.37點，  
管理基金多單增加19221口，空單增加4701口，  
淨多單較前一週增加14520口至86079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
2024/02/20	291073	306043	+14970	+5.14%	93.37	↓ -1.26
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	40757	-2400	170062	+7110	-129305	-9510
互換交易	61858	-1456	38718	+1700	+23140	-3156
管理基金	124937	+19221	38858	+4701	+86079	+14520
其他	60740	+1026	49377	+2375	+11363	-1349

週五收盤價與13週與52週平均線

— CT — 13週 84.387 — 52週 83.309



淨部位佔總OI% 生產 -42.3% 互換 +7.6% 管理 +28.1% 其他 +3.7%