

CFTC 大額交易人持倉報告

永豐期貨顧問事業部編製

2024/3/4

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 2024/02/27

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	104080	+1677	+9387	+725	+9.02%
	VX	361331	+20051	-20729	-1931	-5.74%
	ES	3568228	+214803	-440731	-16166	-12.35%
	NQ	332083	+383	-48028	-13054	-14.46%
債券	30年債	1663991	+57802	-342596	+32815	-20.59%
	10年債	5216932	-663873	-1316223	+109086	-25.23%
	5年債	6315887	-45718	-1961461	-107419	-31.06%
	2年債	3827809	-296621	-1397398	+61292	-36.51%
外匯	英鎊	242921	+15393	+23924	-3625	+9.85%
	紐幣	48489	+7535	+2847	-5157	+5.87%
	綜美(未含)	1098260	+3399	+36940	+9263	+3.36%
	綜美(含美)	1127851	+2989	+26919	+9234	+2.39%
	澳幣	217369	+121	+2496	-7831	+1.15%
	瑞郎	75891	+5136	-1448	+2086	-1.91%
	歐元	805768	-1398	-18550	-4065	-2.30%
	加幣	182943	+8548	-15466	+5689	-8.45%
	日圓	342026	+7358	-83562	-20663	-24.43%
	美元	29591	-410	-10021	-29	-33.87%

金融類投機部位每週變動表

數據日期 2024/02/27

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	551918	-15343	+68042	+3694	+12.33%
	銅	208274	-50162	+4367	+13173	+2.10%
	白銀	162469	-10375	-4143	-9506	-2.55%
	白金	92901	+409	-11218	-5535	-12.08%
能源	無鉛汽油	377998	-13102	+61003	-422	+16.14%
	輕原油	2118576	+20154	+174730	+40580	+8.25%
	熱燃油	336906	-34429	+24347	+1976	+7.23%
	天然氣	1513942	-107768	-121193	+37480	-8.01%
肉類	活豬	344440	+23896	+63064	+14891	+18.31%
	活牛	396702	+19935	+54821	+4288	+13.82%
農產	粗米	12674	-102	+4888	+467	+38.57%
	黃豆粉	540992	-57624	-47650	-16967	-8.81%
	黃豆油	558317	-46054	-52329	+513	-9.37%
	小麥	414999	-40297	-56326	+12198	-13.57%
	玉米	1896360	-157526	-295258	+45475	-15.57%
	黃豆	922159	-115419	-160653	-23975	-17.42%
軟性	棉花	324111	+18068	+94038	+7957	+29.01%
	咖啡	239537	+3555	+42665	-3165	+17.81%
	可可	396177	-11091	+32328	-10444	+8.16%
	11號糖	991472	-15690	+70614	+13677	+7.12%

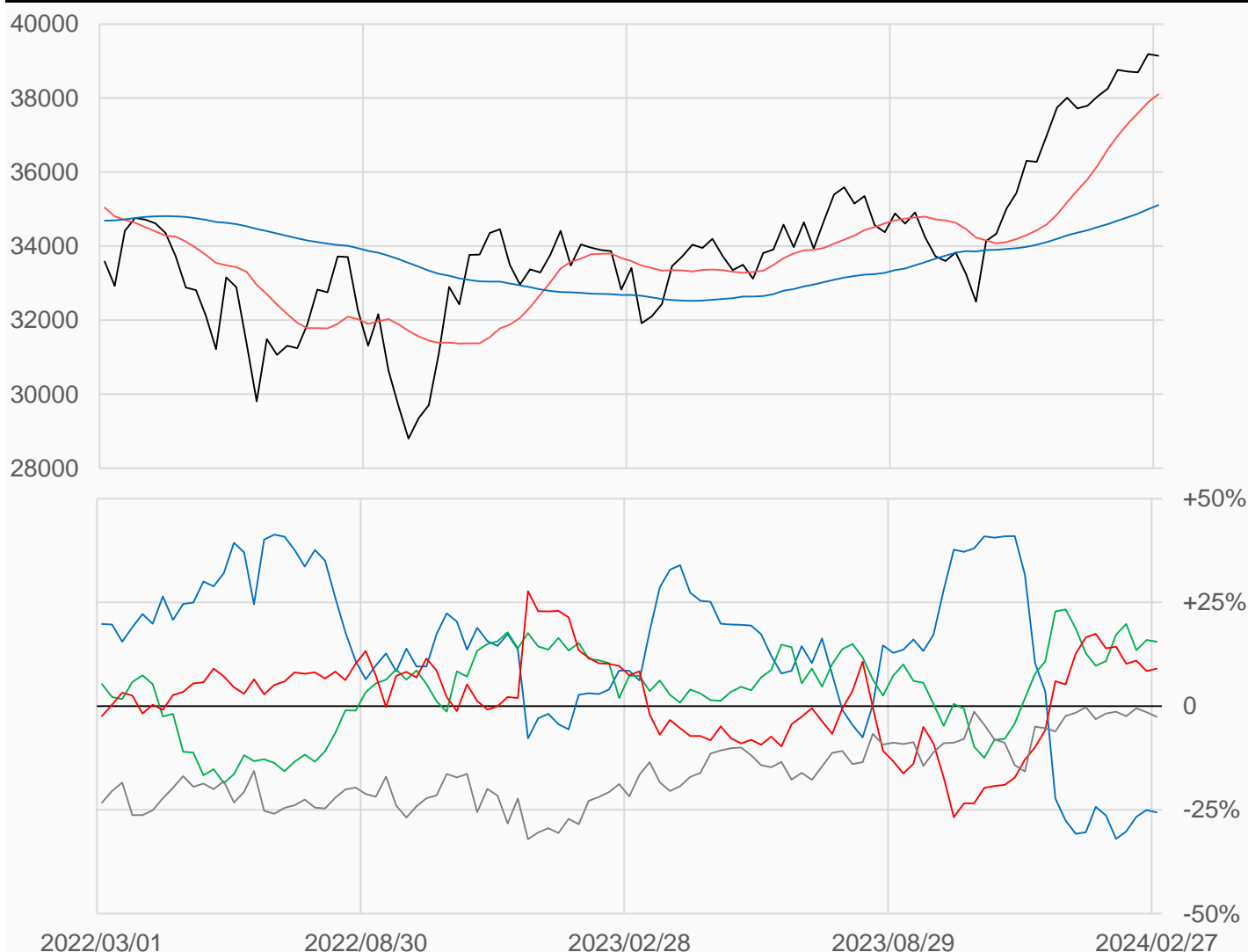
mini 道瓊

mini道瓊較前一週下跌47點收在39142點，
 槓桿基金多單增加454口，空單減少271口，
 淨多單較前一週增加8.37%或725口至9387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
2024/02/27	102403	104080	+1677	+1.64%	39142	↓ -47
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	34358	+209	61003	+1200	-26645	-991
資產管理	25118	+411	8964	+552	+16154	-141
槓桿基金	27285	+454	17898	-271	+9387	+725
其他	1431	-516	4087	+677	-2656	-1193

週五收盤價與13週與52週平均線

— YM — 13週 38104 — 52週 35109



淨部位佔總OI% 經紀 -25.6% 資管 +15.5% 槓桿 +9.0% 其他 -2.6%

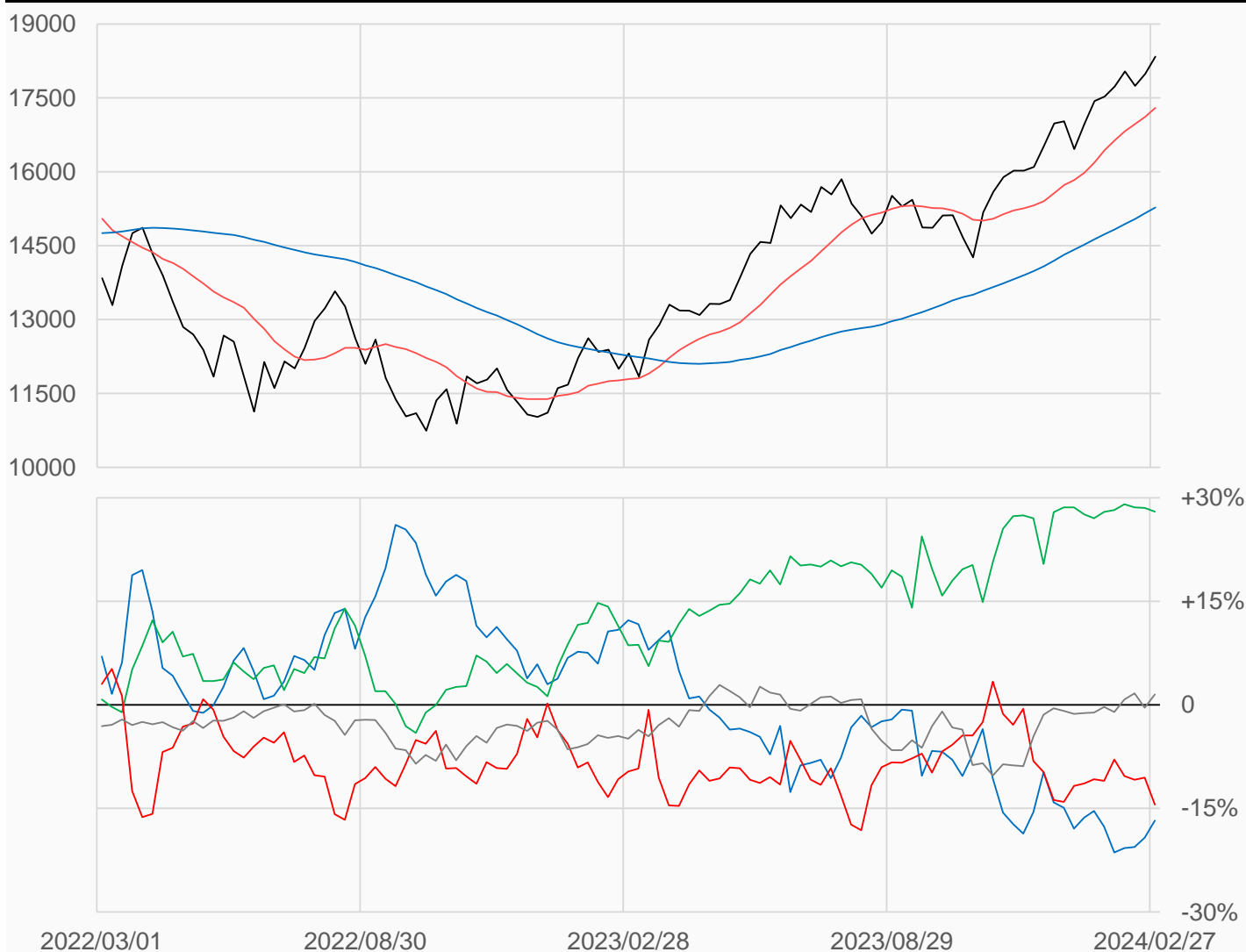
mini NQ

miniNQ較前一週上漲347.25點收在18338.25點，
 槓桿基金多單增加832口，空單增加13886口，
 淨空單較前一週增加13054口至48028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
2024/02/27	331700	332083	+383	+0.12%	18338.25	↑ +347.25
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	63366	+2211	119040	-5985	-55674	+8196
資產管理	121327	-2013	28357	-330	+92970	-1683
槓桿基金	93290	+832	141318	+13886	-48028	-13054
其他	11328	+2969	6345	-3405	+4983	+6374

週五收盤價與13週與52週平均線

— NQ — 13週 17298 — 52週 15275



淨部位佔總OI% 經紀 -16.8% 資管 +28.0% 槓桿 -14.5% 其他 +1.5%

mini S&P

miniS&P較前一週上漲44.5點收在5146點，
 槓桿基金多單增加128373口，空單增加144539口，
 淨空單較前一週增加16166口至440731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
2024/02/27	3353425	3568228	+214803	+6.41%	5146.00	↑ +44.50
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	593976	+27094	1158175	+54154	-564199	-27060
資產管理	1340328	-9867	399655	-4742	+940673	-5125
槓桿基金	1107738	+128373	1548469	+144539	-440731	-16166
其他	211561	+68690	223245	+31773	-11684	+36917

週五收盤價與13週與52週平均線

— ES — 13週 4888.7 — 52週 4470.4



淨部位佔總OI% 經紀 -15.8% 資管 +26.4% 槓桿 -12.4% 其他 -0.3%

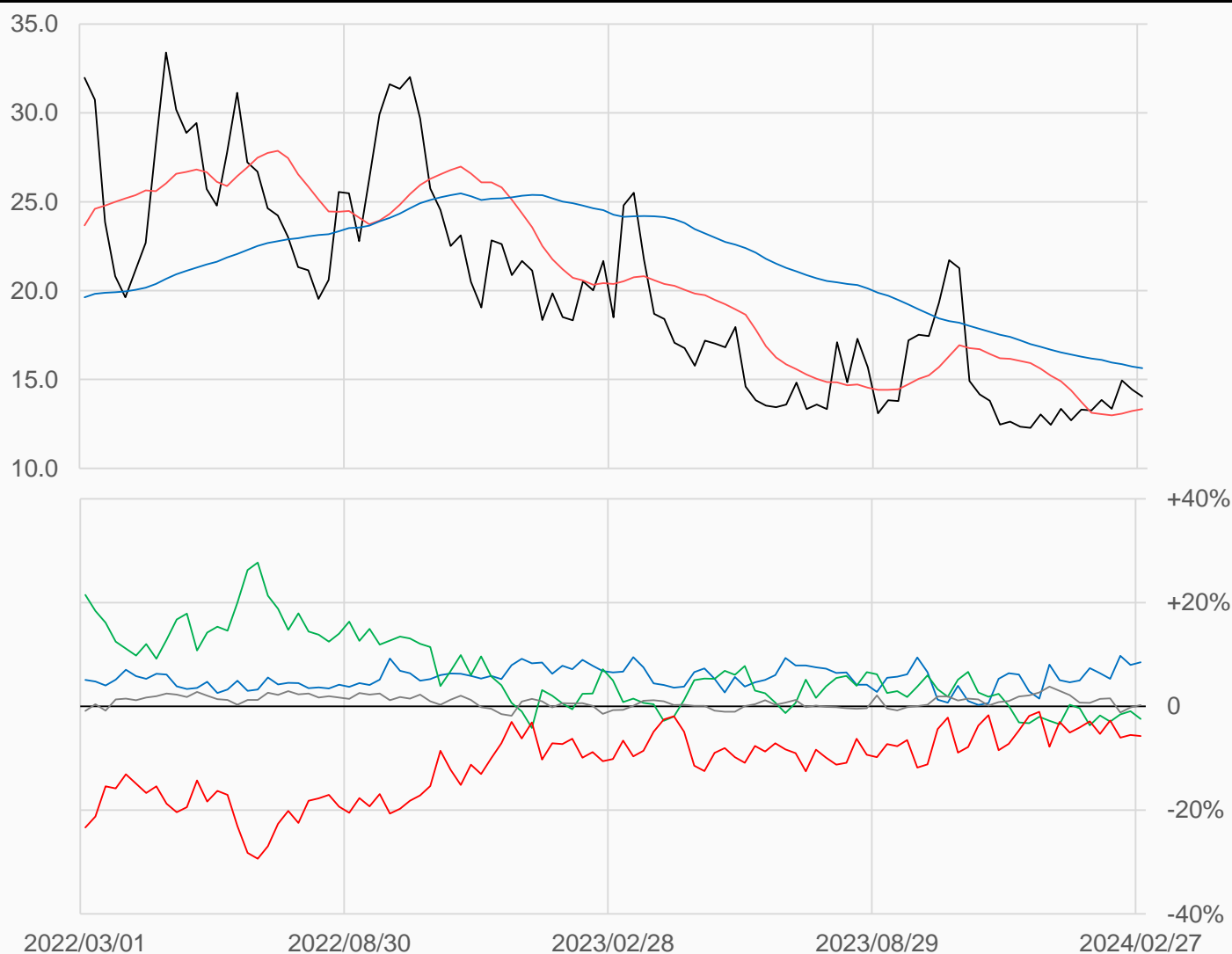
VIX

VIX較前一週下跌0.39點收在14.04點，
槓桿基金多單增加3167口，空單增加5098口，
淨空單較前一週增加1931口至20729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
2024/02/27	341280	361331	+20051	+5.88%	14.04	↓ -0.39
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	73166	+9439	42427	+5859	+30739	+3580
資產管理	119214	+3551	127987	+9177	-8773	-5626
槓桿基金	124917	+3167	145646	+5098	-20729	-1931
其他	17179	+2509	16200	+733	+979	+1776

週五收盤價與13週與52週平均線

— VX — 13週 13.334 — 52週 15.64



淨部位佔總OI% 經紀 +8.5% 資管 -2.4% 槓桿 -5.7% 其他 +0.3%

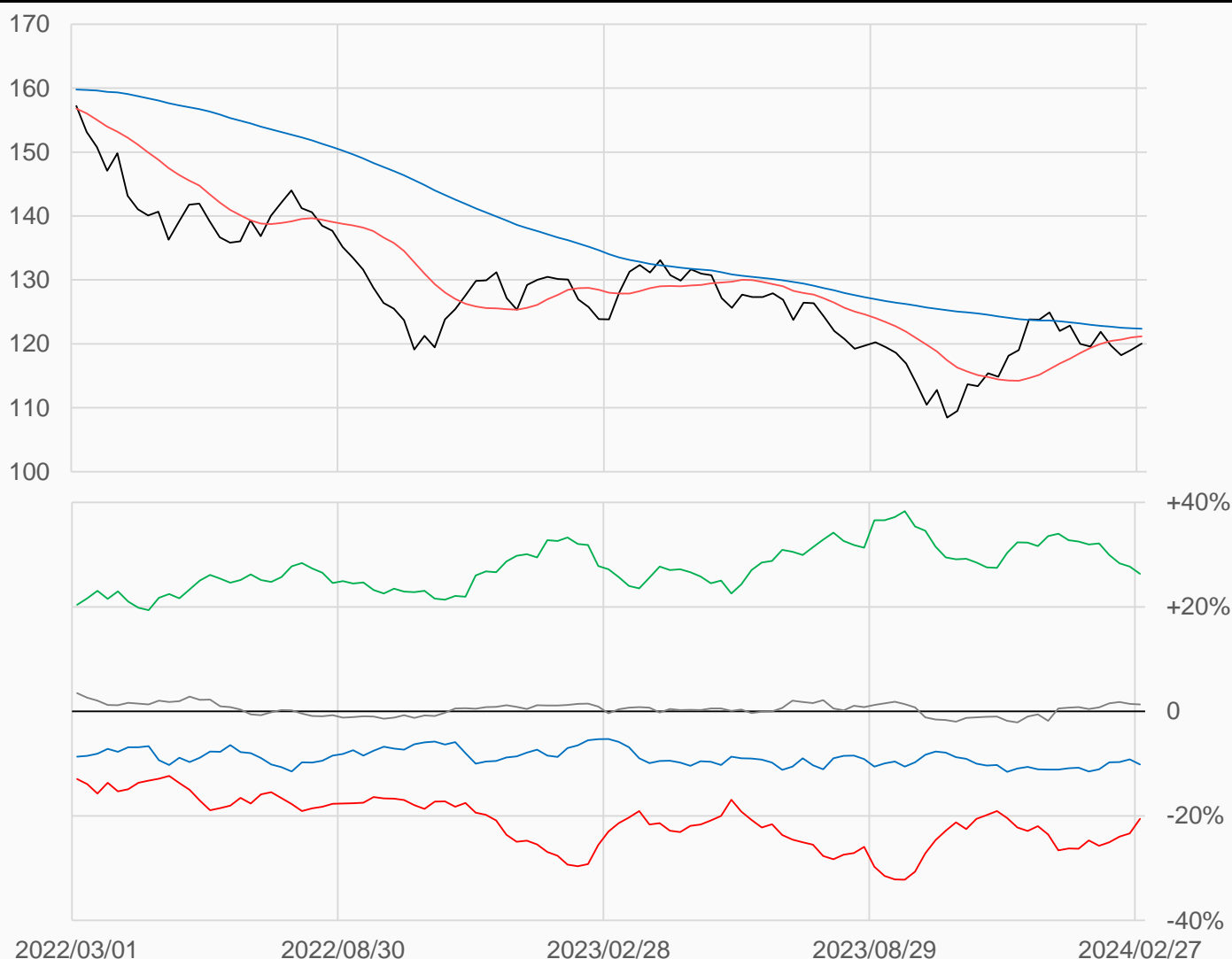
30年債

美國30年公債較前一週上漲0.9688點收在120.03125點，
 槓桿基金多單增加70261口，空單增加37446口，
 淨空單較前一週減少32815口至342596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
2024/02/27	1606189	1663991	+57802	+3.60%	120 1/32	↑ + 31/32
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	57031	-20306	226173	+961	-169142	-21267
資產管理	974202	+21439	535796	+28122	+438406	-6683
槓桿基金	303602	+70261	646198	+37446	-342596	+32815
其他	112295	-1508	90099	-438	+22196	-1070

週五收盤價與13週與52週平均線

— US — 13週 121.16 — 52週 122.37



淨部位佔總OI% 經紀 -10.2% 資管 +26.3% 槓桿 -20.6% 其他 +1.3%

10年債

美國10年公債較前一週上漲1.1563點收在111.03125點。

槓桿基金多單減少224661口，空單減少333746口。

淨空單較前一週減少109085口至1316223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
2024/02/27	5880805	5216932	-663873	-11.29%	111 2/64	↑ +1 10/64
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	276425	-184572	552587	-213446	-276162	+28874
資產管理	3016936	-195545	1847910	-69244	+1169026	-126301
槓桿基金	849472	-224661	2165695	-333746	-1316223	+109085
其他	616795	-57131	245931	-62877	+370864	+5746

週五收盤價與13週與52週平均線

— TY — 13週 111.31 — 52週 111.34



淨部位佔總OI% 經紀 -5.3% 資管 +22.4% 槓桿 -25.2% 其他 +7.1%

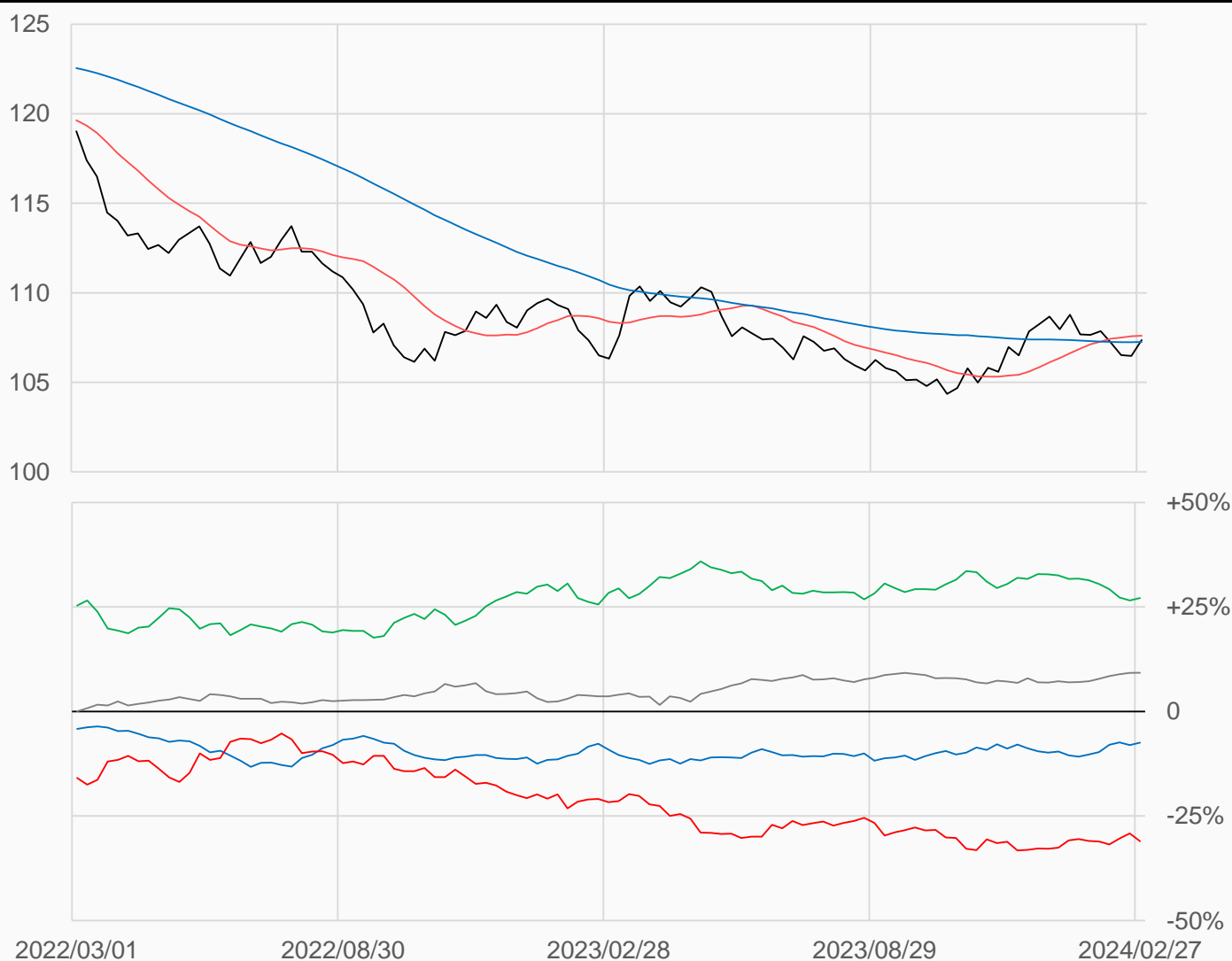
5年公債

美國5年公債較前一週上漲0.8906點收在107.3671875點，
 槓桿基金多單增加17688口，空單增加125107口，
 淨空單較前一週增加107419口至1961461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
2024/02/27	6361605	6315887	-45718	-0.72%	107 47/128	↑ + 114/128
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	275611	-19735	746780	-58328	-471169	+38593
資產管理	3720147	-48898	2005120	-74909	+1715027	+26011
槓桿基金	1213971	+17688	3175432	+125107	-1961461	-107419
其他	670343	-27549	84613	-24445	+585730	-3104

週五收盤價與13週與52週平均線

— FV — 13週 107.6 — 52週 107.26



淨部位佔總OI% 經紀 -7.5% 資管 +27.2% 槓桿 -31.1% 其他 +9.3%

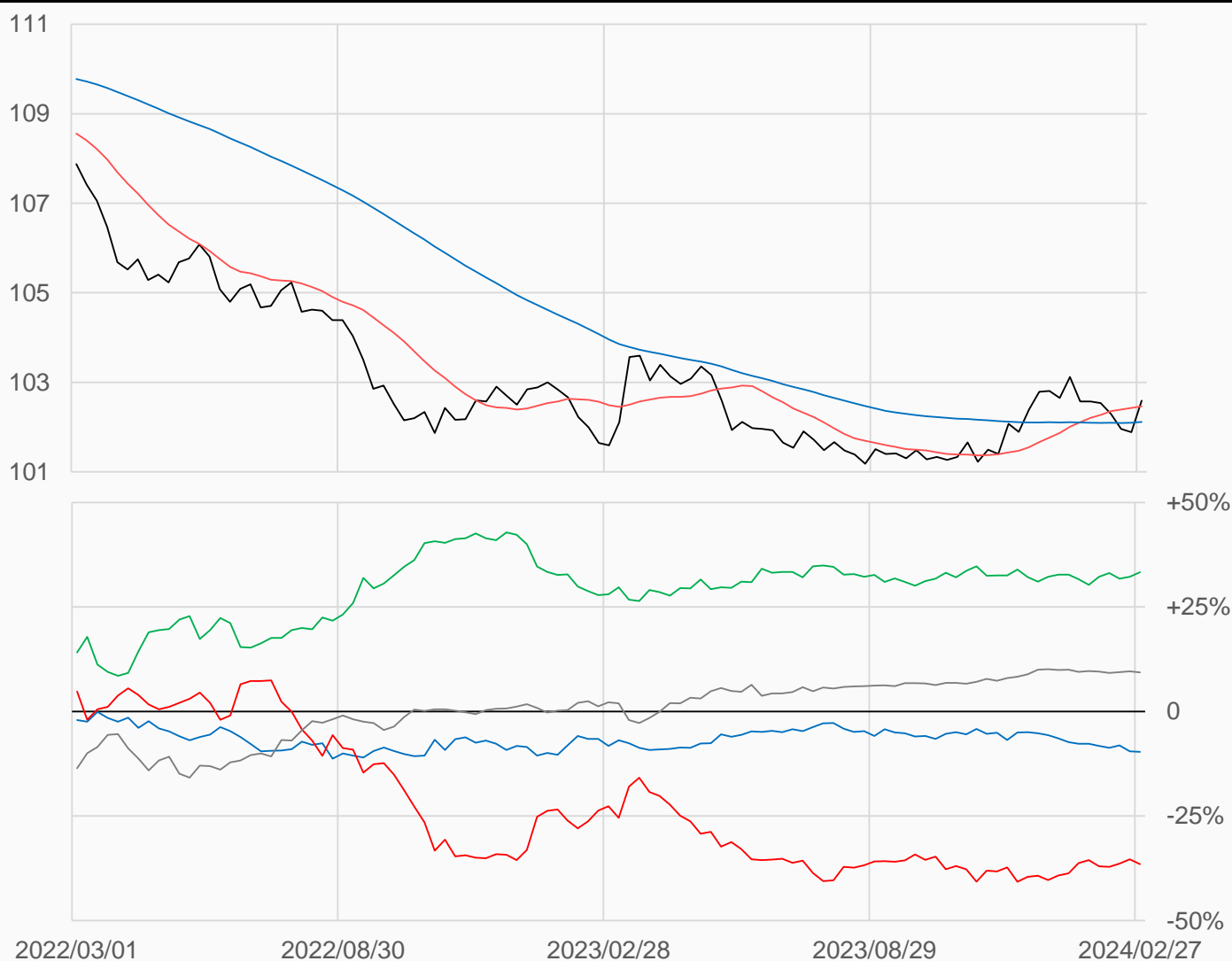
2年公債

美國2年公債較前一週上漲0.707點收在102.58984375點，
 槓桿基金多單減少192787口，空單減少254077口，
 淨空單較前一週減少61290口至1397398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
2024/02/27	4124430	3827809	-296621	-7.19%	102 76/128	↑ + 91/128
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	177260	+14019	547338	-9206	-370078	+23225
資產管理	2140382	-64880	865931	-10909	+1274451	-53971
槓桿基金	720221	-192787	2117619	-254077	-1397398	+61290
其他	520306	-52814	161864	-15708	+358442	-37106

週五收盤價與13週與52週平均線

— TU — 13週 102.47 — 52週 102.12



淨部位佔總OI% 經紀 -9.7% 資管 +33.3% 槓桿 -36.5% 其他 +9.4%

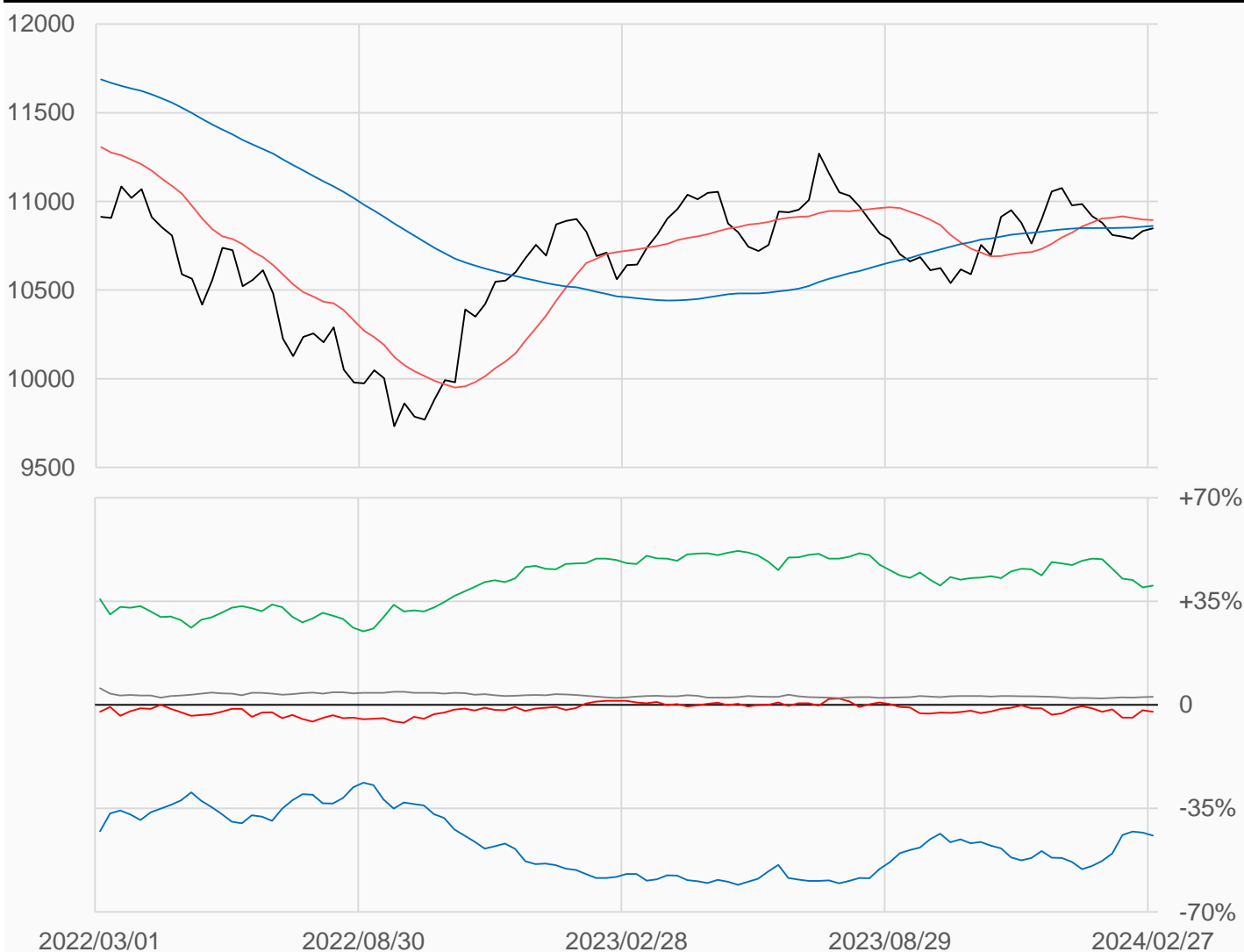
歐元

歐元較前一週上漲15點收在10848點，
 槓桿基金多單增加6067口，空單增加10132口，
 淨空單較前一週增加4065口至18550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
2024/02/27	807166	805768	-1398	-0.17%	10848.0	↑ +15.0
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	48705	-8740	404564	-1718	-355859	-7022
資產管理	494035	-2844	168901	-7737	+325134	+4893
槓桿基金	142329	+6067	160879	+10132	-18550	-4065
其他	37576	+1751	15709	+1264	+21867	+487

週五收盤價與13週與52週平均線

— EC — 13週 10895 — 52週 10862



淨部位佔總OI% 經紀 -44.2% 資管 +40.4% 槓桿 -2.3% 其他 +2.7%

日圓

日圓較前一週上漲8.5點收在6678.5點，
 槓桿基金多單減少4697口，空單增加15966口，
 淨空單較前一週增加20663口至83562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
2024/02/27	334668	342026	+7358	+2.20%	6678.5	↑ +8.5
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	141649	+5778	21913	+2193	+119736	+3585
資產管理	71351	+3757	125246	-6644	-53895	+10401
槓桿基金	63448	-4697	147010	+15966	-83562	-20663
其他	20000	+934	4265	-38	+15735	+972

週五收盤價與13週與52週平均線

— JY — 13週 6874.5 — 52週 7034.6



淨部位佔總OI% 經紀 +35.0% 資管 -15.8% 槓桿 -24.4% 其他 +4.6%

英鎊

英鎊較前一週下跌13點收在12664點，
 槓桿基金多單增加4277口，空單增加7902口，
 淨多單較前一週減少3625口至23924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
2024/02/27	227528	242921	+15393	+6.77%	12664	↓ -13
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	48238	+1835	41296	+6911	+6942	-5076
資產管理	68908	+8260	101571	+2567	-32663	+5693
槓桿基金	92703	+4277	68779	+7902	+23924	-3625
其他	1257	+5	3852	-459	-2595	+464

週五收盤價與13週與52週平均線

— BP — 13週 12678 — 52週 12541



淨部位佔總OI% 經紀 +2.9% 資管 -13.4% 槓桿 +9.8% 其他 -1.1%

瑞郎

瑞郎較前一週下跌34點收在11340點，
 槓桿基金多單增加3132口，空單增加1046口，
 淨空單較前一週減少2086口至1448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
2024/02/27	70755	75891	+5136	+7.26%	11340	↓ -34
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	26440	+2850	5861	-602	+20579	+3452
資產管理	17833	+323	27068	+3677	-9235	-3354
槓桿基金	21348	+3132	22796	+1046	-1448	+2086
其他	1891	+40	0	0	+1891	+40

週五收盤價與13週與52週平均線

— SF — 13週 11590 — 52週 11323



淨部位佔總OI% 經紀 +27.1% 資管 -12.2% 槓桿 -1.9% 其他 +2.5%

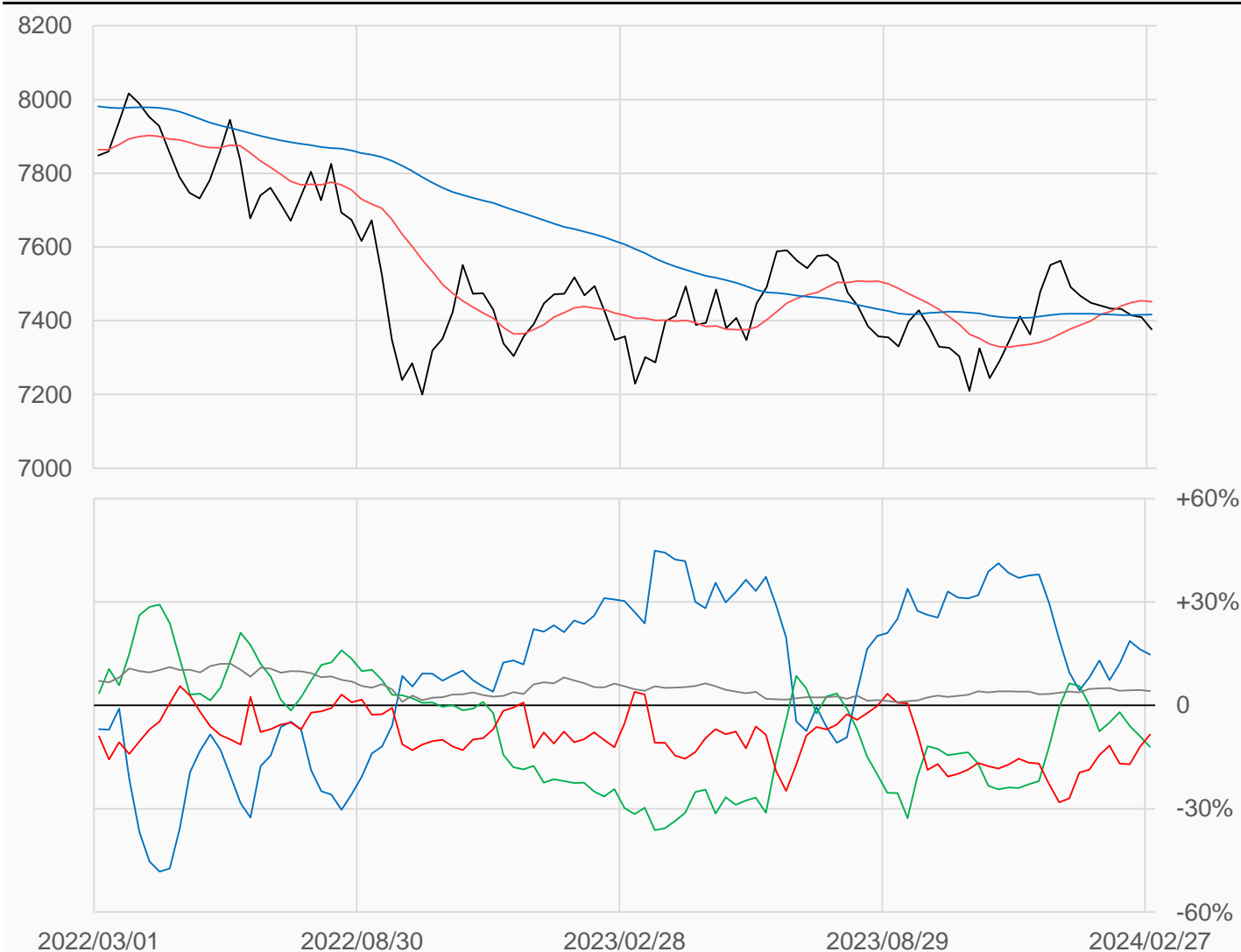
加幣

加幣較前一週下跌33點收在7376.5點，
 槓桿基金多單增加5051口，空單減少638口，
 淨空單較前一週減少5689口至15466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
2024/02/27	174395	182943	+8548	+4.90%	7376.5	↓ -33.0
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	56449	+1212	29471	+2597	+26978	-1385
資產管理	53076	+1062	75275	+7629	-22199	-6567
槓桿基金	30168	+5051	45634	-638	-15466	+5689
其他	11613	+743	3997	+815	+7616	-72

週五收盤價與13週與52週平均線

— CD — 13週 7451.4 — 52週 7416.9



淨部位佔總OI% 經紀 +14.7% 資管 -12.1% 槓桿 -8.5% 其他 +4.2%

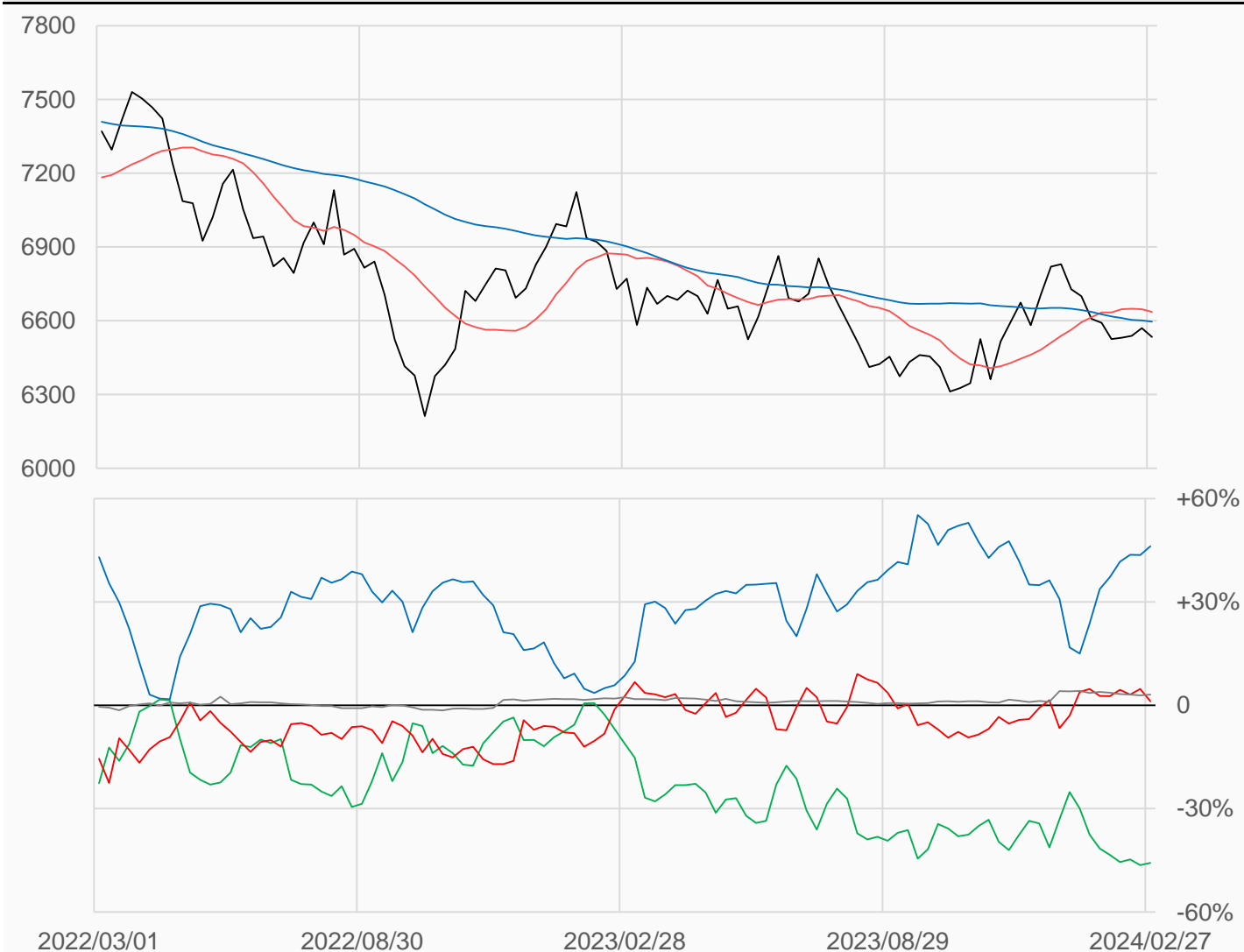
澳幣

澳幣較前一週下跌36點收在6534點，
 槓桿基金多單減少5966口，空單增加1865口，
 淨多單較前一週減少7831口至2496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
2024/02/27	217248	217369	+121	+0.06%	6534	↓ -36
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	104395	+5525	3953	-136	+100442	+5661
資產管理	38271	-79	137637	-1504	-99366	+1425
槓桿基金	46889	-5966	44393	+1865	+2496	-7831
其他	7291	+612	473	+7	+6818	+605

週五收盤價與13週與52週平均線

— AD — 13週 6636 — 52週 6596.4



淨部位佔總OI% 經紀 +46.2% 資管 -45.7% 槓桿 +1.1% 其他 +3.1%

紐幣

紐幣較前一週下跌0.009點收在0.6106點，
 槓桿基金多單減少1885口，空單增加3272口，
 淨多單較前一週減少5157口至2847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
2024/02/27	40954	48489	+7535	+18.40%	0.6106	↓ -0.0090
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	4765	+181	13295	+5886	-8530	-5705
資產管理	21968	+8527	19772	-235	+2196	+8762
槓桿基金	15617	-1885	12770	+3272	+2847	-5157
其他	1114	+271	0	-629	+1114	+900

週五收盤價與13週與52週平均線

— NE — 13週 0.6178 — 52週 0.6109



淨部位佔總OI% 經紀 -17.6% 資管 +4.5% 槓桿 +5.9% 其他 +2.3%

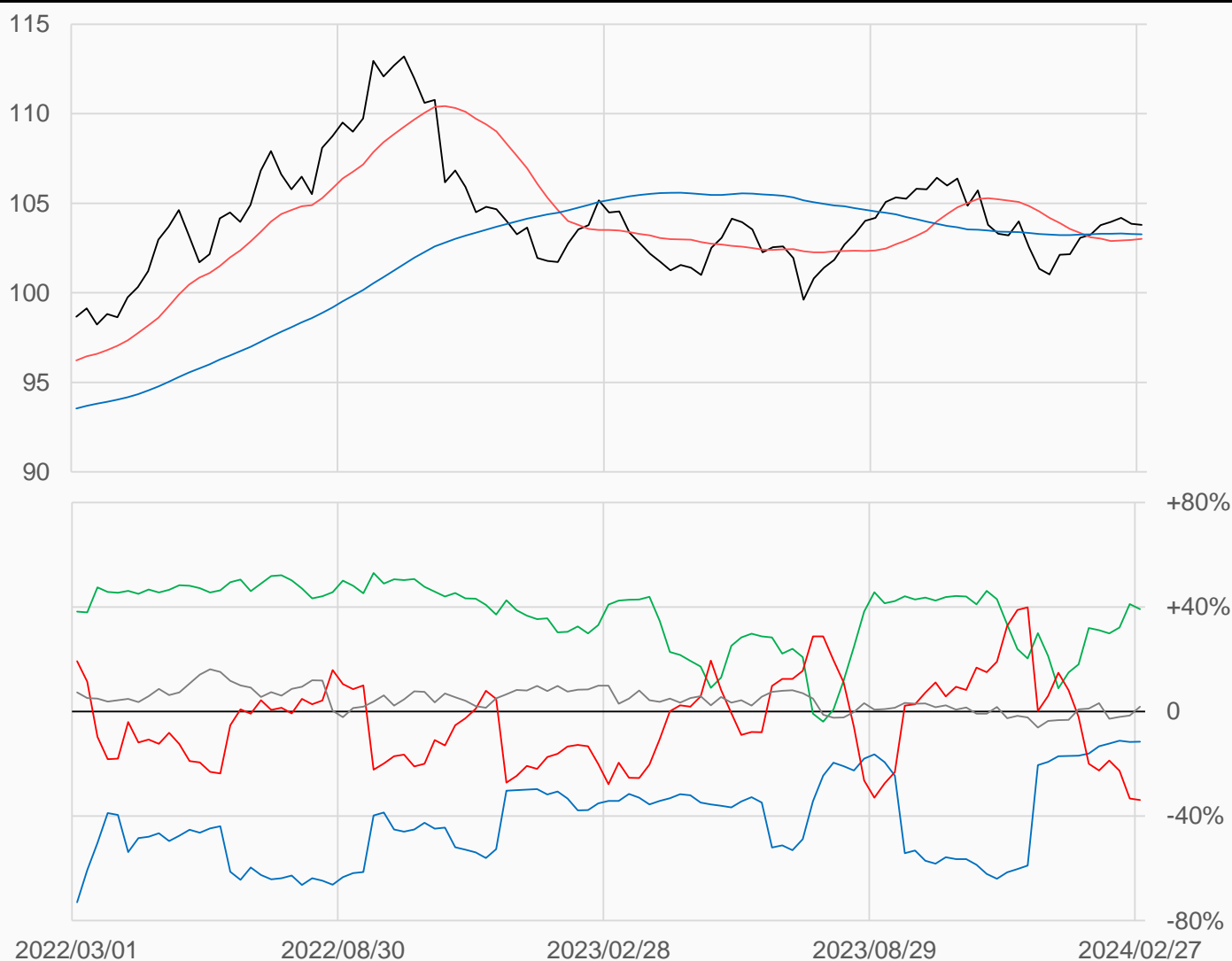
美元

美元較前一週下跌0.06點收在103.799點，
 槓桿基金多單減少169口，空單減少140口，
 淨空單較前一週增加29口至10021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
2024/02/27	30001	29591	-410	-1.37%	103.799	↓ -0.060
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	197	+82	3602	0	-3405	+82
資產管理	14228	-447	2630	+283	+11598	-730
槓桿基金	9570	-169	19591	-140	-10021	-29
其他	2178	+654	1617	-364	+561	+1018

週五收盤價與13週與52週平均線

— DX — 13週 103 — 52週 103.27



淨部位佔總OI% 經紀 -11.5% 資管 +39.2% 槓桿 -33.9% 其他 +1.9%

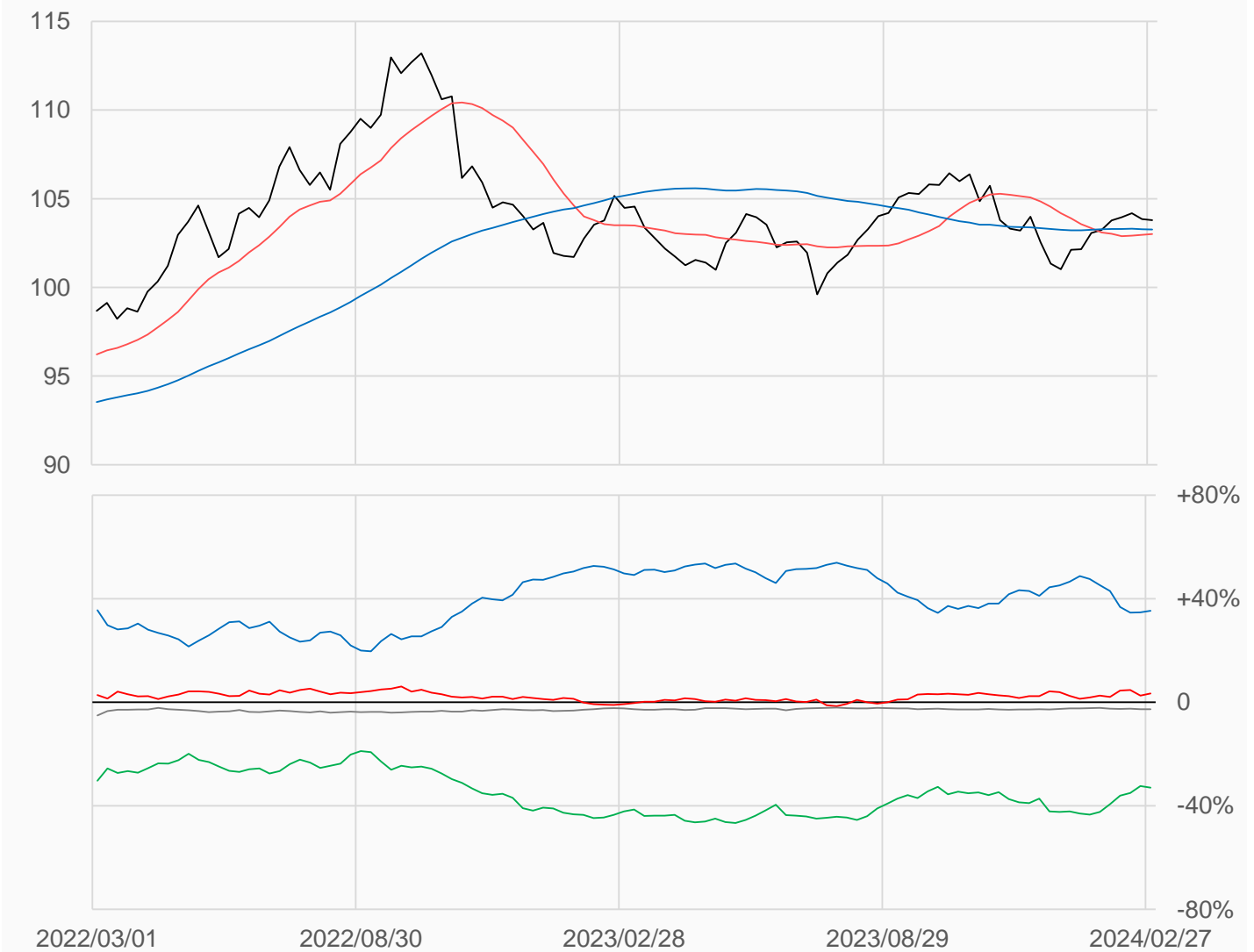
綜合美元 (不含美元)

綜合美元較前一週下跌0.06點收在103.799點，
槓桿基金多單增加16595口，空單增加7332口，
淨多單較前一週增加9263口至36940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
2024/02/27	1094861	1098260	+3399	+0.31%	103.799	↓ -0.060
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	495099.4	-309	106544	-8363	+388555	+8054
資產管理	257783.2	-9219	620522.4	-1219	-362739	-8000
槓桿基金	239881	+16595	202941.5	+7332	+36940	+9263
其他	20559.08	+1507	50570.74	+2379	-30012	-872

週五收盤價與13週與52週平均線

— DXY — 13週 103 — 52週 103.27



淨部位佔總OI% 經紀 +35.4% 資管 -33.0% 槓桿 +3.4% 其他 -2.7%

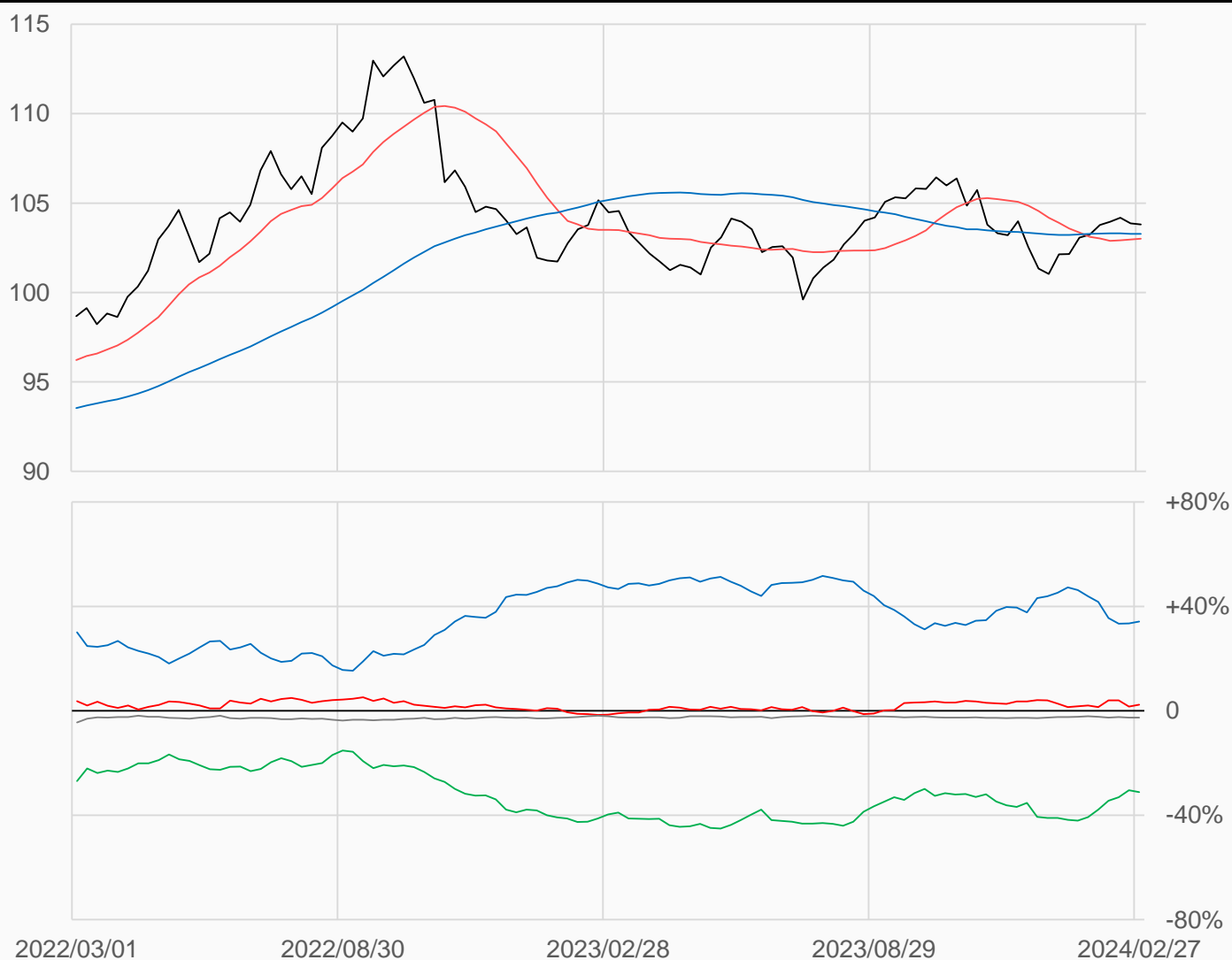
綜合美元 (含美元)

綜合美元較前一週下跌0.06點收在103.799點，
槓桿基金多單增加16426口，空單增加7192口，
淨多單較前一週增加9234口至26919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
2024/02/27	1124862	1127851	+2989	+0.27%	103.799	↓ -0.060
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	495296.4	-227	110146	-8363	+385150	+8136
資產管理	272011.2	-9666	623152.4	-936	-351141	-8730
槓桿基金	249451	+16426	222532.5	+7192	+26919	+9234
其他	22737.08	+2161	52187.74	+2015	-29451	+146

週五收盤價與13週與52週平均線

— DXX — 13週 103 — 52週 103.27



淨部位佔總OI% 經紀 +34.1% 資管 -31.1% 槓桿 +2.4% 其他 -2.6%

黃金

黃金較前一週上漲46.3點收在2095.7點，
管理基金多單增加2402口，空單減少1292口，
淨多單較前一週增加3694口至68042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
2024/02/27	567260	551918	-15342	-2.70%	2095.7	↑ +46.3
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	20308	+495	58540	+1577	-38232	-1082
互換交易	127746	-2193	249911	-3947	-122165	+1754
管理基金	167066	+2402	99024	-1292	+68042	+3694
其他	193195	-12966	117350	-10612	+75845	-2354

週五收盤價與13週與52週平均線

— GC — 13週 2039.6 — 52週 1974.5



淨部位佔總OI% 生產 -6.9% 互換 -22.1% 管理 +12.3% 其他 +13.7%

白銀

白銀較前一週上漲38.2點收在2336.4點，
 管理基金多單減少7142口，空單增加2364口，
 淨空單較前一週增加9506口至4143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
2024/02/27	172844	162469	-10375	-6.00%	2336.4	↑ +38.2
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	9771	+885	43225	-808	-33454	+1693
互換交易	44598	+893	41375	-2718	+3223	+3611
管理基金	41513	-7142	45656	+2364	-4143	-9506
其他	33647	-5117	17896	-6857	+15751	+1740

週五收盤價與13週與52週平均線

— SI — 13週 2321.4 — 52週 2350.6



淨部位佔總OI% 生產 -20.6% 互換 +2.0% 管理 -2.6% 其他 +9.7%

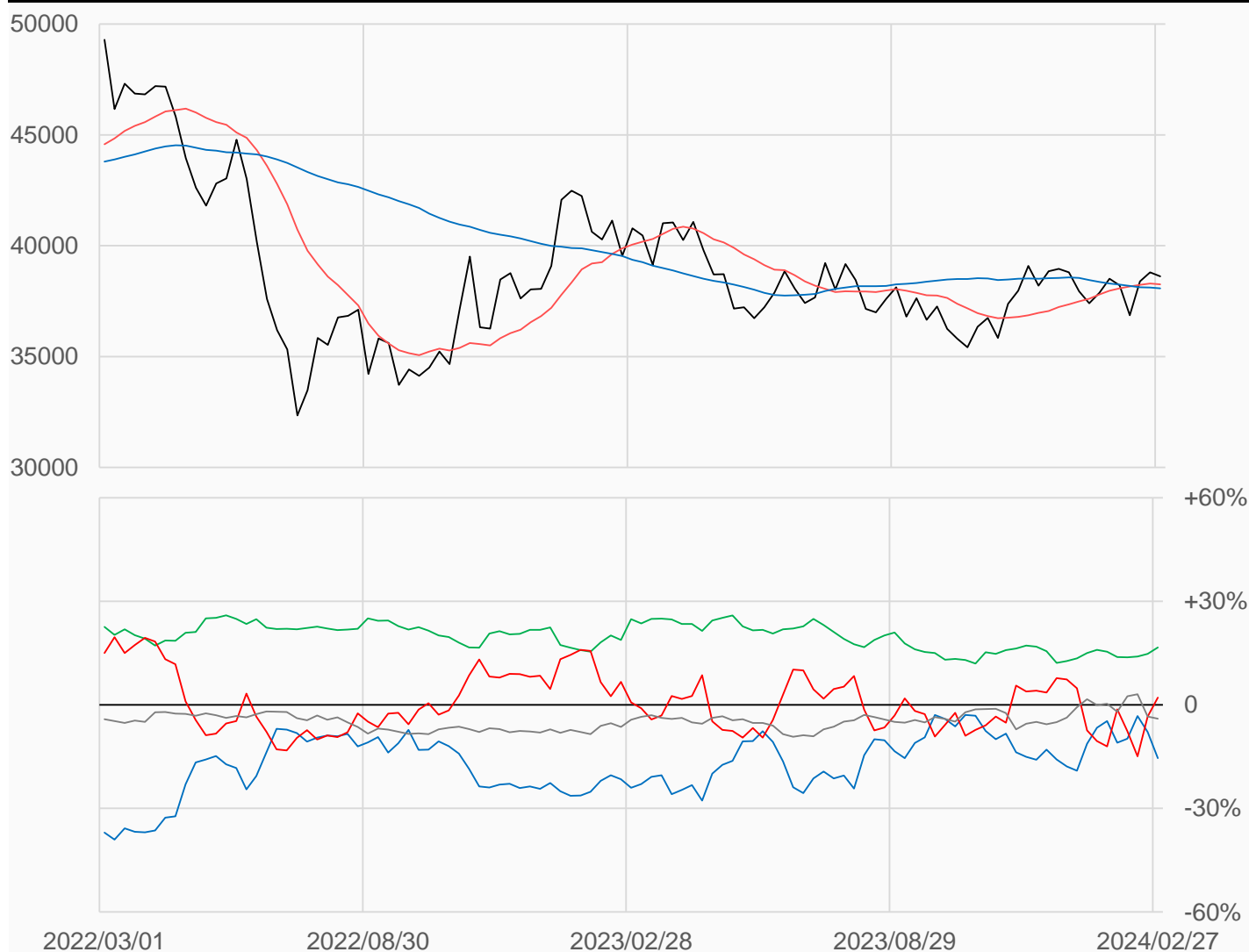
銅

銅較前一週下跌185點收在38615點，
 管理基金多單減少14852口，空單減少28026口，
 淨多單較前一週增加13174口至4367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
2024/02/27	258436	208274	-50162	-19.41%	38615	↓ -185
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	24335	-15677	56460	-3873	-32125	-11804
互換交易	51081	-5981	16457	-2339	+34624	-3642
管理基金	82589	-14852	78222	-28026	+4367	+13174
其他	32924	-13626	41322	-14067	-8398	+441

週五收盤價與13週與52週平均線

— HG — 13週 38262 — 52週 38072



淨部位佔總OI% 生產 -15.4% 互換 +16.6% 管理 +2.1% 其他 -4.0%

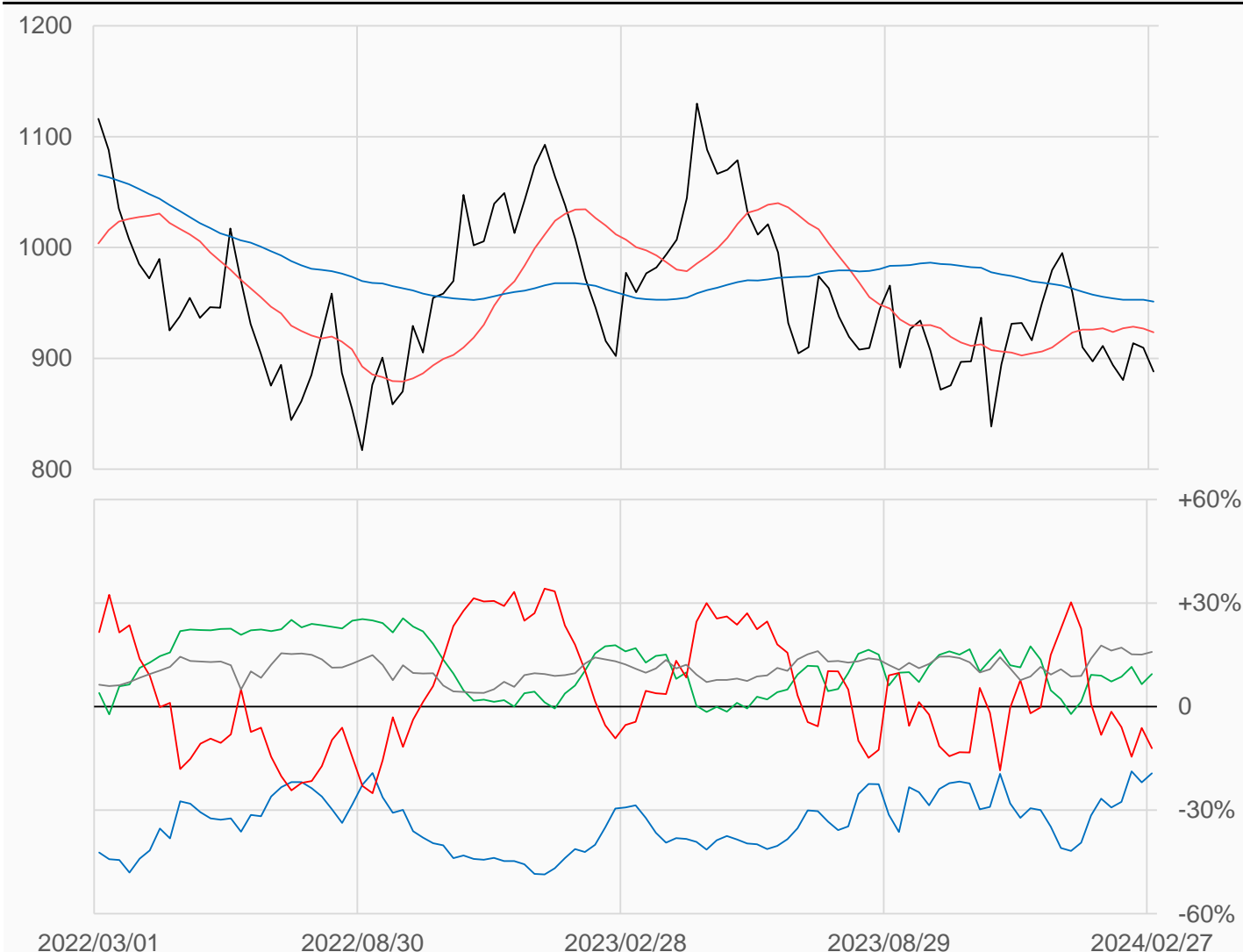
白金

白金較前一週下跌21.6點收在888點，
管理基金多單減少2627口，空單增加2908口，
淨空單較前一週增加5535口至11218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
2024/02/27	92492	92901	+409	+0.44%	888.0	↓ -21.6
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	4452	-895	22406	-3273	-17954	+2378
互換交易	18966	+1898	10189	-890	+8777	+2788
管理基金	38019	-2627	49237	+2908	-11218	-5535
其他	21864	+1753	7132	+1001	+14732	+752

週五收盤價與13週與52週平均線

— PL — 13週 923.38 — 52週 951.17



淨部位佔總OI% 生產 -19.3% 互換 +9.4% 管理 -12.1% 其他 +15.9%

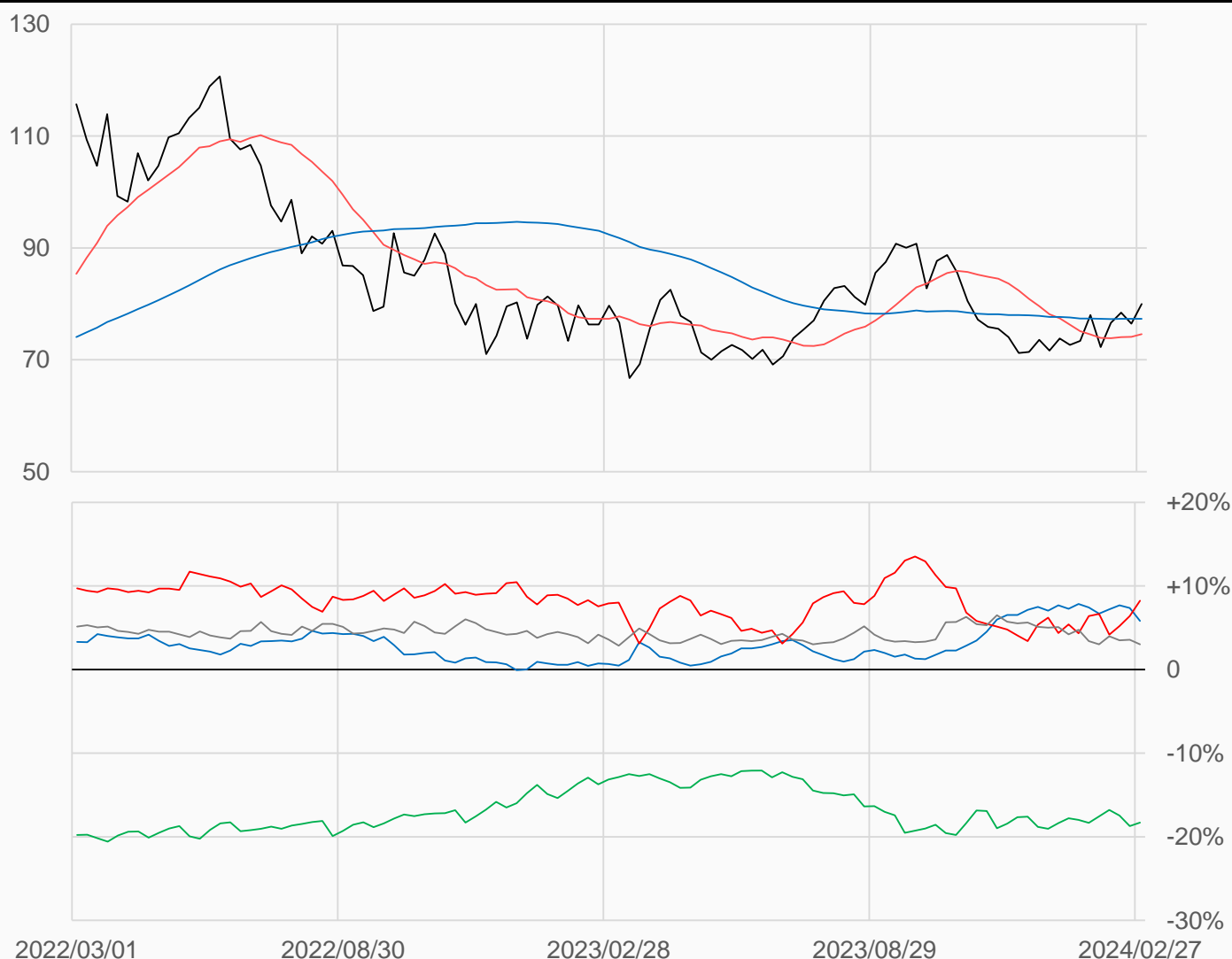
輕原油

輕原油較前一週上漲3.48點收在79.97點，
 管理基金多單增加46777口，空單增加6197口，
 淨多單較前一週增加40580口至174730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
2024/02/27	2098421	2118576	+20155	+0.96%	79.97	↑ +3.48
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	506377	-36977	382885	-5740	+123492	-31237
互換交易	212122	+6013	599626	+518	-387504	+5495
管理基金	727425	+46777	552695	+6197	+174730	+40580
其他	585187	+9226	521483	+20520	+63704	-11294

週五收盤價與13週與52週平均線

— CL — 13週 74.583 — 52週 77.337



淨部位佔總OI% 生產 +5.8% 互換 -18.3% 管理 +8.2% 其他 +3.0%

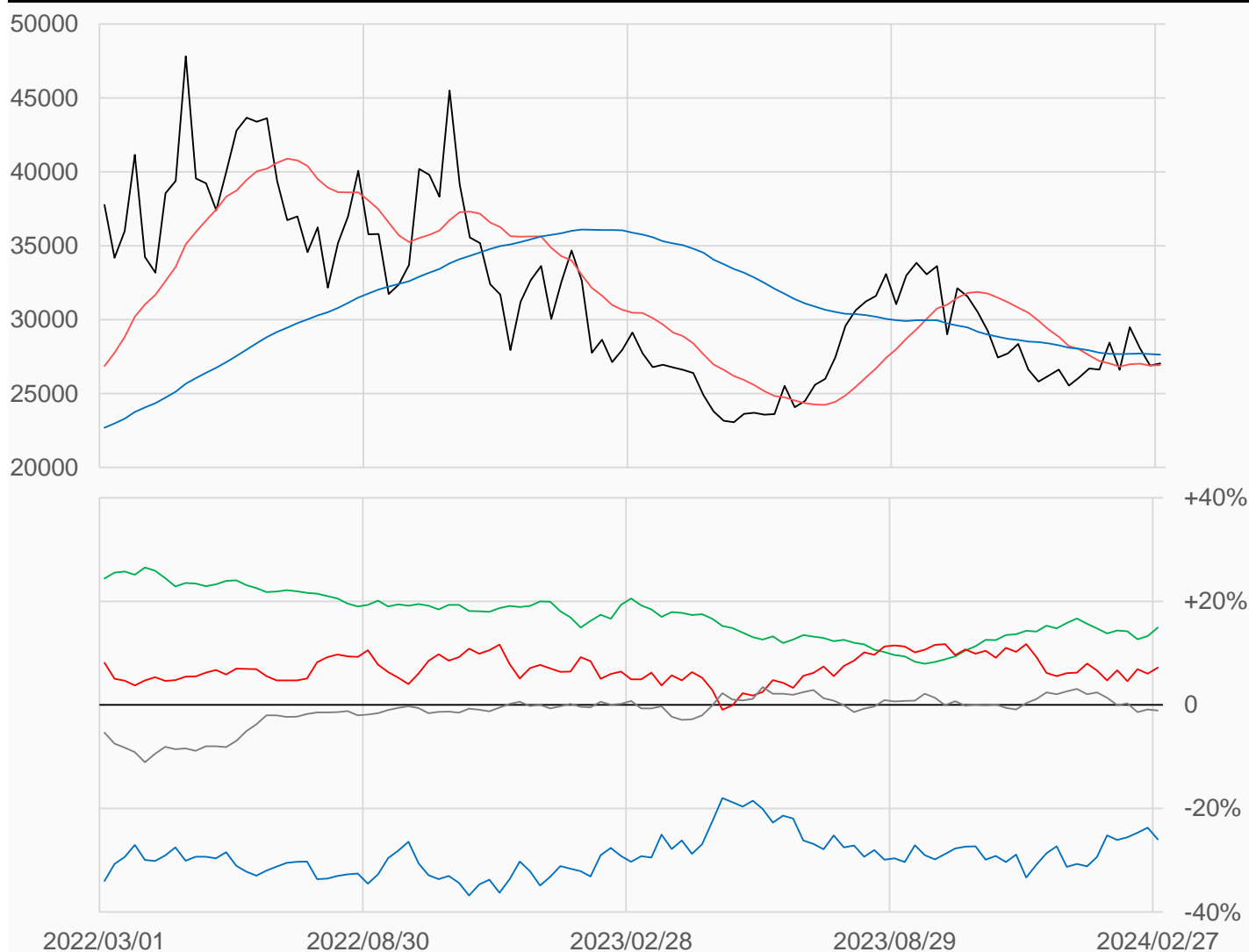
熱燃油

熱燃油較前一週上漲145點收在27042點，
 管理基金多單減少5182口，空單減少7158口，
 淨多單較前一週增加1976口至24347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
2024/02/27	371335	336906	-34429	-9.27%	27042	↑ +145
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	89116	-16967	176747	-17347	-87631	+380
互換交易	66441	-4947	16154	-5907	+50287	+960
管理基金	89116	-5182	64769	-7158	+24347	+1976
其他	44499	-5113	48243	-4644	-3744	-469

週五收盤價與13週與52週平均線

— HO — 13週 26929 — 52週 27635



淨部位佔總OI% 生產 -26.0% 互換 +14.9% 管理 +7.2% 其他 -1.1%

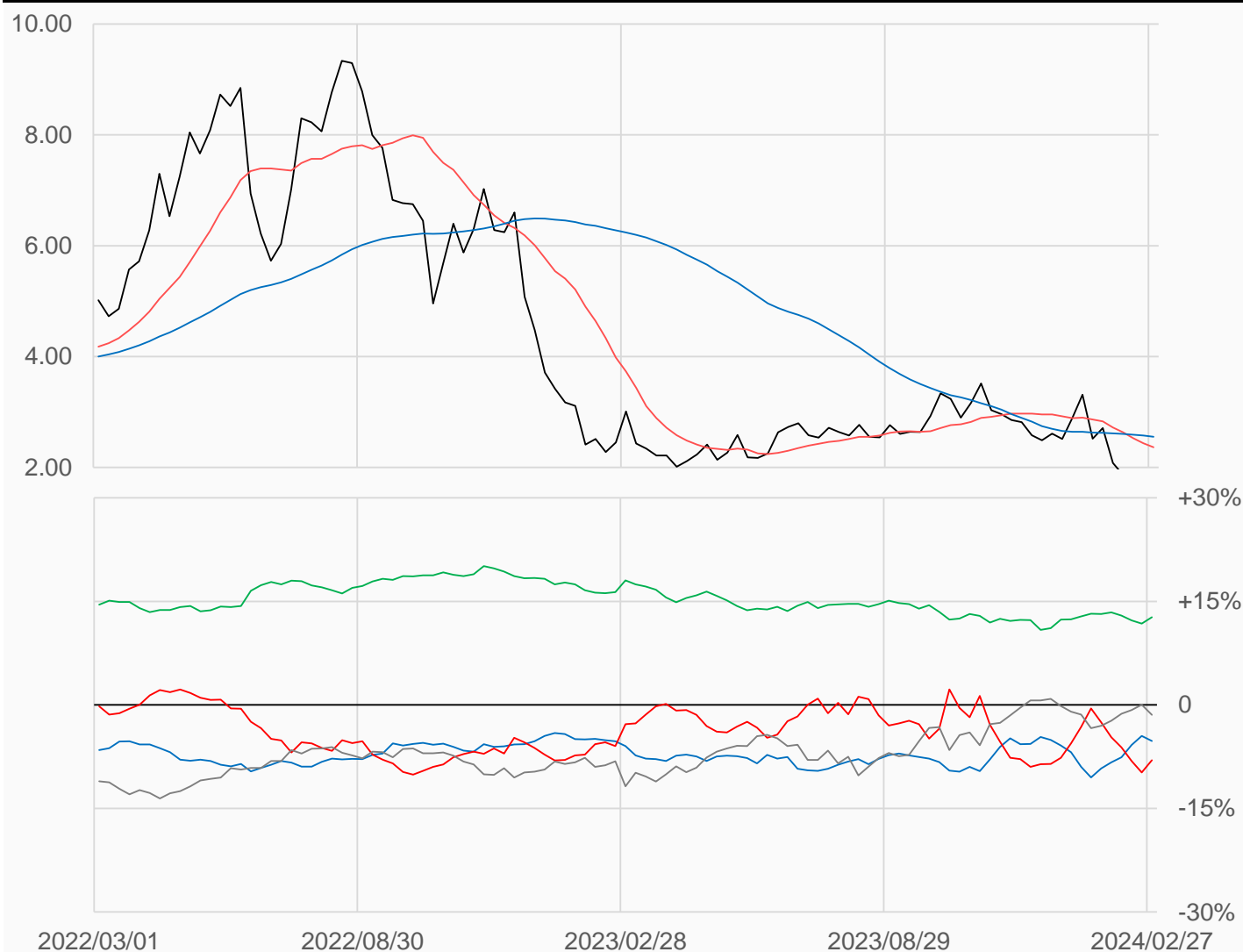
天然氣

天然氣較前一週上漲0.136點收在1.835點，
 管理基金多單減少35092口，空單減少72572口，
 淨空單較前一週減少37480口至121193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
2024/02/27	1621710	1513942	-107768	-6.65%	1.835	↑ +0.136
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	217990	-15286	297328	-9071	-79338	-6215
互換交易	328823	-8410	136671	-9531	+192152	+1121
管理基金	628049	-35092	749242	-72572	-121193	+37480
其他	266369	-37169	288474	-14543	-22105	-22626

週五收盤價與13週與52週平均線

— NG — 13週 2.3628 — 52週 2.5527



淨部位佔總OI% 生產 -5.2% 互換 +12.7% 管理 -8.0% 其他 -1.5%

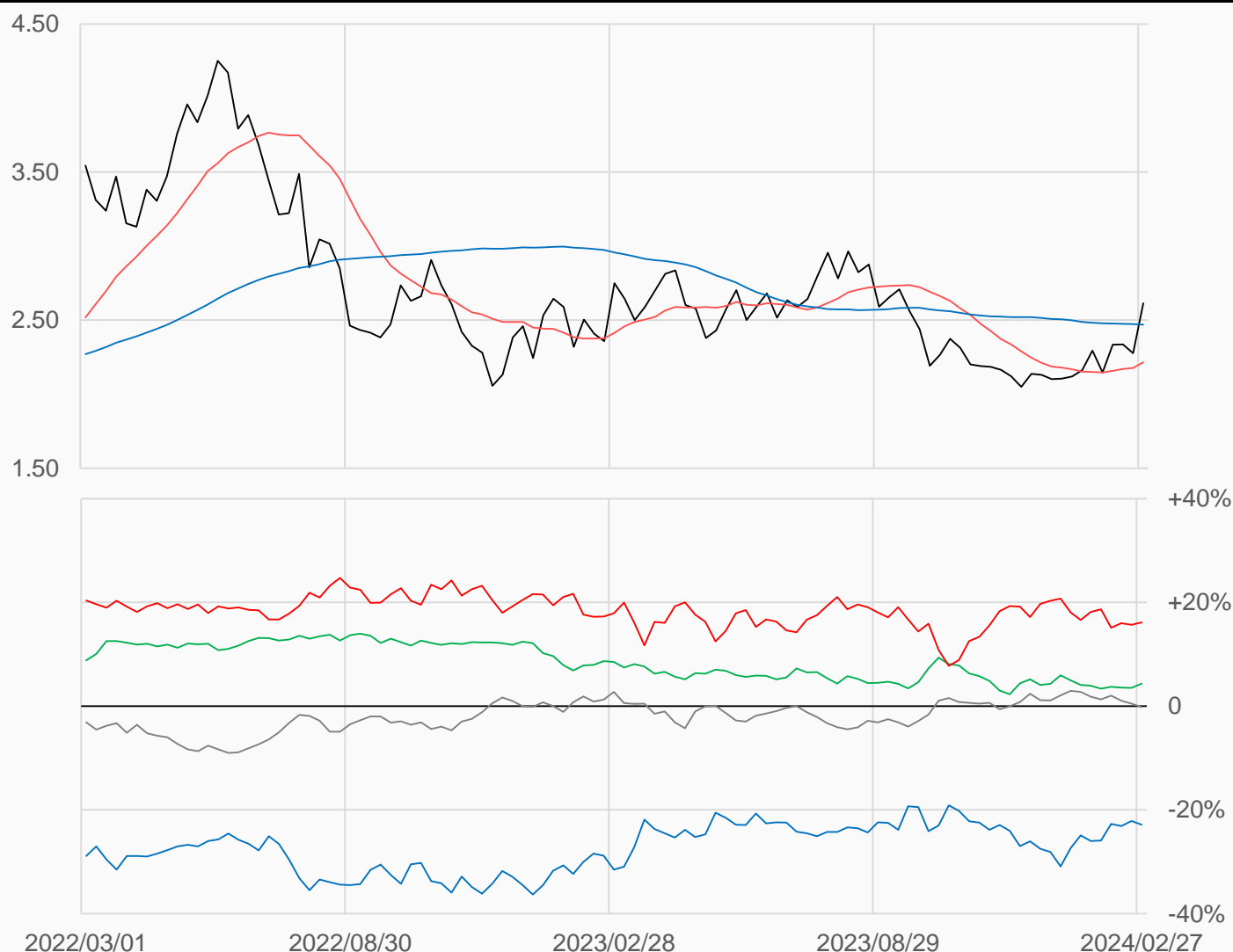
無鉛汽油

無鉛汽油較前一週上漲0.3377點收在2.6144點，
管理基金多單減少7377口，空單減少6955口，
淨多單較前一週減少422口至61003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
2024/02/27	391100	377998	-13102	-3.35%	2.6144	↑ +0.3377
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	130129	-700	216501	-948	-86372	+248
互換交易	57016	-226	40610	-2842	+16406	+2616
管理基金	125320	-7377	64317	-6955	+61003	-422
其他	41623	-4164	42250	-1677	-627	-2487

週五收盤價與13週與52週平均線

— RB — 13週 2.2163 — 52週 2.4709



淨部位佔總OI% 生產 -22.8% 互換 +4.3% 管理 +16.1% 其他 -0.2%

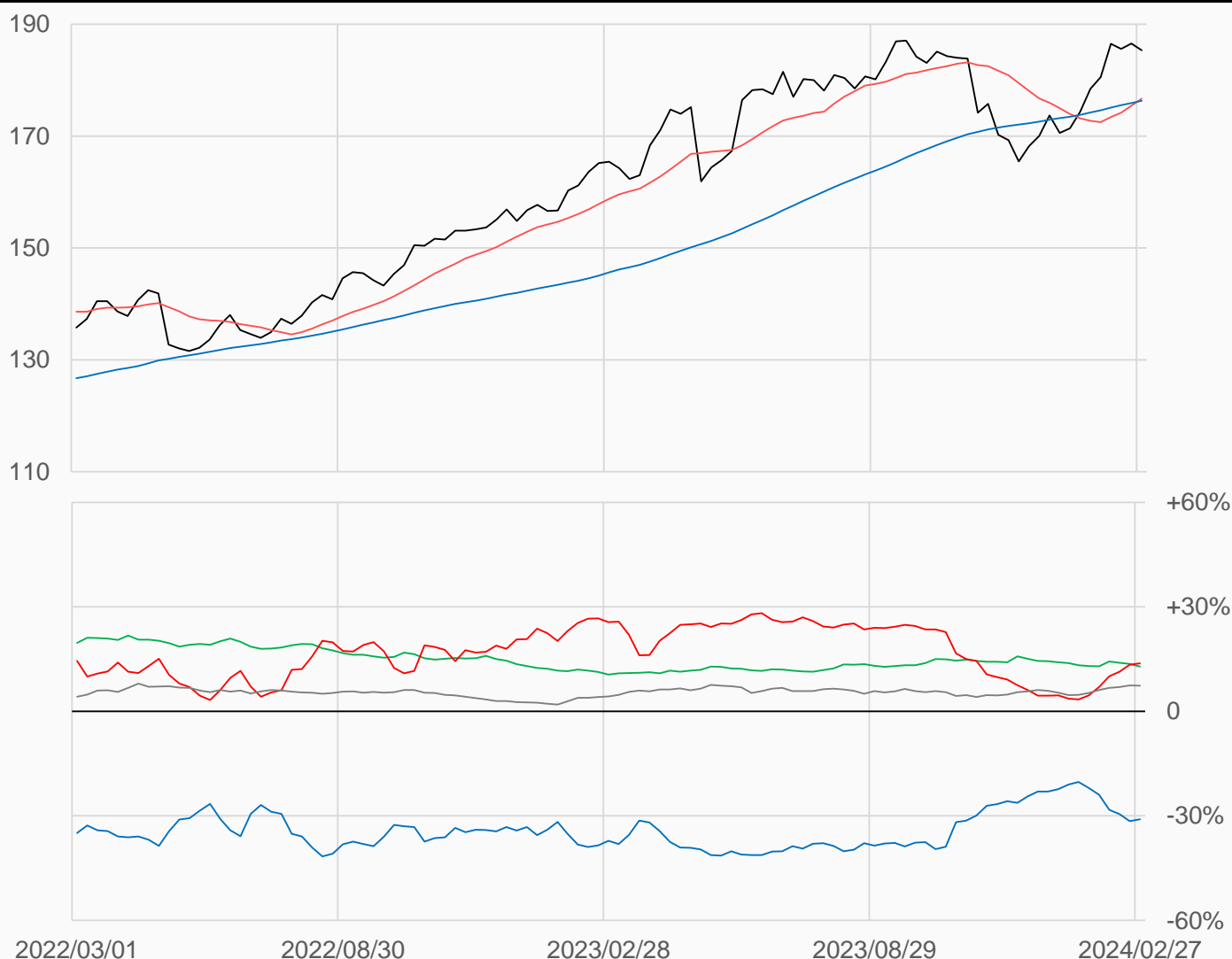
活牛

活牛較前一週下跌1.2點收在185.35點，
管理基金多單增加9647口，空單增加5359口，
淨多單較前一週增加4288口至54821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
2024/02/27	376767	396702	+19935	+5.29%	185.350	↓ -1.200
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	73185	+741	195951	+4613	-122766	-3872
互換交易	56903	+223	6012	+777	+50891	-554
管理基金	125283	+9647	70462	+5359	+54821	+4288
其他	106264	+9671	77201	+8524	+29063	+1147

週五收盤價與13週與52週平均線

— LC — 13週 176.67 — 52週 176.31



淨部位佔總OI% 生產 -30.9% 互換 +12.8% 管理 +13.8% 其他 +7.3%

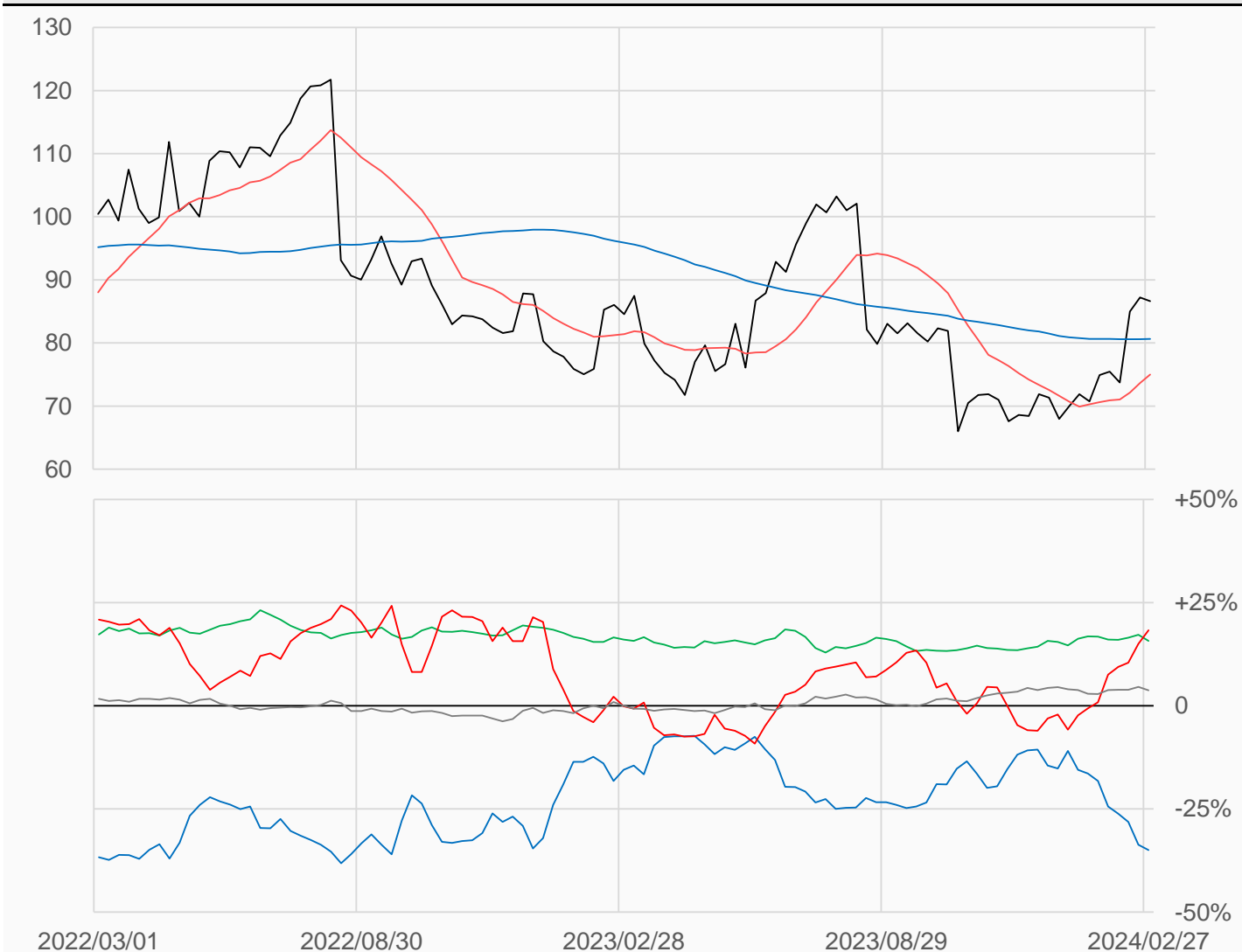
活豬

活豬較前一週下跌0.575點收在86.625點，
管理基金多單增加16056口，空單增加1165口，
淨多單較前一週增加14891口至63064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
2024/02/27	320544	344440	+23896	+7.45%	86.625	↓ -0.575
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	31803	+1898	152328	+14511	-120525	-12613
互換交易	69841	+1527	15569	+2384	+54272	-857
管理基金	116125	+16056	53061	+1165	+63064	+14891
其他	103233	+2491	90253	+4179	+12980	-1688

週五收盤價與13週與52週平均線

— LH — 13週 75.017 — 52週 80.655



淨部位佔總OI% 生產 -35.0% 互換 +15.8% 管理 +18.3% 其他 +3.8%

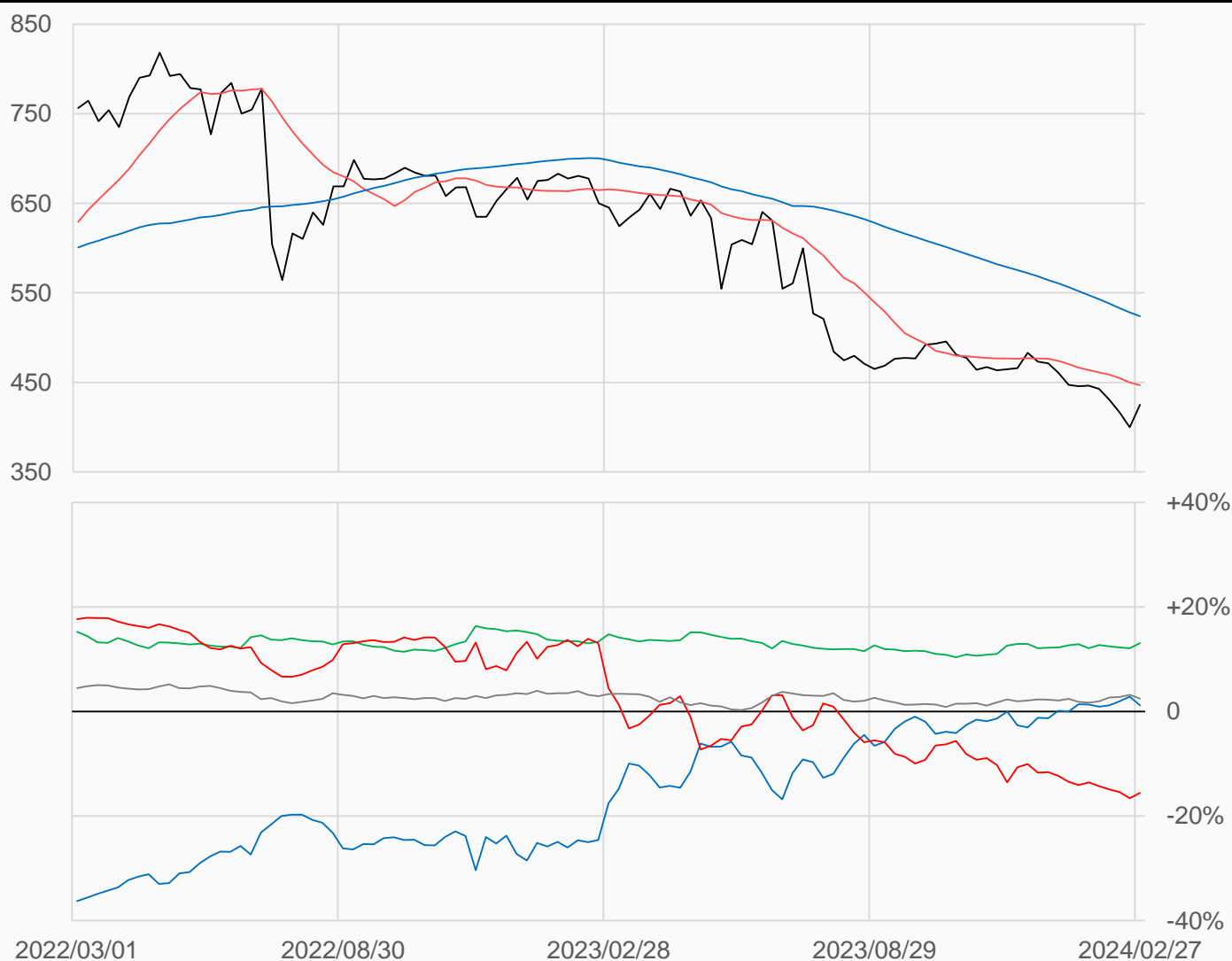
玉米

玉米較前一週上漲25點收在424.75點，
管理基金多單減少13101口，空單減少58575口，
淨空單較前一週減少45474口至295258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
2024/02/27	2053885	1896360	-157525	-7.67%	424.75	↑ +25.00
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	477254	-75756	455121	-39547	+22133	-36209
互換交易	295031	-8474	47227	-7848	+247804	-626
管理基金	473534	-13101	768792	-58575	-295258	+45474
其他	455062	-51789	407920	-32937	+47142	-18852

週五收盤價與13週與52週平均線

— ZC — 13週 446.67 — 52週 523.84



淨部位佔總OI% 生產 +1.2% 互換 +13.1% 管理 -15.6% 其他 +2.5%

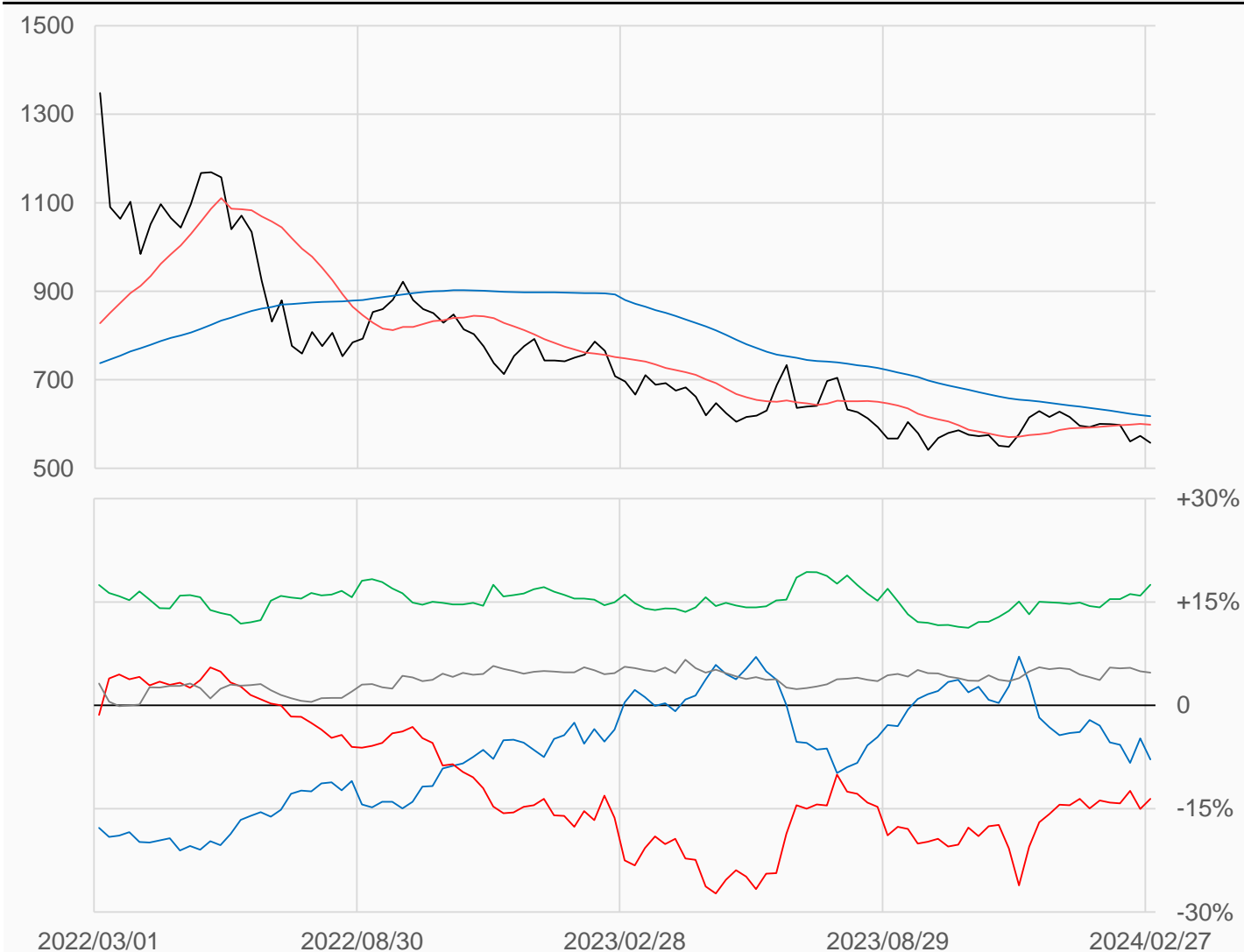
小麥

小麥較前一週下跌15.75點收在557.75點，
 管理基金多單減少6969口，空單減少19167口，
 淨空單較前一週減少12198口至56326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
2024/02/27	455296	414999	-40297	-8.85%	557.75	↓ -15.75
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	49302	-9361	81850	+1307	-32548	-10668
互換交易	96285	-2885	23611	-3082	+72674	+197
管理基金	152473	-6969	208799	-19167	-56326	+12198
其他	86218	-18218	66485	-15472	+19733	-2746

週五收盤價與13週與52週平均線

— ZW — 13週 598.71 — 52週 617.75



淨部位佔總OI% 生產 -7.8% 互換 +17.5% 管理 -13.6% 其他 +4.8%

黃豆

黃豆較前一週上漲18.25點收在1151.25點，
 管理基金多單減少27802口，空單減少3826口，
 淨空單較前一週增加23976口至160653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
2024/02/27	1037578	922159	-115419	-11.12%	1151.25	↑ +18.25
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	321786	-46606	256309	-75689	+65477	+29083
互換交易	156229	-4678	26154	-4531	+130075	-147
管理基金	158708	-27802	319361	-3826	-160653	-23976
其他	226267	-35510	247982	-30586	-21715	-4924

週五收盤價與13週與52週平均線

— ZS — 13週 1224.7 — 52週 1356.7



淨部位佔總OI% 生產 +7.1% 互換 +14.1% 管理 -17.4% 其他 -2.4%

黃豆油

黃豆油較前一週上漲1.14點收在45.16點，
管理基金多單減少10005口，空單減少10517口，
淨空單較前一週減少512口至52329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
2024/02/27	604371	558317	-46054	-7.62%	45.16	↑ +1.14
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	133279	-20320	206103	-25438	-72824	+5118
互換交易	130398	-4482	17920	-1360	+112478	-3122
管理基金	171331	-10005	223660	-10517	-52329	+512
其他	93634	-11519	83391	-8963	+10243	-2556

週五收盤價與13週與52週平均線

— BO — 13週 47.078 — 52週 55.005



淨部位佔總OI% 生產 -13.0% 互換 +20.1% 管理 -9.4% 其他 +1.8%

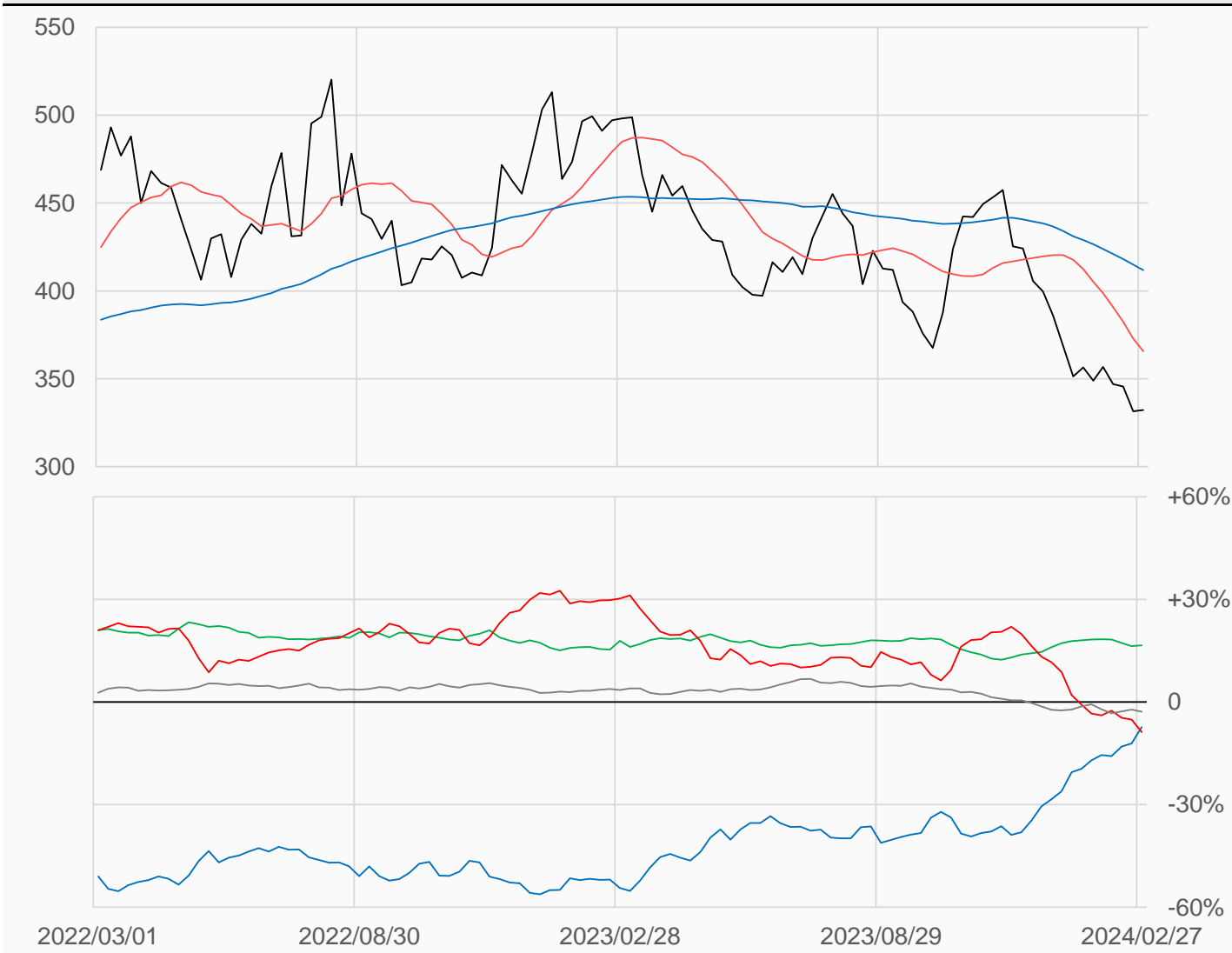
黃豆粉

黃豆粉較前一週上漲0.8點收在332.3點，
 管理基金多單減少14249口，空單增加2717口，
 淨空單較前一週增加16966口至47650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
2024/02/27	598616	540992	-57624	-9.63%	332.3	↑ +0.8
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	163561	-3031	203221	-35774	-39660	+32743
互換交易	102192	-6990	12769	+1563	+89423	-8553
管理基金	127229	-14249	174879	+2717	-47650	-16966
其他	97467	-30763	112965	-28546	-15498	-2217

週五收盤價與13週與52週平均線

— SM — 13週 365.69 — 52週 411.75



淨部位佔總OI% 生產 -7.3% 互換 +16.5% 管理 -8.8% 其他 -2.9%

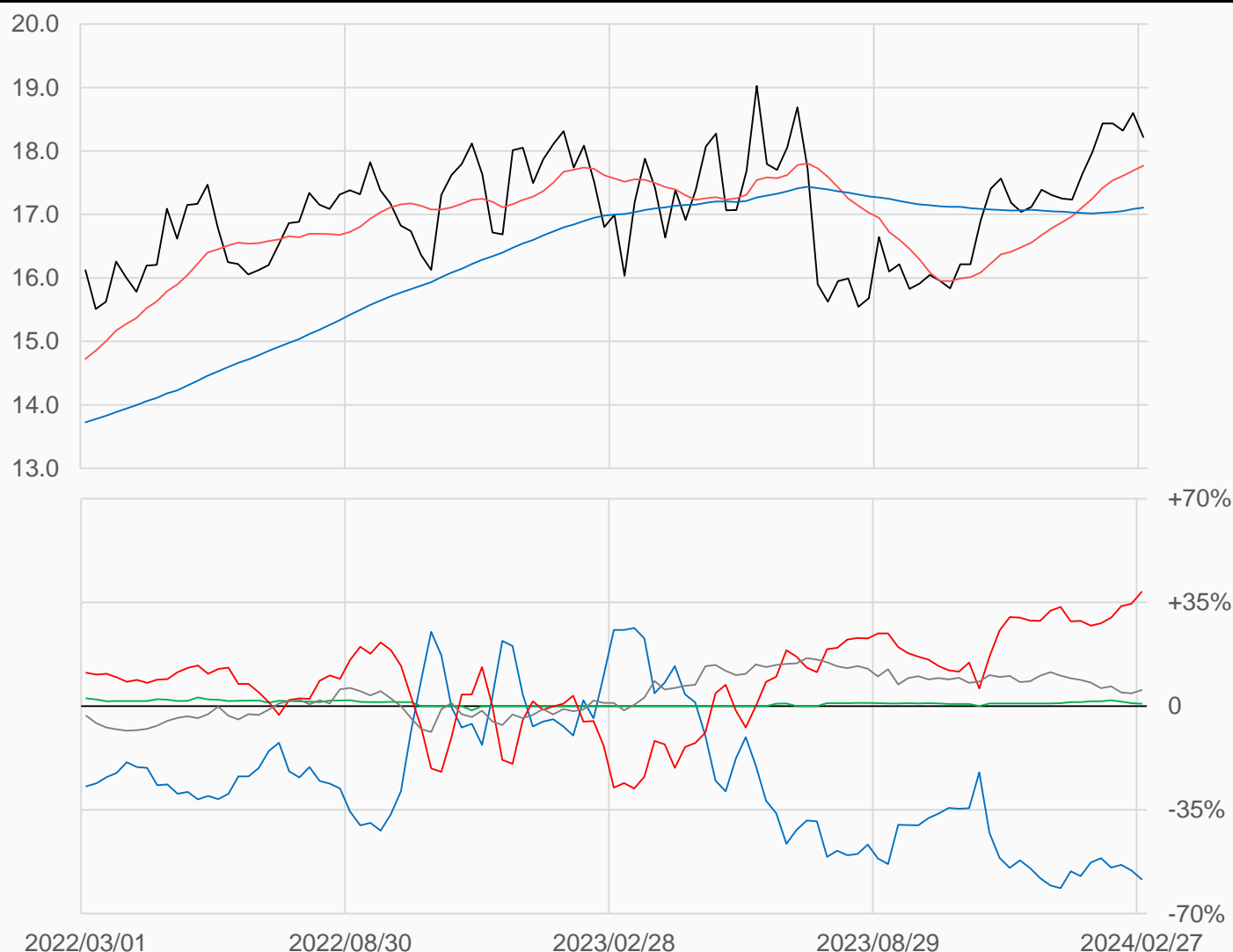
粗米

粗米較前一週下跌0.38點收在18.22點，
管理基金多單增加253口，空單減少214口，
淨多單較前一週增加467口至4888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
2024/02/27	12777	12674	-103	-0.81%	18.220	↓ -0.380
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	2572	+24	9977	+346	-7405	-322
互換交易	108	-53	0	-29	+108	-24
管理基金	5544	+253	656	-214	+4888	+467
其他	1718	+55	1029	-81	+689	+136

週五收盤價與13週與52週平均線

— RR — 13週 17.767 — 52週 17.109



淨部位佔總OI% 生產 -58.4% 互換 +0.9% 管理 +38.6% 其他 +5.4%

咖啡

咖啡較前一週上漲4.45點收在184.35點，
管理基金多單減少2351口，空單增加813口，
淨多單較前一週減少3164口至42665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
2024/02/27	235982	239537	+3555	+1.51%	184.35	↑ +4.45
分類	多單OI	增減	空單OI	增減	多空淨部位	淨部位變動
生產商	50589	+4644	107589	-5825	-57000	+10469
互換交易	39095	+408	32616	+7331	+6479	-6923
管理基金	93098	-2351	50433	+813	+42665	-3164
其他	49133	+909	41777	+1284	+7356	-375

週五收盤價與13週與52週平均線

— KC — 13週 188.57 — 52週 174.9



淨部位佔總OI% 生產 -23.8% 互換 +2.7% 管理 +17.8% 其他 +3.1%

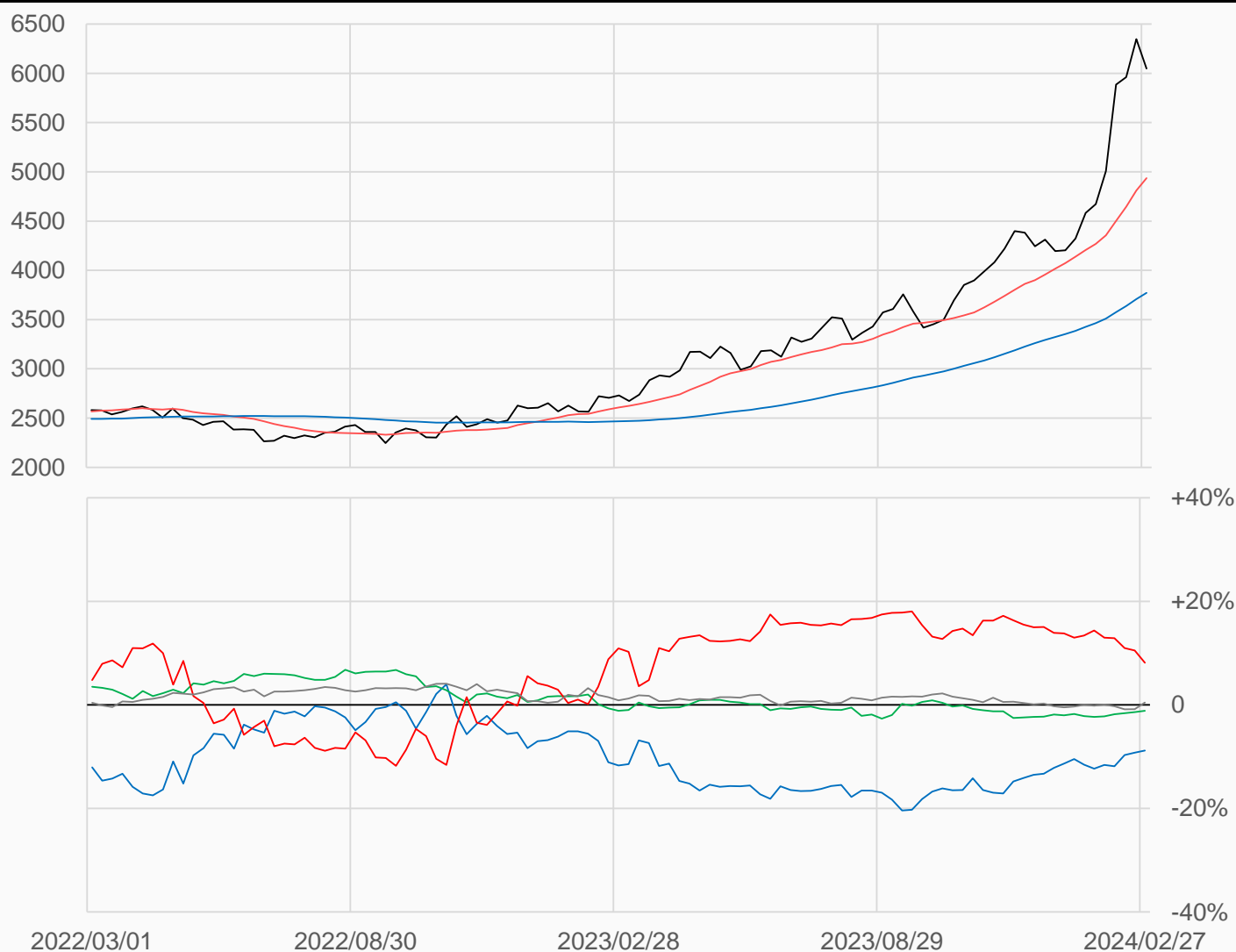
可可

可可較前一週下跌298點收在6049點，
管理基金多單減少12301口，空單減少1856口，
淨多單較前一週減少10445口至32328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
2024/02/27	407268	396177	-11091	-2.72%	6049	↓ -298
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	88989	-7008	124014	-9544	-35025	+2536
互換交易	21638	+451	26255	-707	-4617	+1158
管理基金	143871	-12301	111543	-1856	+32328	-10445
其他	126622	+8996	124792	+3713	+1830	+5283

週五收盤價與13週與52週平均線

— CC — 13週 4935.8 — 52週 3771.4



淨部位佔總OI% 生產 -8.8% 互換 -1.2% 管理 +8.2% 其他 +0.5%

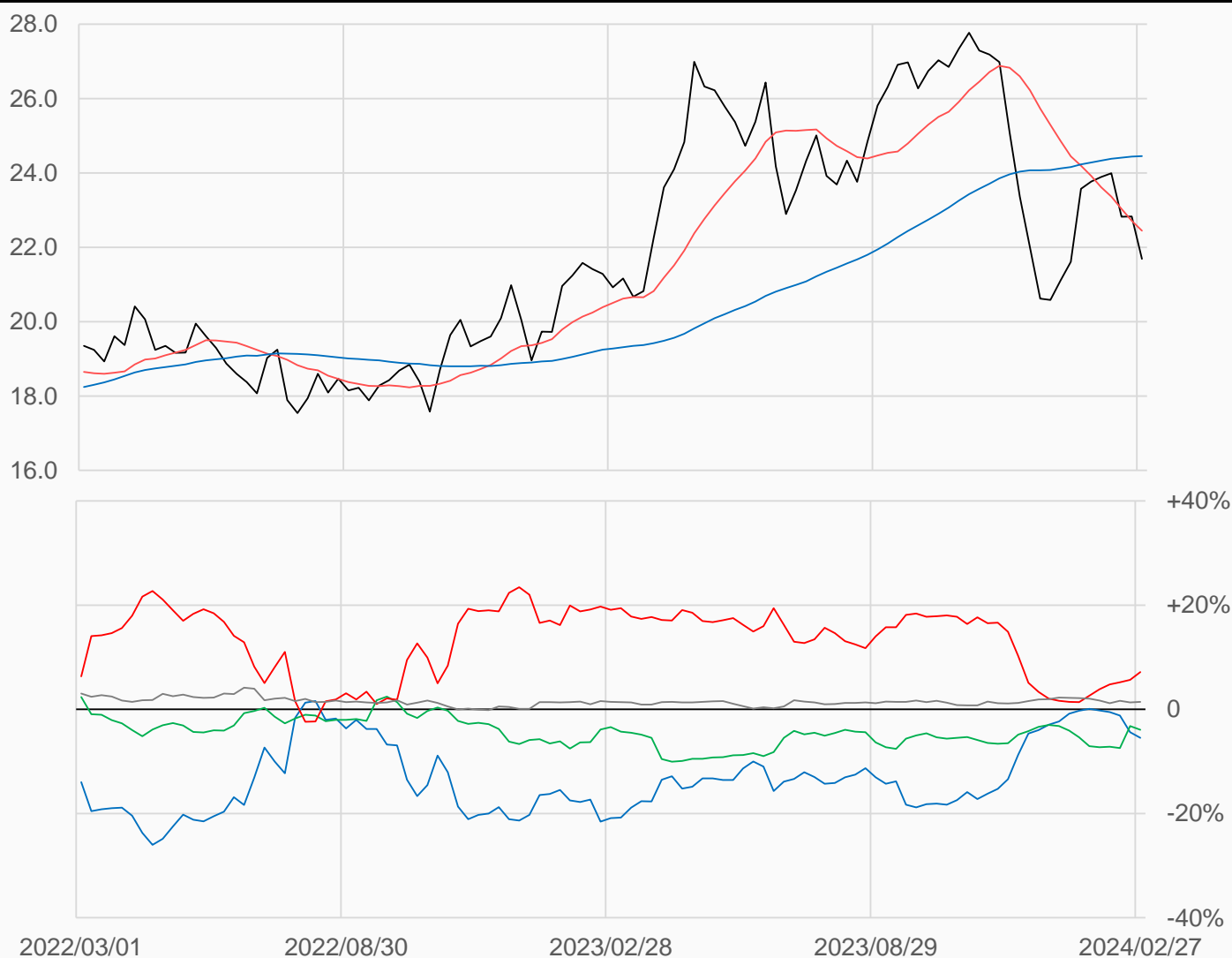
11號糖

11號糖較前一週下跌1.14點收在21.69點，
 管理基金多單增加18539口，空單增加4862口，
 淨多單較前一週增加13677口至70614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
2024/02/27	1007162	991472	-15690	-1.56%	21.69	↓ -1.14
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	331482	-24838	385792	-15030	-54310	-9808
互換交易	168372	-2315	207339	+4566	-38967	-6881
管理基金	247823	+18539	177209	+4862	+70614	+13677
其他	172251	-2927	158280	-3519	+13971	+592

週五收盤價與13週與52週平均線

— SB — 13週 22.448 — 52週 24.452



淨部位佔總OI% 生產 -5.5% 互換 -3.9% 管理 +7.1% 其他 +1.4%

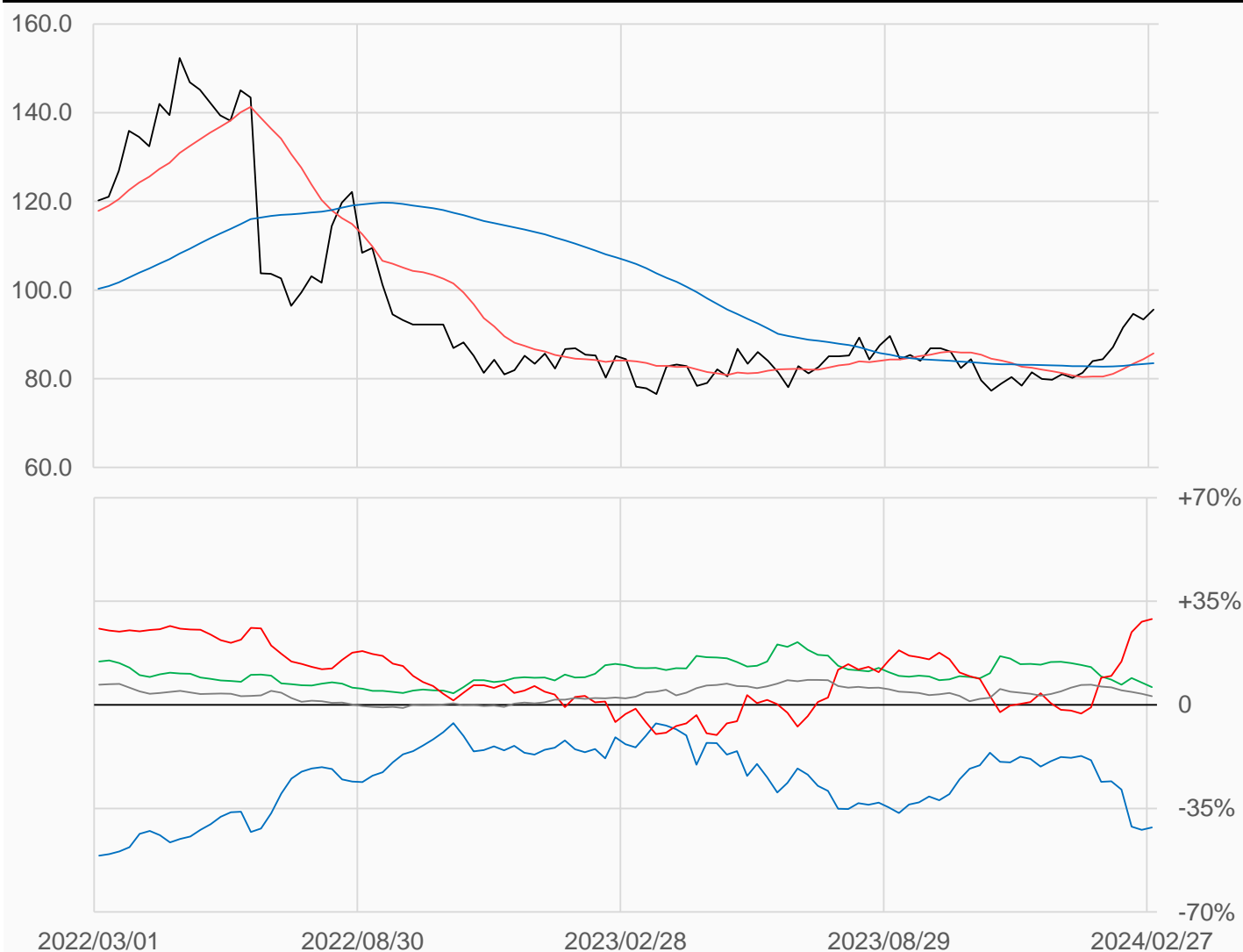
棉花

棉花較前一週上漲2.2點收在95.57點，
管理基金多單增加9626口，空單增加1667口，
淨多單較前一週增加7959口至94038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
2024/02/27	306043	324111	+18068	+5.90%	95.57	↑ +2.20
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	39199	-1558	173463	+3401	-134264	-4959
互換交易	62210	+352	42700	+3982	+19510	-3630
管理基金	134563	+9626	40525	+1667	+94038	+7959
其他	68610	+7870	59088	+9711	+9522	-1841

週五收盤價與13週與52週平均線

— CT — 13週 85.706 — 52週 83.524



淨部位佔總OI% 生產 -41.4% 互換 +6.0% 管理 +29.0% 其他 +2.9%