

# CFTC 大額交易人持倉報告

永豐期貨顧問事業部編製

2024/3/11

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 2024/03/05

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	99191	-4889	+6659	-2729	+6.71%
	VX	364498	+3167	-18218	+2511	-5.00%
	ES	3582734	+14506	-408627	+32104	-11.41%
	NQ	337041	+4958	-58331	-10301	-17.31%
債券	30年債	1639005	-24986	-359207	-16610	-21.92%
	10年債	4973909	-243023	-1169753	+146470	-23.52%
	5年債	6134781	-181106	-1936346	+25115	-31.56%
	2年債	3664001	-163808	-1432469	-35072	-39.10%
外匯	紐幣	50129	+1640	+6567	+3719	+13.10%
	英鎊	257168	+14247	+28185	+4261	+10.96%
	綜美(未含)	1094459	-1658	+32853	-4115	+3.00%
	綜美(含美)	1122939	-2769	+23947	-3000	+2.13%
	澳幣	249748	+32379	+3465	+969	+1.39%
	歐元	796532	-9236	-16332	+2218	-2.05%
	瑞郎	88241	+12350	-4916	-3468	-5.57%
	加幣	202874	+19931	-15829	-363	-7.80%
	日圓	355638	+13612	-78504	+5058	-22.07%
美元	28480	-1111	-8906	+1116	-31.27%	

# 金融類投機部位每週變動表

數據日期 2024/03/05

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	706068	+154151	+131060	+63018	+18.56%
	白銀	166332	+3863	+15530	+19673	+9.34%
	銅	217182	+8907	-8598	-12965	-3.96%
	白金	102395	+9494	-20048	-8829	-19.58%
能源	無鉛汽油	369388	-8610	+60034	-969	+16.25%
	輕原油	2098772	-19804	+183960	+9231	+8.77%
	熱燃油	317365	-19541	+16952	-7395	+5.34%
	天然氣	1549154	+35213	-106708	+14485	-6.89%
肉類	活豬	361151	+16711	+65090	+2026	+18.02%
	活牛	408092	+11390	+59364	+4543	+14.55%
農產	粗米	12633	-42	+4500	-388	+35.62%
	黃豆粉	540921	-71	-49526	-1876	-9.16%
	黃豆油	582934	+24617	-62473	-10145	-10.72%
	小麥	451756	+36757	-65539	-9213	-14.51%
	玉米	1914649	+18290	-296795	-1537	-15.50%
	黃豆	927931	+5773	-171999	-11346	-18.54%
軟性	棉花	323096	-1015	+96361	+2324	+29.82%
	咖啡	247549	+8012	+43362	+697	+17.52%
	可可	369829	-26348	+31965	-363	+8.64%
	11號糖	1018600	+27128	+45545	-25069	+4.47%

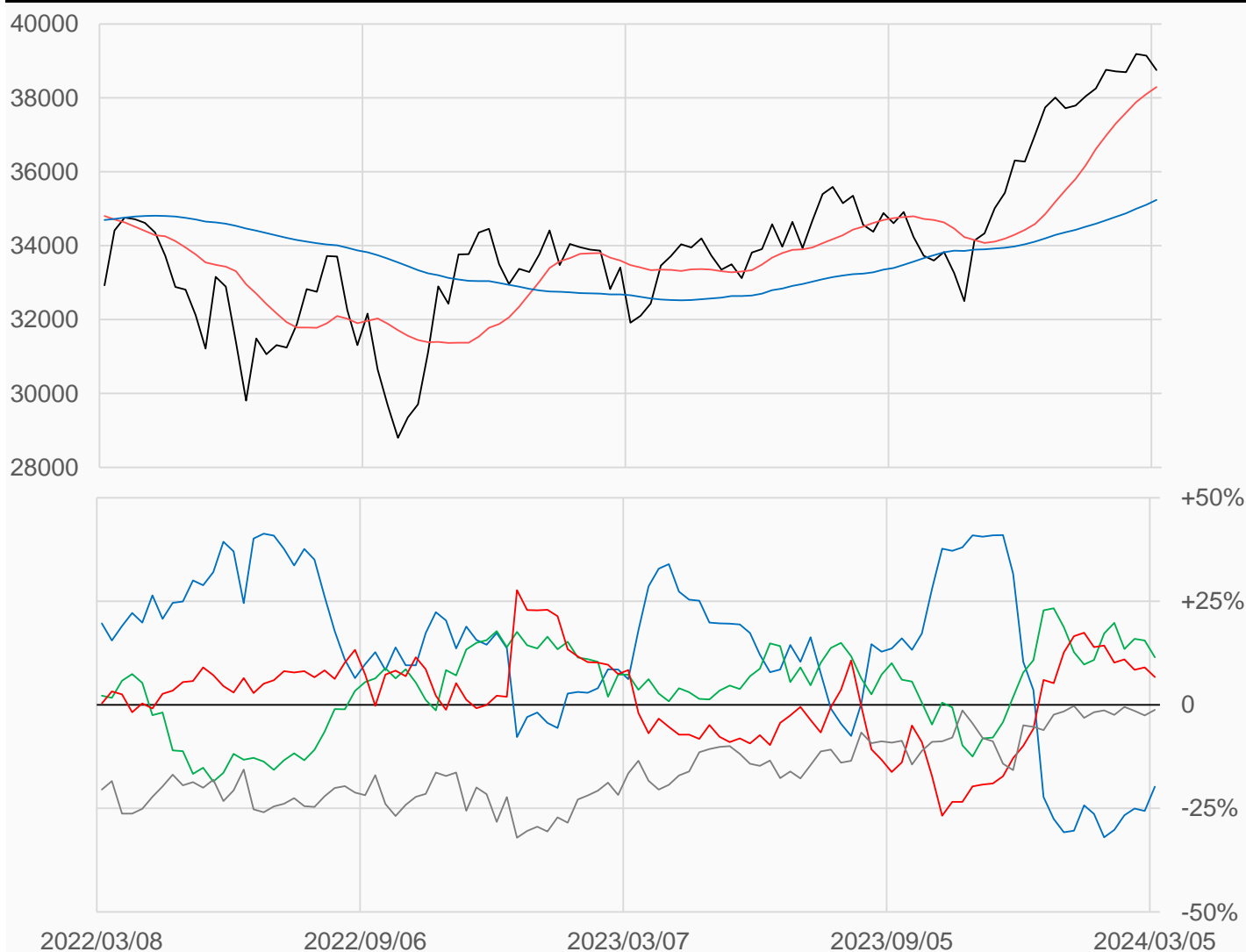
# mini 道瓊

mini道瓊較前一週下跌386點收在38756點，  
 槓桿基金多單減少2396口，空單增加332口，  
 淨多單較前一週減少29.06%或2728口至6659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
2024/03/05	104080	99191	-4889	-4.70%	38756	↓ -386
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	36281	+1923	55898	-5105	-19617	+7028
資產管理	21533	-3585	10150	+1186	+11383	-4771
槓桿基金	24889	-2396	18230	+332	+6659	-2728
其他	1719	+288	2879	-1208	-1160	+1496

週五收盤價與13週與52週平均線

— YM — 13週 38294 — 52週 35240



淨部位佔總OI% 經紀 -19.8% 資管 +11.5% 槓桿 +6.7% 其他 -1.2%

# mini NQ

miniNQ較前一週下跌291.5點收在18046.75點，  
 槓桿基金多單減少3894口，空單增加6409口，  
 淨空單較前一週增加10303口至58331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
2024/03/05	332083	337041	+4958	+1.49%	18046.75	↓ -291.50
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	77479	+14113	112806	-6234	-35327	+20347
資產管理	113307	-8020	31542	+3185	+81765	-11205
槓桿基金	89396	-3894	147727	+6409	-58331	-10303
其他	10648	-680	7746	+1401	+2902	-2081

週五收盤價與13週與52週平均線

— NQ — 13週 17448 — 52週 15395



淨部位佔總OI% 經紀 -10.5% 資管 +24.3% 槓桿 -17.3% 其他 +0.9%



# mini S&P

miniS&P較前一週下跌17點收在5129點，  
 槓桿基金多單增加26324口，空單減少5780口，  
 淨空單較前一週減少32104口至408627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
2024/03/05	3568228	3582734	+14506	+0.41%	5129.00	↓ -17.00
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	615466	+21490	1145002	-13173	-529536	+34663
資產管理	1318610	-21718	402446	+2791	+916164	-24509
槓桿基金	1134062	+26324	1542689	-5780	-408627	+32104
其他	196555	-15006	248381	+25136	-51826	-40142

週五收盤價與13週與52週平均線

— ES — 13週 4928.8 — 52週 4494.7



淨部位佔總OI% 經紀 -14.8% 資管 +25.6% 槓桿 -11.4% 其他 -1.4%

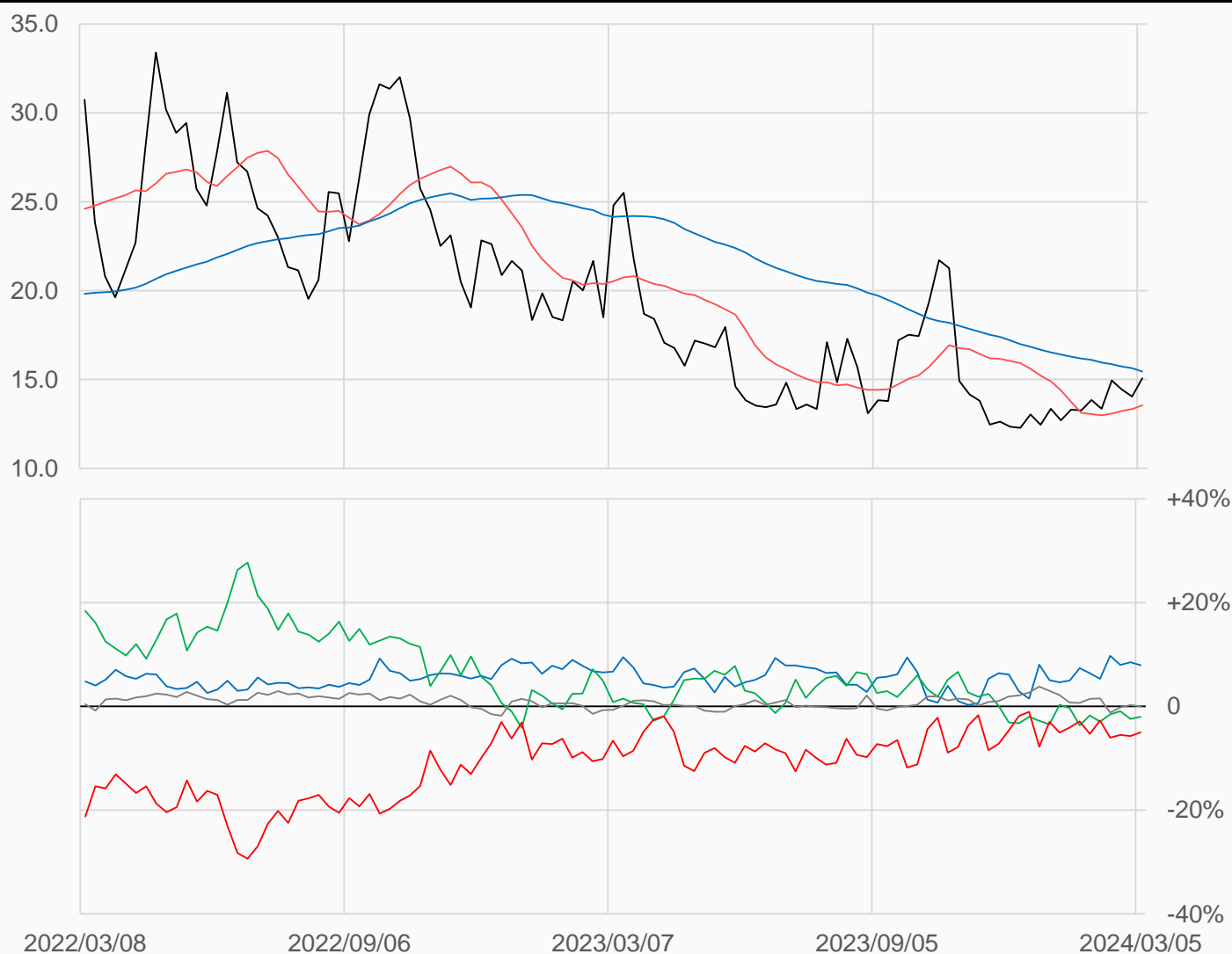
# VIX

VIX較前一週上漲1.03點收在15.07點，  
槓桿基金多單增加7308口，空單增加4797口，  
淨空單較前一週減少2511口至18218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
2024/03/05	361331	364498	+3167	+0.88%	15.07	↑ +1.03
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	72041	-1125	43222	+795	+28819	-1920
資產管理	114403	-4811	121842	-6145	-7439	+1334
槓桿基金	132225	+7308	150443	+4797	-18218	+2511
其他	16241	-938	16330	+130	-89	-1068

週五收盤價與13週與52週平均線

— VX — 13週 13.543 — 52週 15.453



淨部位佔總OI% 經紀 +7.9% 資管 -2.0% 槓桿 -5.0% 其他 -0.0%

# 30年債

美國30年公債較前一週上漲1.4688點收在121.5點，

槓桿基金多單減少16676口，空單減少65口，

淨空單較前一週增加16611口至359207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
2024/03/05	1663991	1639005	-24986	-1.50%	121 16/32	↑ +1 15/32
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	63265	+6234	207129	-19044	-143864	+25278
資產管理	957890	-16312	524392	-11404	+433498	-4908
槓桿基金	286926	-16676	646133	-65	-359207	-16611
其他	113392	+1097	102216	+12117	+11176	-11020

週五收盤價與13週與52週平均線

— US — 13週 121.35 — 52週 122.24



淨部位佔總OI% 經紀 -8.8% 資管 +26.4% 槓桿 -21.9% 其他 +0.7%

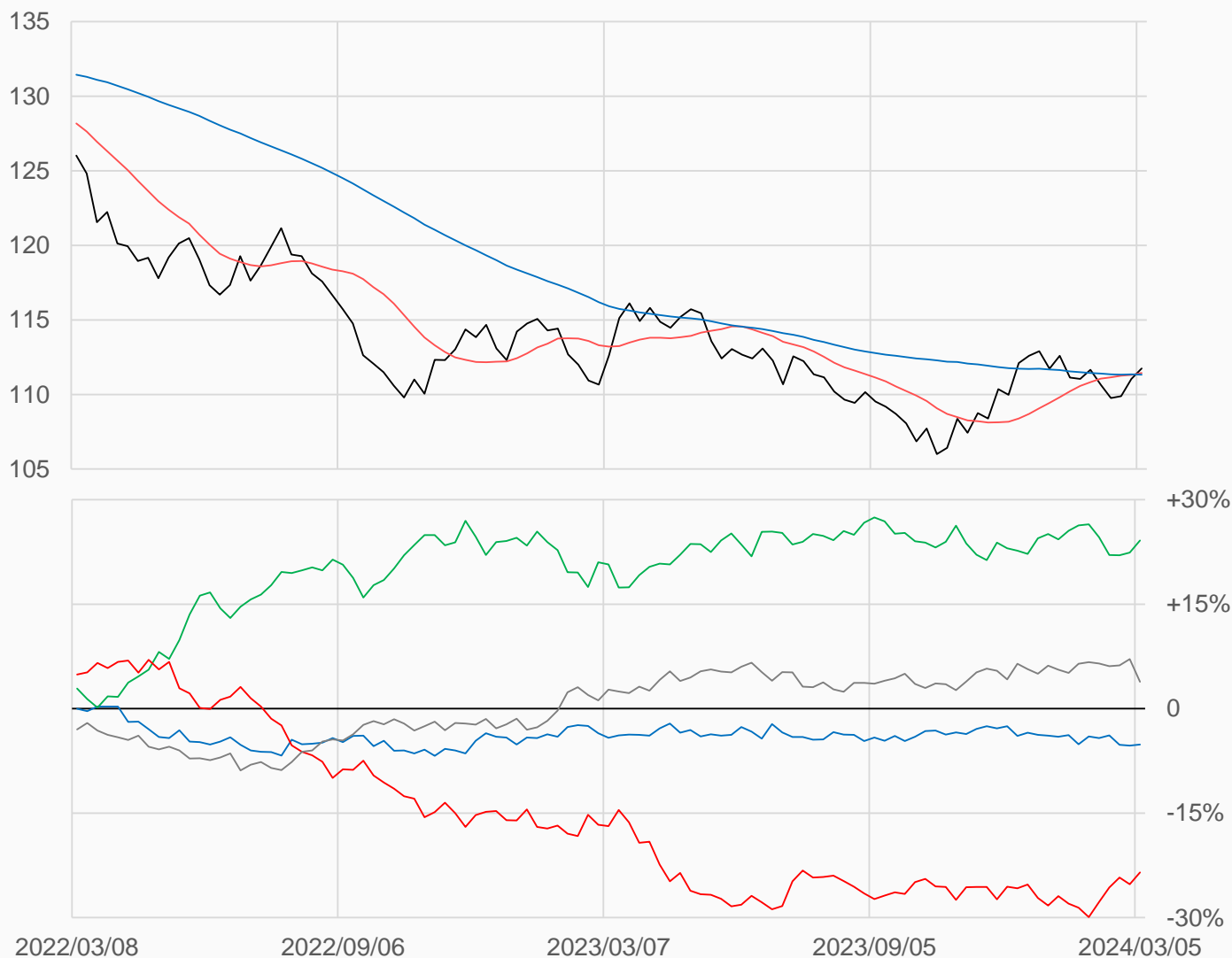
# 10年債

美國10年公債較前一週上漲0.7031點收在111.734375點，  
 槓桿基金多單減少39048口，空單減少185518口，  
 淨空單較前一週減少146470口至1169753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
2024/03/05	5216932	4973909	-243023	-4.66%	111 47/64	↑ + 45/64
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	289528	+13103	545787	-6800	-256259	+19903
資產管理	2928355	-88581	1727234	-120676	+1201121	+32095
槓桿基金	810424	-39048	1980177	-185518	-1169753	+146470
其他	500997	-115798	309507	+63576	+191490	-179374

週五收盤價與13週與52週平均線

— TY — 13週 111.44 — 52週 111.32



淨部位佔總OI% 經紀 -5.2% 資管 +24.1% 槓桿 -23.5% 其他 +3.8%

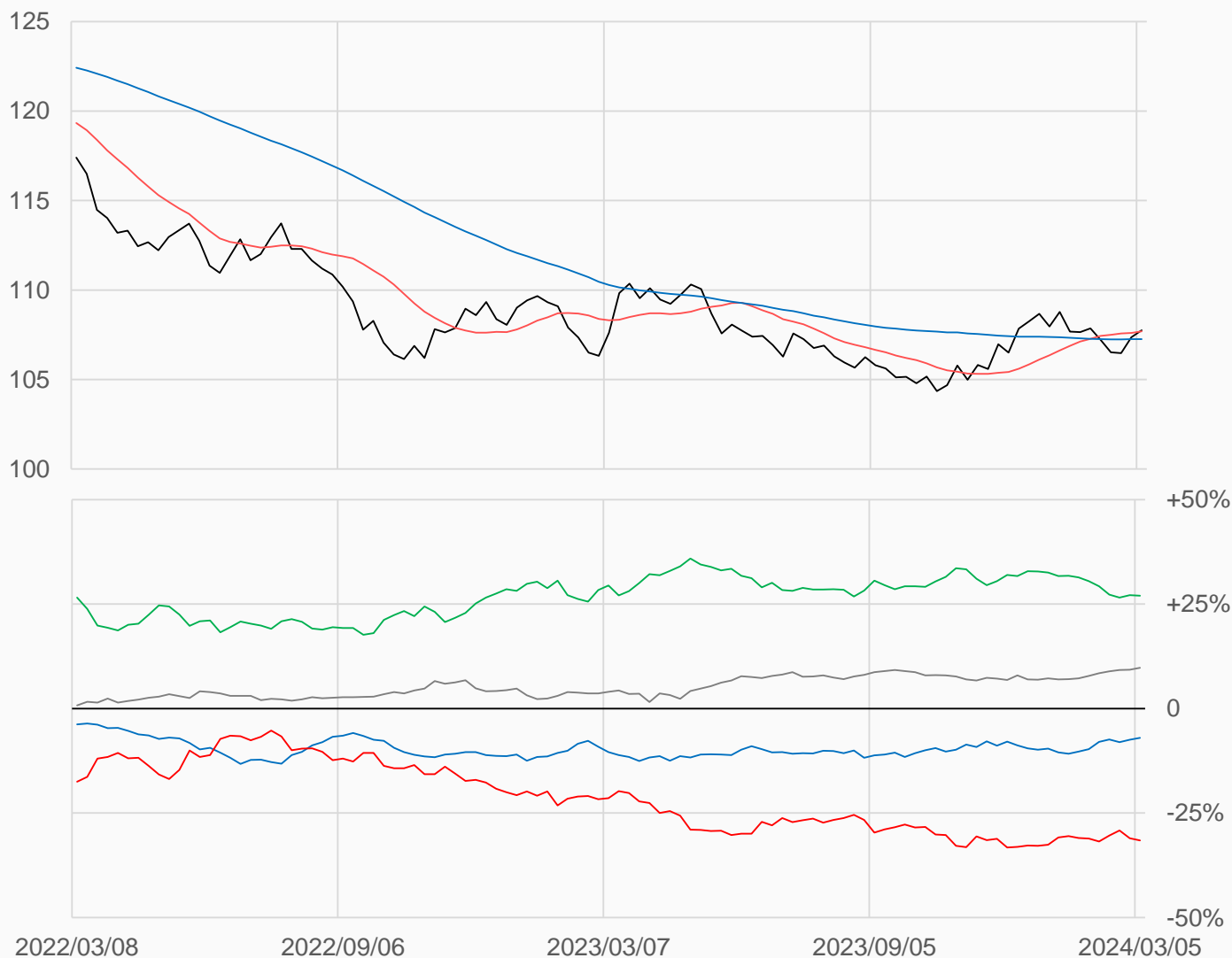
# 5年公債

美國5年公債較前一週上漲0.3828點收在107.75點，  
 槓桿基金多單減少55362口，空單減少80477口，  
 淨空單較前一週減少25115口至1936346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
2024/03/05	6315887	6134781	-181106	-2.87%	107 96/128	↑ + 49/128
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	282641	+7030	713643	-33137	-431002	+40167
資產管理	3588539	-131608	1930044	-75076	+1658495	-56532
槓桿基金	1158609	-55362	3094955	-80477	-1936346	+25115
其他	690443	+20100	90756	+6143	+599687	+13957

週五收盤價與13週與52週平均線

— FV — 13週 107.69 — 52週 107.26



淨部位佔總OI% 經紀 -7.0% 資管 +27.0% 槓桿 -31.6% 其他 +9.8%

# 2年公債

美國2年公債較前一週上漲0.0703點收在102.66015625點。

槓桿基金多單減少63893口，空單減少28822口，

淨空單較前一週增加35071口至1432469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
2024/03/05	3827809	3664001	-163808	-4.28%	102 85/128	↑ + 9/128
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	148201	-29059	448499	-98839	-300298	+69780
資產管理	2085870	-54512	855154	-10777	+1230716	-43735
槓桿基金	656328	-63893	2088797	-28822	-1432469	-35071
其他	527679	+7373	139222	-22642	+388457	+30015

週五收盤價與13週與52週平均線

— TU — 13週 102.52 — 52週 102.13



淨部位佔總OI% 經紀 -8.2% 資管 +33.6% 槓桿 -39.1% 其他 +10.6%

# 歐元

歐元較前一週上漲97.5點收在10945.5點，  
 槓桿基金多單增加1229口，空單減少989口，  
 淨空單較前一週減少2218口至16332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
2024/03/05	805768	796532	-9236	-1.15%	10945.5	↑ +97.5
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	52914	+4209	406073	+1509	-353159	+2700
資產管理	478186	-15849	162055	-6846	+316131	-9003
槓桿基金	143558	+1229	159890	-989	-16332	+2218
其他	37637	+61	14865	-844	+22772	+905

週五收盤價與13週與52週平均線

— EC — 13週 10909 — 52週 10867



淨部位佔總OI% 經紀 -44.3% 資管 +39.7% 槓桿 -2.1% 其他 +2.9%

# 日圓

日圓較前一週上漲131點收在6809.5點，  
 槓桿基金多單增加5774口，空單增加716口，  
 淨空單較前一週減少5058口至78504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
2024/03/05	342026	355638	+13612	+3.98%	6809.5	↑ +131.0
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	134792	-6857	40387	+18474	+94405	-25331
資產管理	74804	+3453	120192	-5054	-45388	+8507
槓桿基金	69222	+5774	147726	+716	-78504	+5058
其他	26801	+6801	4051	-214	+22750	+7015

週五收盤價與13週與52週平均線

— JY — 13週 6867 — 52週 7022.9



淨部位佔總OI% 經紀 +26.5% 資管 -12.8% 槓桿 -22.1% 其他 +6.4%



# 英鎊

英鎊較前一週上漲194點收在12858點，  
槓桿基金多單增加7018口，空單增加2757口，  
淨多單較前一週增加4261口至28185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
2024/03/05	242921	257168	+14247	+5.86%	12858	↑ +194
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	47724	-514	45009	+3713	+2715	-4227
資產管理	75259	+6351	108129	+6558	-32870	-207
槓桿基金	99721	+7018	71536	+2757	+28185	+4261
其他	1177	-80	3915	+63	-2738	-143

週五收盤價與13週與52週平均線

— BP — 13週 12702 — 52週 12557



淨部位佔總OI% 經紀 +1.1% 資管 -12.8% 槓桿 +11.0% 其他 -1.1%

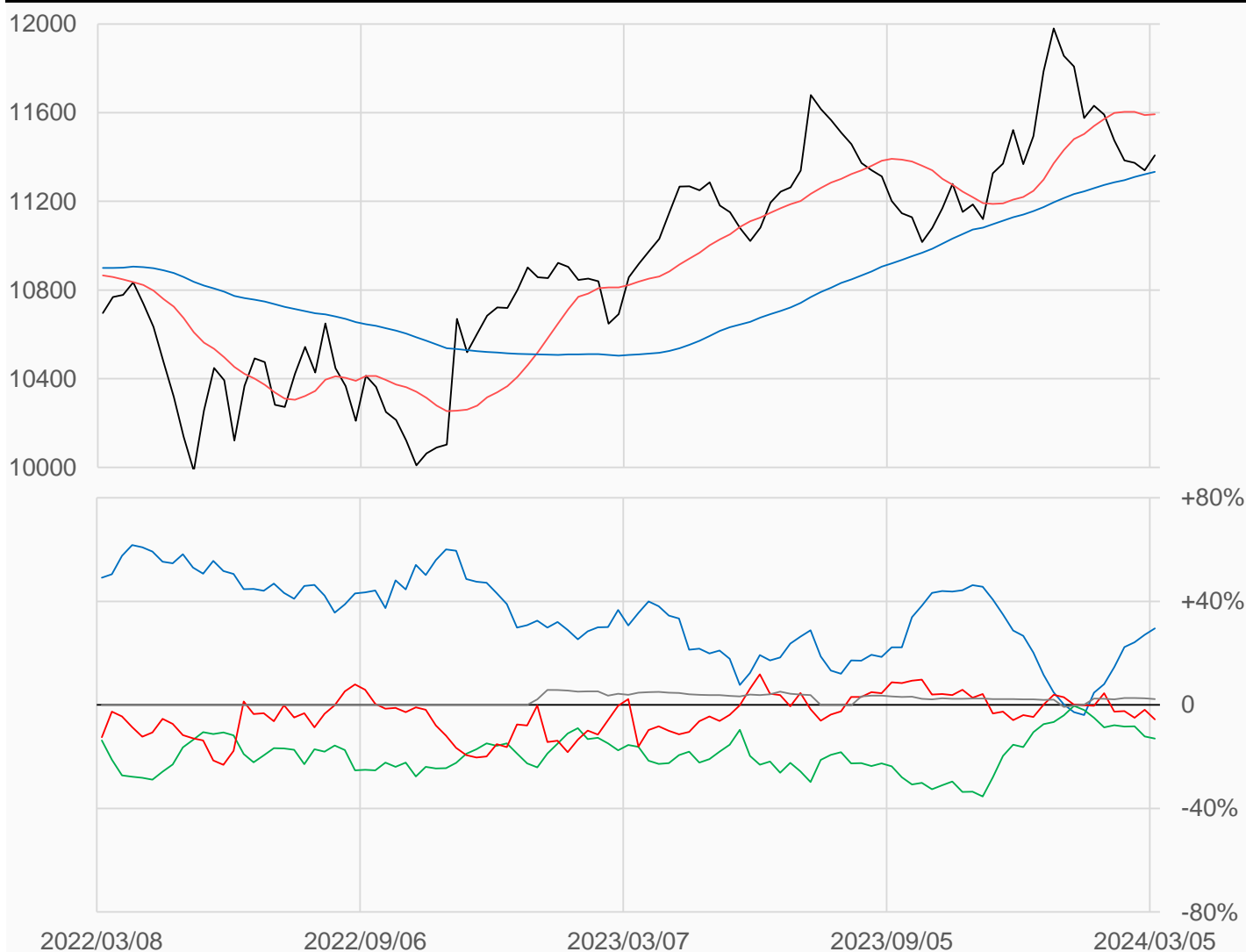
# 瑞郎

瑞郎較前一週上漲68點收在11407.5點，  
 槓桿基金多單增加2091口，空單增加5559口，  
 淨空單較前一週增加3468口至4916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
2024/03/05	75891	88241	+12350	+16.27%	11408	↑ +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	33743	+7303	7640	+1779	+26103	+5524
資產管理	19688	+1855	31165	+4097	-11477	-2242
槓桿基金	23439	+2091	28355	+5559	-4916	-3468
其他	1955	+64	0	0	+1955	+64

週五收盤價與13週與52週平均線

— SF — 13週 11593 — 52週 11333



淨部位佔總OI% 經紀 +29.6% 資管 -13.0% 槓桿 -5.6% 其他 +2.2%

# 加幣

加幣較前一週上漲40.5點收在7417點，  
 槓桿基金多單增加7552口，空單增加7915口，  
 淨空單較前一週增加363口至15829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
2024/03/05	182943	202874	+19931	+10.89%	7417.0	↑ +40.5
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	67101	+10652	17351	-12120	+49750	+22772
資產管理	53088	+12	95672	+20397	-42584	-20385
槓桿基金	37720	+7552	53549	+7915	-15829	-363
其他	14444	+2831	3392	-605	+11052	+3436

週五收盤價與13週與52週平均線

— CD — 13週 7455.6 — 52週 7420.5



淨部位佔總OI% 經紀 +24.5% 資管 -21.0% 槓桿 -7.8% 其他 +5.4%

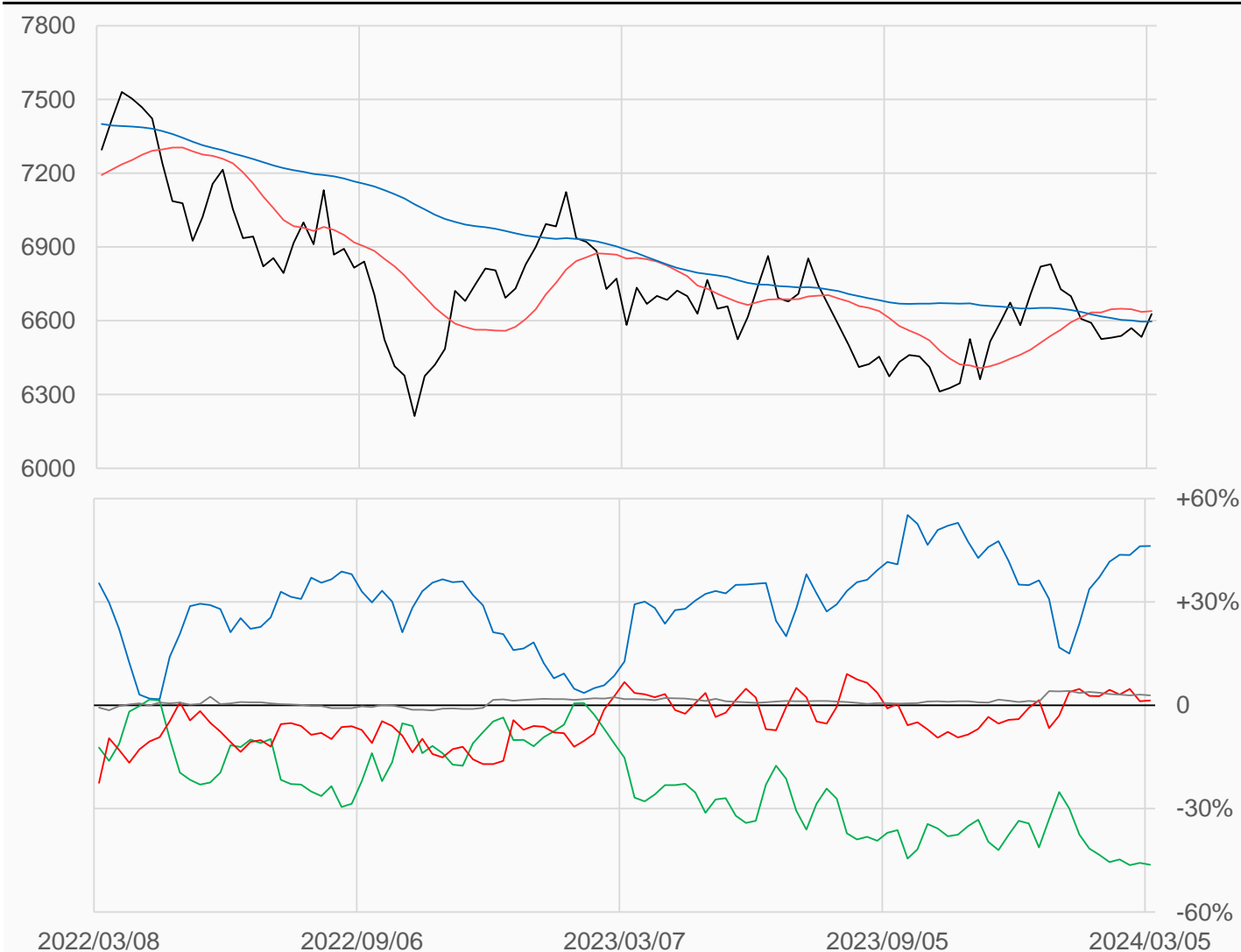
# 澳幣

澳幣較前一週上漲93點收在6627點，  
 槓桿基金多單增加14213口，空單增加13244口，  
 淨多單較前一週增加969口至3465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
2024/03/05	217369	249748	+32379	+14.90%	6627	↑ +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	123701	+19306	8265	+4312	+115436	+14994
資產管理	36674	-1597	152169	+14532	-115495	-16129
槓桿基金	61102	+14213	57637	+13244	+3465	+969
其他	7298	+7	33	-440	+7265	+447

週五收盤價與13週與52週平均線

— AD — 13週 6639.4 — 52週 6597.2



淨部位佔總OI% 經紀 +46.2% 資管 -46.2% 槓桿 +1.4% 其他 +2.9%

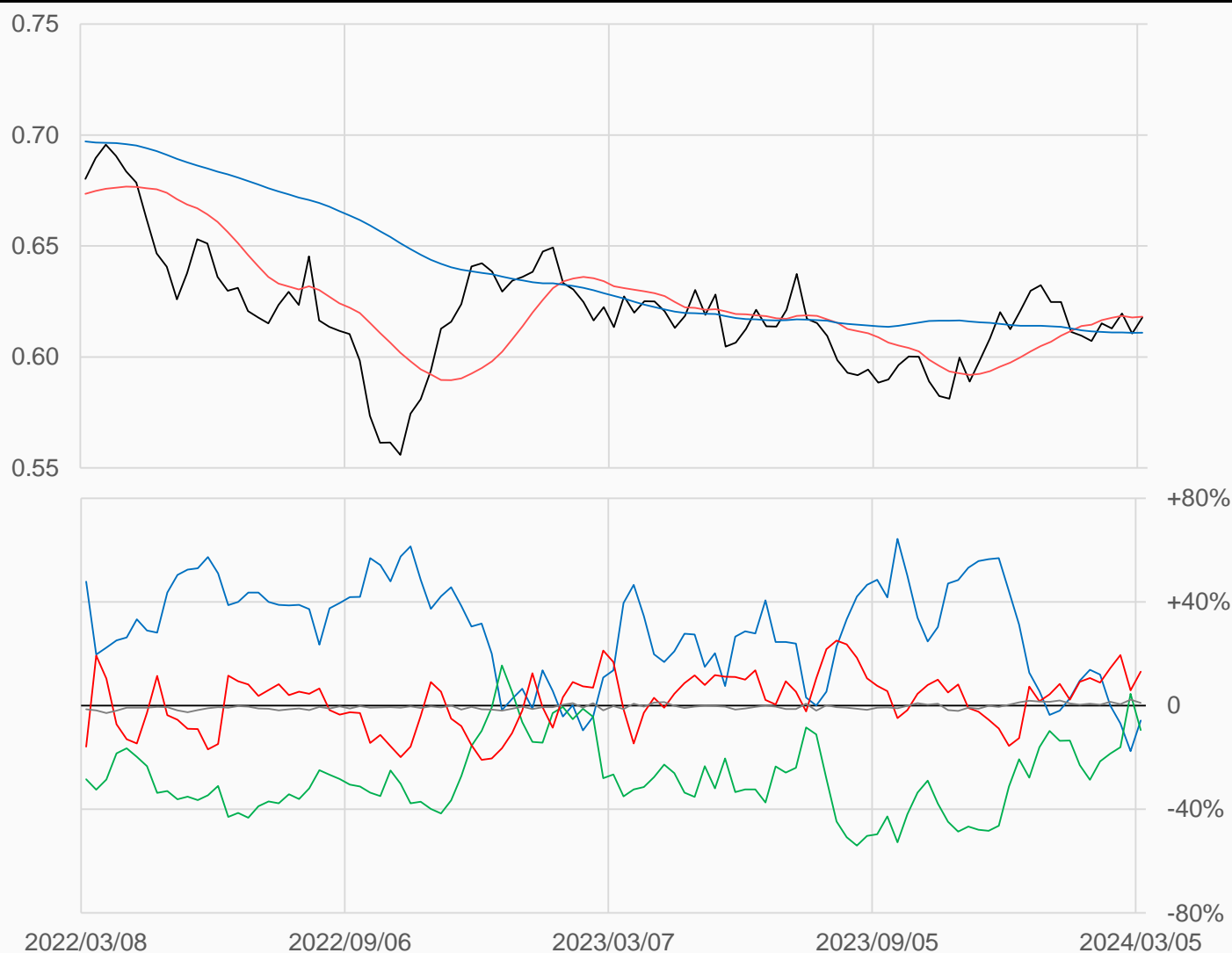
# 紐幣

紐幣較前一週上漲0.0071點收在0.61775點，  
 槓桿基金多單增加2105口，空單減少1615口，  
 淨多單較前一週增加3720口至6567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
2024/03/05	48489	50129	+1640	+3.38%	0.6178	▲ +0.0071
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	7833	+3068	10704	-2591	-2871	+5659
資產管理	19329	-2639	24084	+4312	-4755	-6951
槓桿基金	17722	+2105	11155	-1615	+6567	+3720
其他	963	-151	463	+463	+500	-614

週五收盤價與13週與52週平均線

— NE — 13週 0.6182 — 52週 0.6109



淨部位佔總OI% 經紀 -5.7% 資管 -9.5% 槓桿 +13.1% 其他 +1.0%

# 美元

美元較前一週下跌1.111點收在102.688點，  
 槓桿基金多單減少669口，空單減少1784口，  
 淨空單較前一週減少1115口至8906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
2024/03/05	29591	28480	-1111	-3.75%	102.688	↓ -1.111
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	180	-17	3602	0	-3422	-17
資產管理	13408	-820	2853	+223	+10555	-1043
槓桿基金	8901	-669	17807	-1784	-8906	+1115
其他	2586	+408	1702	+85	+884	+323

週五收盤價與13週與52週平均線

— DX — 13週 102.91 — 52週 103.24



淨部位佔總OI% 經紀 -12.0% 資管 +37.1% 槓桿 -31.3% 其他 +3.1%

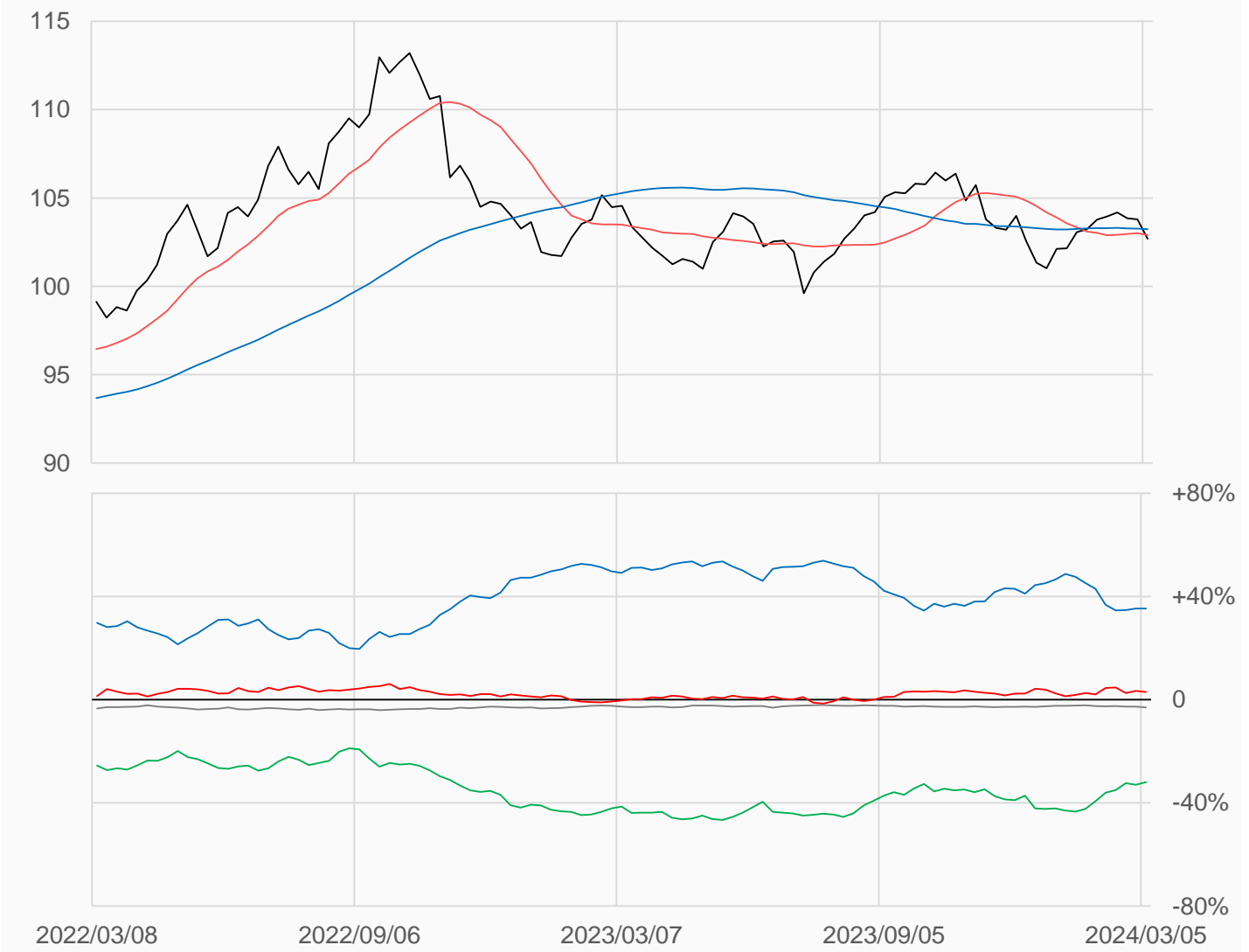
# 綜合美元 (不含美元)

綜合美元較前一週下跌1.111點收在102.688點，  
槓桿基金多單增加1172口，空單增加5287口，  
淨多單較前一週減少4115口至32853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
2024/03/05	1096117	1094459	-1658	-0.15%	102.688	↓ -1.111
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	499228.8	+5218	112406.5	+5959	+386822	-741
資產管理	252176.6	-5128	602126.7	-17074	-349950	+11946
槓桿基金	240672.2	+1172	207819.5	+5287	+32853	-4115
其他	19399.13	-1117	52223.19	+1744	-32824	-2861

週五收盤價與13週與52週平均線

— DXY — 13週 102.91 — 52週 103.24



淨部位佔總OI% 經紀 +35.3% 資管 -32.0% 槓桿 +3.0% 其他 -3.0%

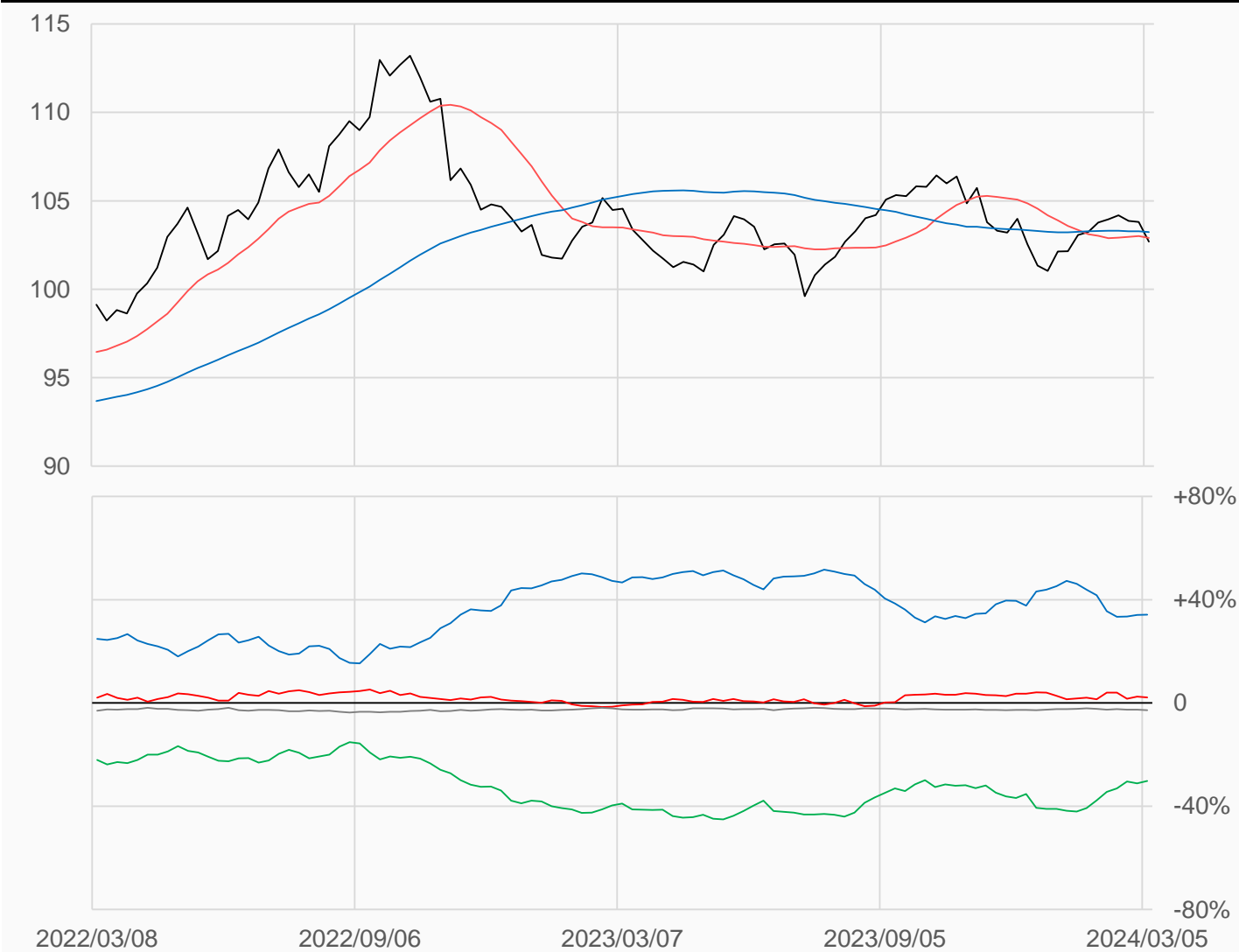
# 綜合美元 (含美元)

綜合美元較前一週下跌1.111點收在102.688點，  
槓桿基金多單增加503口，空單增加3503口，  
淨多單較前一週減少3000口至23947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
2024/03/05	1125708	1122939	-2769	-0.25%	102.688	↓ -1.111
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	499408.8	+5201	116008.5	+5959	+383400	-758
資產管理	265584.6	-5948	604979.7	-16851	-339395	+10903
槓桿基金	249573.2	+503	225626.5	+3503	+23947	-3000
其他	21985.13	-709	53925.19	+1829	-31940	-2538

週五收盤價與13週與52週平均線

— DXX — 13週 102.91 — 52週 103.24



淨部位佔總OI% 經紀 +34.1% 資管 -30.2% 槓桿 +2.1% 其他 -2.8%



# 黃金

黃金較前一週上漲89.8點收在2185.5點，  
管理基金多單增加68729口，空單增加5711口，  
淨多單較前一週增加63018口至131060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
2024/03/05	551918	706068	+154150	+27.93%	2185.5	↑ +89.8
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	24462	+4154	75694	+17154	-51232	-13000
互換交易	138340	+10594	308733	+58822	-170393	-48228
管理基金	235795	+68729	104735	+5711	+131060	+63018
其他	255765	+62570	178573	+61223	+77192	+1347

週五收盤價與13週與52週平均線

— GC — 13週 2054 — 52週 1980.7



淨部位佔總OI% 生產 -7.3% 互換 -24.1% 管理 +18.6% 其他 +10.9%

# 白銀

白銀較前一週上漲118.5點收在2454.9點，  
 管理基金多單增加9194口，空單減少10479口，  
 淨多單較前一週增加19673口至15530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
2024/03/05	162469	166332	+3863	+2.38%	2454.9	↑ +118.5
分類	多單OI	增減	空單OI	增減	多空淨部位	淨部位變動
生產商	7206	-2565	42477	-748	-35271	-1817
互換交易	41346	-3252	50451	+9076	-9105	-12328
管理基金	50707	+9194	35177	-10479	+15530	+19673
其他	35389	+1742	23421	+5525	+11968	-3783

週五收盤價與13週與52週平均線

— SI — 13週 2333.6 — 52週 2358.7



淨部位佔總OI% 生產 -21.2% 互換 -5.5% 管理 +9.3% 其他 +7.2%

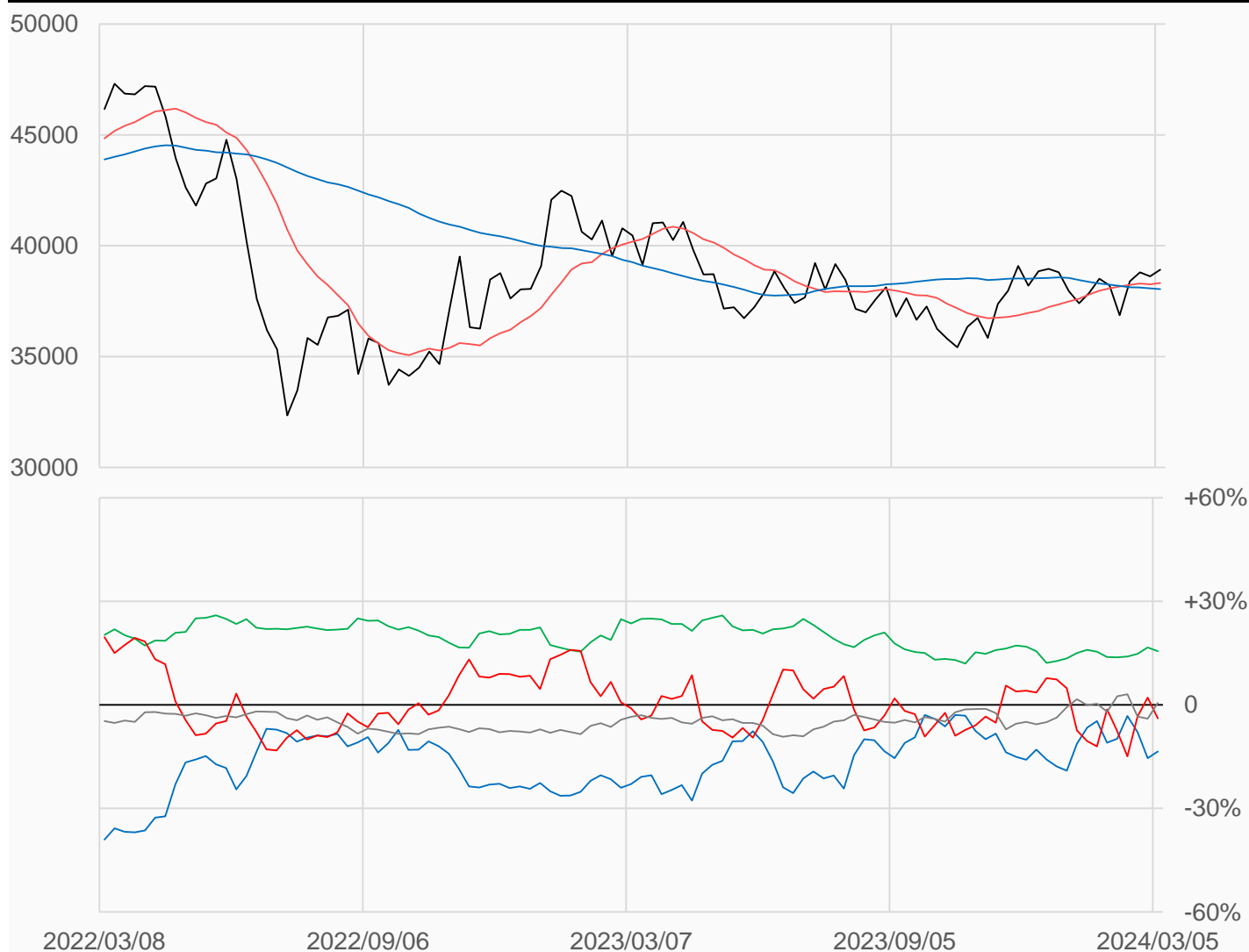
# 銅

銅較前一週上漲300點收在38915點，  
 管理基金多單增加3078口，空單增加16043口，  
 淨空單較前一週增加12965口至8598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
2024/03/05	208274	217182	+8908	+4.28%	38915	↑ +300
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	25987	+1652	55271	-1189	-29284	+2841
互換交易	50052	-1029	16338	-119	+33714	-910
管理基金	85667	+3078	94265	+16043	-8598	-12965
其他	38356	+5432	37123	-4199	+1233	+9631

週五收盤價與13週與52週平均線

— HG — 13週 38317 — 52週 38042



淨部位佔總OI% 生產 -13.5% 互換 +15.5% 管理 -4.0% 其他 +0.6%

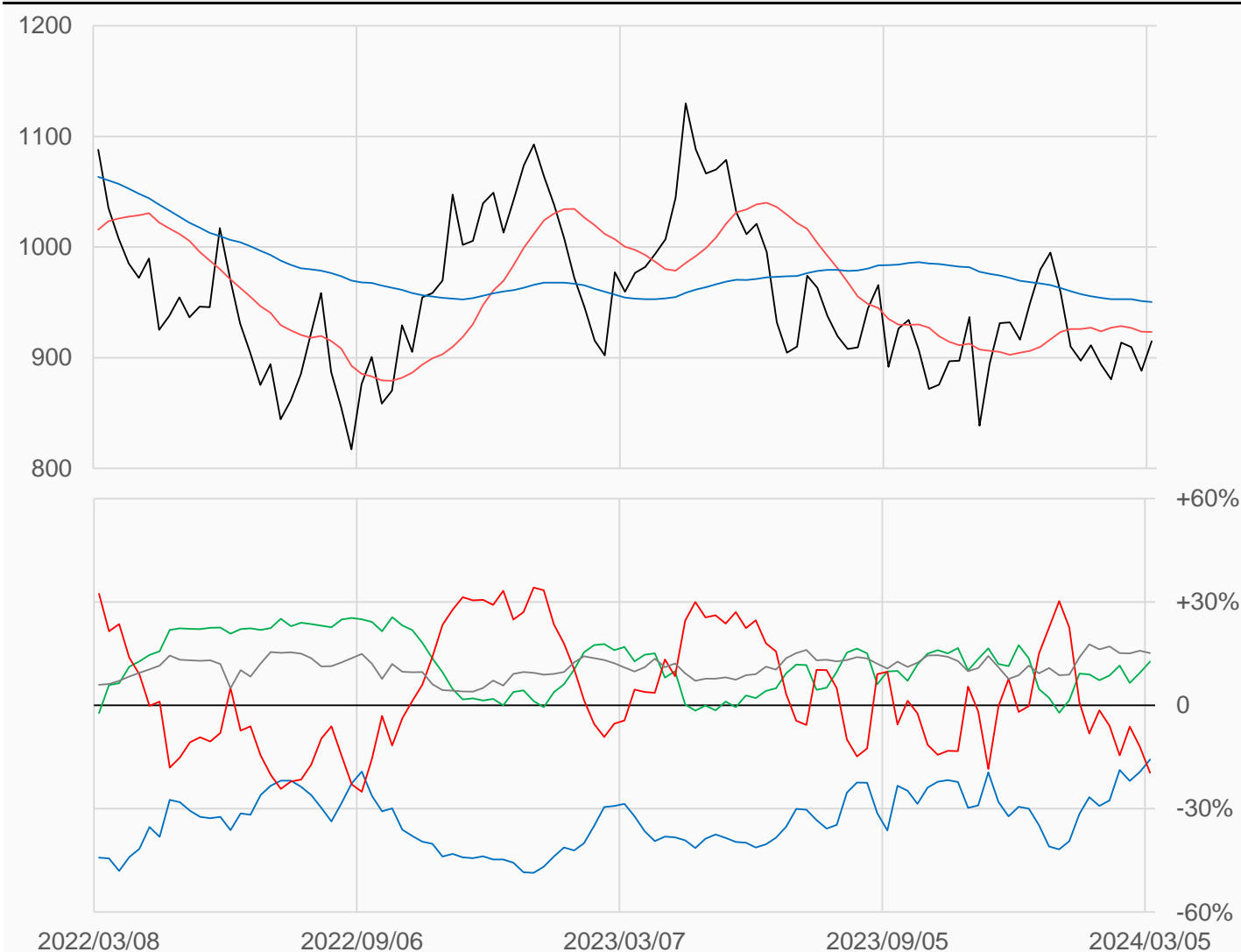
# 白金

白金較前一週上漲26.8點收在914.8點，  
管理基金多單增加437口，空單增加9267口，  
淨空單較前一週增加8830口至20048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
2024/03/05	92901	102395	+9494	+10.22%	914.8	↑ +26.8
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	6100	+1648	22236	-170	-16136	+1818
互換交易	21891	+2925	8935	-1254	+12956	+4179
管理基金	38456	+437	58504	+9267	-20048	-8830
其他	24412	+2548	8897	+1765	+15515	+783

週五收盤價與13週與52週平均線

— PL — 13週 923.27 — 52週 950.31



淨部位佔總OI% 生產 -15.8% 互換 +12.7% 管理 -19.6% 其他 +15.2%

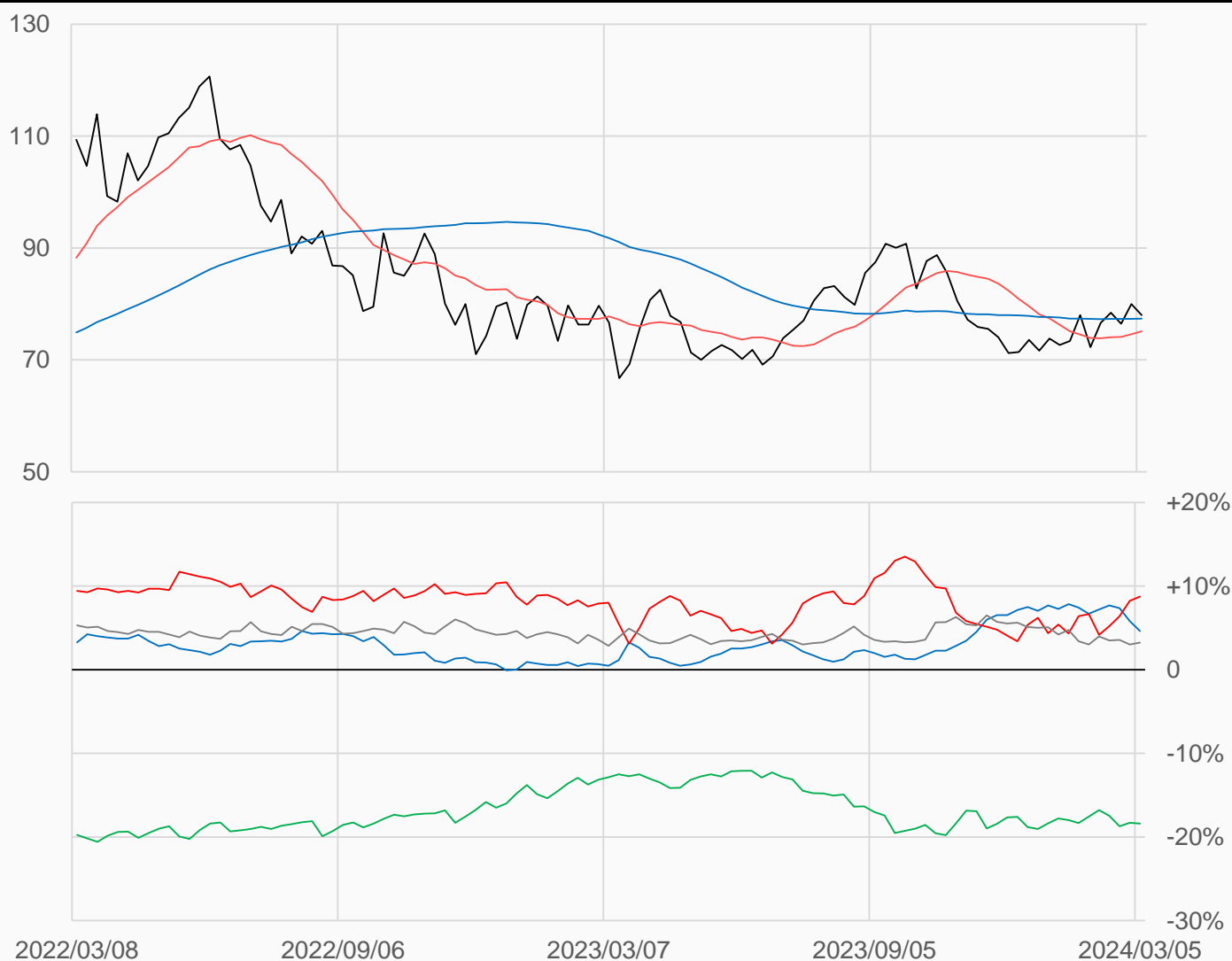
# 輕原油

輕原油較前一週下跌1.96點收在78.01點，  
管理基金多單減少23824口，空單減少33054口，  
淨多單較前一週增加9230口至183960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
2024/03/05	2118576	2098772	-19804	-0.93%	78.01	↓ -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	471190	-35187	373855	-9030	+97335	-26157
互換交易	217072	+4950	602975	+3349	-385903	+1601
管理基金	703601	-23824	519641	-33054	+183960	+9230
其他	608583	+23396	540372	+18889	+68211	+4507

週五收盤價與13週與52週平均線

— CL — 13週 75.105 — 52週 77.362



淨部位佔總OI% 生產 +4.6% 互換 -18.4% 管理 +8.8% 其他 +3.3%

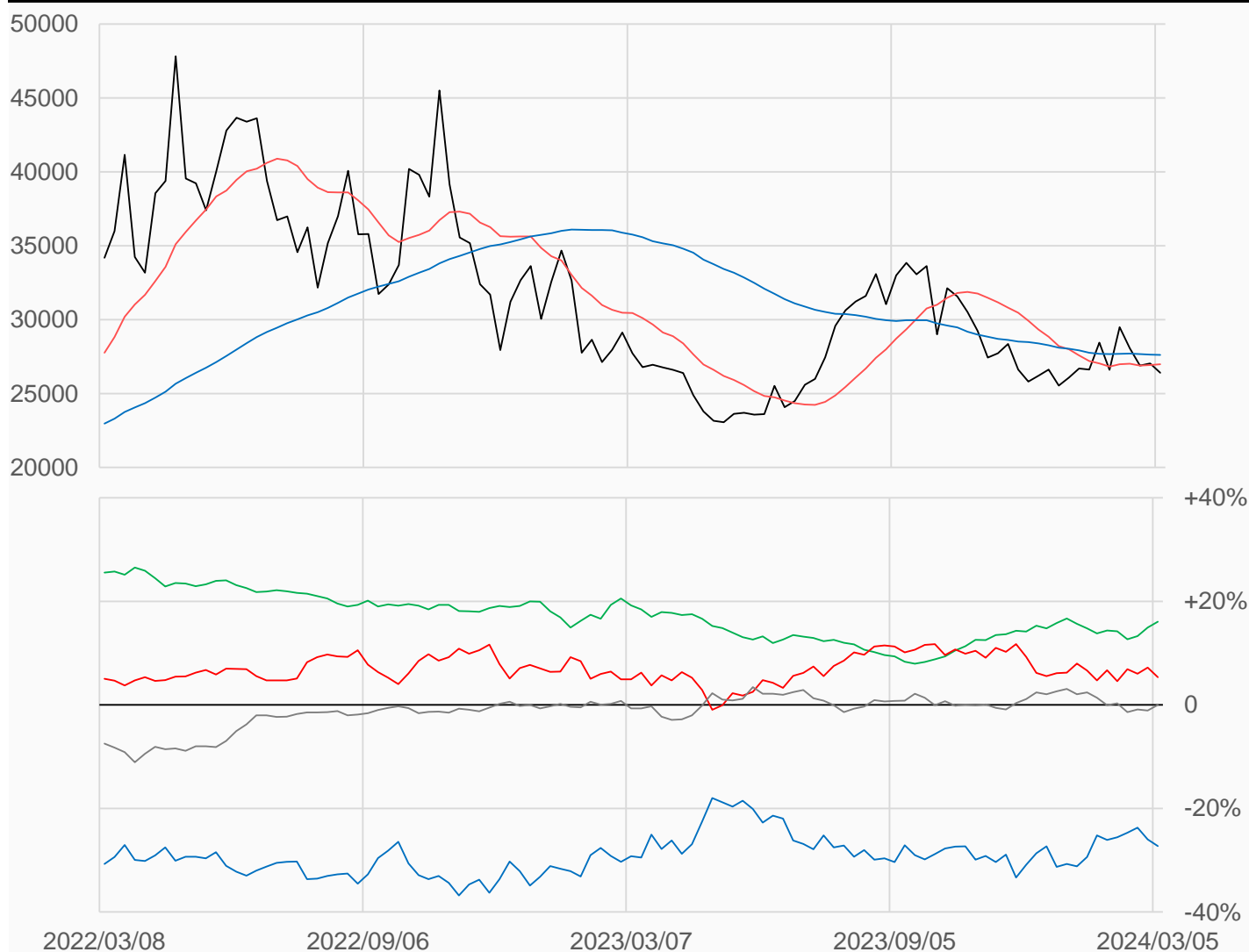
# 熱燃油

熱燃油較前一週下跌633點收在26409點，  
管理基金多單減少6930口，空單增加465口，  
淨多單較前一週減少7395口至16952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
2024/03/05	336906	317365	-19541	-5.80%	26409	↓ -633
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	84032	-5084	170657	-6090	-86625	+1006
互換交易	64267	-2174	13344	-2810	+50923	+636
管理基金	82186	-6930	65234	+465	+16952	-7395
其他	39386	-5113	39364	-8879	+22	+3766

週五收盤價與13週與52週平均線

— HO — 13週 26975 — 52週 27609



淨部位佔總OI% 生產 -27.3% 互換 +16.0% 管理 +5.3% 其他 +0.0%

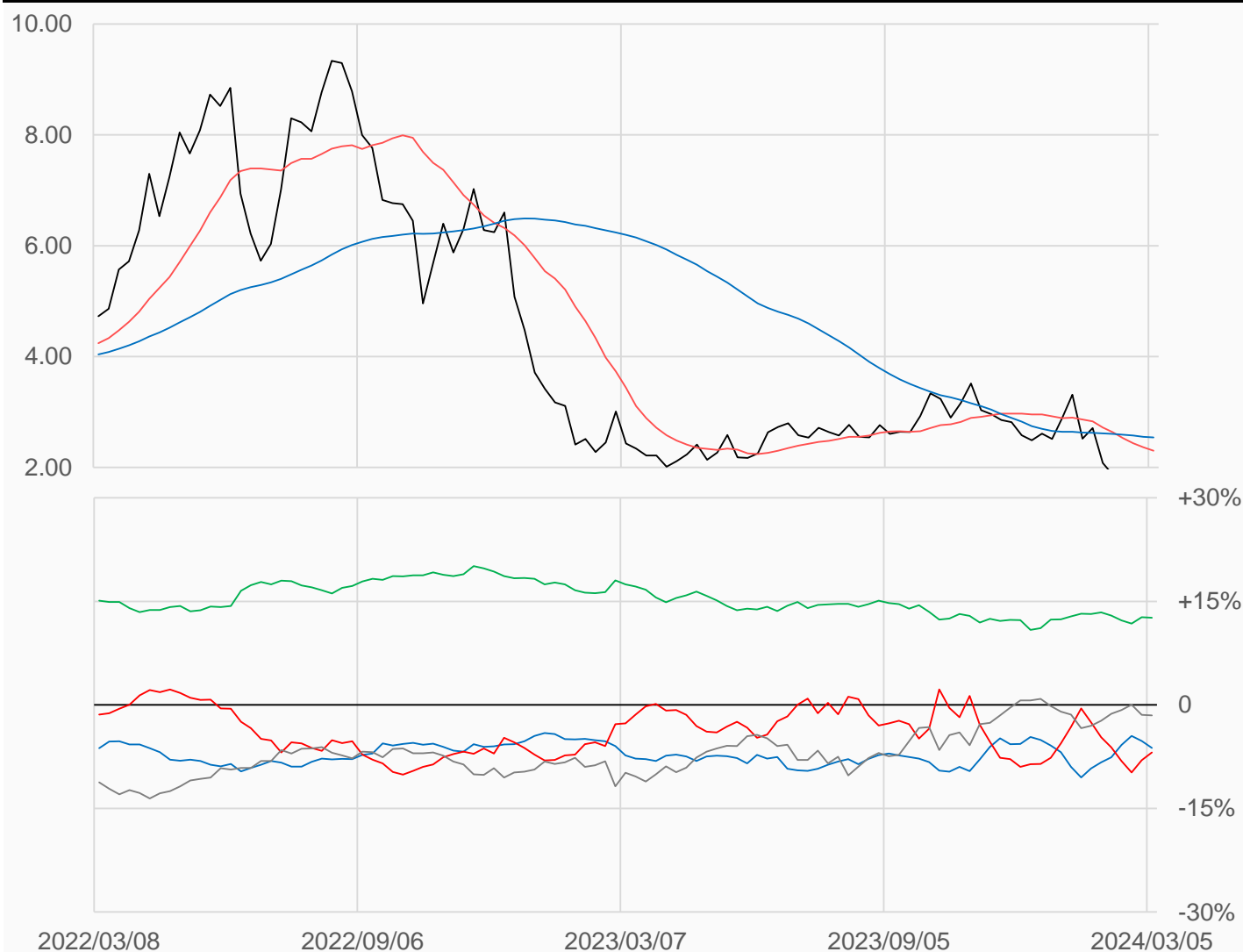
# 天然氣

天然氣較前一週下跌0.03點收在1.805點，  
 管理基金多單增加19923口，空單增加5438口，  
 淨空單較前一週減少14485口至106708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
2024/03/05	1513942	1549154	+35212	+2.33%	1.805	↓ -0.030
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	216974	-1016	313585	+16257	-96611	-17273
互換交易	340011	+11188	144636	+7965	+195375	+3223
管理基金	647972	+19923	754680	+5438	-106708	+14485
其他	270792	+4423	294147	+5673	-23355	-1250

週五收盤價與13週與52週平均線

— NG — 13週 2.3031 — 52週 2.5407



淨部位佔總OI% 生產 -6.2% 互換 +12.6% 管理 -6.9% 其他 -1.5%

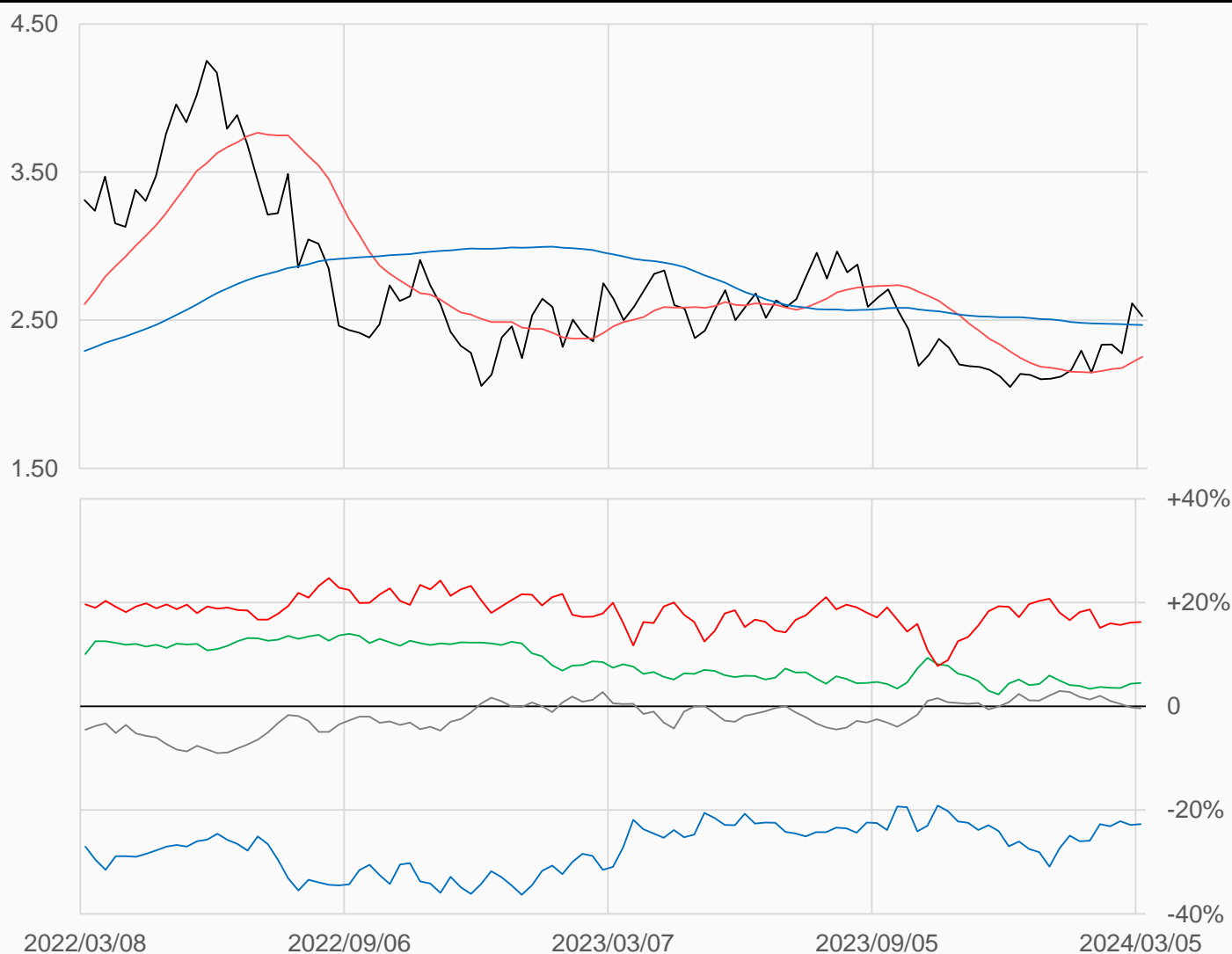
# 無鉛汽油

無鉛汽油較前一週下跌0.0872點收在2.5272點，  
管理基金多單減少10145口，空單減少9176口，  
淨多單較前一週減少969口至60034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
2024/03/05	377998	369388	-8610	-2.28%	2.5272	↓ -0.0872
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	134165	+4036	218013	+1512	-83848	+2524
互換交易	57655	+639	40949	+339	+16706	+300
管理基金	115175	-10145	55141	-9176	+60034	-969
其他	39083	-2540	40438	-1812	-1355	-728

週五收盤價與13週與52週平均線

— RB — 13週 2.253 — 52週 2.4687



淨部位佔總OI% 生產 -22.7% 互換 +4.5% 管理 +16.3% 其他 -0.4%



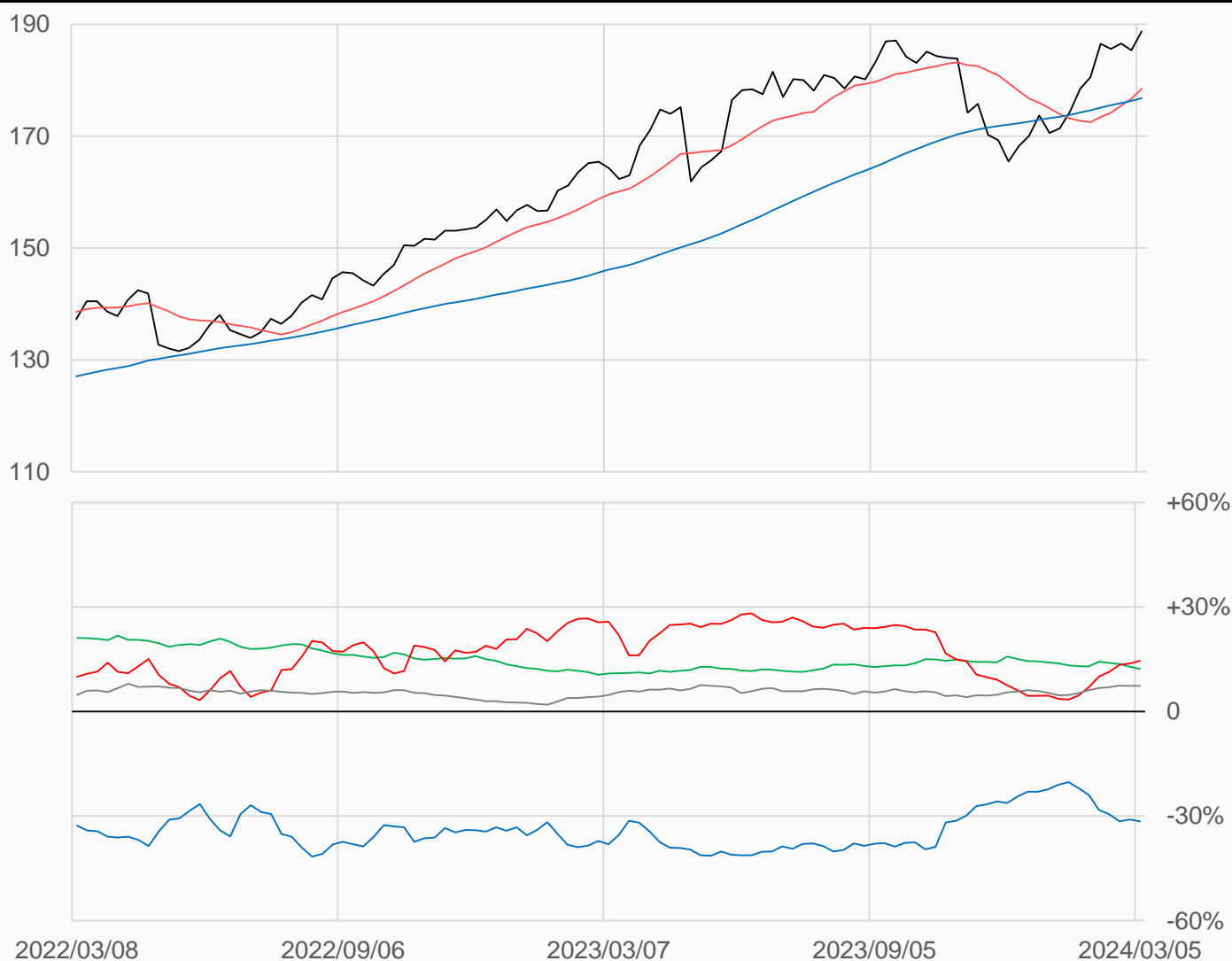
# 活牛

活牛較前一週上漲3.375點收在188.725點，  
管理基金多單增加7114口，空單增加2571口，  
淨多單較前一週增加4543口至59364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
2024/03/05	396702	408092	+11390	+2.87%	188.725	↑ +3.375
分類	多單OI	增減	空單OI	增減	多空淨部位	淨部位變動
生產商	73637	+452	202114	+6163	-128477	-5711
互換交易	56748	-155	6726	+714	+50022	-869
管理基金	132397	+7114	73033	+2571	+59364	+4543
其他	108512	+2248	78448	+1247	+30064	+1001

週五收盤價與13週與52週平均線

— LC — 13週 178.46 — 52週 176.78



淨部位佔總OI% 生產 -31.5% 互換 +12.3% 管理 +14.5% 其他 +7.4%

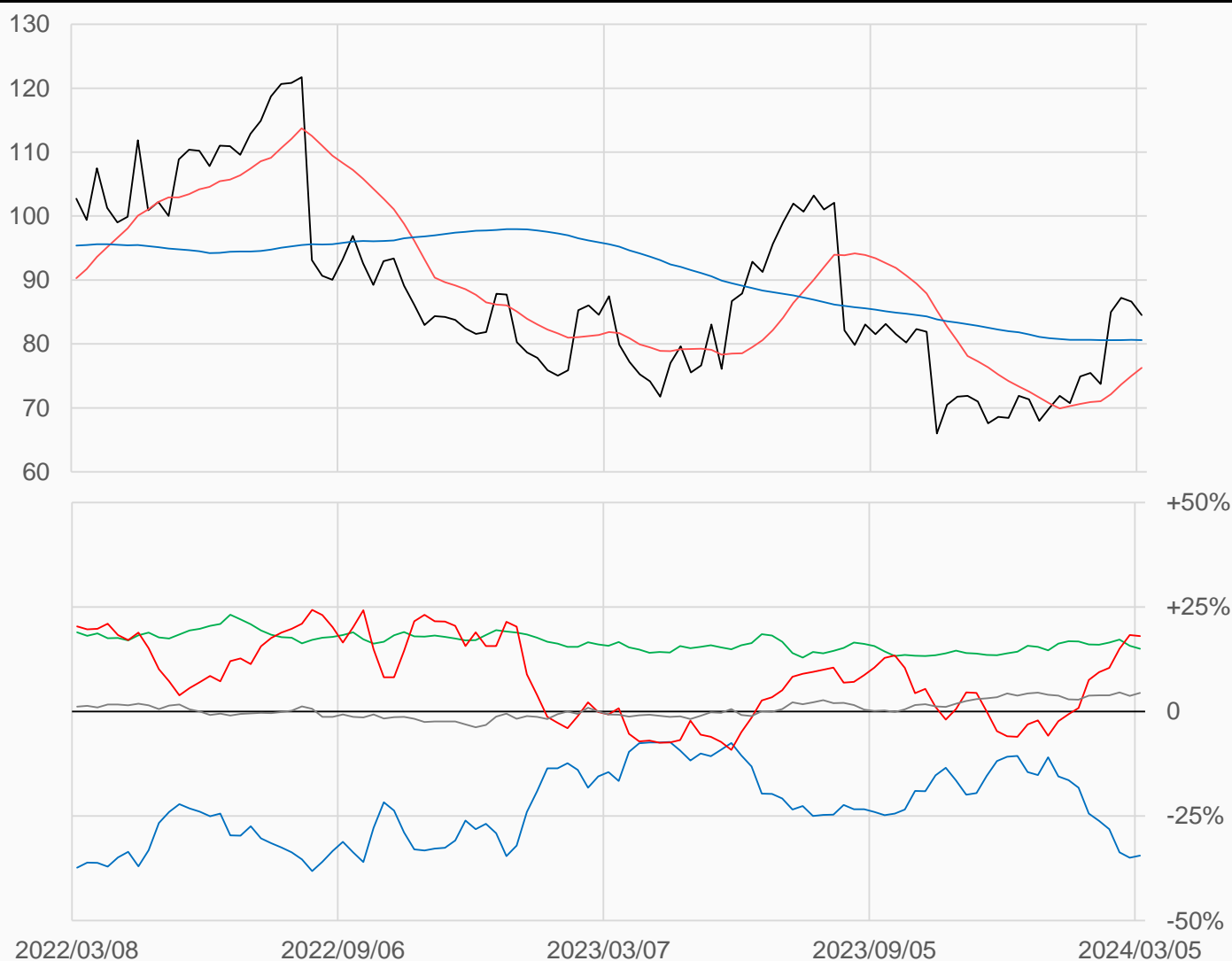
# 活豬

活豬較前一週下跌2.1點收在84.525點，  
管理基金多單增加4514口，空單增加2488口，  
淨多單較前一週增加2026口至65090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
2024/03/05	344440	361151	+16711	+4.85%	84.525	↓ -2.100
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	32899	+1096	157298	+4970	-124399	-3874
互換交易	74031	+4190	19785	+4216	+54246	-26
管理基金	120639	+4514	55549	+2488	+65090	+2026
其他	108580	+5347	92478	+2225	+16102	+3122

週五收盤價與13週與52週平均線

— LH — 13週 76.256 — 52週 80.599



淨部位佔總OI% 生產 -34.4% 互換 +15.0% 管理 +18.0% 其他 +4.5%

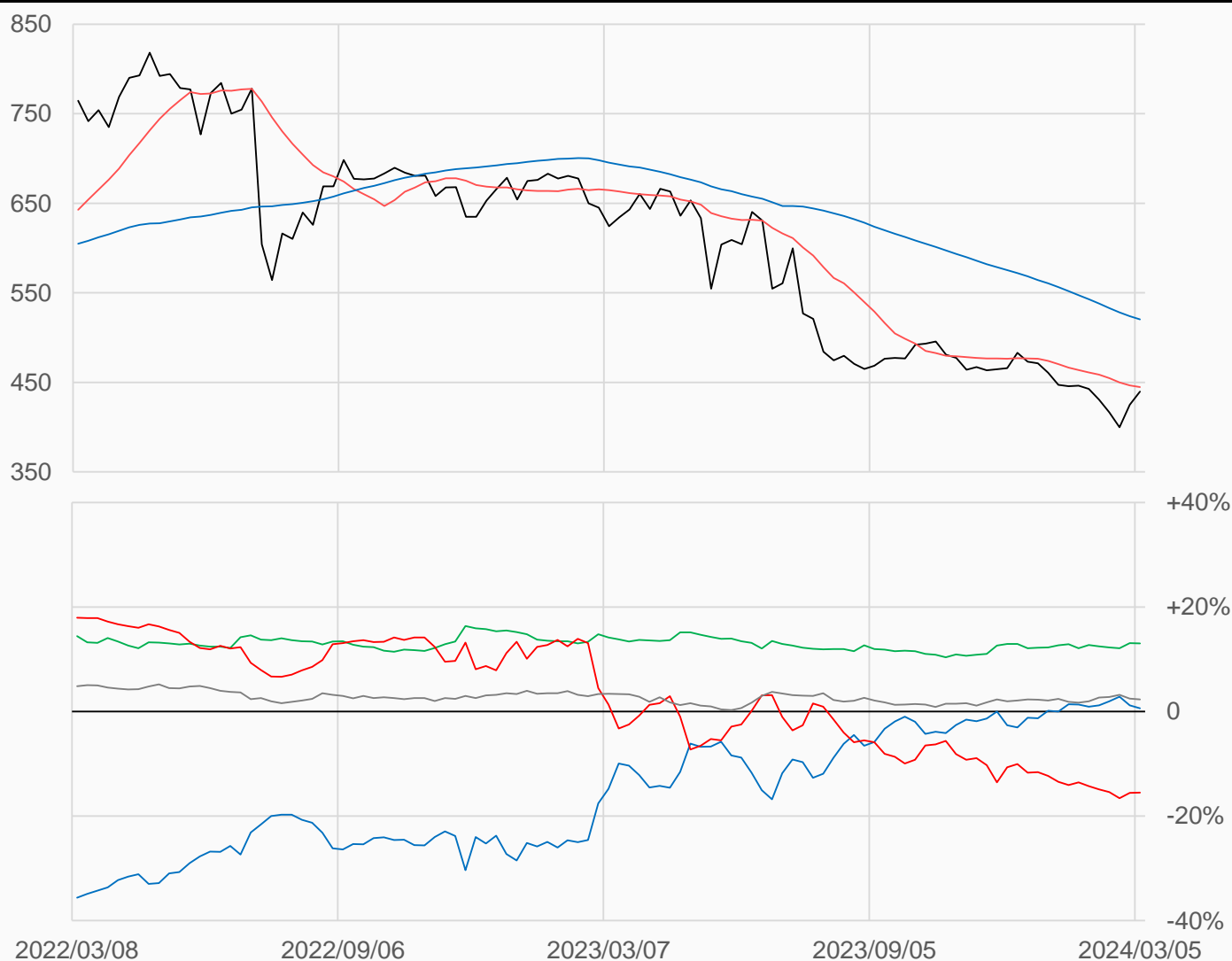
# 玉米

玉米較前一週上漲15點收在439.75點，  
管理基金多單增加20342口，空單增加21879口，  
淨空單較前一週增加1537口至296795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
2024/03/05	1896360	1914649	+18289	+0.96%	439.75	↑ +15.00
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	450761	-26493	439337	-15784	+11424	-10709
互換交易	303672	+8641	54127	+6900	+249545	+1741
管理基金	493876	+20342	790671	+21879	-296795	-1537
其他	465137	+10075	420780	+12860	+44357	-2785

週五收盤價與13週與52週平均線

— ZC — 13週 444.67 — 52週 520.29



淨部位佔總OI% 生產 +0.6% 互換 +13.0% 管理 -15.5% 其他 +2.3%

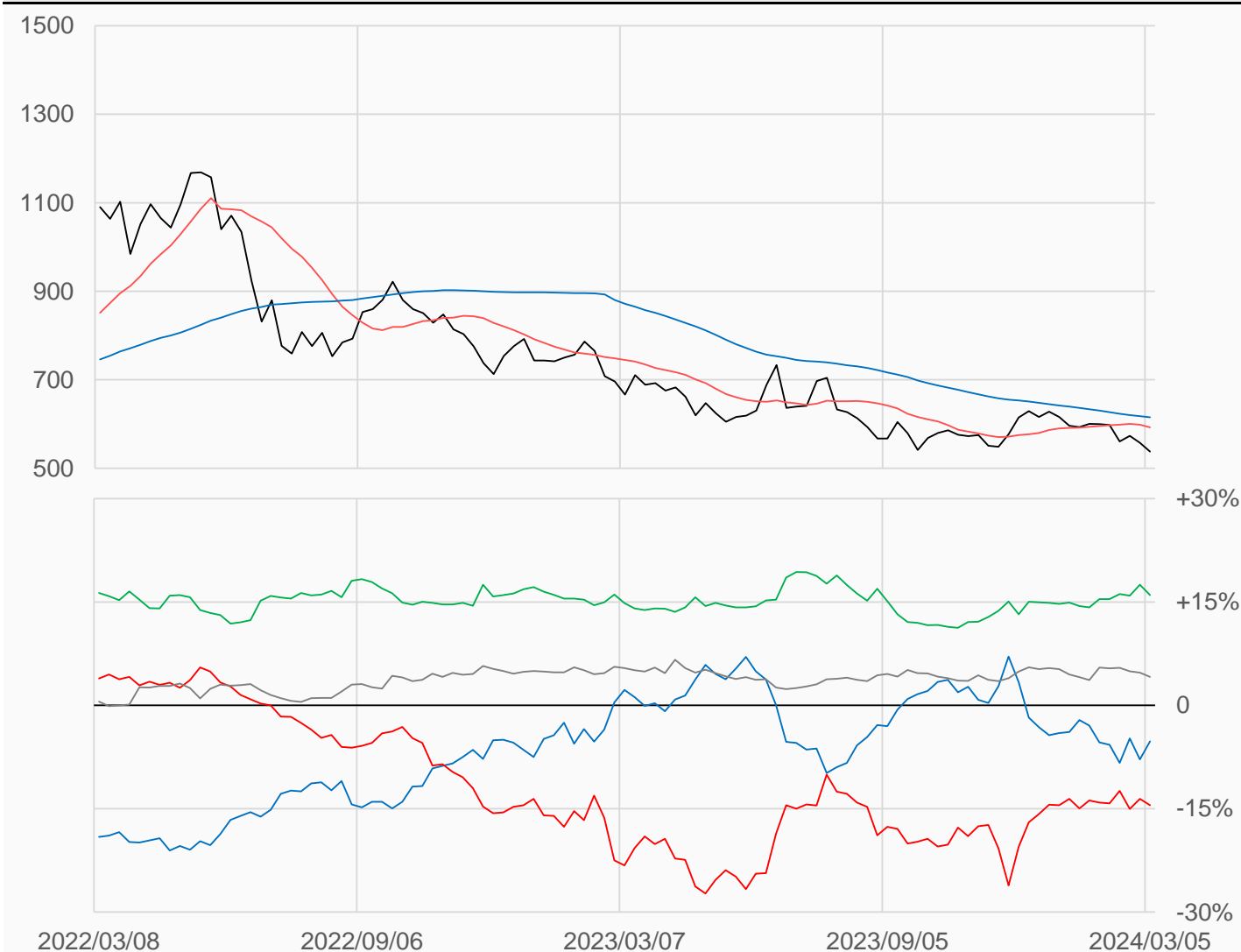
# 小麥

小麥較前一週下跌20點收在537.75點，  
 管理基金多單增加14885口，空單增加24098口，  
 淨空單較前一週增加9213口至65539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
2024/03/05	414999	451756	+36757	+8.86%	537.75	↓ -20.00
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	57190	+7888	80783	-1067	-23593	+8955
互換交易	97875	+1590	25632	+2021	+72243	-431
管理基金	167358	+14885	232897	+24098	-65539	-9213
其他	96228	+10010	77639	+11154	+18589	-1144

週五收盤價與13週與52週平均線

— ZW — 13週 592.77 — 52週 615.26



淨部位佔總OI% 生產 -5.2% 互換 +16.0% 管理 -14.5% 其他 +4.1%

# 黃豆

黃豆較前一週上漲32.75點收在1184點，  
 管理基金多單增加1928口，空單增加13274口，  
 淨空單較前一週增加11346口至171999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
2024/03/05	922159	927931	+5772	+0.63%	1184.00	↑ +32.75
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	321278	-508	250890	-5419	+70388	+4911
互換交易	163269	+7040	28164	+2010	+135105	+5030
管理基金	160636	+1928	332635	+13274	-171999	-11346
其他	224751	-1516	247517	-465	-22766	-1051

週五收盤價與13週與52週平均線

— ZS — 13週 1215.4 — 52週 1350.4



淨部位佔總OI% 生產 +7.6% 互換 +14.6% 管理 -18.5% 其他 -2.5%

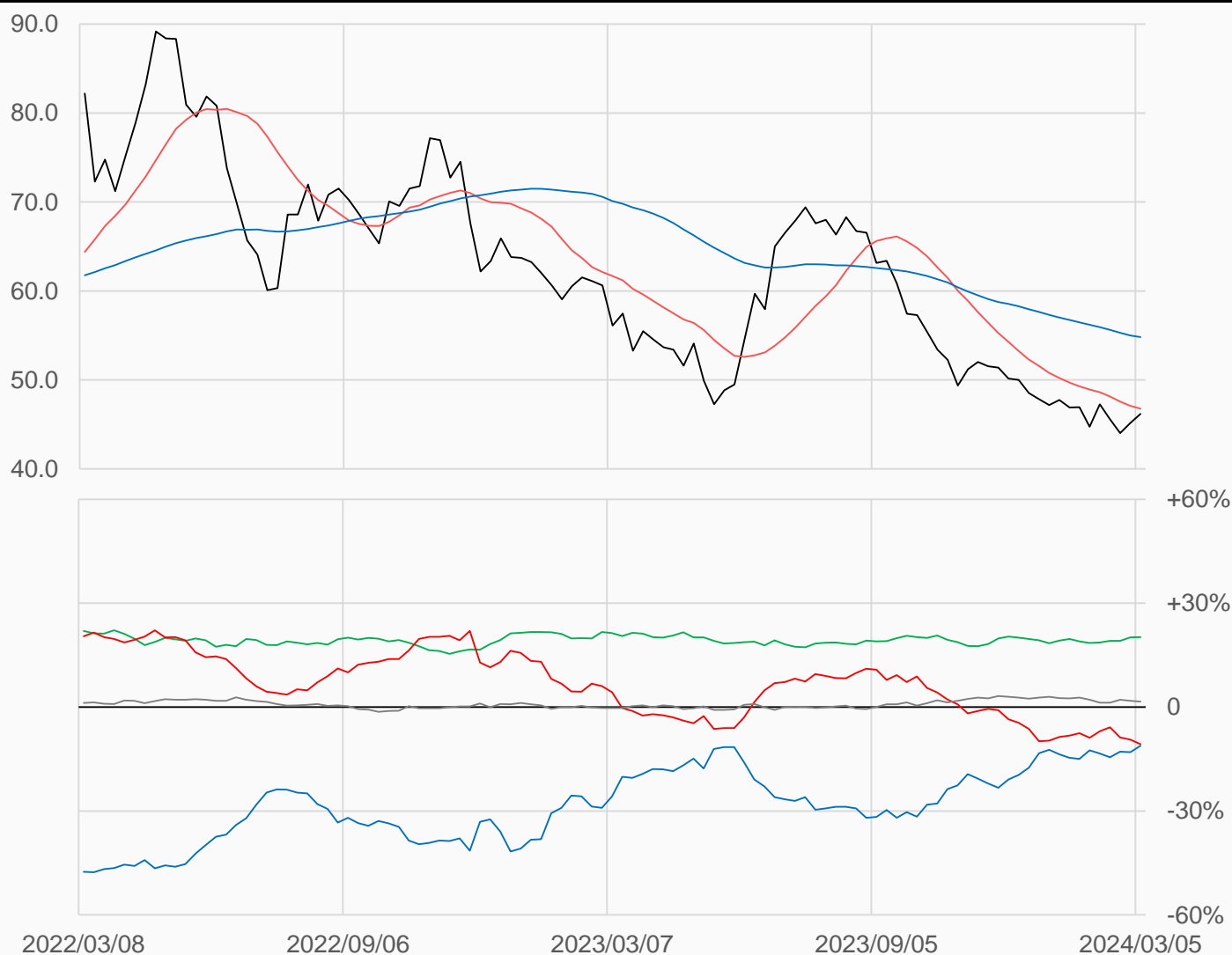
# 黃豆油

黃豆油較前一週上漲1.01點收在46.17點，  
 管理基金多單增加4165口，空單增加14309口，  
 淨空單較前一週增加10144口至62473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
2024/03/05	558317	582934	+24617	+4.41%	46.17	↑ +1.01
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	142214	+8935	207238	+1135	-65024	+7800
互換交易	134843	+4445	17118	-802	+117725	+5247
管理基金	175496	+4165	237969	+14309	-62473	-10144
其他	101152	+7518	91834	+8443	+9318	-925

週五收盤價與13週與52週平均線

— BO — 13週 46.772 — 52週 54.814



淨部位佔總OI% 生產 -11.2% 互換 +20.2% 管理 -10.7% 其他 +1.6%

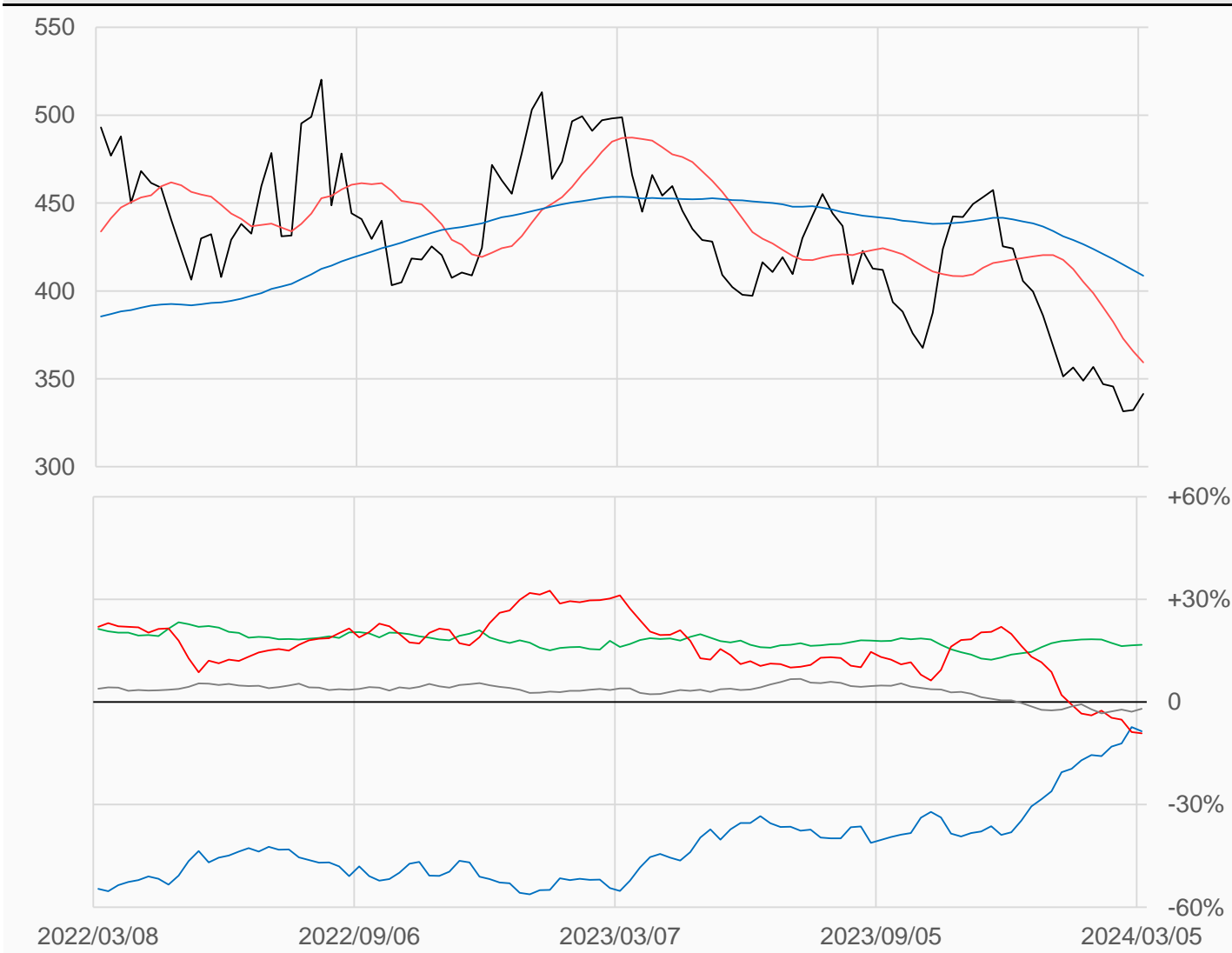
# 黃豆粉

黃豆粉較前一週上漲9.1點收在341.4點，  
 管理基金多單增加7822口，空單增加9698口，  
 淨空單較前一週增加1876口至49526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
2024/03/05	540992	540921	-71	-0.01%	341.4	↑ +9.1
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	155245	-8316	201672	-1549	-46427	-6767
互換交易	104470	+2278	14040	+1271	+90430	+1007
管理基金	135051	+7822	184577	+9698	-49526	-1876
其他	96487	-980	107330	-5635	-10843	+4655

週五收盤價與13週與52週平均線

— SM — 13週 359.32 — 52週 408.73



淨部位佔總OI% 生產 -8.6% 互換 +16.7% 管理 -9.2% 其他 -2.0%

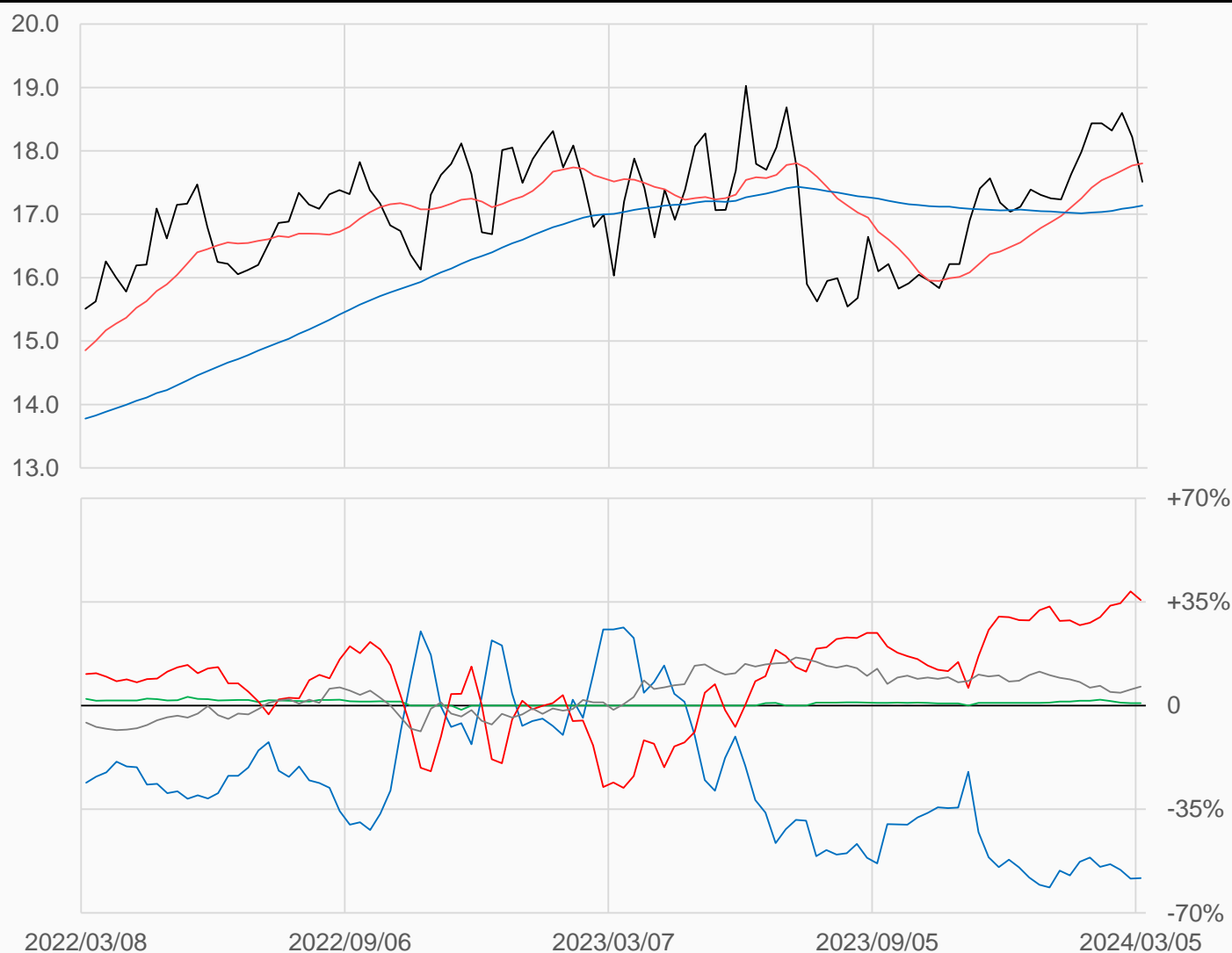
# 粗米

粗米較前一週下跌0.71點收在17.51點，  
 管理基金多單減少373口，空單增加15口，  
 淨多單較前一週減少388口至4500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
2024/03/05	12674	12633	-41	-0.32%	17.510	↓ -0.710
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	2557	-15	9910	-67	-7353	+52
互換交易	107	-1	0	0	+107	-1
管理基金	5171	-373	671	+15	+4500	-388
其他	1786	+68	977	-52	+809	+120

週五收盤價與13週與52週平均線

— RR — 13週 17.803 — 52週 17.138



淨部位佔總OI% 生產 -58.2% 互換 +0.8% 管理 +35.6% 其他 +6.4%



# 咖啡

咖啡較前一週上漲7.85點收在192.2點，  
管理基金多單增加3956口，空單增加3259口，  
淨多單較前一週增加697口至43362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
2024/03/05	239537	247549	+8012	+3.34%	192.20	↑ +7.85
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	50125	-464	109360	+1771	-59235	-2235
互換交易	40296	+1201	34161	+1545	+6135	-344
管理基金	97054	+3956	53692	+3259	+43362	+697
其他	51962	+2829	43902	+2125	+8060	+704

週五收盤價與13週與52週平均線

— KC — 13週 189.11 — 52週 175.09



淨部位佔總OI% 生產 -23.9% 互換 +2.5% 管理 +17.5% 其他 +3.3%

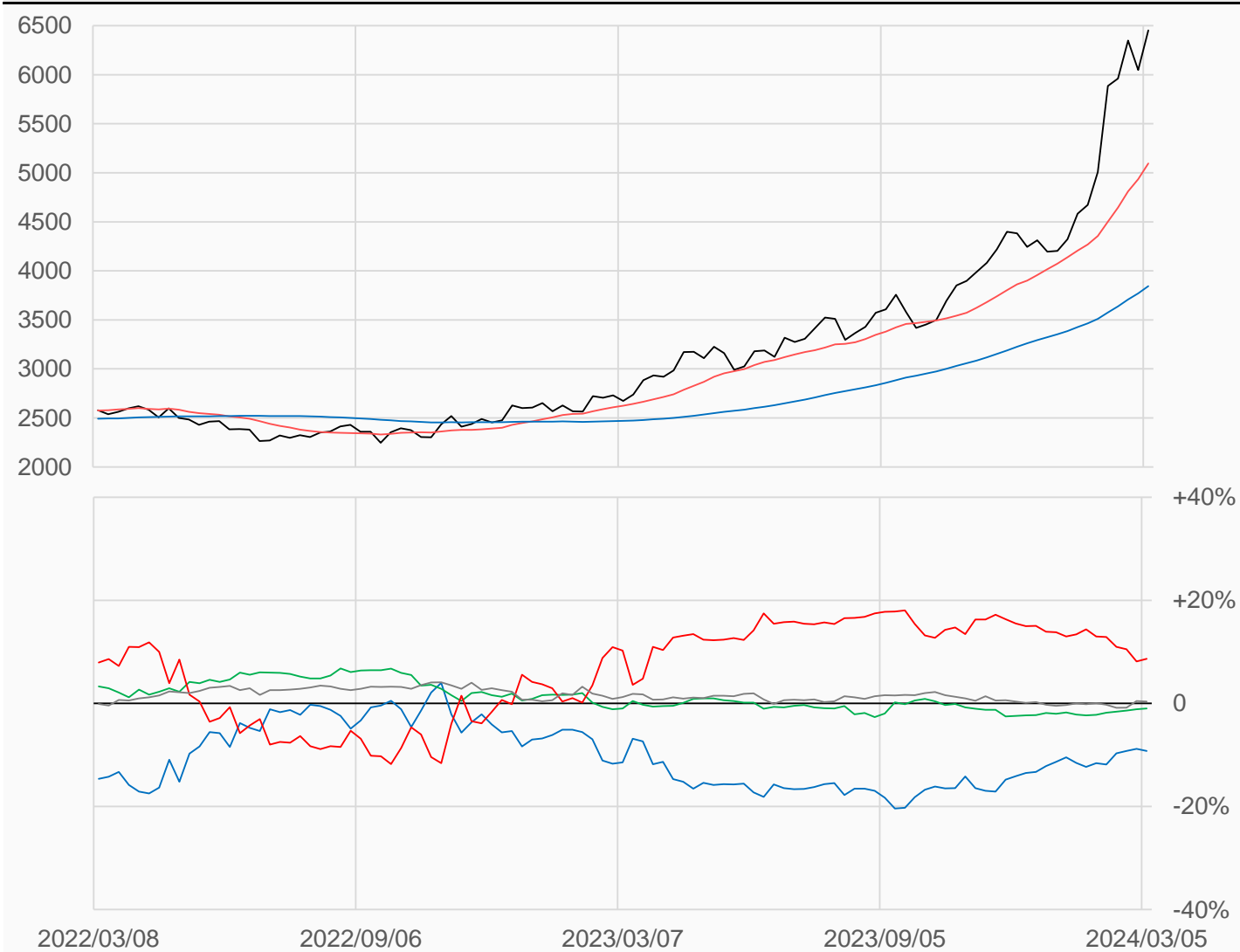
# 可可

可可較前一週上漲403點收在6452點，  
管理基金多單減少6087口，空單減少5724口，  
淨多單較前一週減少363口至31965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
2024/03/05	396177	369829	-26348	-6.65%	6452	↑ +403
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	83529	-5460	117747	-6267	-34218	+807
互換交易	21945	+307	25561	-694	-3616	+1001
管理基金	137784	-6087	105819	-5724	+31965	-363
其他	112296	-14326	110951	-13841	+1345	-485

週五收盤價與13週與52週平均線

— CC — 13週 5095.2 — 52週 3844.1



淨部位佔總OI% 生產 -9.3% 互換 -1.0% 管理 +8.6% 其他 +0.4%

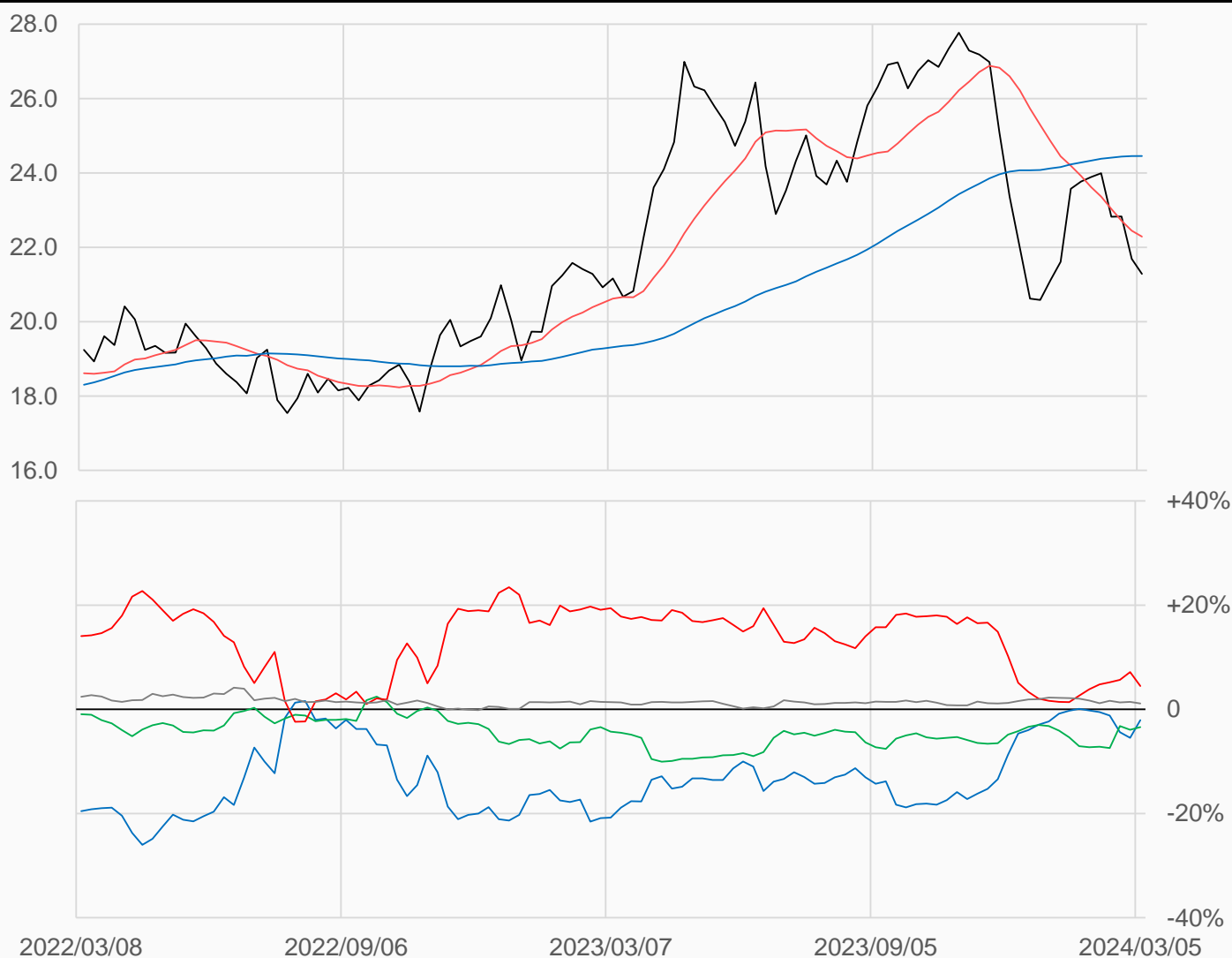
# 11號糖

11號糖較前一週下跌0.41點收在21.28點，  
 管理基金多單增加14930口，空單增加39999口，  
 淨多單較前一週減少25069口至45545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
2024/03/05	991472	1018600	+27128	+2.74%	21.28	↓ -0.41
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	336769	+5287	357846	-27946	-21077	+33233
互換交易	174955	+6583	209776	+2437	-34821	+4146
管理基金	262753	+14930	217208	+39999	+45545	-25069
其他	178238	+5987	166596	+8316	+11642	-2329

週五收盤價與13週與52週平均線

— SB — 13週 22.288 — 52週 24.454



淨部位佔總OI% 生產 -2.1% 互換 -3.4% 管理 +4.5% 其他 +1.1%

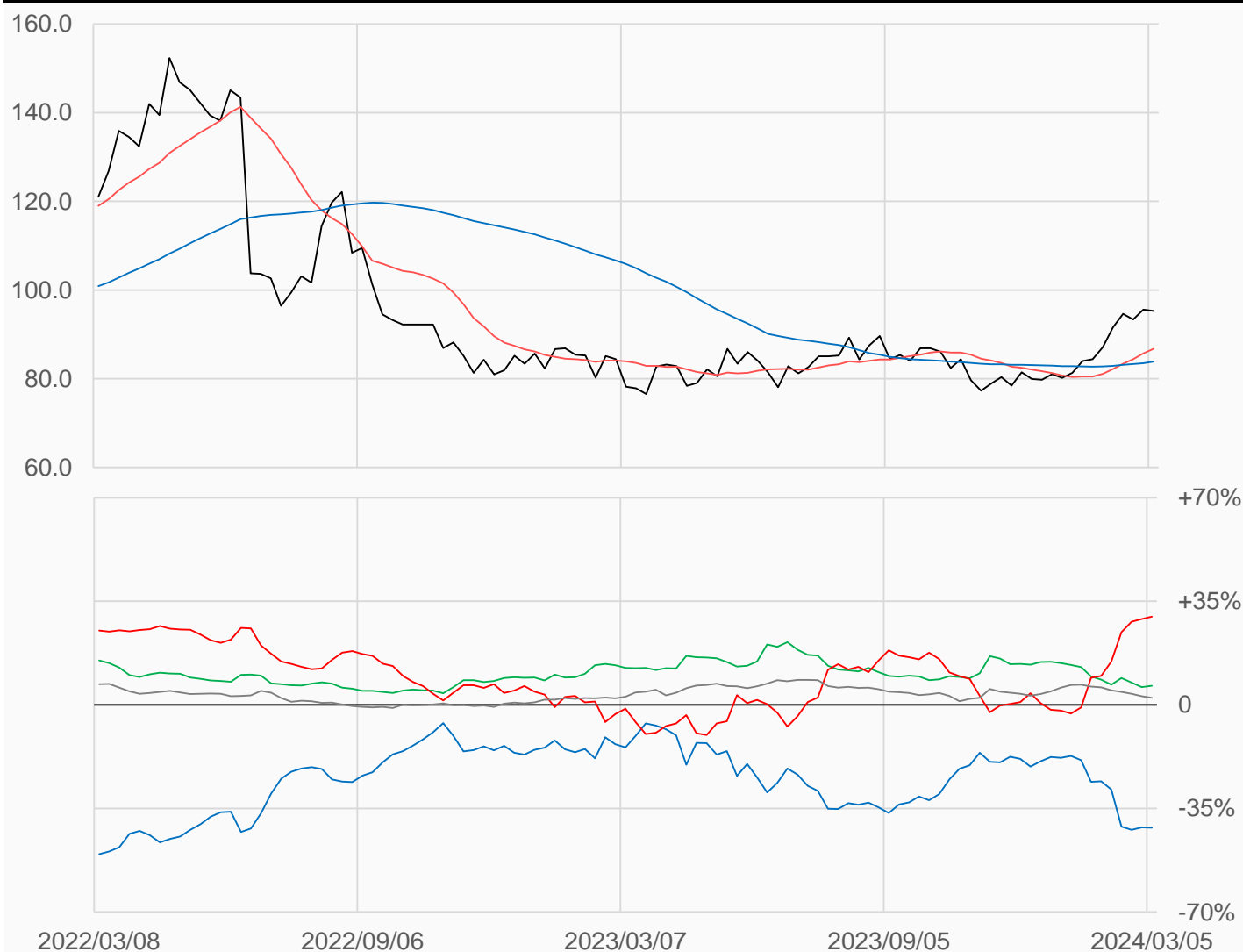
# 棉花

棉花較前一週下跌0.29點收在95.28點，  
 管理基金多單減少3166口，空單減少5489口，  
 淨多單較前一週增加2323口至96361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
2024/03/05	324111	323096	-1015	-0.31%	95.28	↓ -0.29
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	39807	+608	173853	+390	-134046	+218
互換交易	61943	-267	40956	-1744	+20987	+1477
管理基金	131397	-3166	35036	-5489	+96361	+2323
其他	71731	+3121	64028	+4940	+7703	-1819

週五收盤價與13週與52週平均線

— CT — 13週 86.771 — 52週 83.853



淨部位佔總OI% 生產 -41.5% 互換 +6.5% 管理 +29.8% 其他 +2.4%