

CFTC 大額交易人持倉報告

永豐期貨顧問事業部編製

2024/3/18

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 2024/03/12

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	112394	+13203	+1746	-4912	+1.55%
	VX	375710	+11212	-18828	-610	-5.01%
	ES	4082106	+499372	-483430	-74803	-11.84%
	NQ	382396	+45355	-63880	-5549	-16.71%
債券	10年債	5015594	+41685	-1176449	-6696	-23.46%
	30年債	1663317	+24312	-393740	-34534	-23.67%
	5年債	6160976	+26195	-1890489	+45857	-30.68%
	2年債	3703993	+39992	-1429886	+2582	-38.60%
外匯	英鎊	310143	+52975	+22654	-5533	+7.30%
	紐幣	52728	+2599	+3273	-3294	+6.21%
	綜美(未含)	1104776	+11585	+40117	+7303	+3.63%
	綜美(含美)	1131167	+9496	+36424	+12516	+3.22%
	歐元	797868	+1336	-21294	-4962	-2.67%
	澳幣	242105	-7643	-9724	-13189	-4.02%
	瑞郎	90827	+2586	-7194	-2278	-7.92%
	加幣	209294	+6420	-21258	-5429	-10.16%
	美元	26391	-2089	-3693	+5213	-13.99%
	日圓	362894	+7256	-74854	+3649	-20.63%

金融類投機部位每週變動表

數據日期 2024/03/12

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	776137	+70068	+159560	+28500	+20.56%
	白銀	175805	+9473	+26661	+11132	+15.17%
	銅	249969	+32788	+8546	+17144	+3.42%
	白金	93285	-9110	-2453	+17594	-2.63%
能源	無鉛汽油	379544	+10156	+66769	+6735	+17.59%
	輕原油	2177329	+78557	+169893	-14068	+7.80%
	熱燃油	316953	-411	+10937	-6015	+3.45%
	天然氣	1613883	+64729	-98042	+8666	-6.07%
肉類	活豬	361522	+371	+63679	-1410	+17.61%
	活牛	406781	-1311	+63311	+3945	+15.56%
農產	粗米	12188	-445	+3689	-811	+30.27%
	黃豆油	595795	+12861	-33410	+29064	-5.61%
	黃豆粉	535541	-5380	-50935	-1409	-9.51%
	玉米	1961433	+46783	-255928	+40867	-13.05%
	黃豆	951826	+23895	-155137	+16861	-16.30%
	小麥	451363	-394	-78870	-13331	-17.47%
軟性	棉花	328311	+5215	+93160	-3201	+28.38%
	咖啡	244398	-3151	+47069	+3707	+19.26%
	可可	374405	+4577	+33678	+1713	+9.00%
	11號糖	997591	-21009	+52171	+6626	+5.23%

mini 道瓊

mini道瓊較前一週上漲397點收在39153點，
 槓桿基金多單增加6432口，空單增加11345口，
 淨多單較前一週減少73.78%或4913口至1746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
2024/03/12	99191	112394	+13203	+13.31%	39153	↑ +397
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	37309	+1028	58715	+2817	-21406	-1789
資產管理	25138	+3605	7447	-2703	+17691	+6308
槓桿基金	31321	+6432	29575	+11345	+1746	-4913
其他	2489	+770	2654	-225	-165	+995

週五收盤價與13週與52週平均線

— YM — 13週 38460 — 52週 35376



淨部位佔總OI% 經紀 -19.0% 資管 +15.7% 槓桿 +1.6% 其他 -0.1%

mini NQ

miniNQ較前一週上漲12點收在18058.75點，
 槓桿基金多單增加15451口，空單增加21000口，
 淨空單較前一週增加5549口至63880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
2024/03/12	337041	382396	+45355	+13.46%	18058.75	↑ +12.00
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	91540	+14061	121817	+9011	-30277	+5050
資產管理	123197	+9890	40398	+8856	+82799	+1034
槓桿基金	104847	+15451	168727	+21000	-63880	-5549
其他	14691	+4043	8878	+1132	+5813	+2911

週五收盤價與13週與52週平均線

— NQ — 13週 17565 — 52週 15500



淨部位佔總OI% 經紀 -7.9% 資管 +21.7% 槓桿 -16.7% 其他 +1.5%

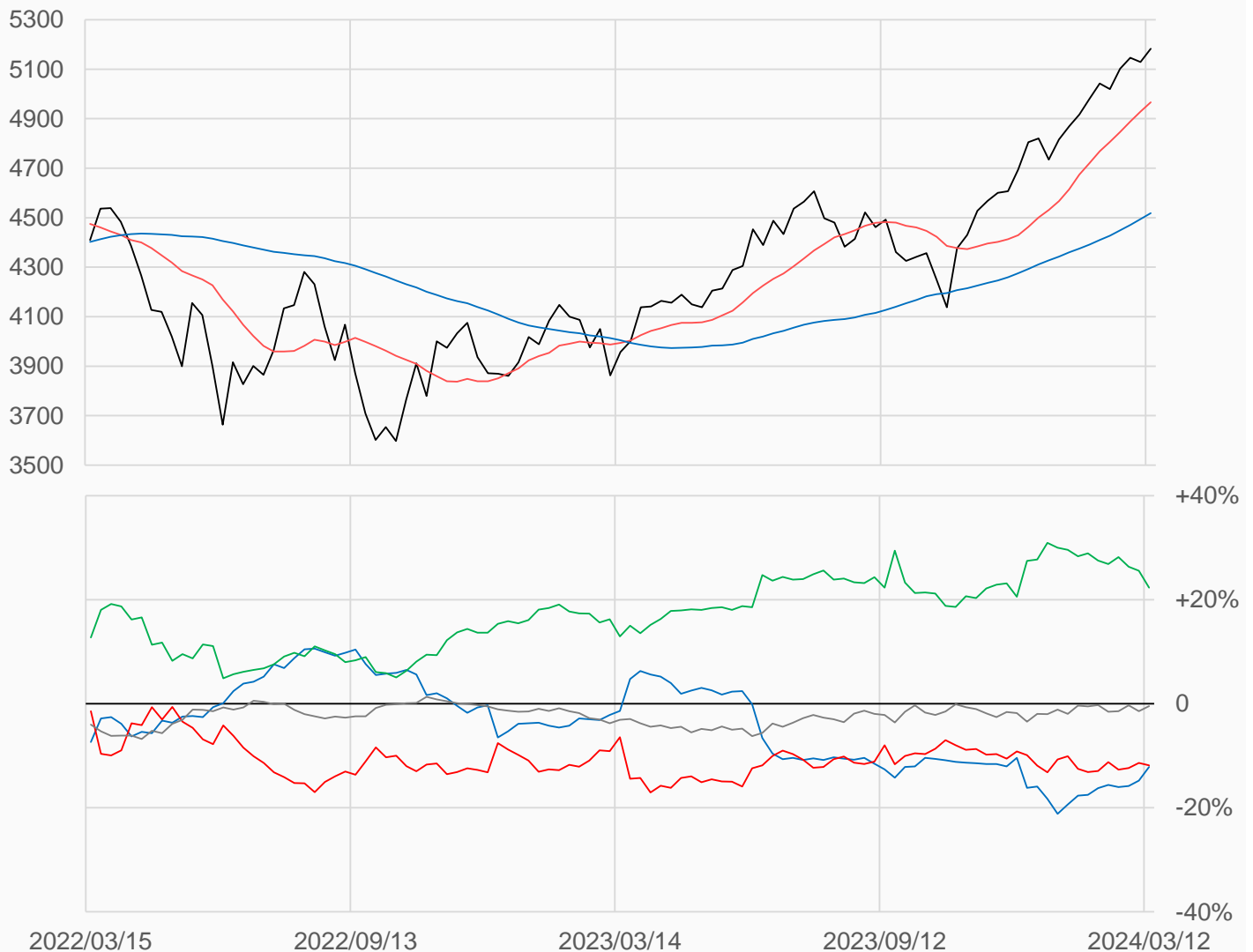
mini S&P

miniS&P較前一週上漲53.75點收在5182.75點，
 槓桿基金多單增加200707口，空單增加275510口，
 淨空單較前一週增加74803口至483430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
2024/03/12	3582734	4082106	+499372	+13.94%	5182.75	↑ +53.75
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	730960	+115494	1227945	+82943	-496985	+32551
資產管理	1380875	+62265	469198	+66752	+911677	-4487
槓桿基金	1334769	+200707	1818199	+275510	-483430	-74803
其他	291121	+94566	309207	+60826	-18086	+33740

週五收盤價與13週與52週平均線

— ES — 13週 4966.4 — 52週 4518.3



淨部位佔總OI% 經紀 -12.2% 資管 +22.3% 槓桿 -11.8% 其他 -0.4%

VIX

VIX較前一週下跌0.48點收在14.59點，
槓桿基金多單增加3331口，空單增加3941口，
淨空單較前一週增加610口至18828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
2024/03/12	364498	375710	+11212	+3.08%	14.59	↓ -0.48
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	80533	+8492	48869	+5647	+31664	+2845
資產管理	109001	-5402	124206	+2364	-15205	-7766
槓桿基金	135556	+3331	154384	+3941	-18828	-610
其他	21201	+4960	17311	+981	+3890	+3979

週五收盤價與13週與52週平均線

— VX — 13週 13.721 — 52週 15.243



淨部位佔總OI% 經紀 +8.4% 資管 -4.0% 槓桿 -5.0% 其他 +1.0%

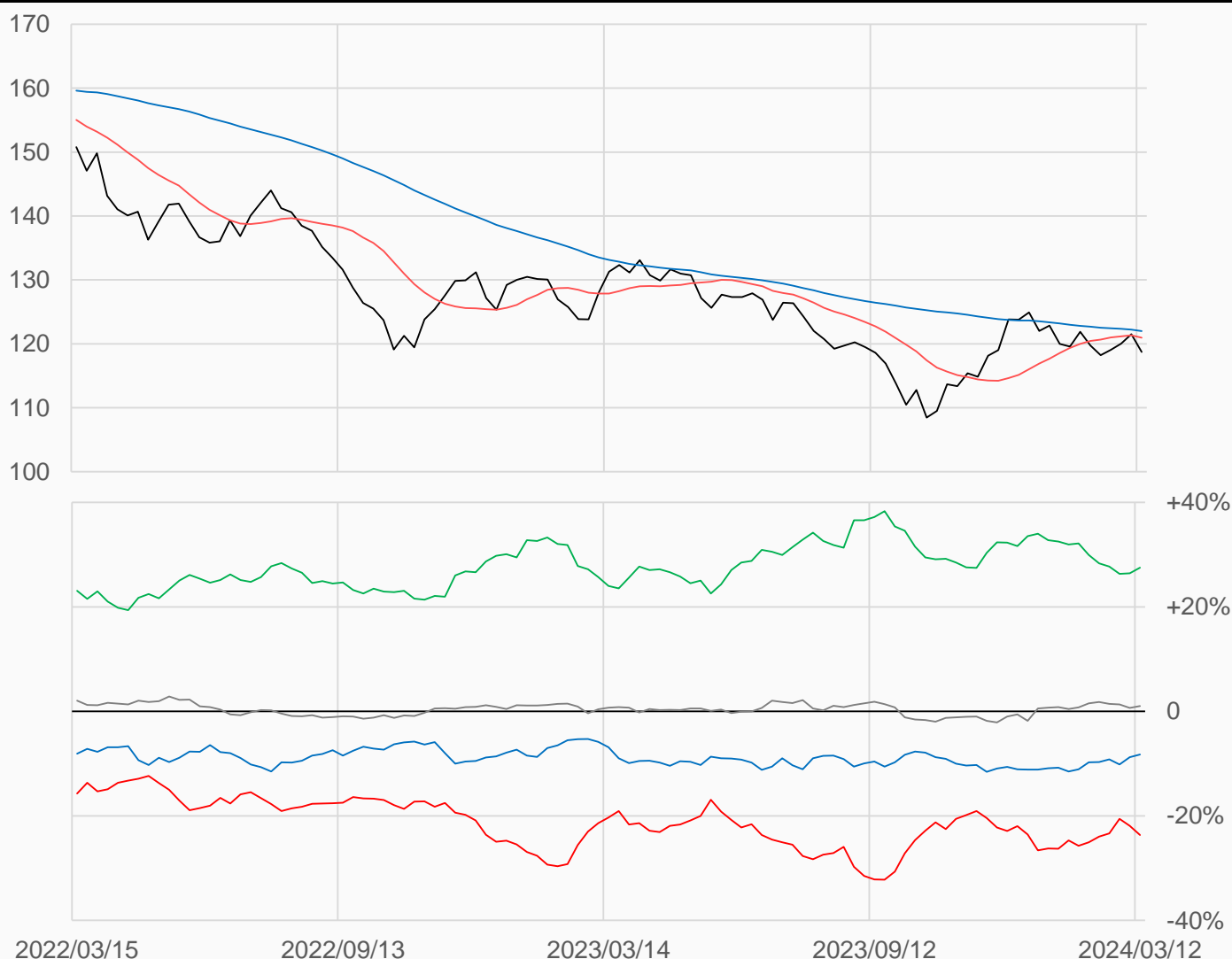
30年債

美國30年公債較前一週下跌2.7813點收在118.71875點，
 槓桿基金多單減少11175口，空單增加23358口，
 淨空單較前一週增加34533口至393740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
2024/03/12	1639005	1663317	+24312	+1.48%	118 23/32	↓ -2 25/32
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	69693	+6428	207433	+304	-137740	+6124
資產管理	992660	+34770	535379	+10987	+457281	+23783
槓桿基金	275751	-11175	669491	+23358	-393740	-34533
其他	115986	+2594	99188	-3028	+16798	+5622

週五收盤價與13週與52週平均線

— US — 13週 120.95 — 52週 122



淨部位佔總OI% 經紀 -8.3% 資管 +27.5% 槓桿 -23.7% 其他 +1.0%

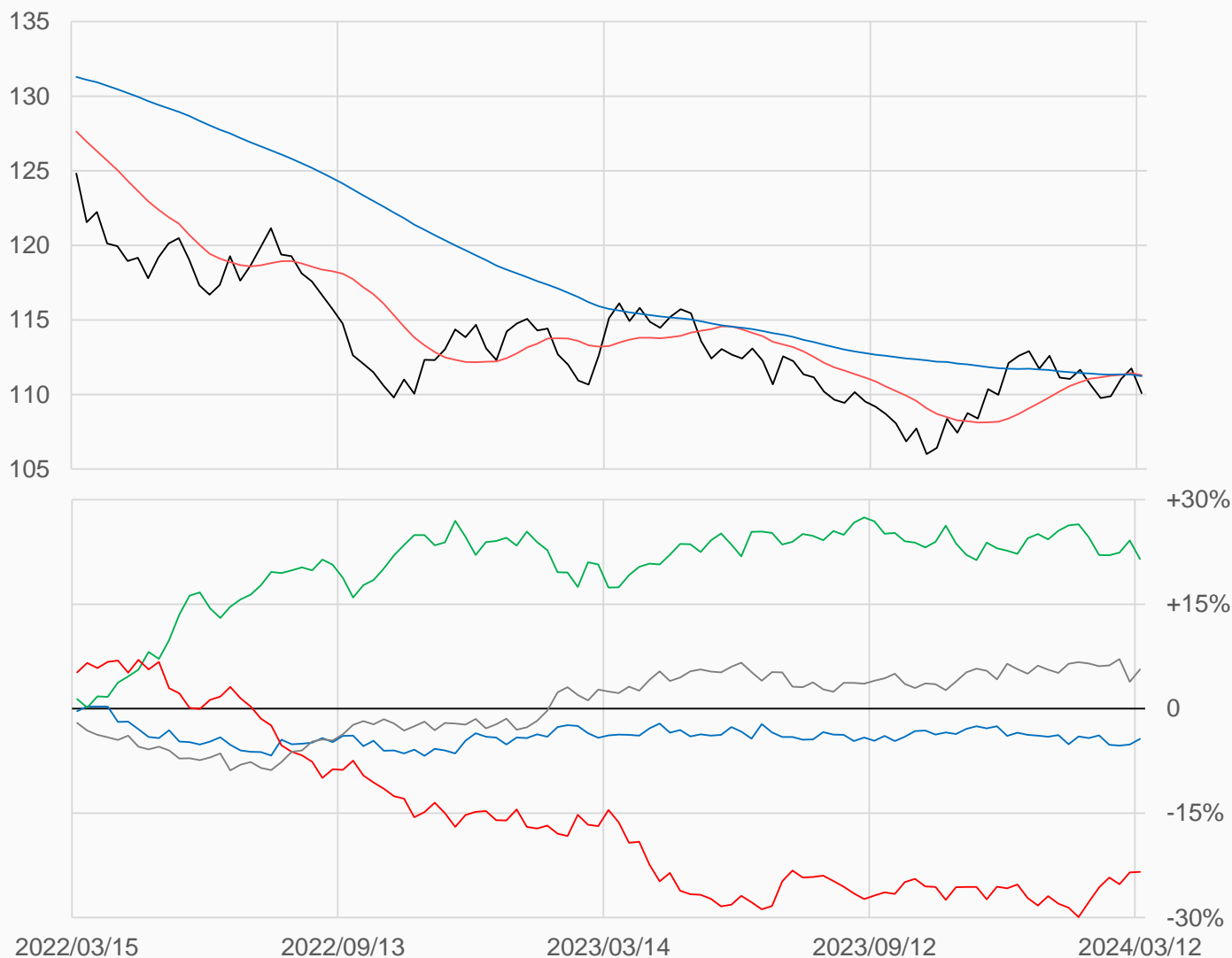
10年債

美國10年公債較前一週下跌1.6563點收在110.078125點，
 槓桿基金多單增加3025口，空單增加9721口，
 淨空單較前一週增加6696口至1176449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
2024/03/12	4973909	5015594	+41685	+0.84%	110 5/64	↓ -1 42/64
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	332768	+43240	551156	+5369	-218388	+37871
資產管理	2912514	-15841	1835219	+107985	+1077295	-123826
槓桿基金	813449	+3025	1989898	+9721	-1176449	-6696
其他	545248	+44251	263950	-45557	+281298	+89808

週五收盤價與13週與52週平均線

— TY — 13週 111.29 — 52週 111.23



淨部位佔總OI% 經紀 -4.4% 資管 +21.5% 槓桿 -23.5% 其他 +5.6%

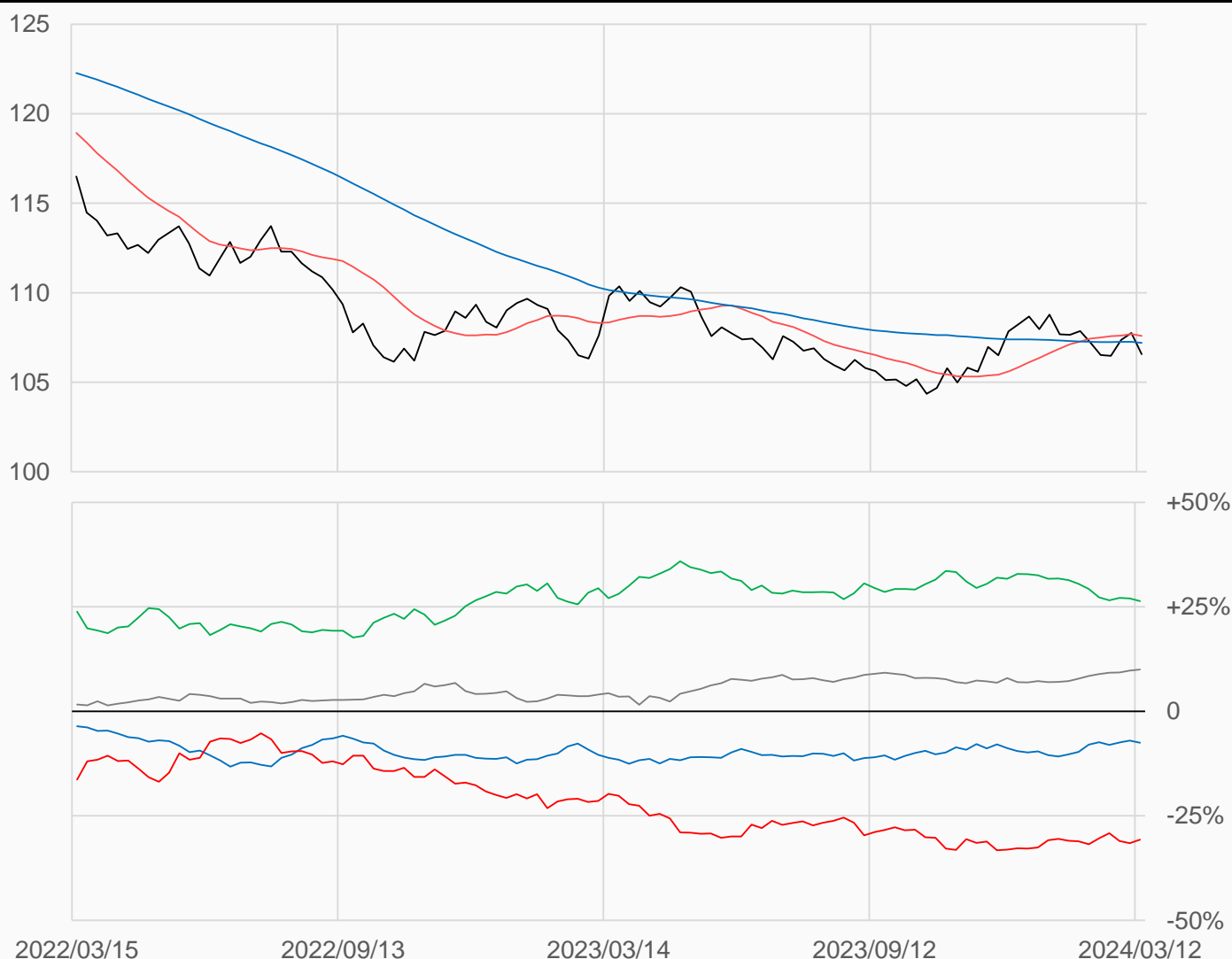
5年公債

美國5年公債較前一週下跌1.1875點收在106.5625點，
 槓桿基金多單增加26471口，空單減少19386口，
 淨空單較前一週減少45857口至1890489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
2024/03/12	6134781	6160976	+26195	+0.43%	106 72/128	↓ -1 24/128
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	273663	-8978	735255	+21612	-461592	-30590
資產管理	3581076	-7463	1954597	+24553	+1626479	-32016
槓桿基金	1185080	+26471	3075569	-19386	-1890489	+45857
其他	708987	+18544	92711	+1955	+616276	+16589

週五收盤價與13週與52週平均線

— FV — 13週 107.59 — 52週 107.2



淨部位佔總OI% 經紀 -7.5% 資管 +26.4% 槓桿 -30.7% 其他 +10.0%

2年公債

美國2年公債較前一週下跌0.5273點收在102.1328125點，

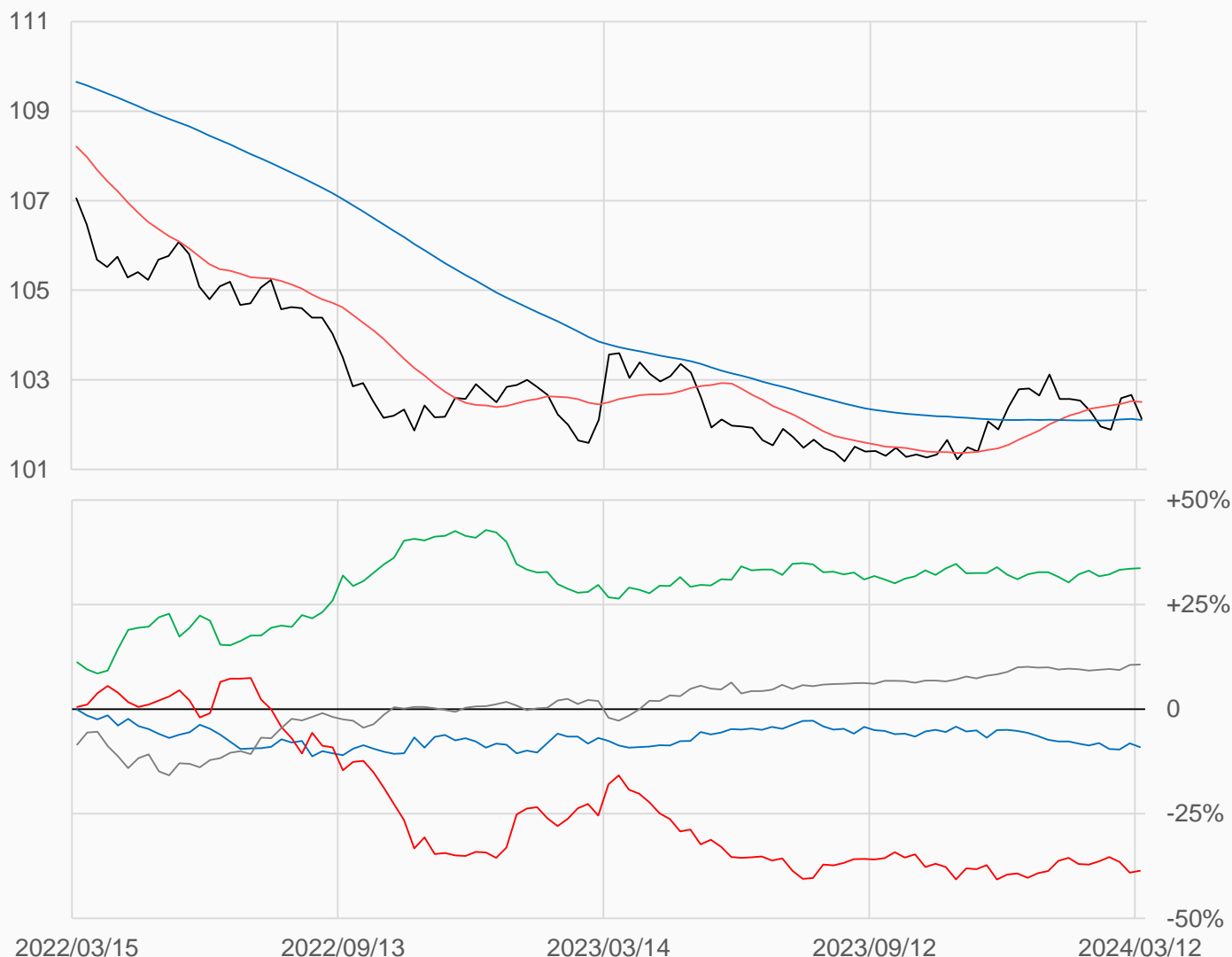
槓桿基金多單減少9818口，空單減少12401口，

淨空單較前一週減少2583口至1429886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
2024/03/12	3664001	3703993	+39992	+1.09%	102 17/128	↓ - 68/128
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	147600	-601	482455	+33956	-334855	-34557
資產管理	2116383	+30513	867648	+12494	+1248735	+18019
槓桿基金	646510	-9818	2076396	-12401	-1429886	+2583
其他	538927	+11248	143319	+4097	+395608	+7151

週五收盤價與13週與52週平均線

— TU — 13週 102.5 — 52週 102.1



淨部位佔總OI% 經紀 -9.0% 資管 +33.7% 槓桿 -38.6% 其他 +10.7%

歐元

歐元較前一週下跌14點收在10931.5點，
 槓桿基金多單減少1889口，空單增加3073口，
 淨空單較前一週增加4962口至21294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
2024/03/12	796532	797868	+1336	+0.17%	10931.5	↓ -14.0
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	53596	+682	411077	+5004	-357481	-4322
資產管理	479445	+1259	149664	-12391	+329781	+13650
槓桿基金	141669	-1889	162963	+3073	-21294	-4962
其他	36410	-1227	17916	+3051	+18494	-4278

週五收盤價與13週與52週平均線

— EC — 13週 10911 — 52週 10871



淨部位佔總OI% 經紀 -44.8% 資管 +41.3% 槓桿 -2.7% 其他 +2.3%

日圓

日圓較前一週下跌4點收在6805.5點，
 槓桿基金多單減少6055口，空單減少9705口，
 淨空單較前一週減少3650口至74854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
2024/03/12	355638	362894	+7256	+2.04%	6805.5	↓ -4.0
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	143706	+8914	67324	+26937	+76382	-18023
資產管理	76726	+1922	110631	-9561	-33905	+11483
槓桿基金	63167	-6055	138021	-9705	-74854	+3650
其他	28774	+1973	2732	-1319	+26042	+3292

週五收盤價與13週與52週平均線

— JY — 13週 6849.4 — 52週 7005.7



淨部位佔總OI% 經紀 +21.0% 資管 -9.3% 槓桿 -20.6% 其他 +7.2%

英鎊

英鎊較前一週下跌113點收在12745點，
 槓桿基金多單增加28450口，空單增加33981口，
 淨多單較前一週減少5531口至22654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
2024/03/12	257168	310143	+52975	+20.60%	12745	↓ -113
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	56080	+8356	63558	+18549	-7478	-10193
資產管理	94034	+18775	113402	+5273	-19368	+13502
槓桿基金	128171	+28450	105517	+33981	+22654	-5531
其他	1074	-103	4319	+404	-3245	-507

週五收盤價與13週與52週平均線

— BP — 13週 12706 — 52週 12567



淨部位佔總OI% 經紀 -2.4% 資管 -6.2% 槓桿 +7.3% 其他 -1.0%

瑞郎

瑞郎較前一週上漲17點收在11424.5點，
 槓桿基金多單減少5060口，空單減少2782口，
 淨空單較前一週增加2278口至7194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
2024/03/12	88241	90827	+2586	+2.93%	11425	↑ +17
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	40112	+6369	15832	+8192	+24280	-1823
資產管理	20944	+1256	28375	-2790	-7431	+4046
槓桿基金	18379	-5060	25573	-2782	-7194	-2278
其他	1755	-200	465	+465	+1290	-665

週五收盤價與13週與52週平均線

— SF — 13週 11587 — 52週 11343



淨部位佔總OI% 經紀 +26.7% 資管 -8.2% 槓桿 -7.9% 其他 +1.4%

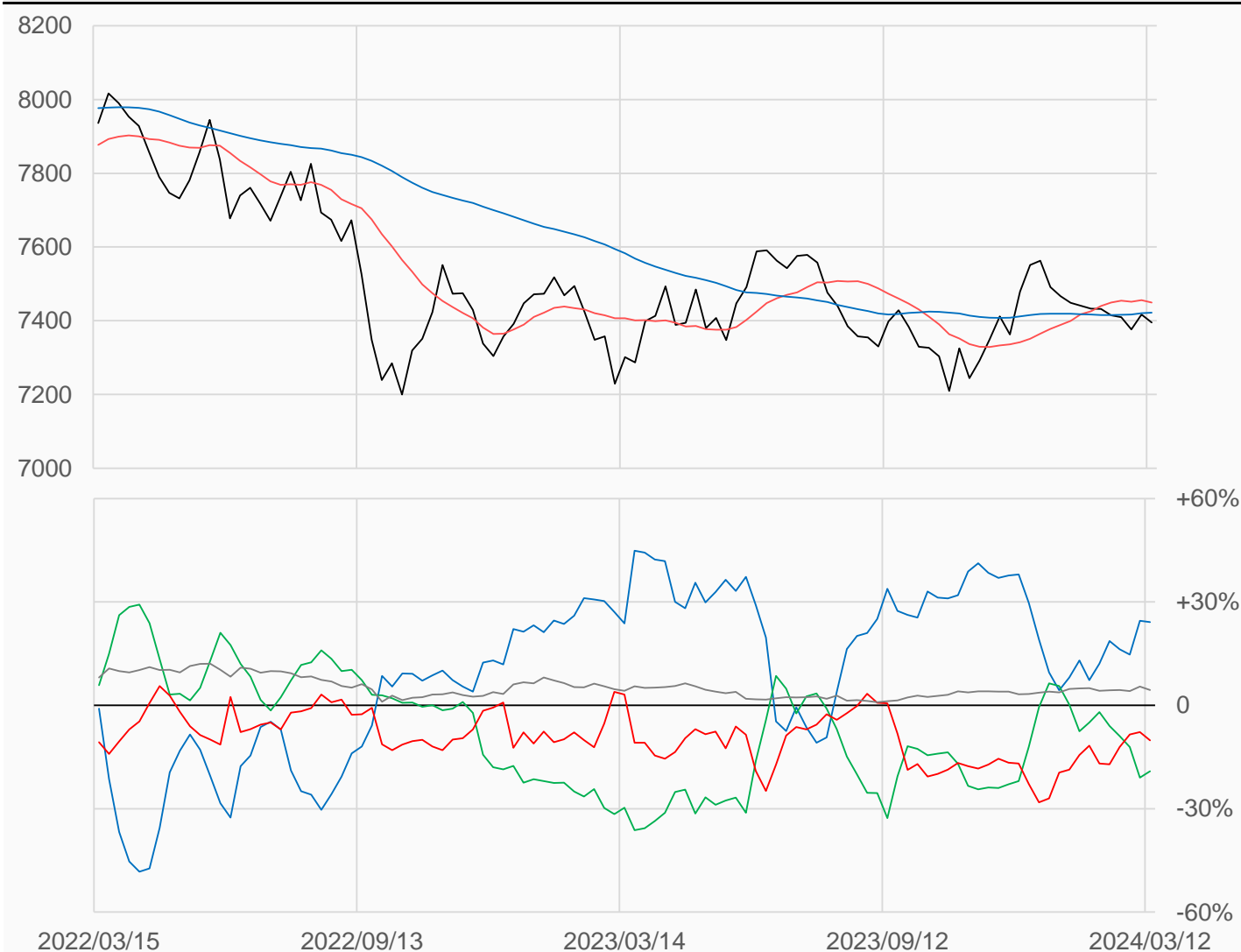
加幣

加幣較前一週下跌21.5點收在7395.5點，
 槓桿基金多單增加796口，空單增加6225口，
 淨空單較前一週增加5429口至21258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
2024/03/12	202874	209294	+6420	+3.16%	7395.5	↓ -21.5
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	72673	+5572	22173	+4822	+50500	+750
資產管理	53505	+417	93589	-2083	-40084	+2500
槓桿基金	38516	+796	59774	+6225	-21258	-5429
其他	12847	-1597	3486	+94	+9361	-1691

週五收盤價與13週與52週平均線

— CD — 13週 7449.2 — 52週 7422.3



淨部位佔總OI% 經紀 +24.1% 資管 -19.2% 槓桿 -10.2% 其他 +4.5%

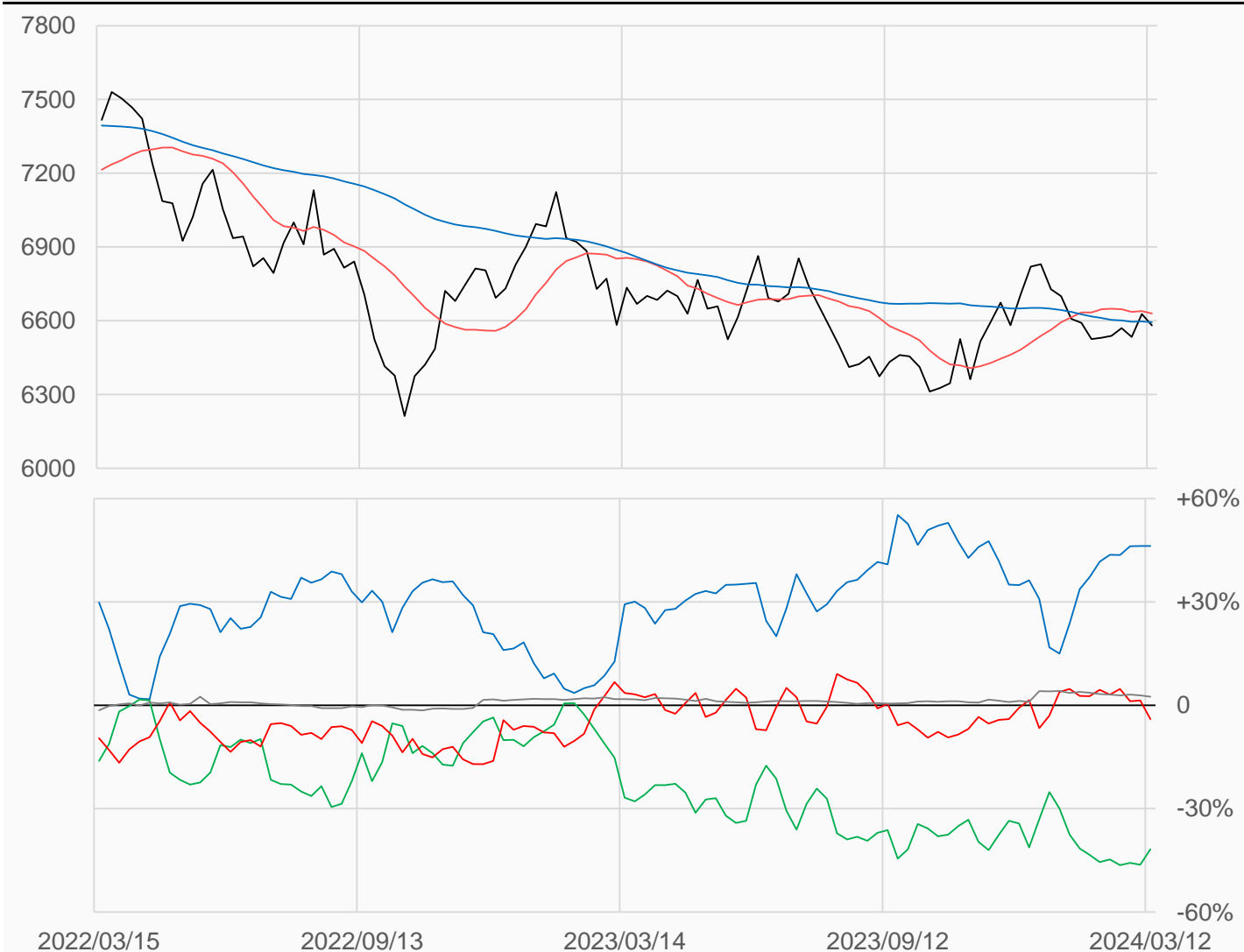
澳幣

澳幣較前一週下跌47點收在6580.5點，
 槓桿基金多單減少6762口，空單增加6427口，
 淨空單較前一週增加13189口至9724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
2024/03/12	249748	242105	-7643	-3.06%	6580.5	↓ -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	121629	-2072	9653	+1388	+111976	-3460
資產管理	38198	+1524	139476	-12693	-101278	+14217
槓桿基金	54340	-6762	64064	+6427	-9724	-13189
其他	6083	-1215	23	-10	+6060	-1205

週五收盤價與13週與52週平均線

— AD — 13週 6629.7 — 52週 6594.3



淨部位佔總OI% 經紀 +46.3% 資管 -41.8% 槓桿 -4.0% 其他 +2.5%

紐幣

紐幣較前一週下跌0.009點收在0.6088點，
 槓桿基金多單減少2508口，空單增加786口，
 淨多單較前一週減少3294口至3273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
2024/03/12	50129	52728	+2599	+5.18%	0.6088	↓ -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	12628	+4795	14017	+3313	-1389	+1482
資產管理	19307	-22	23932	-152	-4625	+130
槓桿基金	15214	-2508	11941	+786	+3273	-3294
其他	873	-90	10	-453	+863	+363

週五收盤價與13週與52週平均線

— NE — 13週 0.6172 — 52週 0.6106



淨部位佔總OI% 經紀 -2.6% 資管 -8.8% 槓桿 +6.2% 其他 +1.6%

美元

美元較前一週上漲0.376點收在103.064點，
 槓桿基金多單增加1321口，空單減少3892口，
 淨空單較前一週減少5213口至3693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
2024/03/12	28480	26391	-2089	-7.33%	103.064	↑ +0.376
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	310	+130	3692	+90	-3382	+40
資產管理	10356	-3052	4162	+1309	+6194	-4361
槓桿基金	10222	+1321	13915	-3892	-3693	+5213
其他	2635	+49	1957	+255	+678	-206

週五收盤價與13週與52週平均線

— DX — 13週 102.94 — 52週 103.23



淨部位佔總OI% 經紀 -12.8% 資管 +23.5% 槓桿 -14.0% 其他 +2.6%

綜合美元 (不含美元)

綜合美元較前一週上漲0.376點收在103.064點，
槓桿基金多單增加7614口，空單增加311口，
淨多單較前一週增加7303口至40117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
2024/03/12	1093192	1104776	+11585	+1.06%	103.064	↑ +0.376
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	513940.6	+15309	117063.9	+4760	+396877	+10548
資產管理	235103.8	-16814	606360.6	+4937	-371257	-21751
槓桿基金	247983.3	+7614	207866.3	+311	+40117	+7303
其他	22819.27	+3443	50866.6	-1301	-28047	+4744

週五收盤價與13週與52週平均線

— DXY — 13週 102.94 — 52週 103.23



淨部位佔總OI% 經紀 +35.9% 資管 -33.6% 槓桿 +3.6% 其他 -2.5%

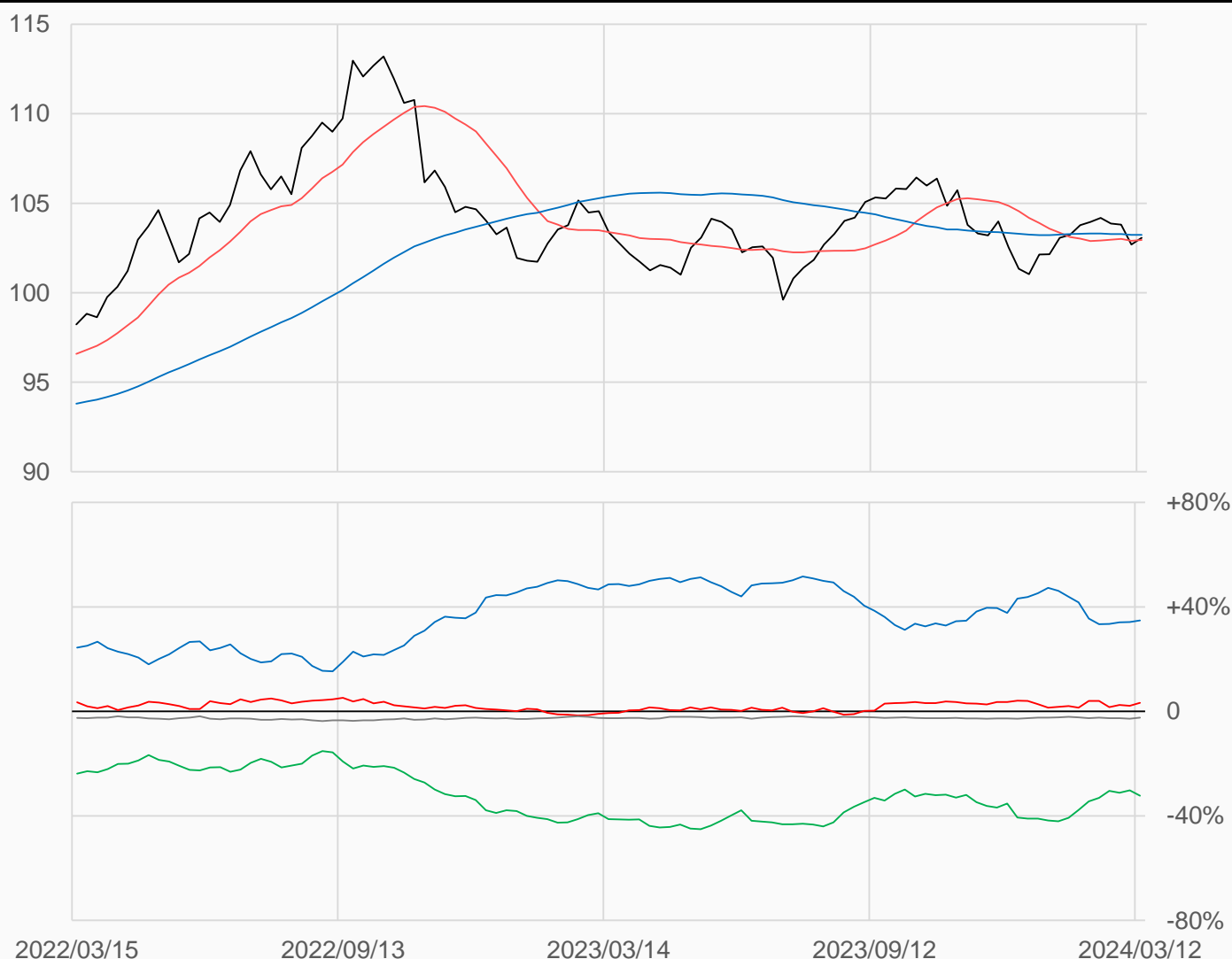
綜合美元 (含美元)

綜合美元較前一週上漲0.376點收在103.064點，
槓桿基金多單增加8935口，空單減少3581口，
淨多單較前一週增加12516口至36424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
2024/03/12	1121672	1131167	+9496	+0.85%	103.064	↑ +0.376
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	514250.6	+15439	120755.9	+4850	+393495	+10588
資產管理	245459.8	-19866	610522.6	+6246	-365063	-26112
槓桿基金	258205.3	+8935	221781.3	-3581	+36424	+12516
其他	25454.27	+3492	52823.6	-1046	-27369	+4538

週五收盤價與13週與52週平均線

— DXX — 13週 102.94 — 52週 103.23



淨部位佔總OI% 經紀 +34.8% 資管 -32.3% 槓桿 +3.2% 其他 -2.4%

黃金

黃金較前一週下跌24點收在2161.5點，
管理基金多單增加31166口，空單增加2666口，
淨多單較前一週增加28500口至159560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
2024/03/12	706068	776137	+70069	+9.92%	2161.5	↓ -24.0
分類	多單OI	增減	空單OI	增減	多空淨部位	淨部位變動
生產商	44346	+19884	96388	+20694	-52042	-810
互換交易	149975	+11635	334922	+26189	-184947	-14554
管理基金	266961	+31166	107401	+2666	+159560	+28500
其他	259696	+3931	196716	+18143	+62980	-14212

週五收盤價與13週與52週平均線

— GC — 13週 2064.8 — 52週 1984.4



淨部位佔總OI% 生產 -6.7% 互換 -23.8% 管理 +20.6% 其他 +8.1%

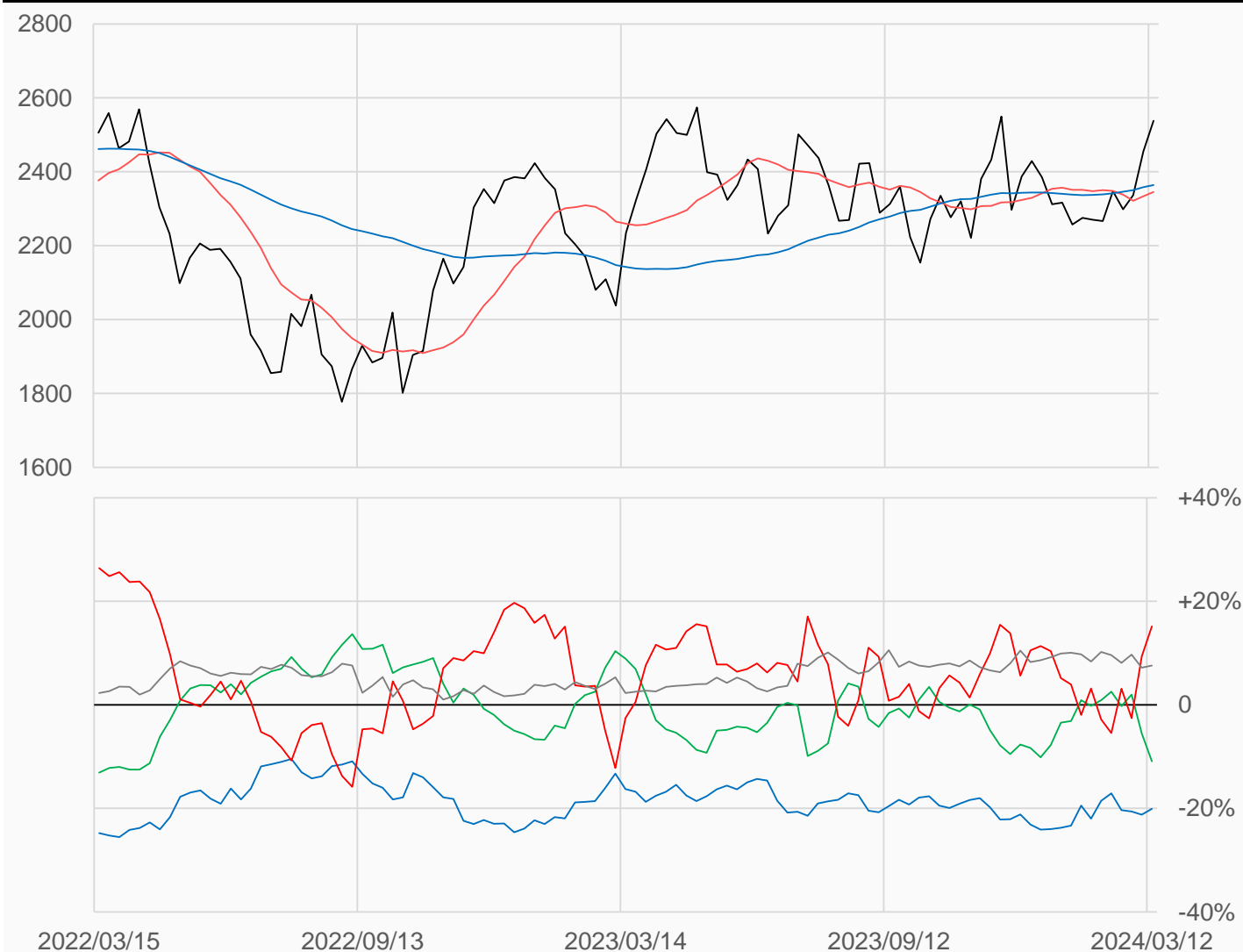
白銀

白銀較前一週上漲83.2點收在2538.1點，
管理基金多單增加3749口，空單減少7382口，
淨多單較前一週增加11131口至26661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
2024/03/12	166332	175805	+9473	+5.70%	2538.1	↑ +83.2
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	7717	+511	43003	+526	-35286	-15
互換交易	40475	-871	59609	+9158	-19134	-10029
管理基金	54456	+3749	27795	-7382	+26661	+11131
其他	42432	+7043	29059	+5638	+13373	+1405

週五收盤價與13週與52週平均線

— SI — 13週 2345.2 — 52週 2364.5



淨部位佔總OI% 生產 -20.1% 互換 -10.9% 管理 +15.2% 其他 +7.6%

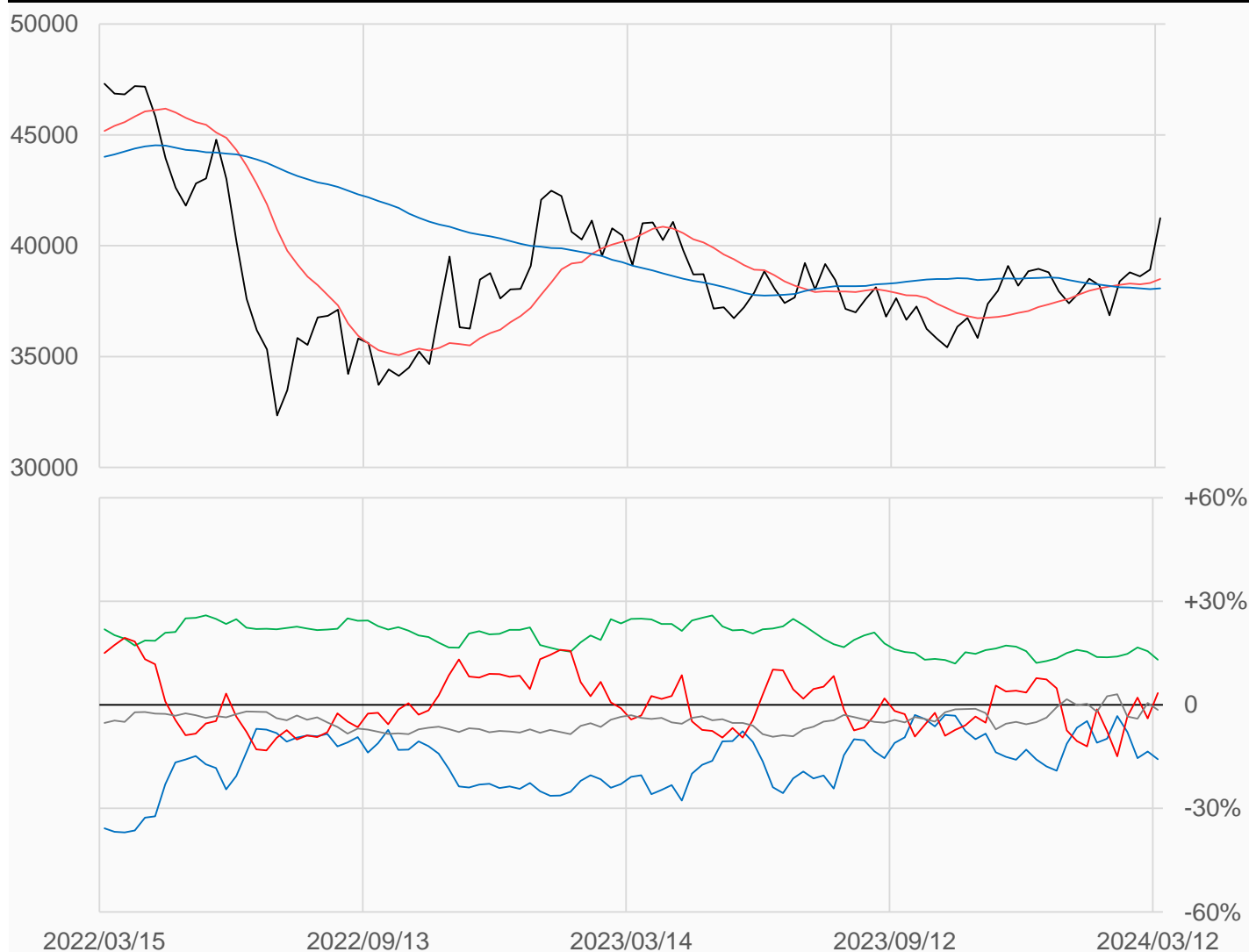
銅

銅較前一週上漲2330點收在41245點，
 管理基金多單增加22769口，空單增加5625口，
 淨多單較前一週增加17144口至8546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
2024/03/12	217182	249969	+32787	+15.10%	41245	↑ +2330
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	21676	-4311	61149	+5878	-39473	-10189
互換交易	55702	+5650	23070	+6732	+32632	-1082
管理基金	108436	+22769	99890	+5625	+8546	+17144
其他	46013	+7657	49722	+12599	-3709	-4942

週五收盤價與13週與52週平均線

— HG — 13週 38501 — 52週 38083



淨部位佔總OI% 生產 -15.8% 互換 +13.1% 管理 +3.4% 其他 -1.5%

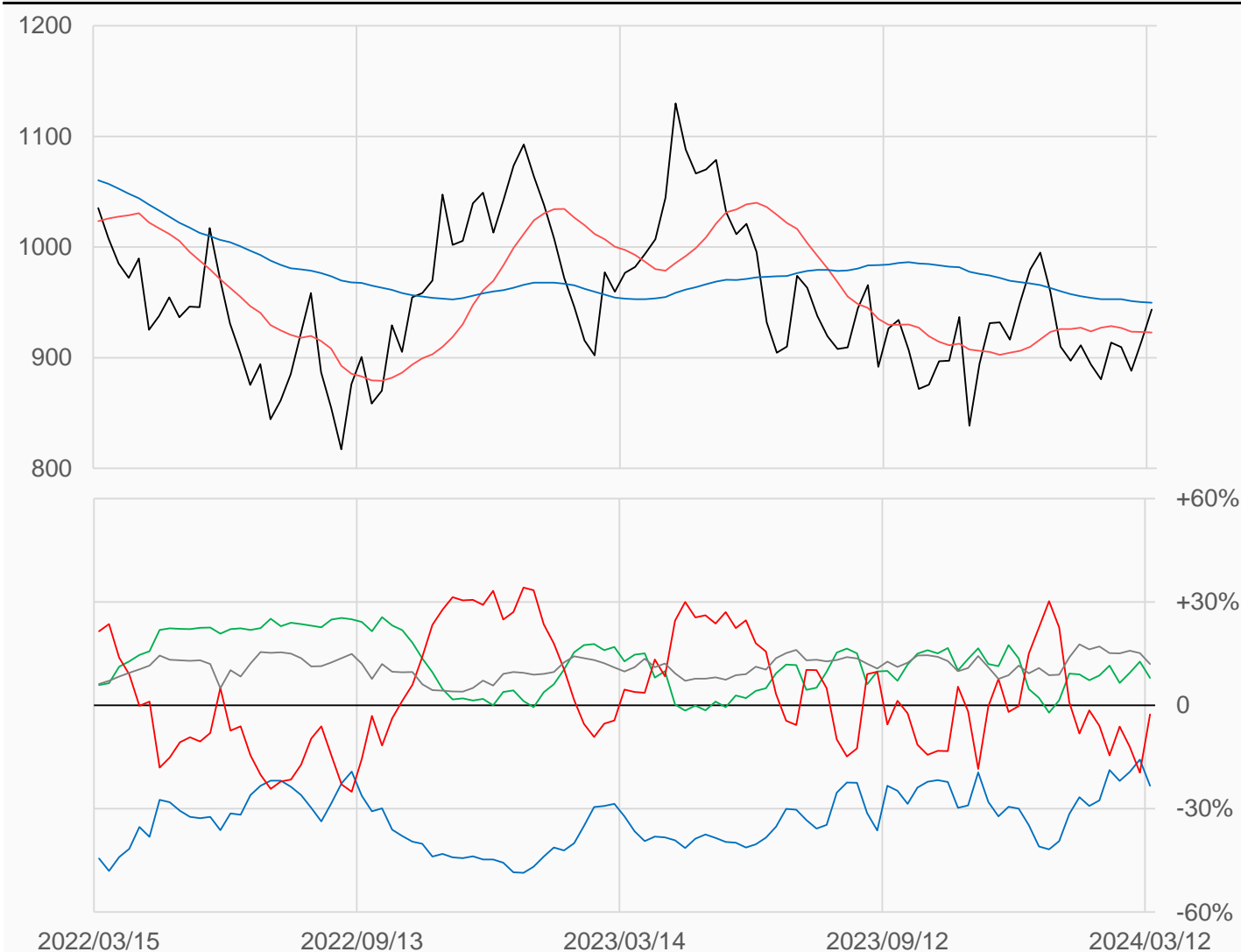
白金

白金較前一週上漲28.7點收在943.5點，
管理基金多單增加1959口，空單減少15636口，
淨空單較前一週減少17595口至2453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
2024/03/12	102395	93285	-9110	-8.90%	943.5	↑ +28.7
分類	多單OI	增減	空單OI	增減	多空淨部位	淨部位變動
生產商	3687	-2413	25485	+3249	-21798	-5662
互換交易	19360	-2531	11956	+3021	+7404	-5552
管理基金	40415	+1959	42868	-15636	-2453	+17595
其他	20399	-4013	9201	+304	+11198	-4317

週五收盤價與13週與52週平均線

— PL — 13週 922.78 — 52週 949.67



淨部位佔總OI% 生產 -23.4% 互換 +7.9% 管理 -2.6% 其他 +12.0%

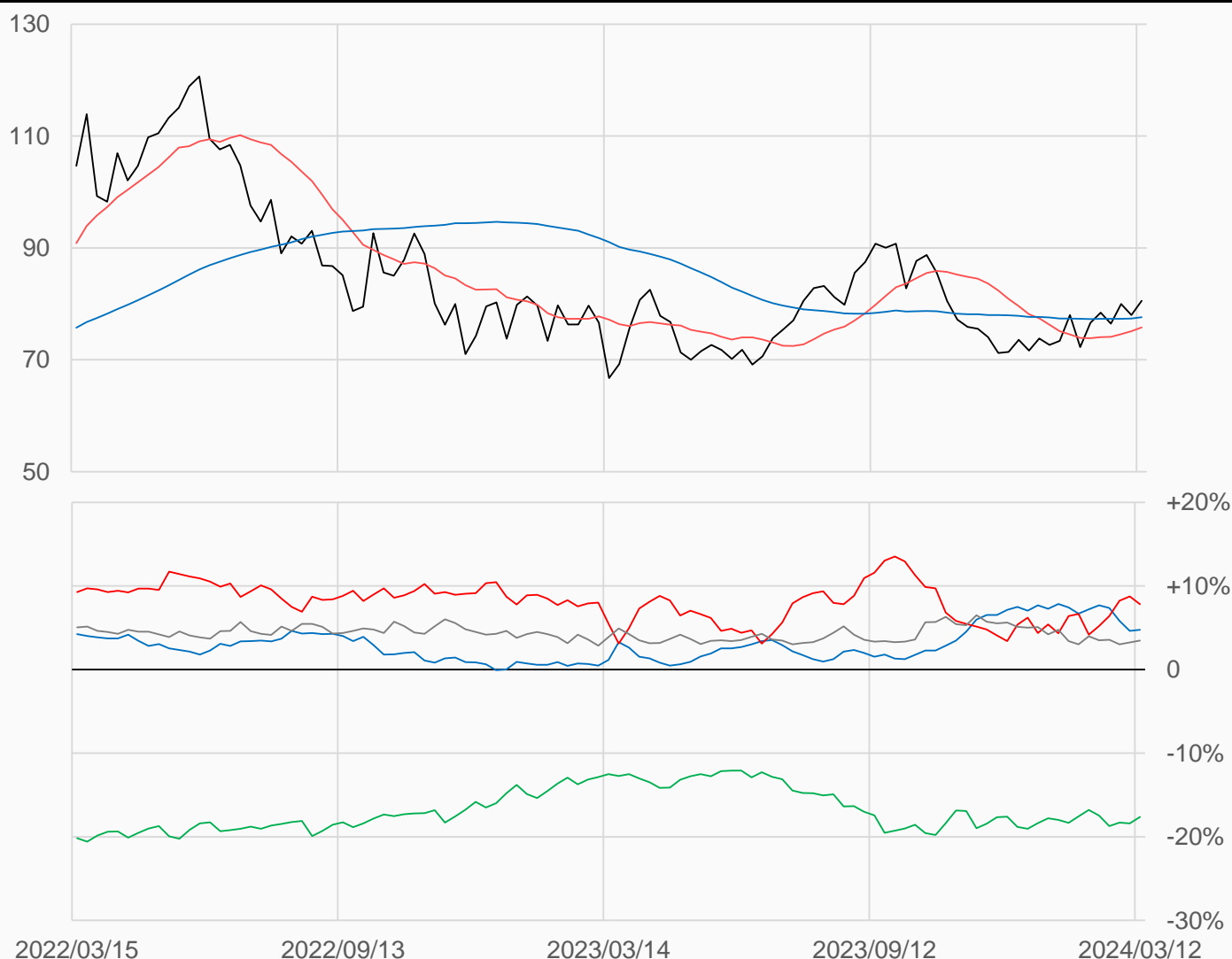
輕原油

輕原油較前一週上漲2.57點收在80.58點，
 管理基金多單增加45699口，空單增加59766口，
 淨多單較前一週減少14067口至169893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
2024/03/12	2098772	2177329	+78557	+3.74%	80.58	↑ +2.57
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	509163	+37973	405259	+31404	+103904	+6569
互換交易	224320	+7248	608410	+5435	-384090	+1813
管理基金	749300	+45699	579407	+59766	+169893	-14067
其他	597436	-11147	522185	-18187	+75251	+7040

週五收盤價與13週與52週平均線

— CL — 13週 75.808 — 52週 77.628



淨部位佔總OI% 生產 +4.8% 互換 -17.6% 管理 +7.8% 其他 +3.5%

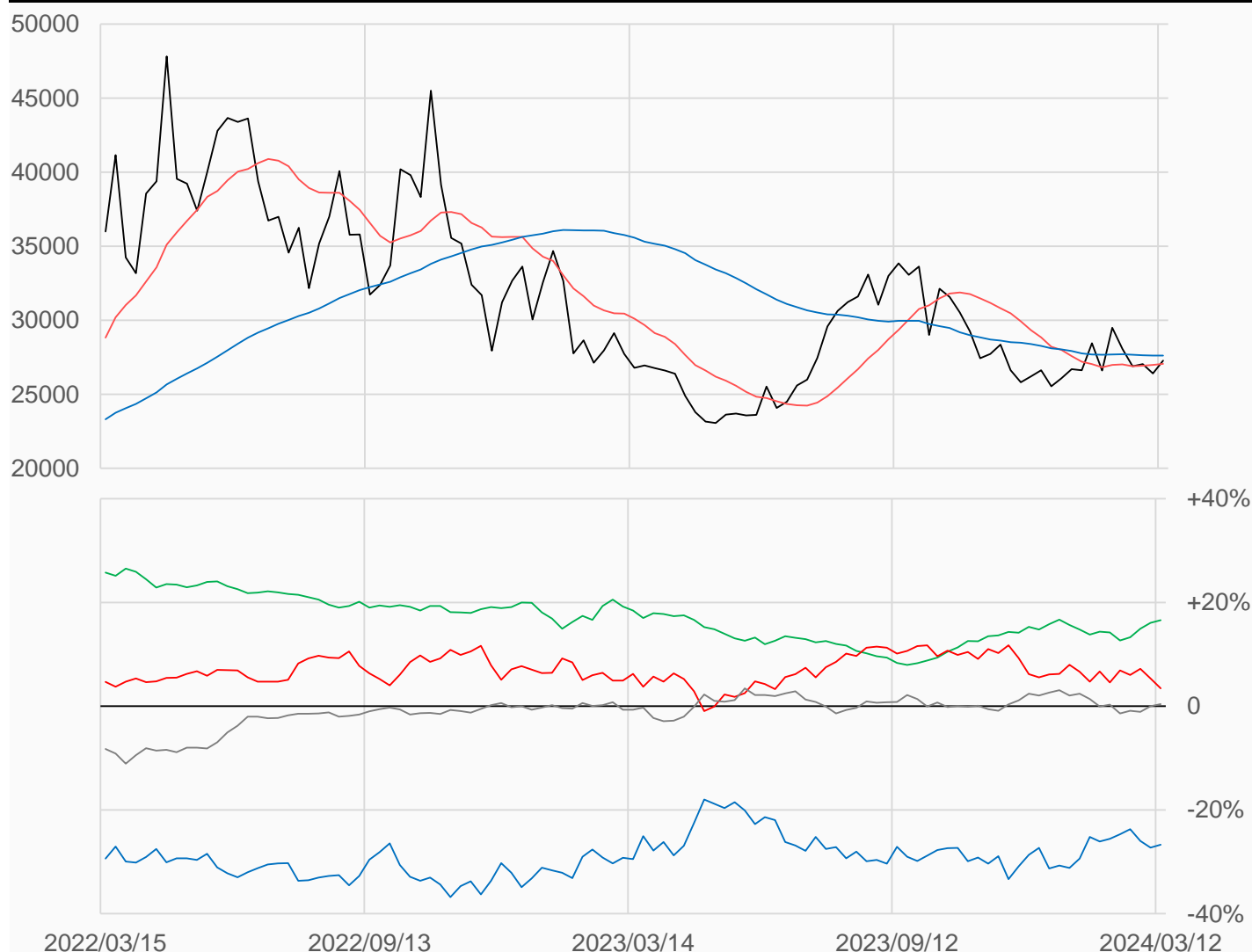
熱燃油

熱燃油較前一週上漲861點收在27270點，
管理基金多單減少3905口，空單增加2110口，
淨多單較前一週減少6015口至10937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
2024/03/12	317365	316953	-412	-0.13%	27270	↑ +861
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	84931	+899	169596	-1061	-84665	+1960
互換交易	67770	+3503	15144	+1800	+52626	+1703
管理基金	78281	-3905	67344	+2110	+10937	-6015
其他	38568	-818	37301	-2063	+1267	+1245

週五收盤價與13週與52週平均線

— HO — 13週 27057 — 52週 27619



淨部位佔總OI% 生產 -26.7% 互換 +16.6% 管理 +3.5% 其他 +0.4%

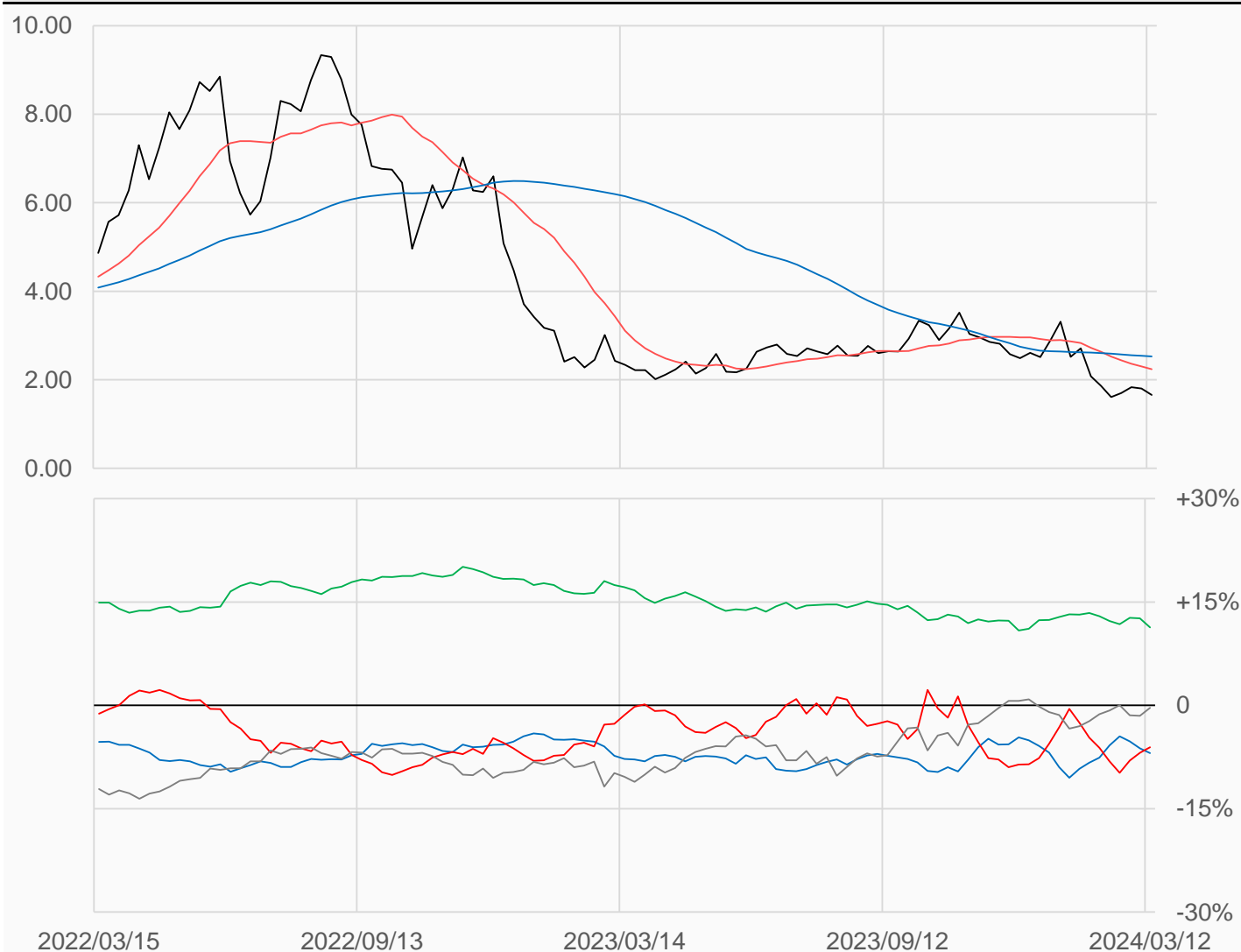
天然氣

天然氣較前一週下跌0.15點收在1.655點，
 管理基金多單增加27943口，空單增加19277口，
 淨空單較前一週減少8666口至98042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
2024/03/12	1549154	1613883	+64729	+4.18%	1.655	↓ -0.150
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	226527	+9553	338501	+24916	-111974	-15363
互換交易	342531	+2520	159801	+15165	+182730	-12645
管理基金	675915	+27943	773957	+19277	-98042	+8666
其他	292863	+22071	298619	+4472	-5756	+17599

週五收盤價與13週與52週平均線

— NG — 13週 2.2388 — 52週 2.5276



淨部位佔總OI% 生產 -6.9% 互換 +11.3% 管理 -6.1% 其他 -0.4%

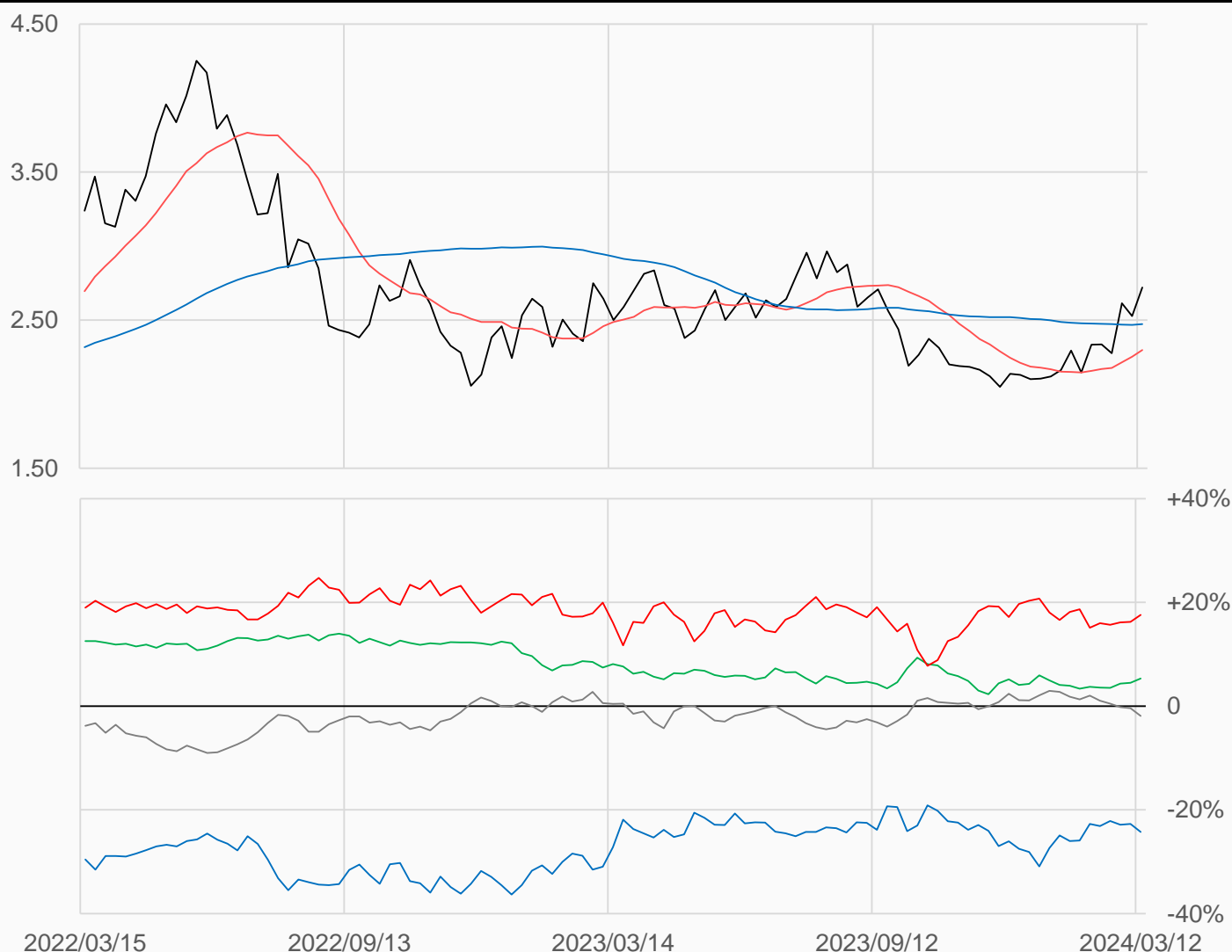
無鉛汽油

無鉛汽油較前一週上漲0.1936點收在2.7208點，
管理基金多單增加5022口，空單減少1713口，
淨多單較前一週增加6735口至66769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
2024/03/12	369388	379544	+10156	+2.75%	2.7208	↑ +0.1936
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	131583	-2582	223540	+5527	-91957	-8109
互換交易	63635	+5980	43339	+2390	+20296	+3590
管理基金	120197	+5022	53428	-1713	+66769	+6735
其他	36845	-2238	44038	+3600	-7193	-5838

週五收盤價與13週與52週平均線

— RB — 13週 2.2979 — 52週 2.4729



淨部位佔總OI% 生產 -24.2% 互換 +5.3% 管理 +17.6% 其他 -1.9%

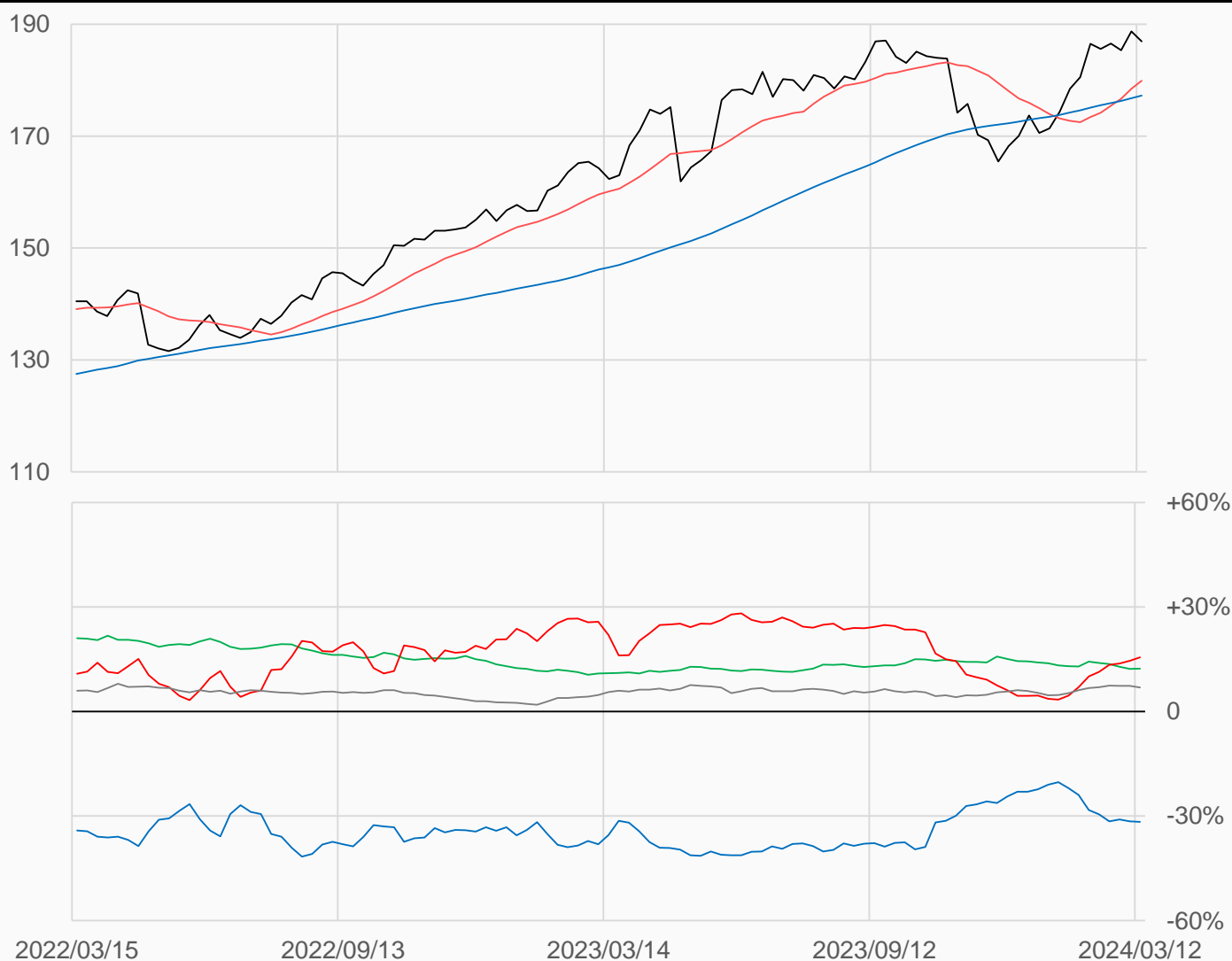
活牛

活牛較前一週下跌1.775點收在186.95點，
管理基金多單增加1534口，空單減少2413口，
淨多單較前一週增加3947口至63311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
2024/03/12	408092	406781	-1311	-0.32%	186.950	↓ -1.775
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	70398	-3239	199133	-2981	-128735	-258
互換交易	55619	-1129	5487	-1239	+50132	+110
管理基金	133931	+1534	70620	-2413	+63311	+3947
其他	108787	+275	80666	+2218	+28121	-1943

週五收盤價與13週與52週平均線

— LC — 13週 179.9 — 52週 177.26



淨部位佔總OI% 生產 -31.6% 互換 +12.3% 管理 +15.6% 其他 +6.9%

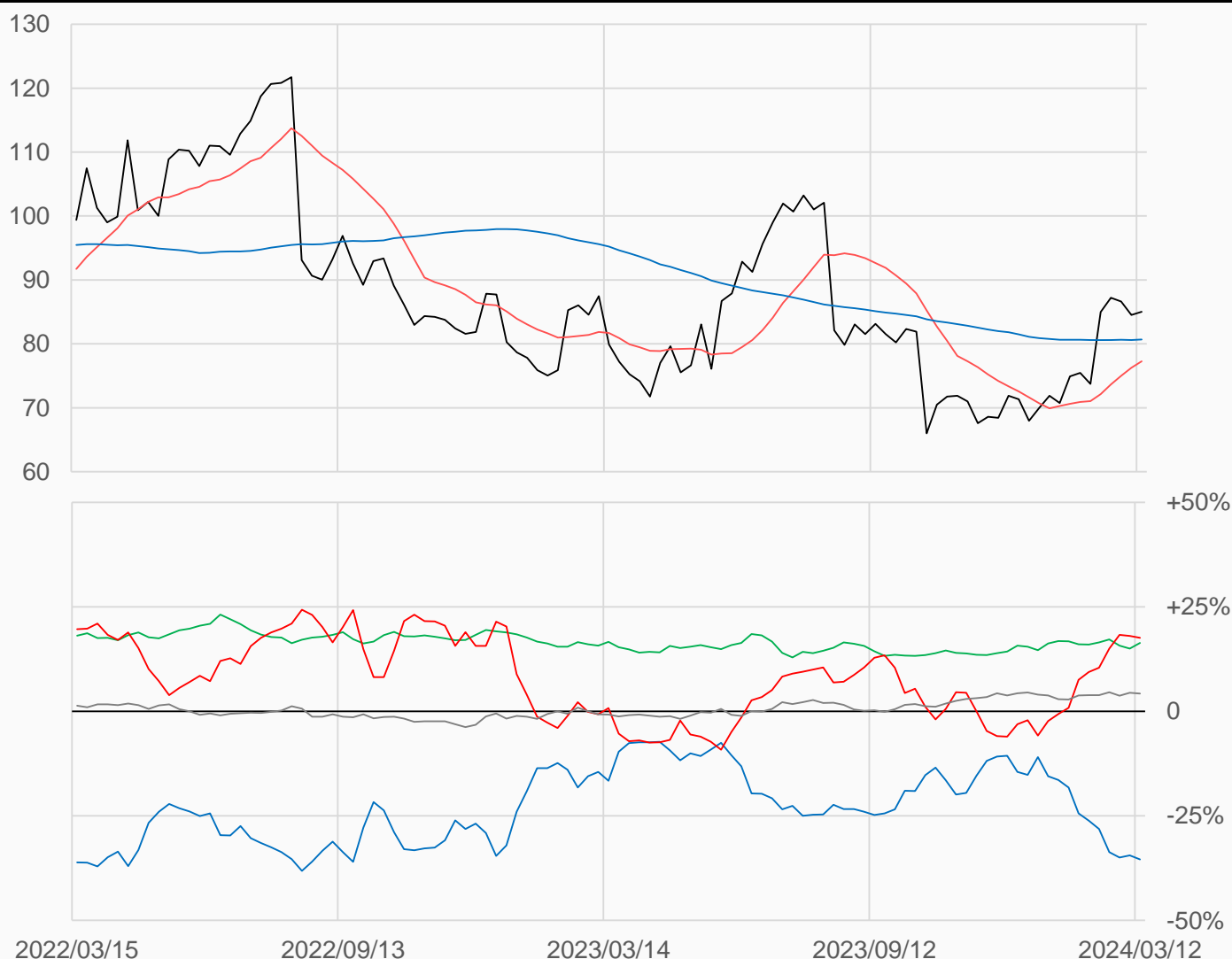
活豬

活豬較前一週上漲0.5點收在85.025點，
 管理基金多單減少3288口，空單減少1877口，
 淨多單較前一週減少1411口至63679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
2024/03/12	361151	361522	+371	+0.10%	85.025	↑ +0.500
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	36001	+3102	164017	+6719	-128016	-3617
互換交易	76536	+2505	17396	-2389	+59140	+4894
管理基金	117351	-3288	53672	-1877	+63679	-1411
其他	105579	-3001	90232	-2246	+15347	-755

週五收盤價與13週與52週平均線

— LH — 13週 77.265 — 52週 80.698



淨部位佔總OI% 生產 -35.4% 互換 +16.4% 管理 +17.6% 其他 +4.2%

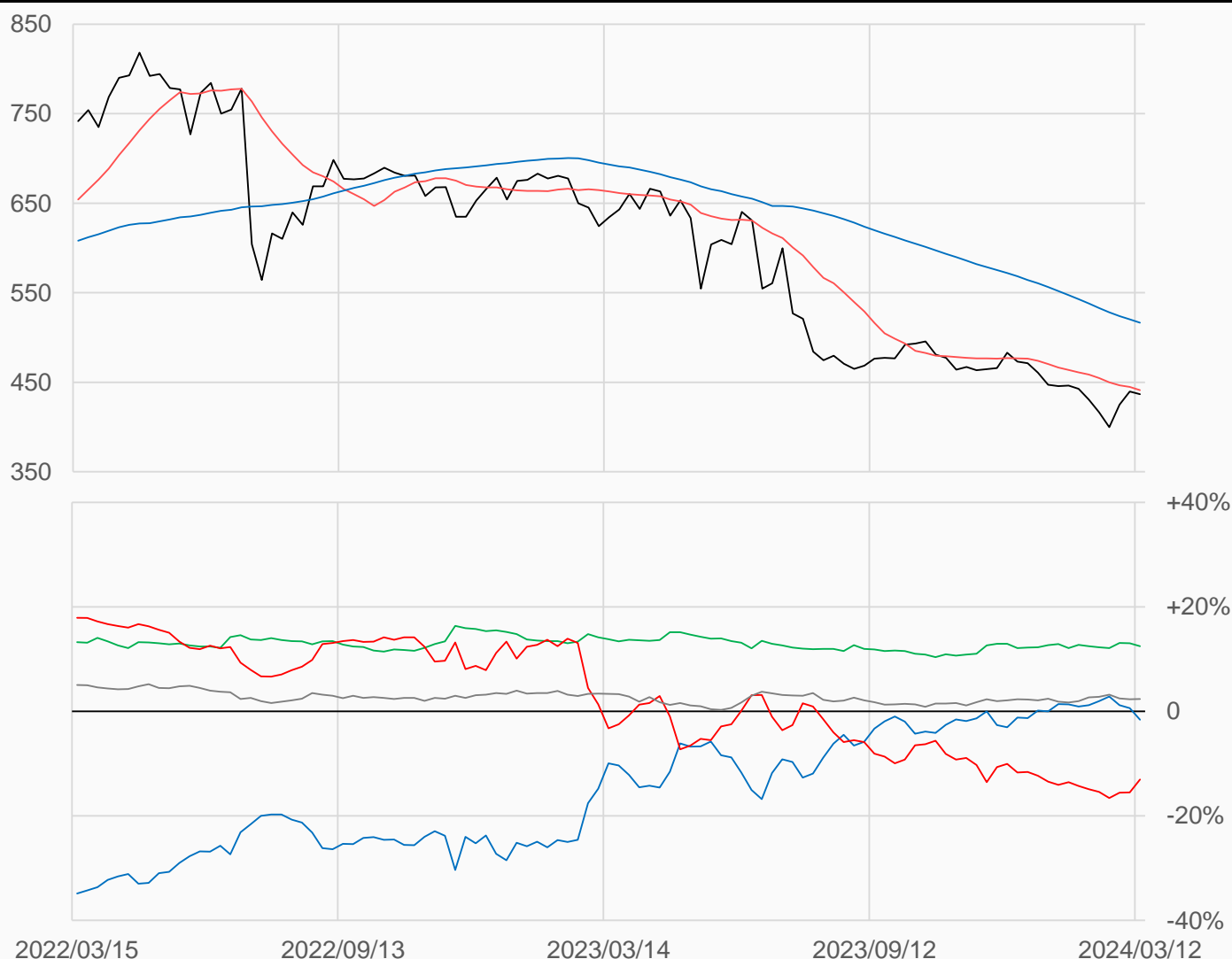
玉米

玉米較前一週下跌3點收在436.75點，
管理基金多單增加7677口，空單減少33190口，
淨空單較前一週減少40867口至255928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
2024/03/12	1914649	1961433	+46784	+2.44%	436.75	↓ -3.00
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	457944	+7183	489012	+49675	-31068	-42492
互換交易	310806	+7134	65886	+11759	+244920	-4625
管理基金	501553	+7677	757481	-33190	-255928	+40867
其他	484853	+19716	438603	+17823	+46250	+1893

週五收盤價與13週與52週平均線

— ZC — 13週 441.12 — 52週 516.5



淨部位佔總OI% 生產 -1.6% 互換 +12.5% 管理 -13.0% 其他 +2.4%

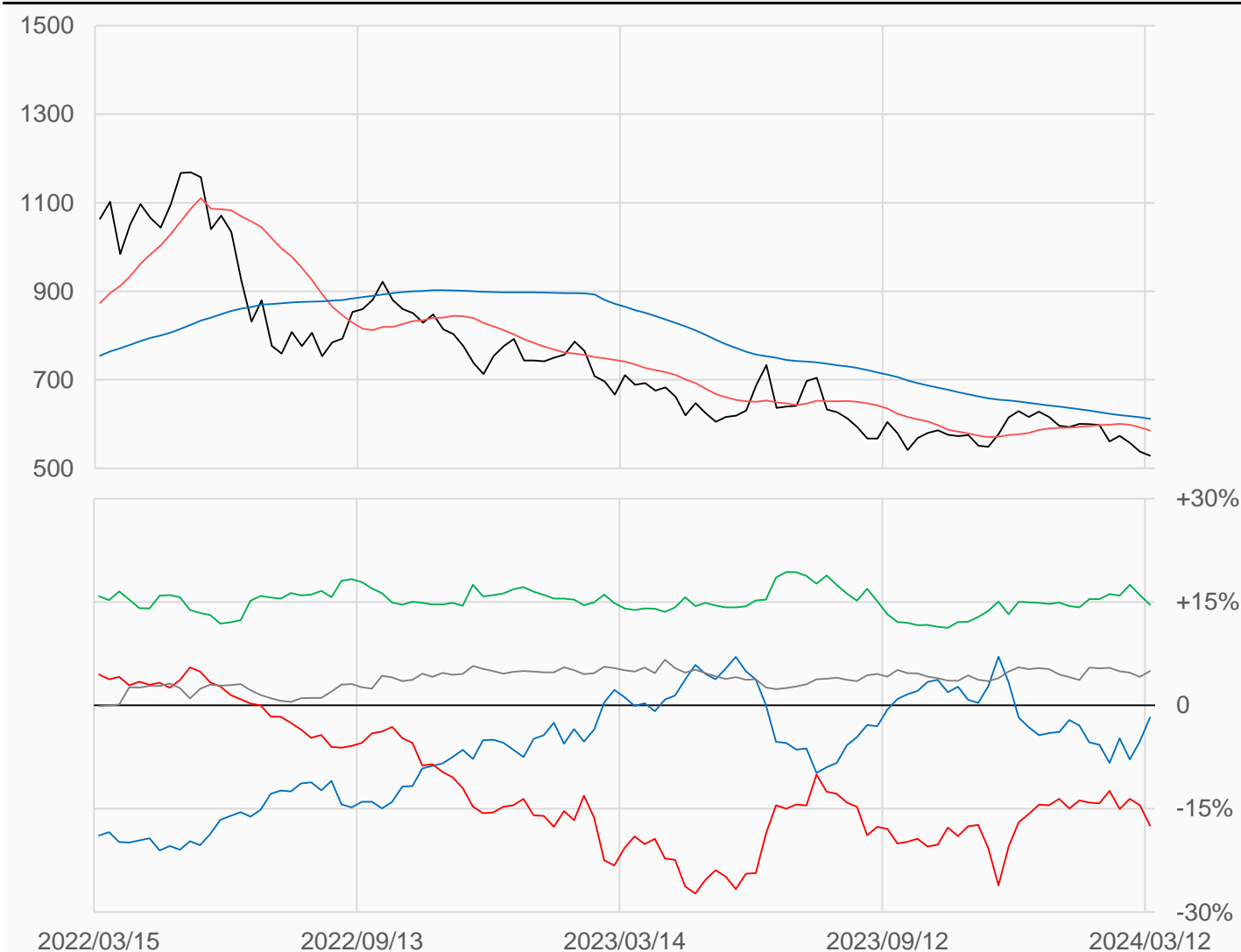
小麥

小麥較前一週下跌9.25點收在528.5點，
管理基金多單減少5291口，空單增加8040口，
淨空單較前一週增加13331口至78870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
2024/03/12	451756	451363	-393	-0.09%	528.50	↓ -9.25
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	55965	-1225	63939	-16844	-7974	+15619
互換交易	99146	+1271	33261	+7629	+65885	-6358
管理基金	162067	-5291	240937	+8040	-78870	-13331
其他	99761	+3533	77324	-315	+22437	+3848

週五收盤價與13週與52週平均線

— ZW — 13週 585.02 — 52週 611.76



淨部位佔總OI% 生產 -1.8% 互換 +14.6% 管理 -17.5% 其他 +5.0%

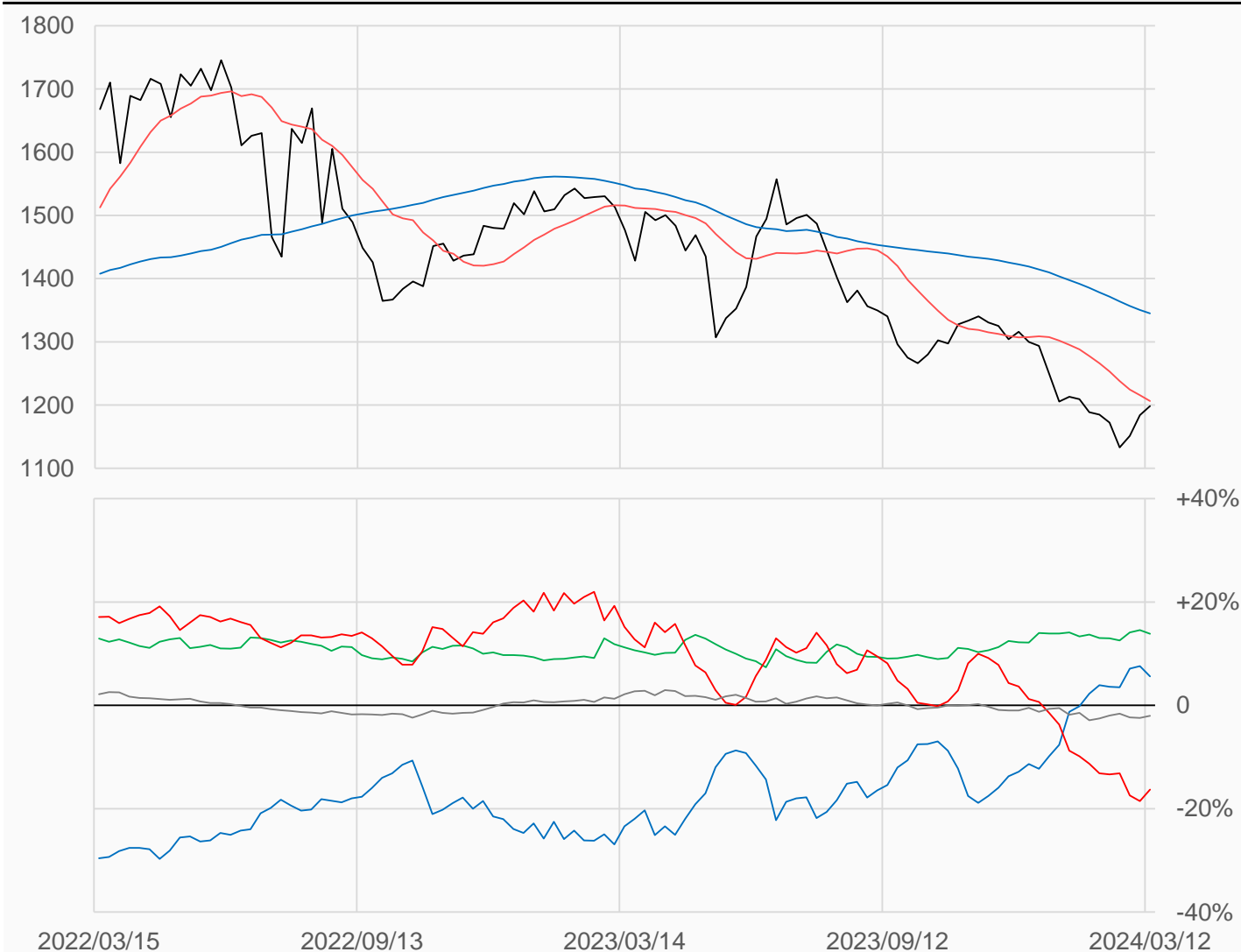
黃豆

黃豆較前一週上漲14.25點收在1198.25點，
 管理基金多單增加5628口，空單減少11234口，
 淨空單較前一週減少16862口至155137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
2024/03/12	927931	951826	+23895	+2.58%	1198.25	↑ +14.25
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	330612	+9334	277419	+26529	+53193	-17195
互換交易	163500	+231	31515	+3351	+131985	-3120
管理基金	166264	+5628	321401	-11234	-155137	+16862
其他	231631	+6880	250724	+3207	-19093	+3673

週五收盤價與13週與52週平均線

— ZS — 13週 1206.4 — 52週 1345



淨部位佔總OI% 生產 +5.6% 互換 +13.9% 管理 -16.3% 其他 -2.0%

黃豆油

黃豆油較前一週上漲3.25點收在49.42點，
管理基金多單增加23519口，空單減少5544口，
淨空單較前一週減少29063口至33410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
2024/03/12	582934	595795	+12861	+2.21%	49.42	↑ +3.25
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	133094	-9120	220402	+13164	-87308	-22284
互換交易	136411	+1568	16824	-294	+119587	+1862
管理基金	199015	+23519	232425	-5544	-33410	+29063
其他	96931	-4221	98541	+6707	-1610	-10928

週五收盤價與13週與52週平均線

— BO — 13週 46.728 — 52週 54.66



淨部位佔總OI% 生產 -14.7% 互換 +20.1% 管理 -5.6% 其他 -0.3%

黃豆粉

黃豆粉較前一週下跌6.7點收在334.7點，
 管理基金多單增加405口，空單增加1814口，
 淨空單較前一週增加1409口至50935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
2024/03/12	540921	535541	-5380	-0.99%	334.7	↓ -6.7
分類	多單OI	增減	空單OI	增減	多空淨部位	淨部位變動
生產商	149747	-5498	199222	-2450	-49475	-3048
互換交易	105116	+646	13976	-64	+91140	+710
管理基金	135456	+405	186391	+1814	-50935	-1409
其他	94905	-1582	104465	-2865	-9560	+1283

週五收盤價與13週與52週平均線

— SM — 13週 353.87 — 52週 406.2



淨部位佔總OI% 生產 -9.2% 互換 +17.0% 管理 -9.5% 其他 -1.8%

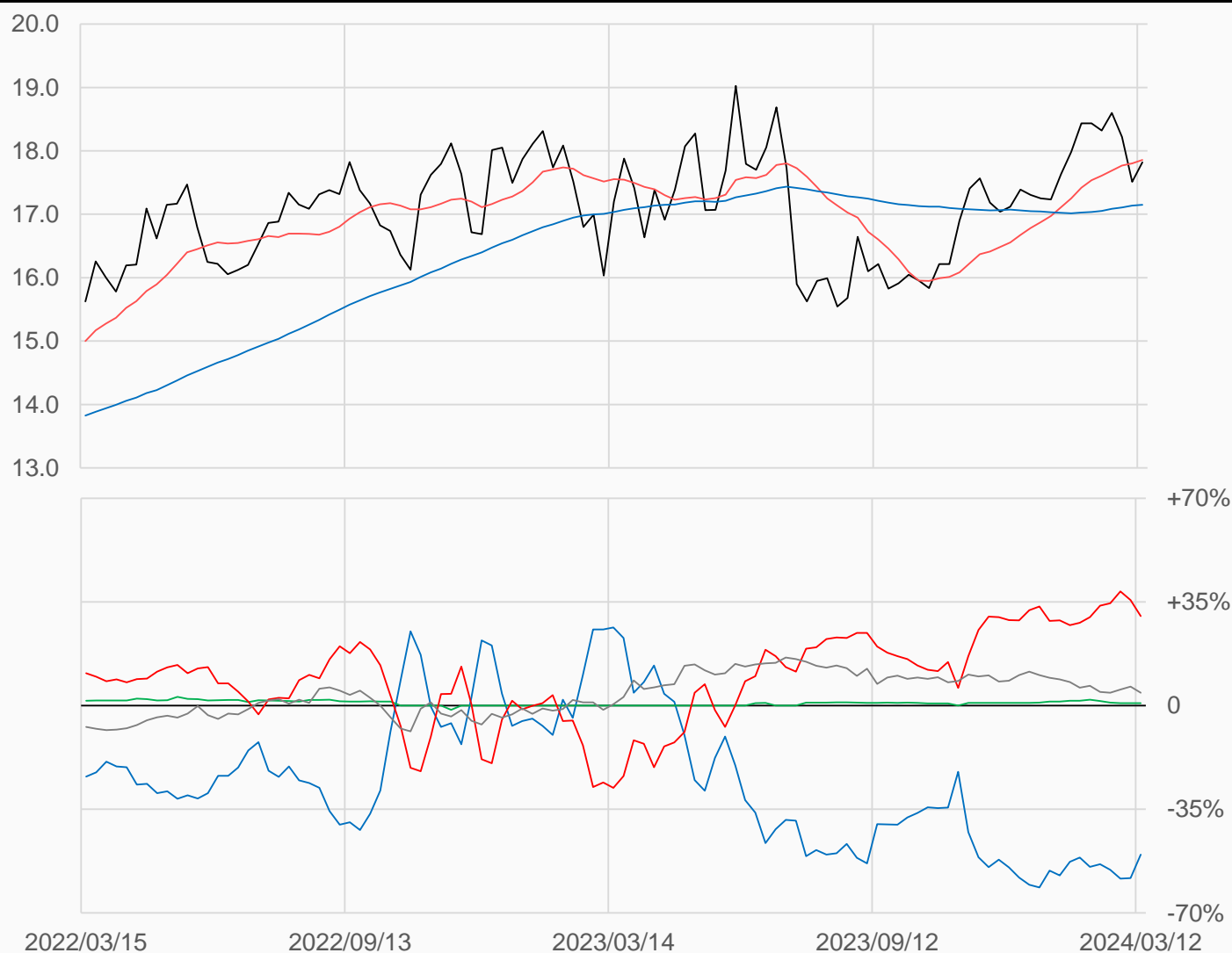
粗米

粗米較前一週上漲0.31點收在17.82點，
 管理基金多單減少747口，空單增加64口，
 淨多單較前一週減少811口至3689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
2024/03/12	12633	12188	-445	-3.52%	17.820	↑ +0.310
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	3139	+582	9266	-644	-6127	+1226
互換交易	103	-4	0	0	+103	-4
管理基金	4424	-747	735	+64	+3689	-811
其他	1807	+21	1273	+296	+534	-275

週五收盤價與13週與52週平均線

— RR — 13週 17.857 — 52週 17.15



淨部位佔總OI% 生產 -50.3% 互換 +0.8% 管理 +30.3% 其他 +4.4%

咖啡

咖啡較前一週下跌8.35點收在183.85點，
管理基金多單增加520口，空單減少3187口，
淨多單較前一週增加3707口至47069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
2024/03/12	247549	244398	-3151	-1.27%	183.85	↓ -8.35
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	49497	-628	110531	+1171	-61034	-1799
互換交易	40229	-67	35774	+1613	+4455	-1680
管理基金	97574	+520	50505	-3187	+47069	+3707
其他	48415	-3547	40581	-3321	+7834	-226

週五收盤價與13週與52週平均線

— KC — 13週 187.73 — 52週 175.1



淨部位佔總OI% 生產 -25.0% 互換 +1.8% 管理 +19.3% 其他 +3.2%

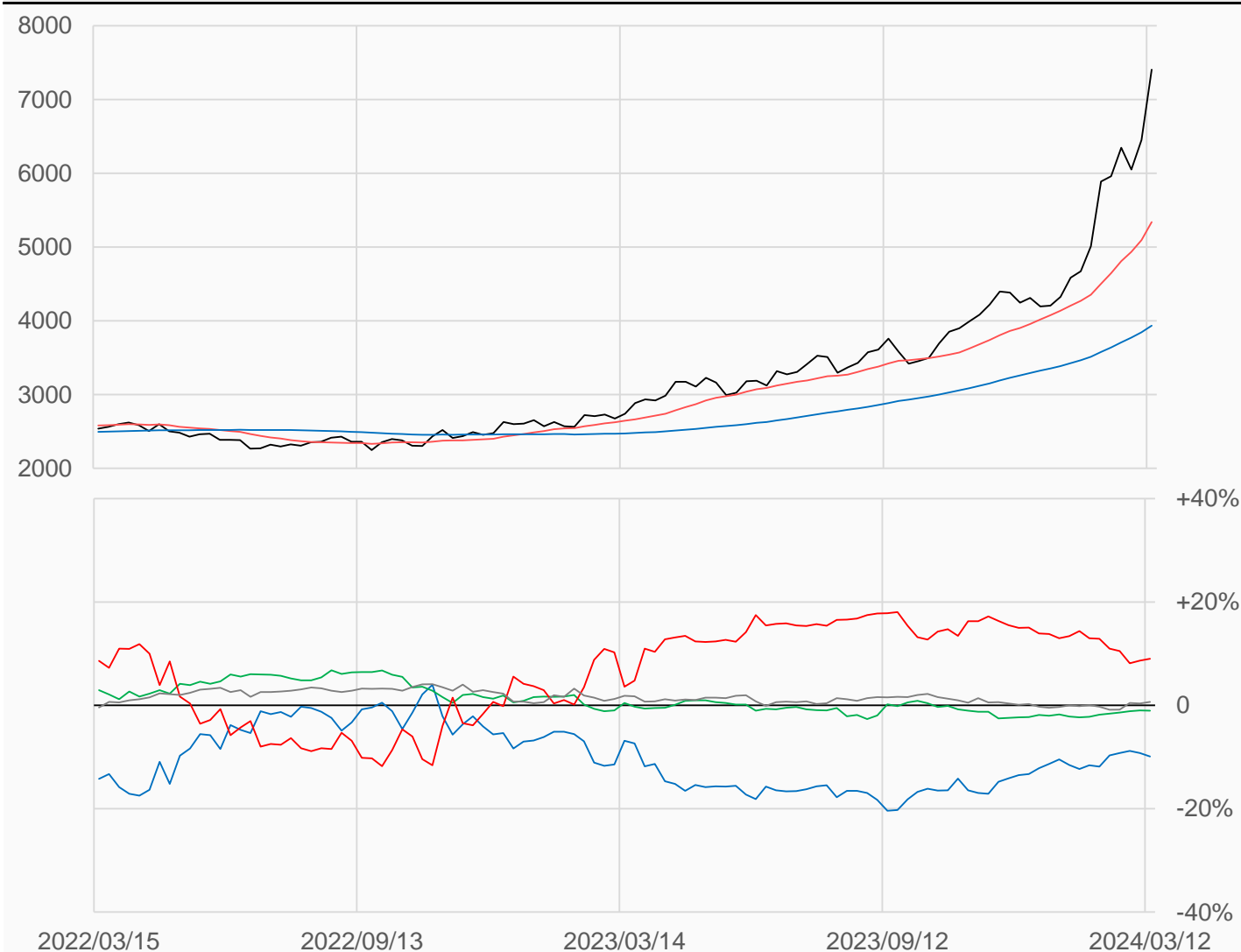
可可

可可較前一週上漲953點收在7405點，
管理基金多單增加4818口，空單增加3105口，
淨多單較前一週增加1713口至33678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
2024/03/12	369829	374405	+4576	+1.24%	7405	↑ +953
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	80455	-3074	117565	-182	-37110	-2892
互換交易	21066	-879	24902	-659	-3836	-220
管理基金	142602	+4818	108924	+3105	+33678	+1713
其他	115090	+2794	112599	+1648	+2491	+1146

週五收盤價與13週與52週平均線

— CC — 13週 5338.3 — 52週 3933.8



淨部位佔總OI% 生產 -9.9% 互換 -1.0% 管理 +9.0% 其他 +0.7%

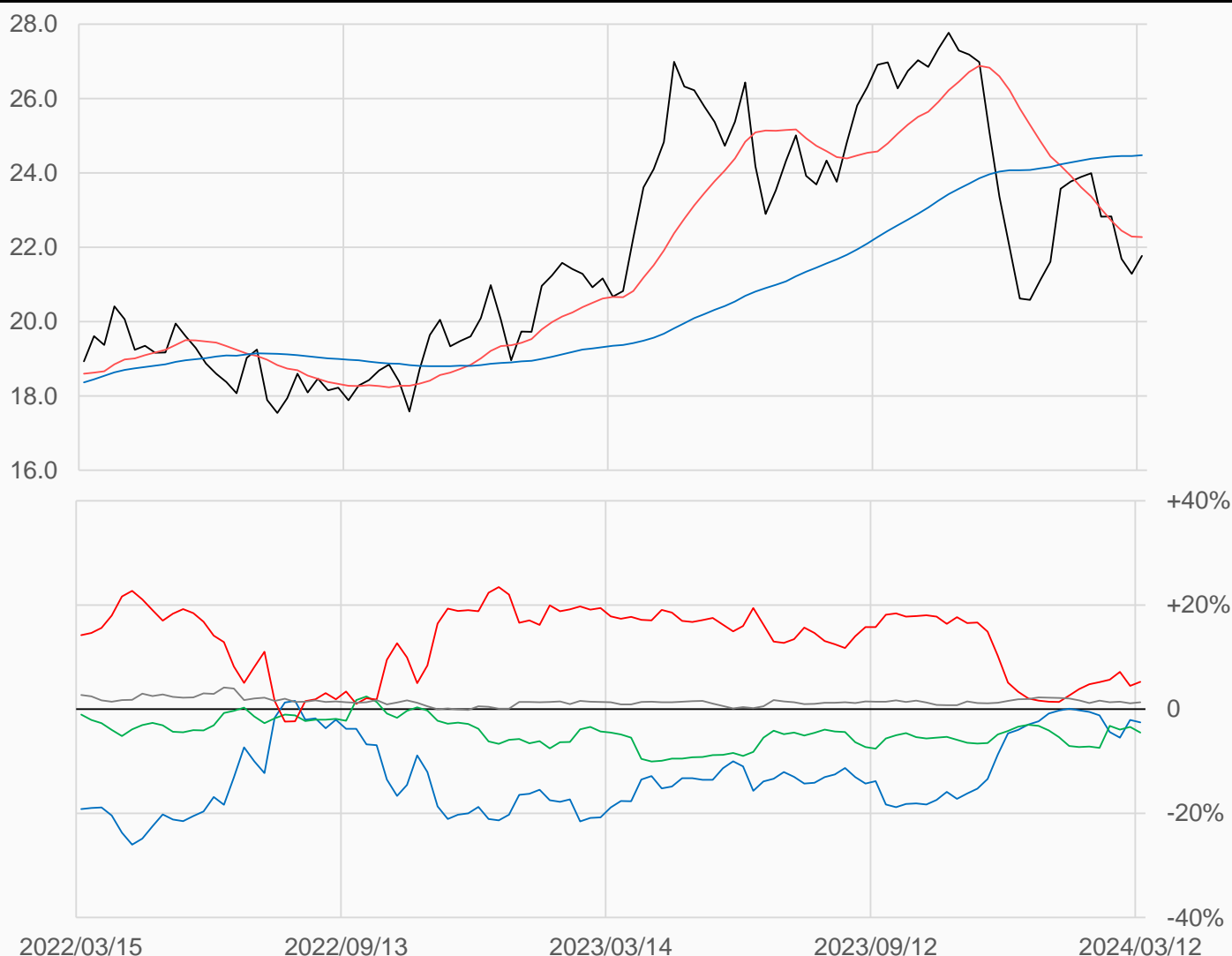
11號糖

11號糖較前一週上漲0.49點收在21.77點，
 管理基金多單減少13014口，空單減少19640口，
 淨多單較前一週增加6626口至52171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
2024/03/12	1018600	997591	-21009	-2.06%	21.77	↑ +0.49
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	340670	+3901	365818	+7972	-25148	-4071
互換交易	159931	-15024	204900	-4876	-44969	-10148
管理基金	249739	-13014	197568	-19640	+52171	+6626
其他	173335	-4903	160250	-6346	+13085	+1443

週五收盤價與13週與52週平均線

— SB — 13週 22.272 — 52週 24.475



淨部位佔總OI% 生產 -2.5% 互換 -4.5% 管理 +5.2% 其他 +1.3%

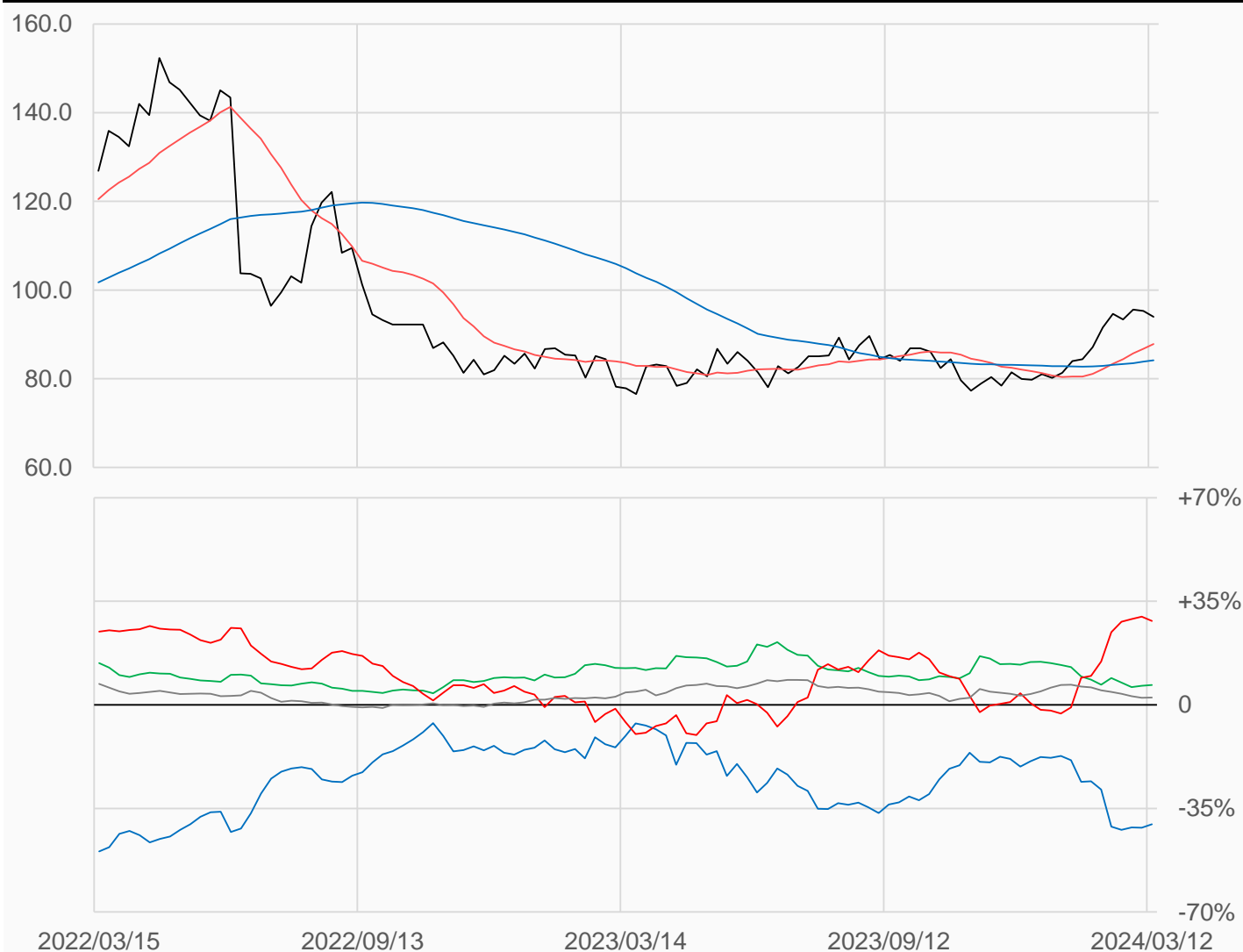
棉花

棉花較前一週下跌1.34點收在93.94點，
管理基金多單減少4309口，空單減少1108口，
淨多單較前一週減少3201口至93160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
2024/03/12	323096	328311	+5215	+1.61%	93.94	↓ -1.34
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	42059	+2252	174588	+735	-132529	+1517
互換交易	65160	+3217	43237	+2281	+21923	+936
管理基金	127088	-4309	33928	-1108	+93160	-3201
其他	74575	+2844	66468	+2440	+8107	+404

週五收盤價與13週與52週平均線

— CT — 13週 87.848 — 52週 84.163



淨部位佔總OI% 生產 -40.4% 互換 +6.7% 管理 +28.4% 其他 +2.5%