

CFTC 大額交易人持倉報告

永豐期貨顧問事業部編製

2024/4/1

資料來源：CFTC官網、精誠資訊DQII、奇狐全球版

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 2024/03/26

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	92758	-1147	+15478	+2303	+16.69%
	VX	370601	-6763	-2081	+5843	-0.56%
	ES	3149533	+42797	-452061	-32571	-14.35%
	NQ	287092	+4311	-45961	-10364	-16.01%
債券	30年債	1640916	-12038	-387553	-11501	-23.62%
	10年債	4994466	-68432	-1252106	-40869	-25.07%
	5年債	6188096	-12899	-1907448	-123	-30.82%
	2年債	3791606	+5927	-1278081	+32840	-33.71%
外匯	紐幣	53416	+3114	+5947	+4564	+11.13%
	英鎊	246625	+11778	+27142	-3936	+11.01%
	綜美(未含)	1007239	+8096	+61944	+8407	+6.15%
	綜美(含美)	1039276	+16284	+50731	+2973	+4.88%
	瑞郎	84155	+9072	-2421	+377	-2.88%
	歐元	747280	+7163	-39227	-6305	-5.25%
	加幣	207433	-39260	-26747	-3348	-12.89%
	澳幣	232888	-2422	-32567	-778	-13.98%
	日圓	344304	+7934	-81644	-839	-23.71%
美元	32037	+8188	-11213	-5433	-35.00%	

金融類投機部位每週變動表

數據日期 2024/03/26

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	723391	-65728	+157720	+253	+21.80%
	白銀	191539	-935	+30182	-7637	+15.76%
	銅	326936	+903	+20269	-19002	+6.20%
	白金	85045	-7811	-2741	+1084	-3.22%
能源	無鉛汽油	386461	+2421	+79049	+2508	+20.45%
	輕原油	2276002	+57248	+217439	-2525	+9.55%
	熱燃油	319220	+2304	+3444	-7523	+1.08%
	天然氣	1557101	-52358	-85436	+2001	-5.49%
肉類	活豬	375591	+8830	+64951	+2075	+17.29%
	活牛	422974	+6046	+59164	-3227	+13.99%
農產	粗米	10650	-685	+1445	-1388	+13.57%
	黃豆油	623074	+1625	+951	+15699	+0.15%
	黃豆粉	544389	-5188	-29789	+17085	-5.47%
	玉米	2017822	+18685	-251730	-8742	-12.48%
	黃豆	1022662	+27639	-134780	+13560	-13.18%
	小麥	465014	-12554	-92102	-11532	-19.81%
軟性	棉花	332195	+2207	+84468	-5054	+25.43%
	咖啡	267043	+18302	+47936	+5562	+17.95%
	11號糖	1010825	+4649	+68512	+13004	+6.78%
	可可	383874	+965	+21874	-4880	+5.70%

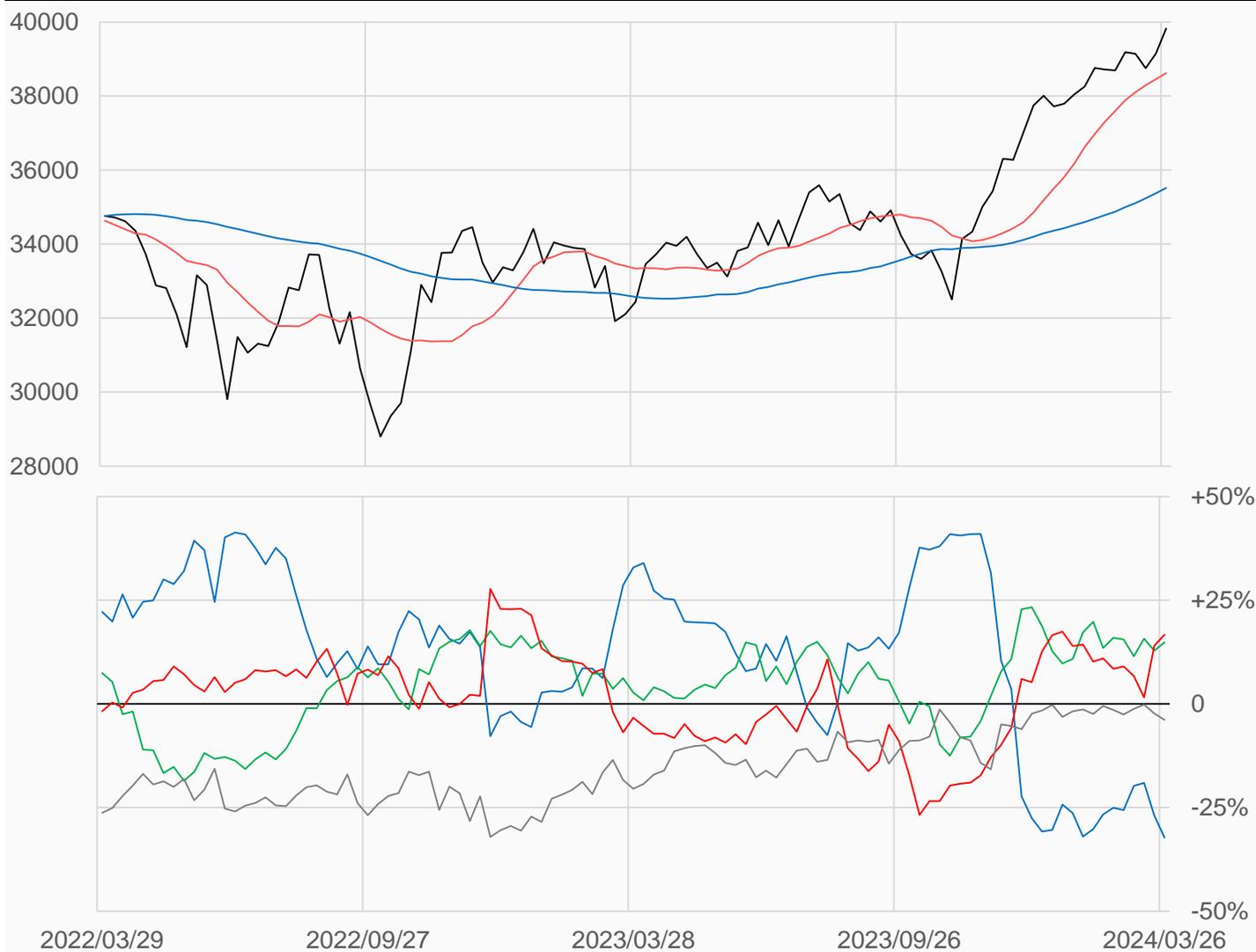
mini 道瓊

mini道瓊較前一週上漲674點收在39827點，
 槓桿基金多單減少1710口，空單減少4013口，
 淨多單較前一週增加17.48%或2303口至15478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
2024/03/26	93905	92758	-1147	-1.22%	39827	↑ +674
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	27107	+247	56996	+4867	-29889	-4620
資產管理	21192	+1384	7439	-319	+13753	+1703
槓桿基金	29640	-1710	14162	-4013	+15478	+2303
其他	208	-1664	3776	-257	-3568	-1407

週五收盤價與13週與52週平均線

— YM — 13週 38621 — 52週 35518



淨部位佔總OI% 經紀 -32.2% 資管 +14.8% 槓桿 +16.7% 其他 -3.8%

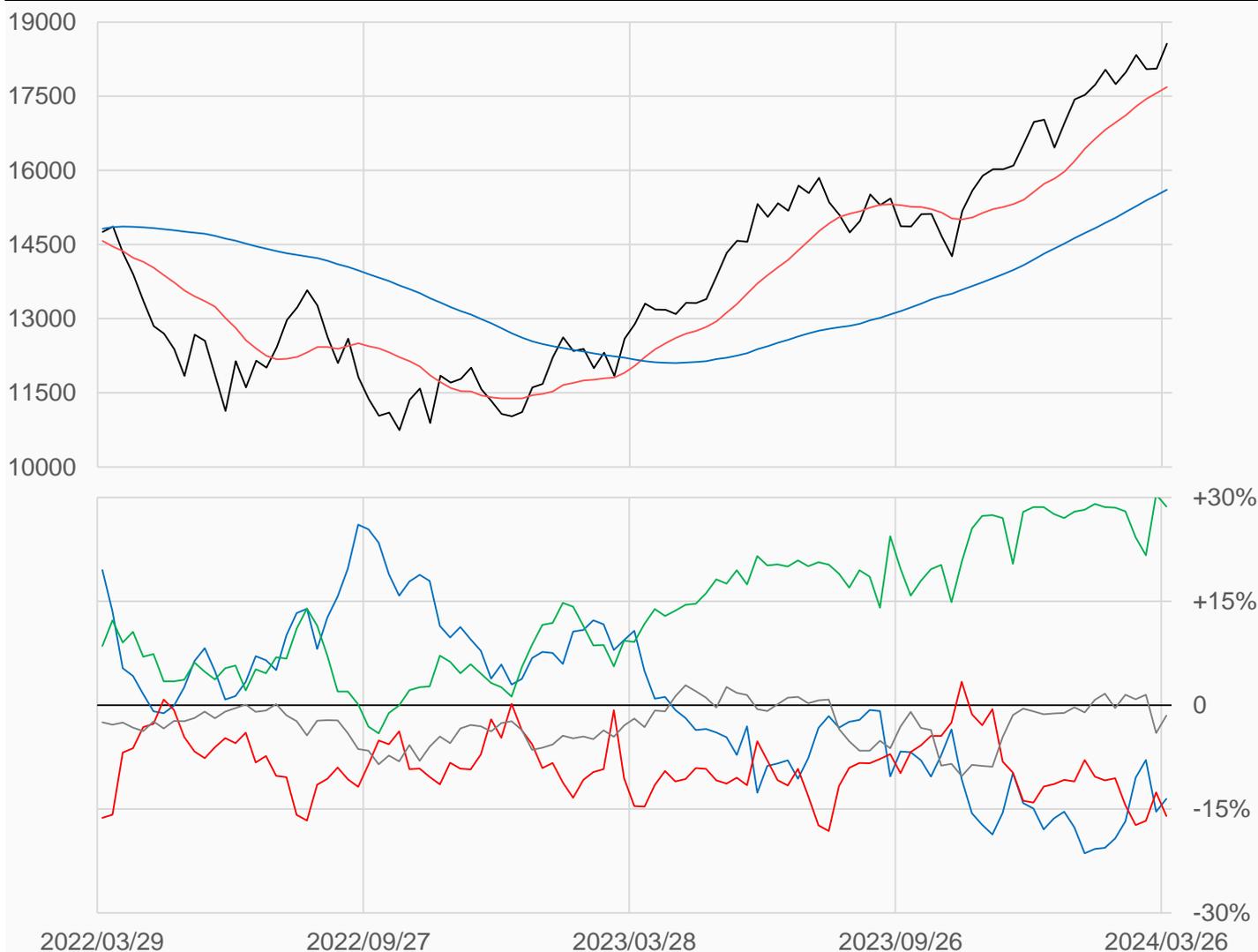
mini NQ

miniNQ較前一週上漲505點收在18563.75點，
 槓桿基金多單減少3929口，空單增加6435口，
 淨空單較前一週增加10364口至45961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
2024/03/26	282781	287092	+4311	+1.52%	18563.75	↑ +505.00
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	47965	+8928	86756	+4259	-38791	+4669
資產管理	113189	-1137	30871	+2586	+82318	-3723
槓桿基金	75542	-3929	121503	+6435	-45961	-10364
其他	7662	+17	11982	-7034	-4320	+7051

週五收盤價與13週與52週平均線

— NQ — 13週 17687 — 52週 15609



淨部位佔總OI% 經紀 -13.5% 資管 +28.7% 槓桿 -16.0% 其他 -1.5%

mini S&P

miniS&P較前一週上漲107點收在5289.75點，
 槓桿基金多單增加22157口，空單增加54728口，
 淨空單較前一週增加32571口至452061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
2024/03/26	3106736	3149533	+42797	+1.38%	5289.75	↑ +107.00
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	465327	+25239	1052406	-9051	-587079	+34290
資產管理	1325211	-8147	371152	-14744	+954059	+6597
槓桿基金	876770	+22157	1328831	+54728	-452061	-32571
其他	157520	-10858	159686	+10103	-2166	-20961

週五收盤價與13週與52週平均線

— ES — 13週 5003.7 — 52週 4543.1



淨部位佔總OI% 經紀 -18.6% 資管 +30.3% 槓桿 -14.4% 其他 -0.1%

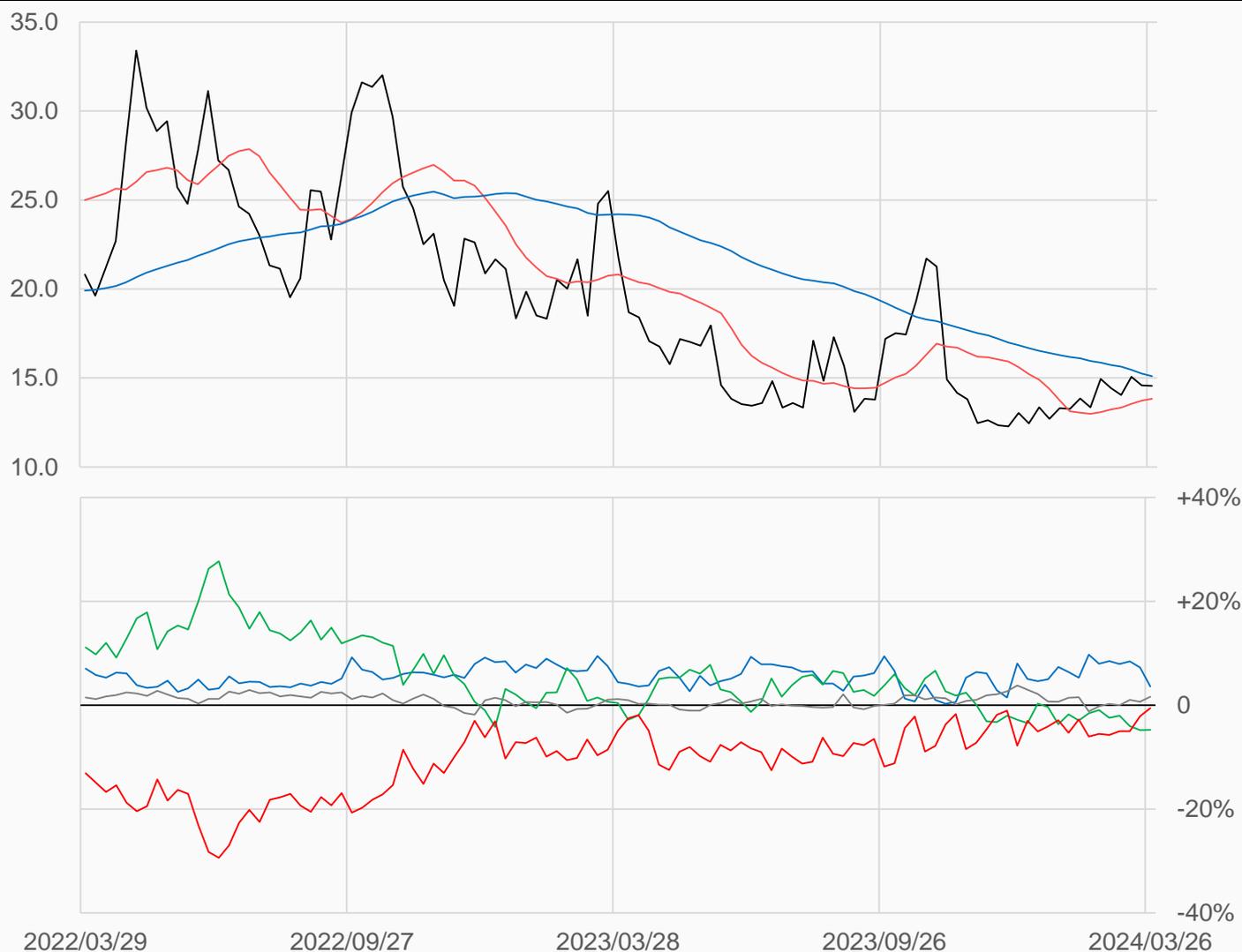
VIX

VIX較前一週下跌0.04點收在14.55點，
槓桿基金多單增加4674口，空單減少1169口，
淨空單較前一週減少5843口至2081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
2024/03/26	377364	370601	-6763	-1.79%	14.55	↓ -0.04
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	61673	-20960	48319	-6958	+13354	-14002
資產管理	117677	+7207	135282	+6702	-17605	+505
槓桿基金	141196	+4674	143277	-1169	-2081	+5843
其他	24299	+4105	18147	+485	+6152	+3620

週五收盤價與13週與52週平均線

— VX — 13週 13.838 — 52週 15.104



淨部位佔總OI% 經紀 +3.6% 資管 -4.8% 槓桿 -0.6% 其他 +1.7%

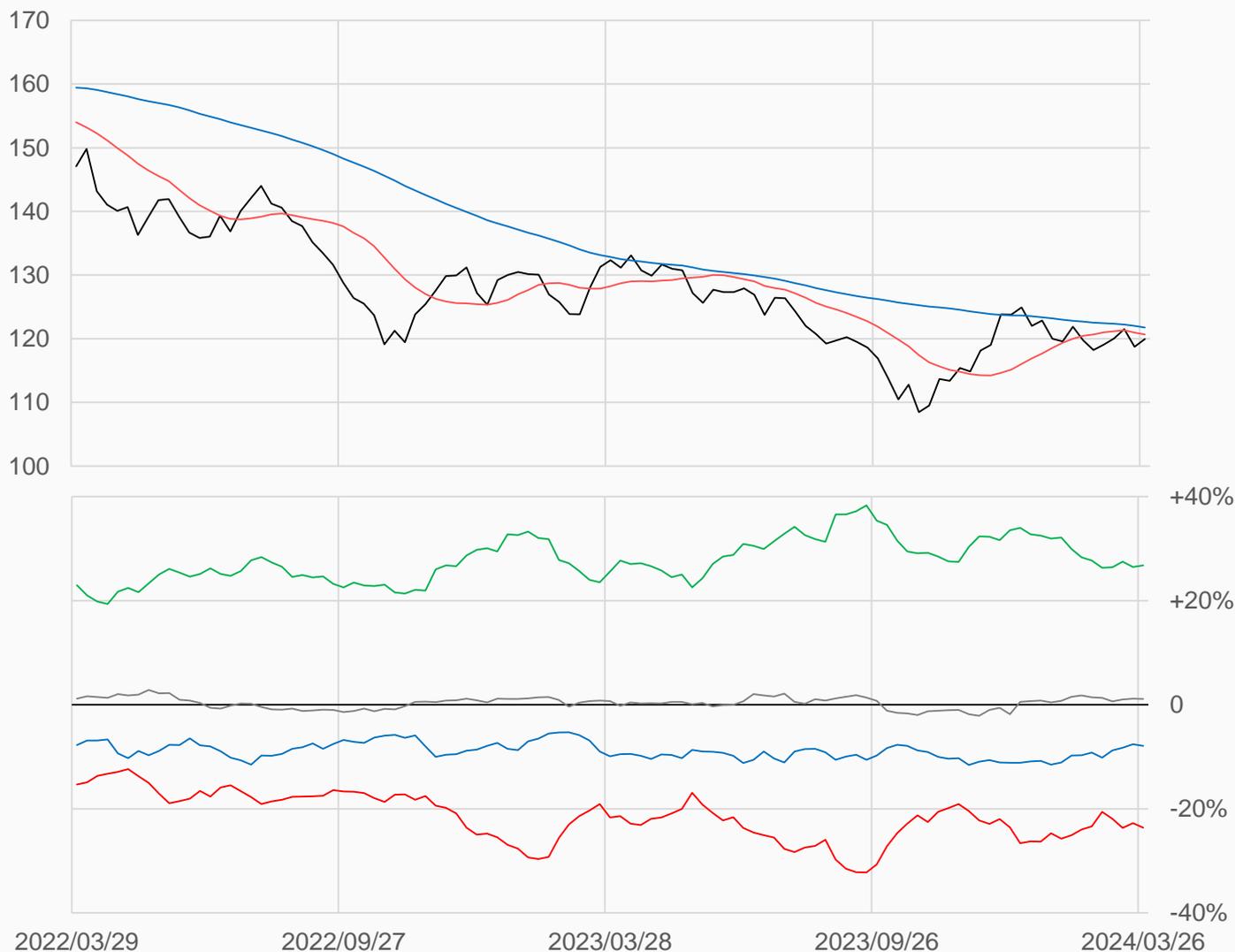
30年債

美國30年公債較前一週上漲1.25點收在119.96875點，
 槓桿基金多單減少29992口，空單減少18492口，
 淨空單較前一週增加11500口至387553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
2024/03/26	1652954	1640916	-12038	-0.73%	119 31/32	↑ +1 8/32
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	61418	-2400	191025	+1471	-129607	-3871
資產管理	993984	+10866	554753	+8864	+439231	+2002
槓桿基金	253844	-29992	641397	-18492	-387553	-11500
其他	112883	-3177	94815	-1820	+18068	-1357

週五收盤價與13週與52週平均線

— US — 13週 120.66 — 52週 121.76



淨部位佔總OI% 經紀 -7.9% 資管 +26.8% 槓桿 -23.6% 其他 +1.1%

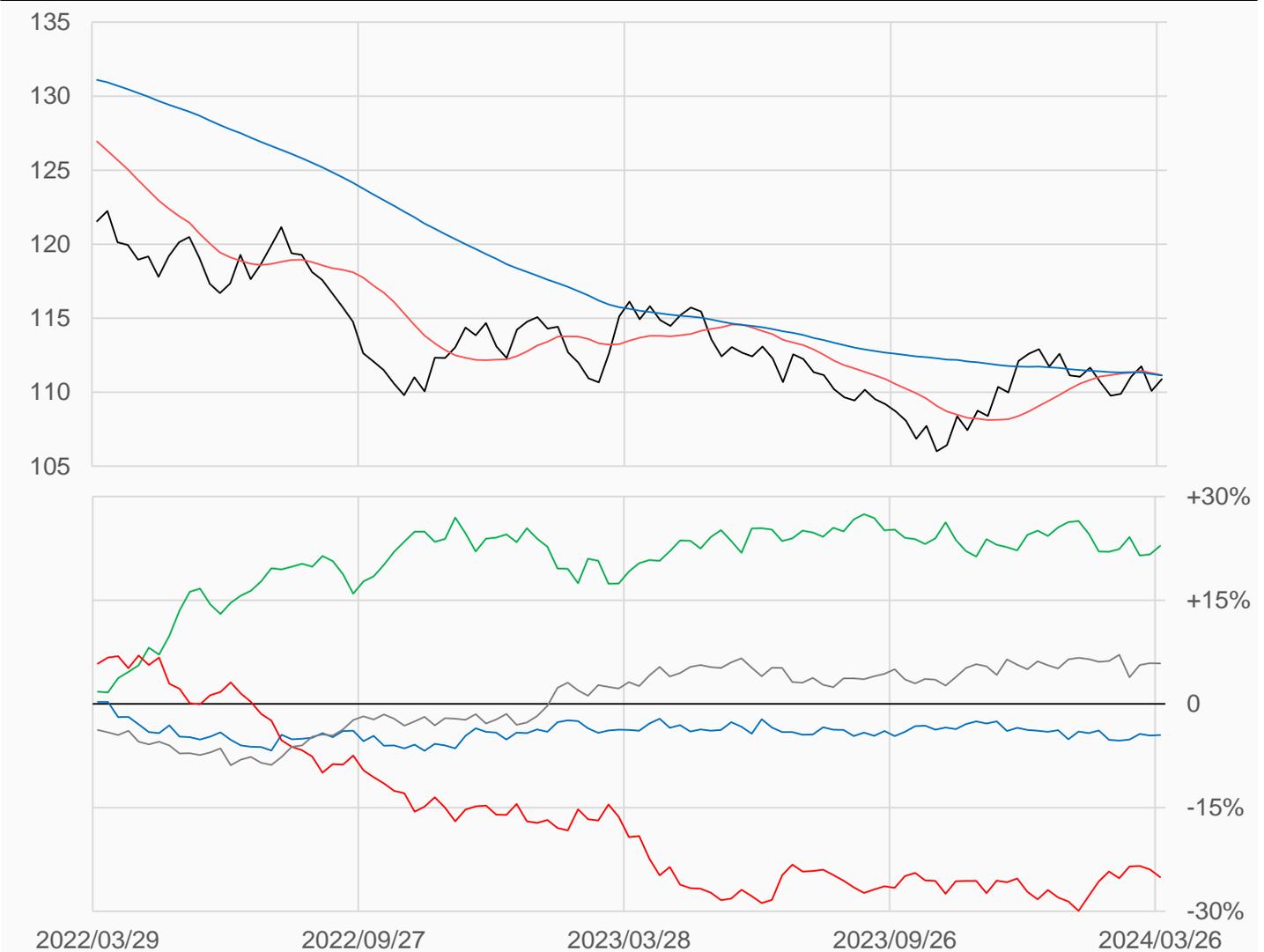
10年債

美國10年公債較前一週上漲0.7969點收在110.875點，
 槓桿基金多單減少4907口，空單增加35960口，
 淨空單較前一週增加40867口至1252106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
2024/03/26	5062898	4994466	-68432	-1.35%	110 56/64	↑ + 51/64
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	275914	-37973	500932	-44165	-225018	+6192
資產管理	2952612	+14837	1809679	-32063	+1142933	+46900
槓桿基金	816049	-4907	2068155	+35960	-1252106	-40867
其他	510240	-37805	218195	-30543	+292045	-7262

週五收盤價與13週與52週平均線

— TY — 13週 111.16 — 52週 111.13



淨部位佔總OI% 經紀 -4.5% 資管 +22.9% 槓桿 -25.1% 其他 +5.8%

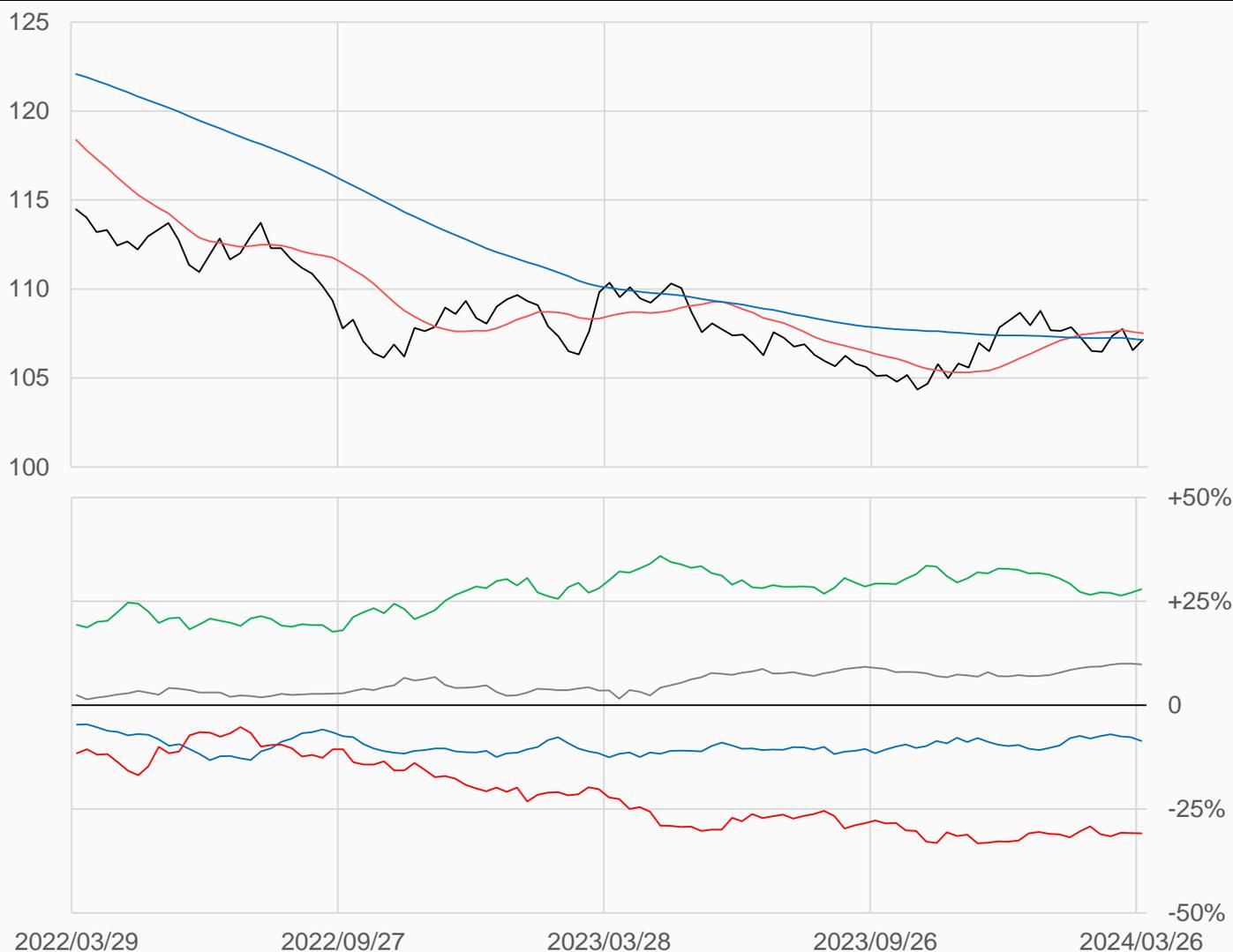
5年公債

美國5年公債較前一週上漲0.5938點收在107.15625點，
 槓桿基金多單減少26064口，空單減少25941口，
 淨空單較前一週增加123口至1907448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
2024/03/26	6200995	6188096	-12899	-0.21%	107 20/128	↑ + 76/128
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	211847	-66114	746224	-9154	-534377	-56960
資產管理	3718302	+93485	1991618	+45968	+1726684	+47517
槓桿基金	1134097	-26064	3041545	-25941	-1907448	-123
其他	700765	-21726	92098	-9376	+608667	-12350

週五收盤價與13週與52週平均線

— FV — 13週 107.51 — 52週 107.14



淨部位佔總OI% 經紀 -8.6% 資管 +27.9% 槓桿 -30.8% 其他 +9.8%

2年公債

美國2年公債較前一週上漲0.2539點收在102.38671875點，

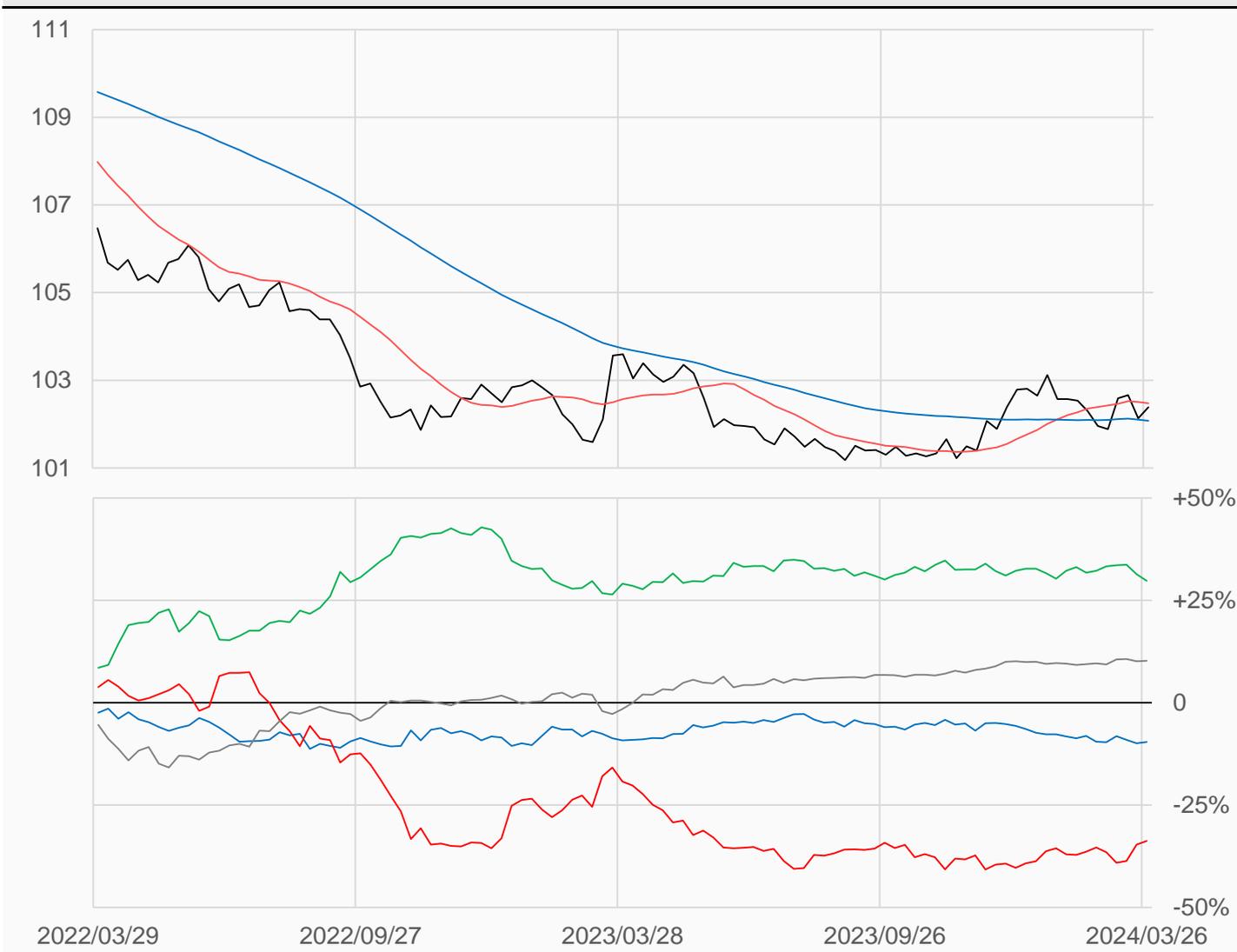
槓桿基金多單增加24244口，空單減少8596口，

淨空單較前一週減少32840口至1278081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
2024/03/26	3785679	3791606	+5927	+0.16%	102 50/128	↑ + 33/128
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	126207	-5596	490270	-16289	-364063	+10693
資產管理	2085075	-31740	954741	+25928	+1130334	-57668
槓桿基金	773121	+24244	2051202	-8596	-1278081	+32840
其他	550105	+10355	160517	+3850	+389588	+6505

週五收盤價與13週與52週平均線

— TU — 13週 102.47 — 52週 102.08



淨部位佔總OI% 經紀 -9.6% 資管 +29.8% 槓桿 -33.7% 其他 +10.3%

歐元

歐元較前一週下跌87點收在10844.5點，
 槓桿基金多單增加813口，空單增加7119口，
 淨空單較前一週增加6306口至39227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
2024/03/26	740117	747280	+7163	+0.97%	10844.5	↓ -87.0
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	47889	+3181	344851	-18023	-296962	+21204
資產管理	457996	-97	161774	+11539	+296222	-11636
槓桿基金	126237	+813	165464	+7119	-39227	-6306
其他	36317	+2579	19161	+2695	+17156	-116

週五收盤價與13週與52週平均線

— EC — 13週 10895 — 52週 10872



淨部位佔總OI% 經紀 -39.7% 資管 +39.6% 槓桿 -5.2% 其他 +2.3%

日圓

日圓較前一週下跌115點收在6690.5點，
 槓桿基金多單增加8259口，空單增加9098口，
 淨空單較前一週增加839口至81644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
2024/03/26	336370	344304	+7934	+2.36%	6690.5	↓ -115.0
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	126649	+5889	7528	-1844	+119121	+7733
資產管理	69994	+297	128556	-670	-58562	+967
槓桿基金	75602	+8259	157246	+9098	-81644	-839
其他	23296	-5519	3488	+768	+19808	-6287

週五收盤價與13週與52週平均線

— JY — 13週 6816.7 — 52週 6985.4



淨部位佔總OI% 經紀 +34.6% 資管 -17.0% 槓桿 -23.7% 其他 +5.8%

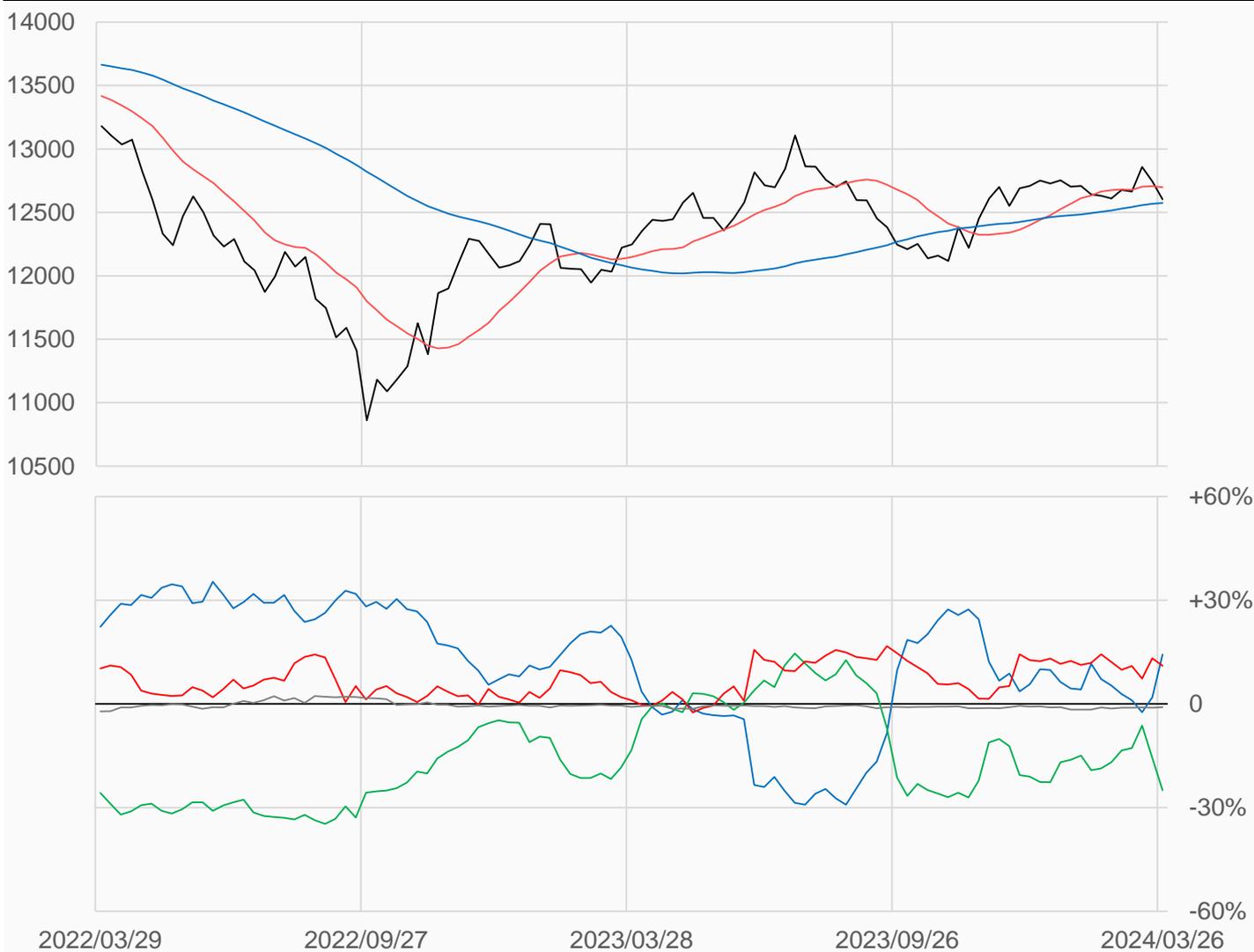
英鎊

英鎊較前一週下跌141點收在12604點，
 槓桿基金多單增加8259口，空單增加12195口，
 淨多單較前一週減少3936口至27142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
2024/03/26	234847	246625	+11778	+5.02%	12604	↓ -141
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	50722	+25941	15412	-4852	+35310	+30793
資產管理	54045	-21358	115712	+3600	-61667	-24958
槓桿基金	110238	+8259	83096	+12195	+27142	-3936
其他	1146	+33	3394	-345	-2248	+378

週五收盤價與13週與52週平均線

— BP — 13週 12698 — 52週 12574



淨部位佔總OI% 經紀 +14.3% 資管 -25.0% 槓桿 +11.0% 其他 -0.9%

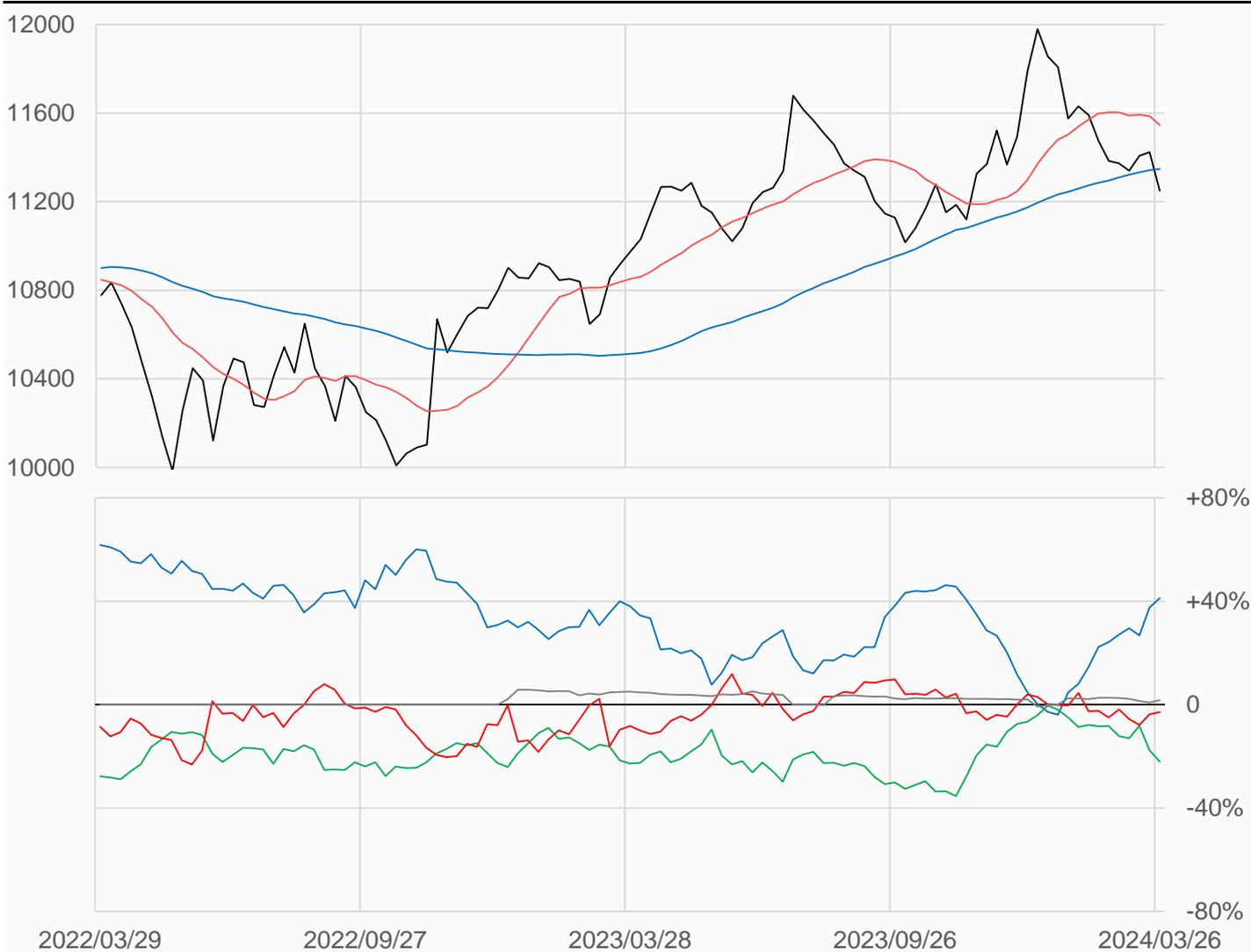
瑞郎

瑞郎較前一週下跌175點收在11250點，
 槓桿基金多單增加2422口，空單增加2045口，
 淨空單較前一週減少377口至2421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
2024/03/26	75083	84155	+9072	+12.08%	11250	↓ -175
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	35214	+6494	508	+3	+34706	+6491
資產管理	18834	-625	37409	+4653	-18575	-5278
槓桿基金	18279	+2422	20700	+2045	-2421	+377
其他	1883	+830	461	0	+1422	+830

週五收盤價與13週與52週平均線

— SF — 13週 11546 — 52週 11348



淨部位佔總OI% 經紀 +41.2% 資管 -22.1% 槓桿 -2.9% 其他 +1.7%

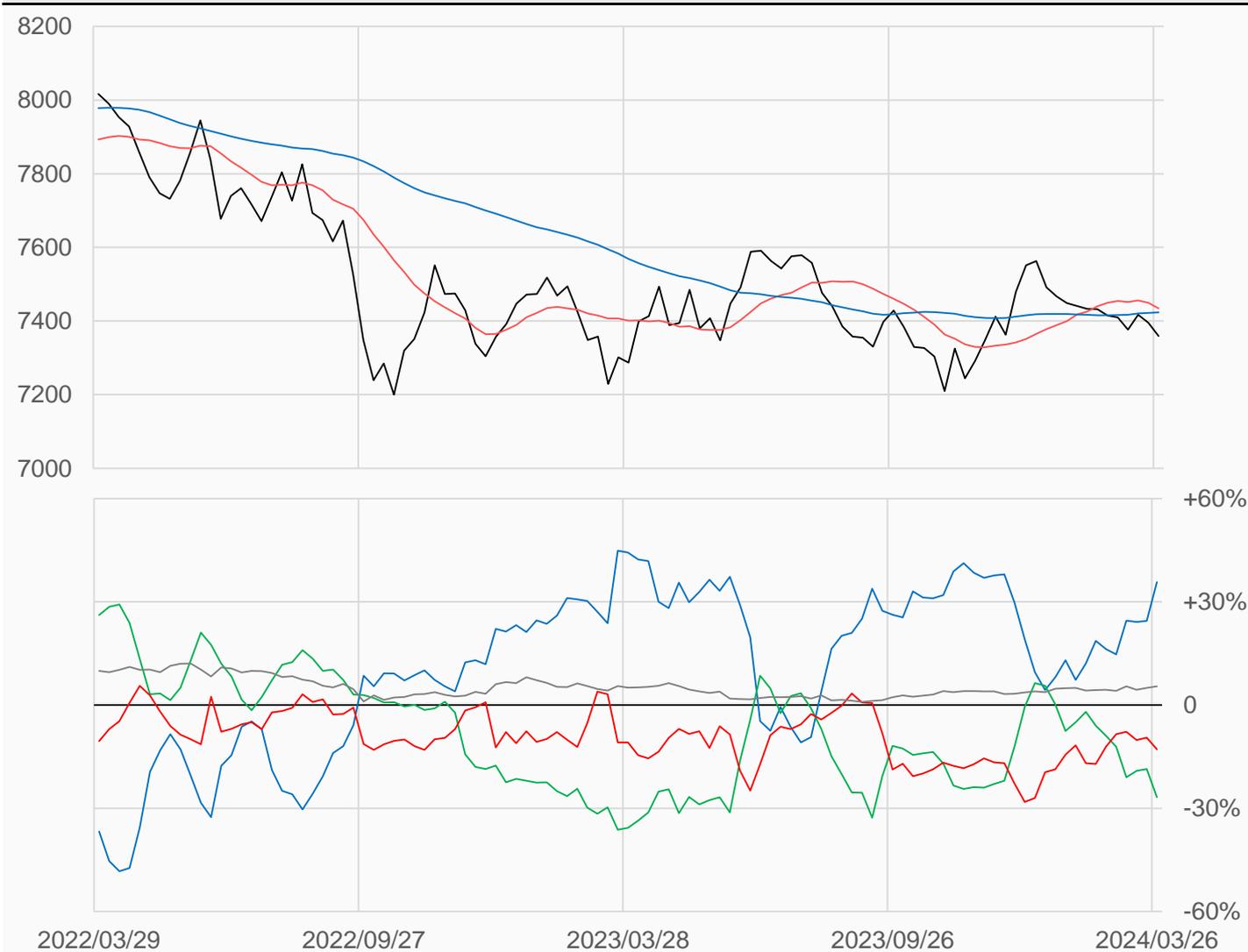
加幣

加幣較前一週下跌36.5點收在7359點，
 槓桿基金多單減少8439口，空單減少5092口，
 淨空單較前一週增加3347口至26747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
2024/03/26	246693	207433	-39260	-15.91%	7359.0	↓ -36.5
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	80724	-30911	6496	-44859	+74228	+13948
資產管理	46990	+412	102612	+10143	-55622	-9731
槓桿基金	35846	-8439	62593	-5092	-26747	-3347
其他	14562	-811	3300	+200	+11262	-1011

週五收盤價與13週與52週平均線

— CD — 13週 7434.4 — 52週 7423.7



淨部位佔總OI% 經紀 +35.8% 資管 -26.8% 槓桿 -12.9% 其他 +5.4%

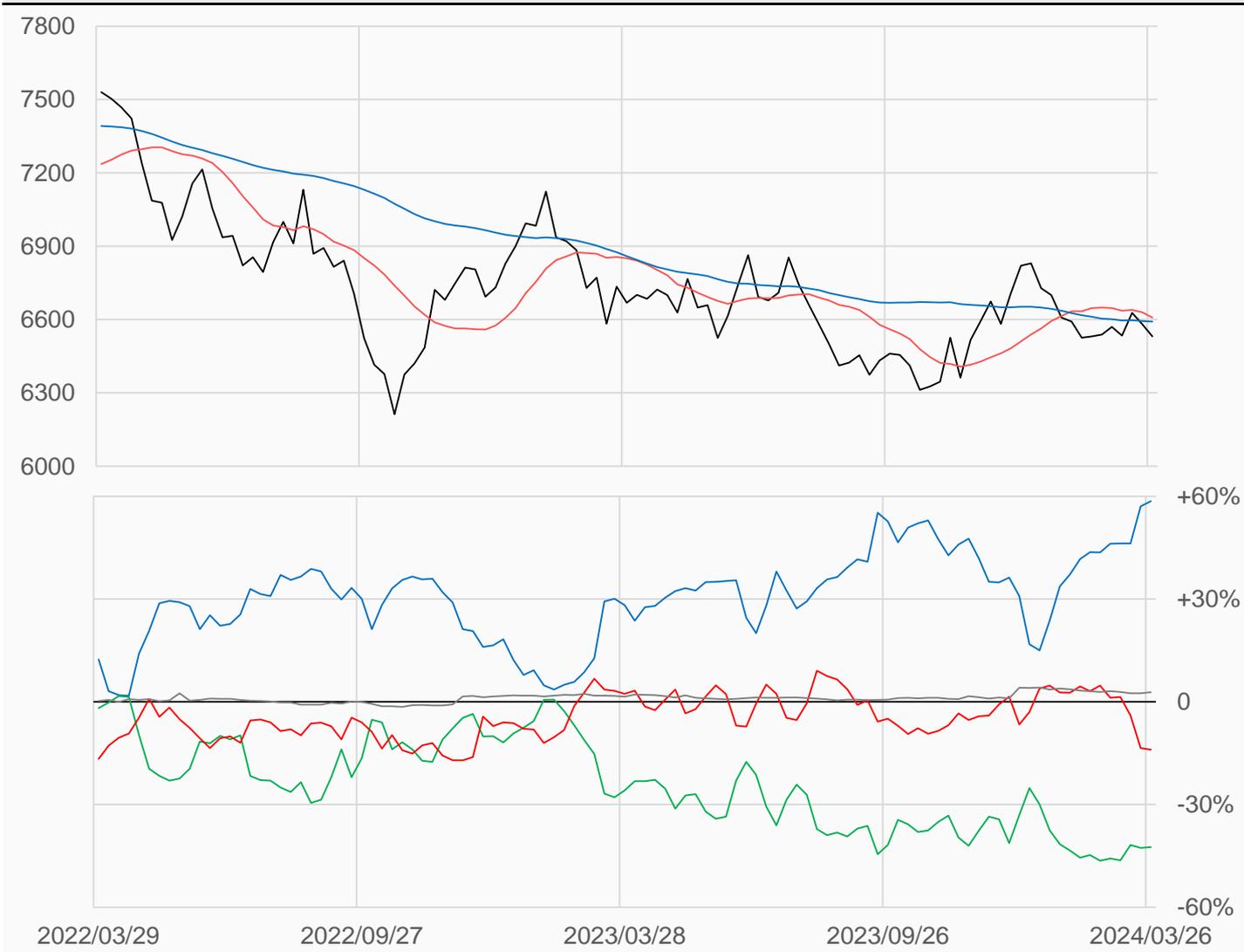
澳幣

澳幣較前一週下跌50點收在6530.5點，
 槓桿基金多單減少8002口，空單減少7226口，
 淨空單較前一週增加776口至32567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
2024/03/26	235310	232888	-2422	-1.03%	6530.5	↓ -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	139879	+2676	3431	+617	+136448	+2059
資產管理	39095	+3638	137935	+2053	-98840	+1585
槓桿基金	28291	-8002	60858	-7226	-32567	-776
其他	6461	+516	0	0	+6461	+516

週五收盤價與13週與52週平均線

— AD — 13週 6607.4 — 52週 6591.6



淨部位佔總OI% 經紀 +58.6% 資管 -42.4% 槓桿 -14.0% 其他 +2.8%

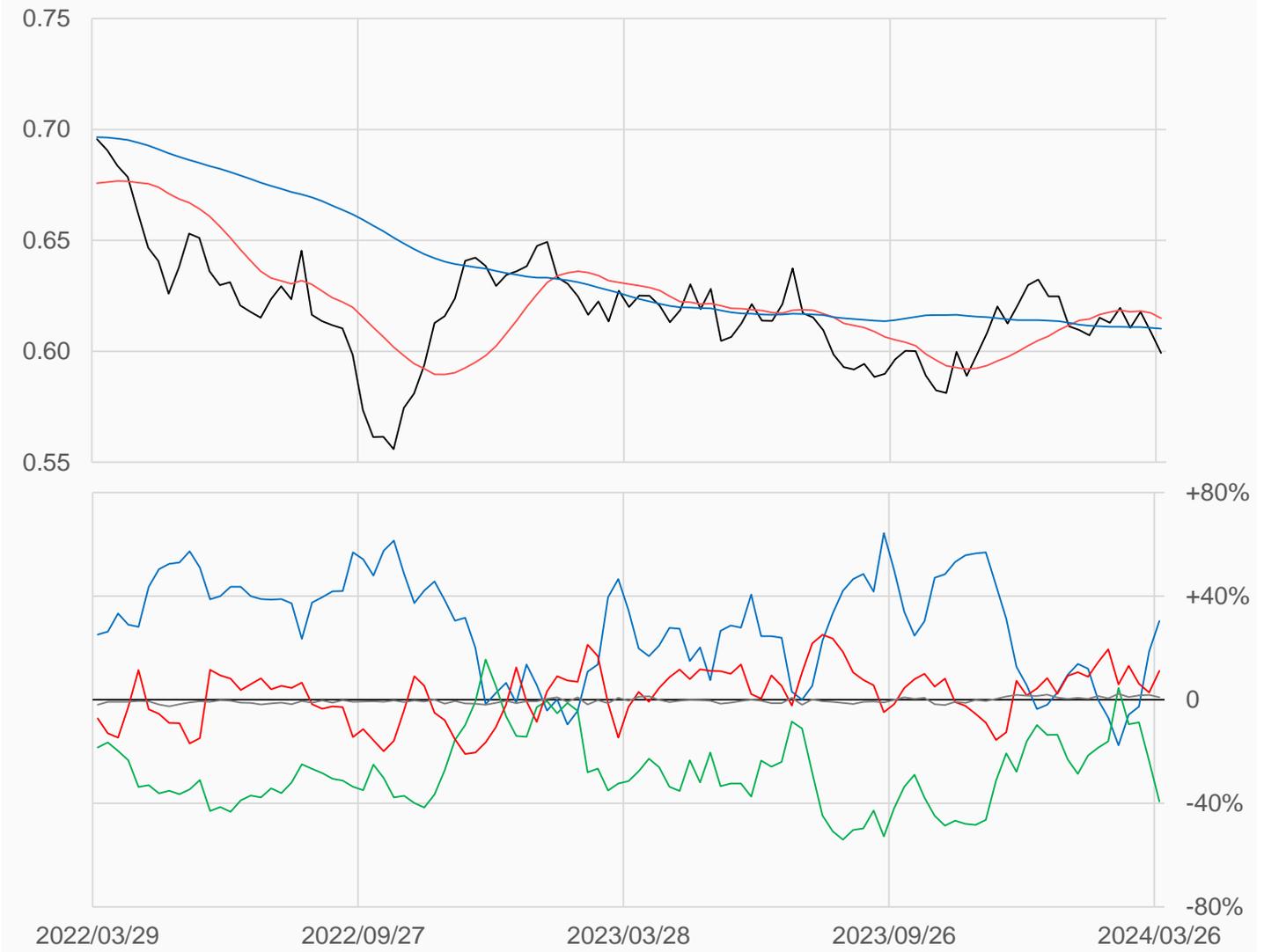
紐幣

紐幣較前一週下跌0.0096點收在0.59925點，
 槓桿基金多單增加1909口，空單減少2655口，
 淨多單較前一週增加4564口至5947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
2024/03/26	50302	53416	+3114	+6.19%	0.5993	↓ -0.0096
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	23055	+7000	6828	+159	+16227	+6841
資產管理	9557	-5153	30533	+3895	-20976	-9048
槓桿基金	16205	+1909	10258	-2655	+5947	+4564
其他	832	-130	323	+323	+509	-453

週五收盤價與13週與52週平均線

— NE — 13週 0.6149 — 52週 0.6102



淨部位佔總OI% 經紀 +30.4% 資管 -39.3% 槓桿 +11.1% 其他 +1.0%

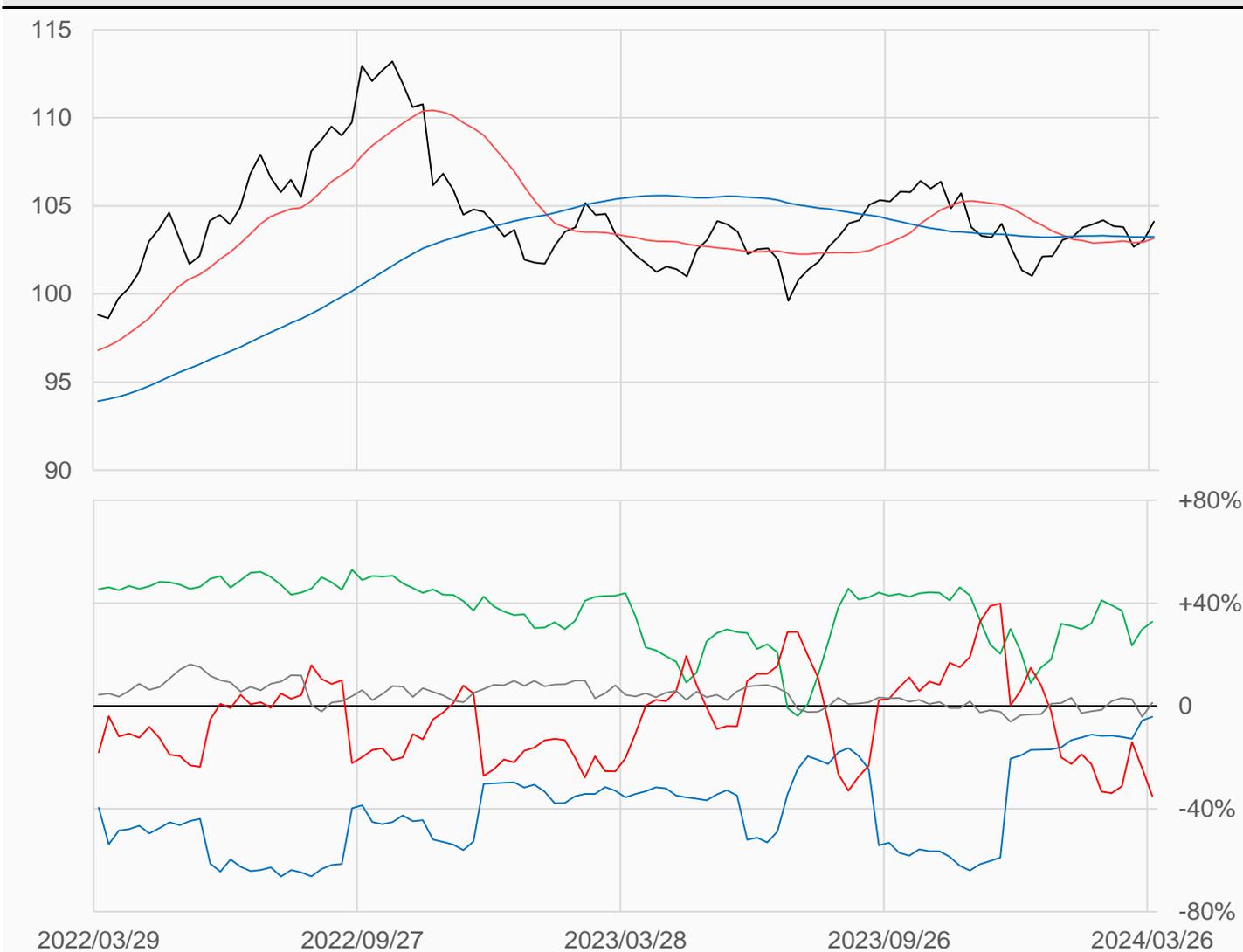
美元

美元較前一週上漲1.051點收在104.115點，
 槓桿基金多單增加3016口，空單增加8450口，
 淨空單較前一週增加5434口至11213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
2024/03/26	23849	32037	+8188	+34.33%	104.115	↑ +1.051
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	138	+8	1487	0	-1349	+8
資產管理	14086	+3024	3576	-371	+10510	+3395
槓桿基金	11610	+3016	22823	+8450	-11213	-5434
其他	2418	+1464	2014	+57	+404	+1407

週五收盤價與13週與52週平均線

— DX — 13週 103.16 — 52週 103.26



淨部位佔總OI% 經紀 -4.2% 資管 +32.8% 槓桿 -35.0% 其他 +1.3%

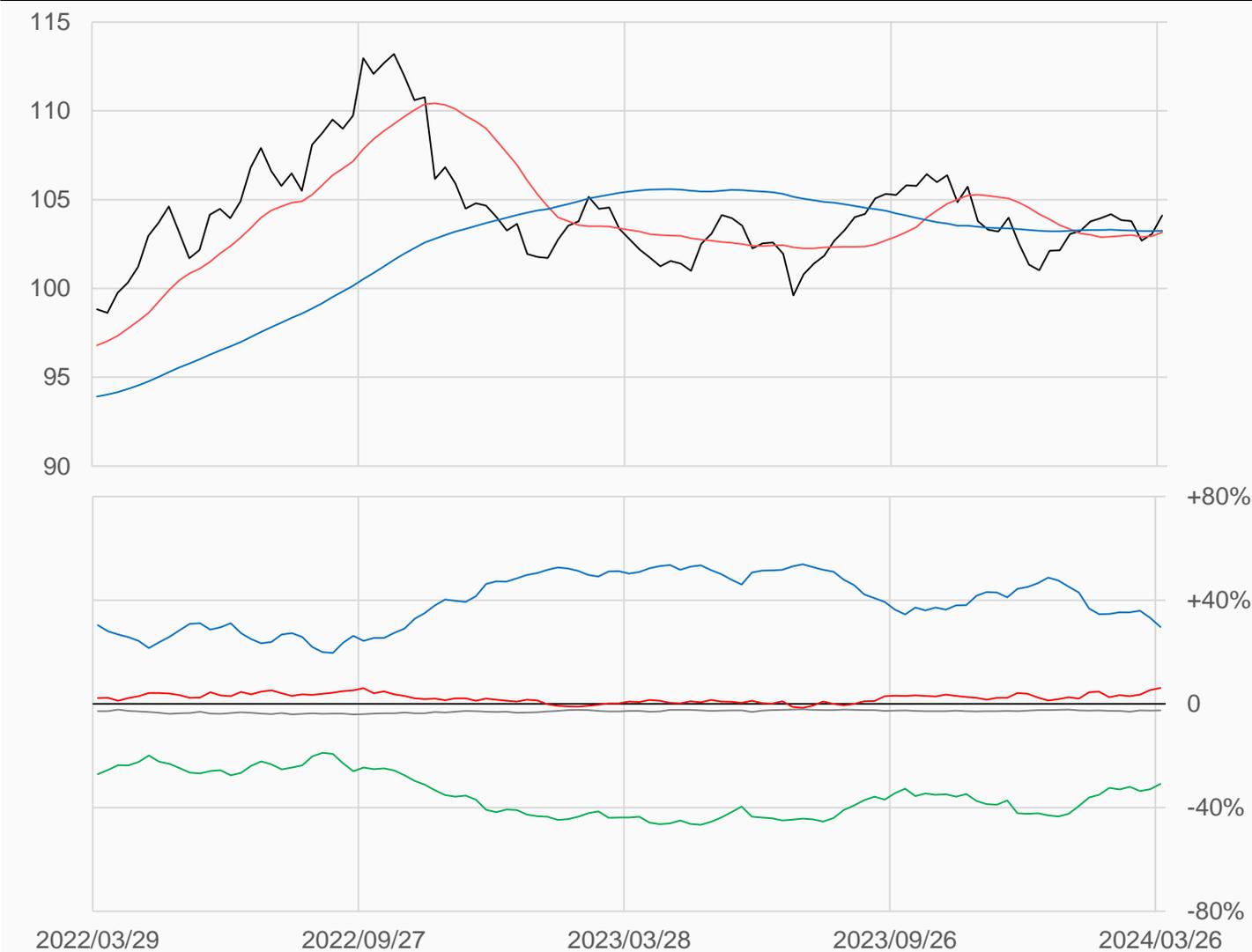
綜合美元 (不含美元)

綜合美元較前一週上漲1.051點收在104.115點，
槓桿基金多單增加11138口，空單增加2731口，
淨多單較前一週增加8407口至61944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
2024/03/26	999142.8	1007239	+8096	+0.81%	104.115	↑ +1.051
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	403807.1	-26449	105053	+6130	+298754	-32579
資產管理	249223.1	+15160	559827.6	-3073	-310605	+18233
槓桿基金	245620	+11138	183676.4	+2731	+61944	+8407
其他	23739.42	+3240	48721.77	+1886	-24982	+1354

週五收盤價與13週與52週平均線

— DXY — 13週 103.16 — 52週 103.26



淨部位佔總OI% 經紀 +29.7% 資管 -30.8% 槓桿 +6.1% 其他 -2.5%

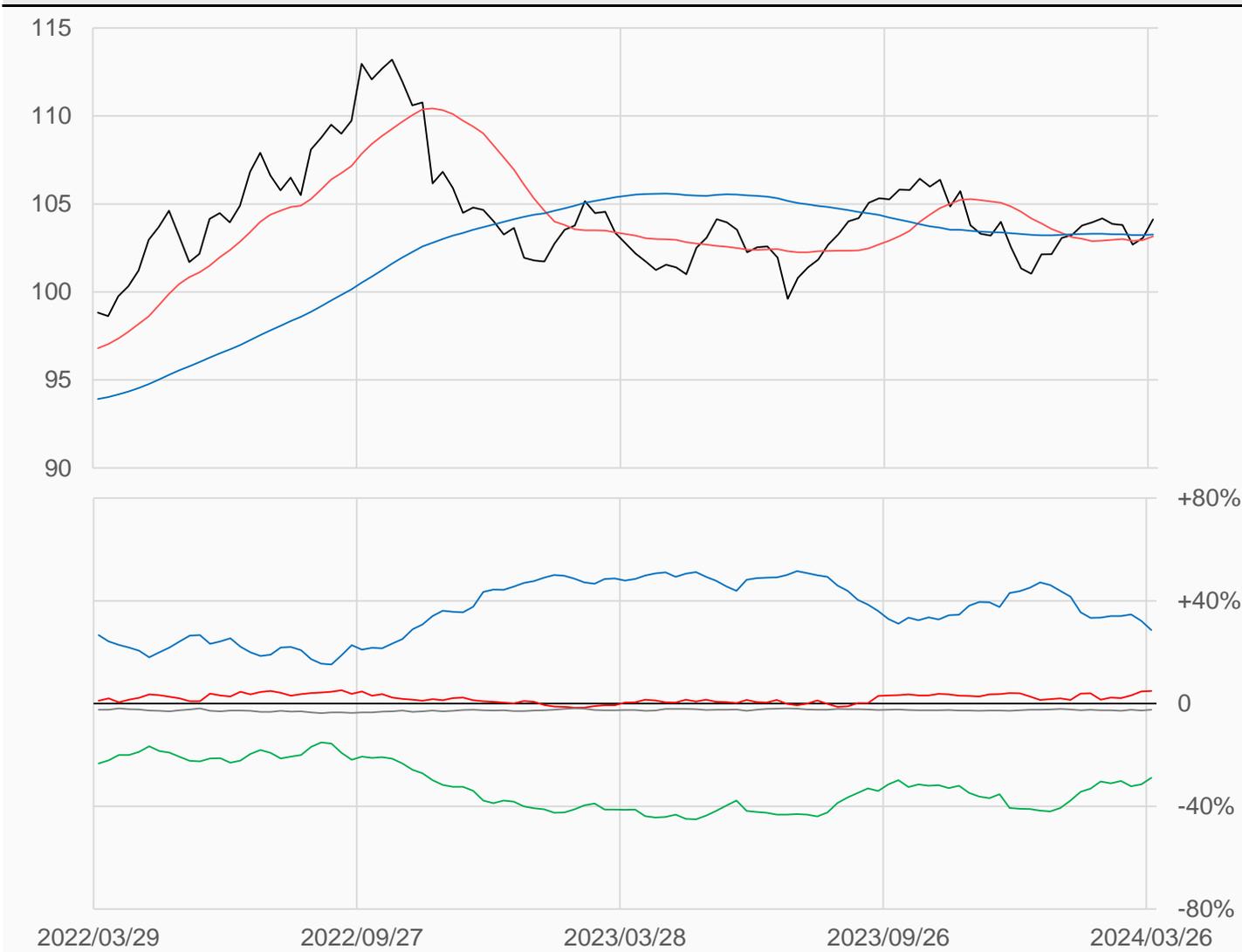
綜合美元 (含美元)

綜合美元較前一週上漲1.051點收在104.115點，
槓桿基金多單增加14154口，空單增加11181口，
淨多單較前一週增加2973口至50731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
2024/03/26	1022992	1039276	+16284	+1.59%	104.115	↑ +1.051
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	403945.1	-26441	106540	+6130	+297405	-32571
資產管理	263309.1	+18184	563403.6	-3444	-300095	+21628
槓桿基金	257230	+14154	206499.4	+11181	+50731	+2973
其他	26157.42	+4704	50735.77	+1943	-24578	+2761

週五收盤價與13週與52週平均線

— DXX — 13週 103.16 — 52週 103.26



淨部位佔總OI% 經紀 +28.6% 資管 -28.9% 槓桿 +4.9% 其他 -2.4%

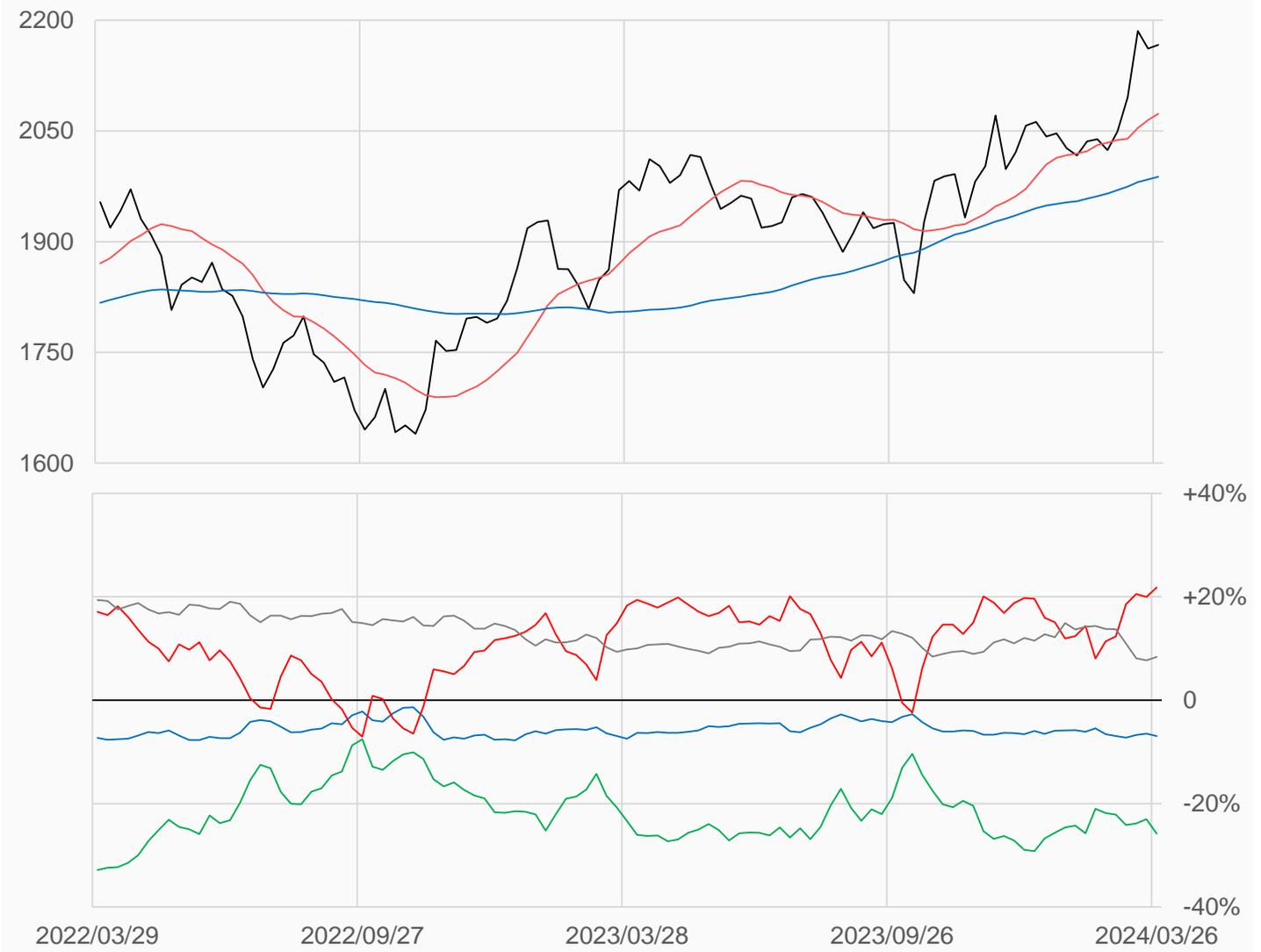
黃金

黃金較前一週上漲5點收在2166.5點，
 管理基金多單減少28607口，空單減少28860口，
 淨多單較前一週增加253口至157720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
2024/03/26	789118	723391	-65727	-8.33%	2166.5	↑ +5.0
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	45210	-1534	95321	-2426	-50111	+892
互換交易	152484	-6214	338982	-1433	-186498	-4781
管理基金	244457	-28607	86737	-28860	+157720	+253
其他	227084	-27171	166439	-26997	+60645	-174

週五收盤價與13週與52週平均線

— GC — 13週 2073.3 — 52週 1987.9



淨部位佔總OI% 生產 -6.9% 互換 -25.8% 管理 +21.8% 其他 +8.4%

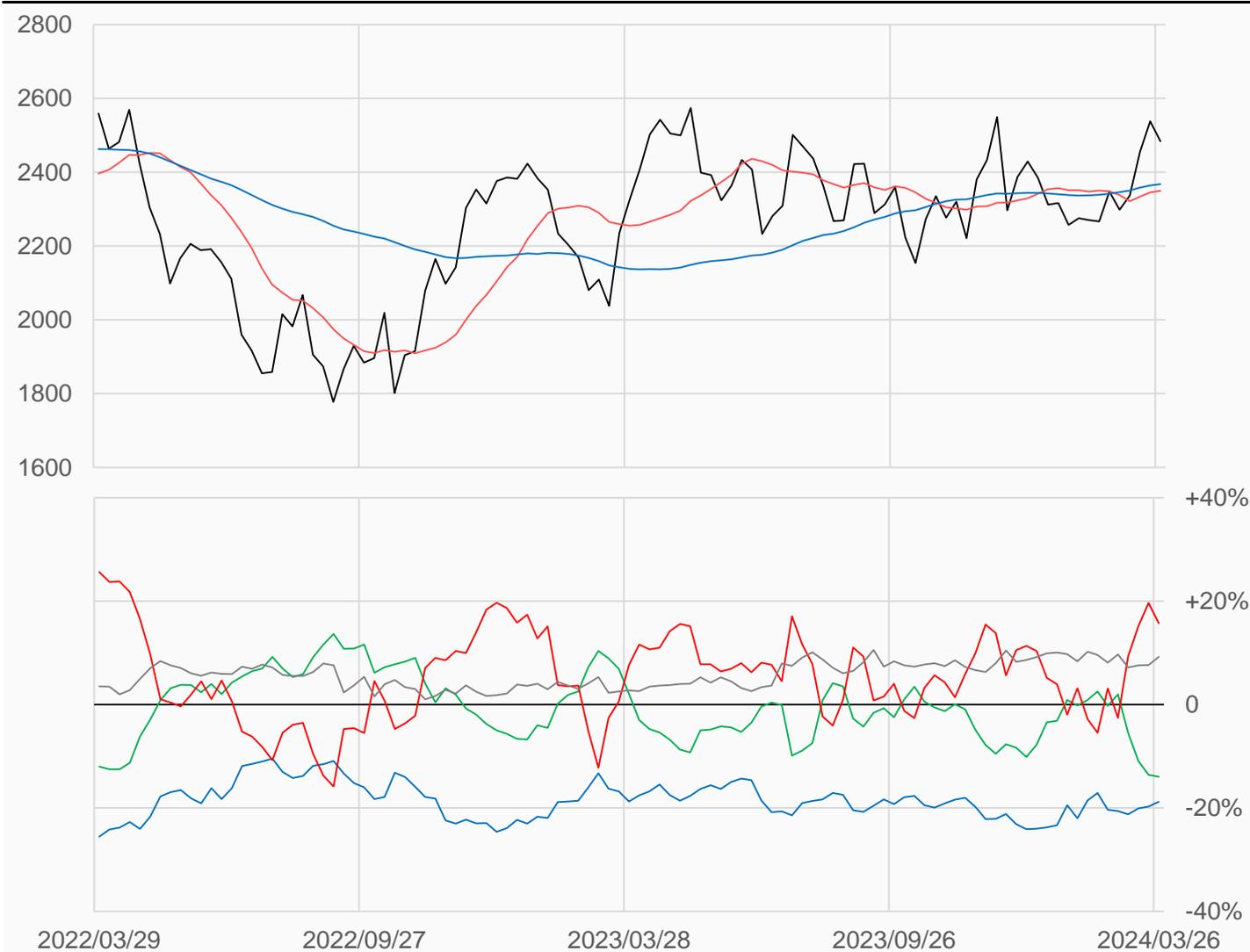
白銀

白銀較前一週下跌54.1點收在2484點，
管理基金多單減少938口，空單增加6699口，
淨多單較前一週減少7637口至30182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
2024/03/26	192474	191539	-935	-0.49%	2484.0	↓ -54.1
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	8599	+1457	44586	-476	-35987	+1933
互換交易	41336	+99	68067	+647	-26731	-548
管理基金	62556	-938	32374	+6699	+30182	-7637
其他	48018	-3015	30276	-6063	+17742	+3048

週五收盤價與13週與52週平均線

— SI — 13週 2349.4 — 52週 2367.5



淨部位佔總OI% 生產 -18.8% 互換 -14.0% 管理 +15.8% 其他 +9.3%

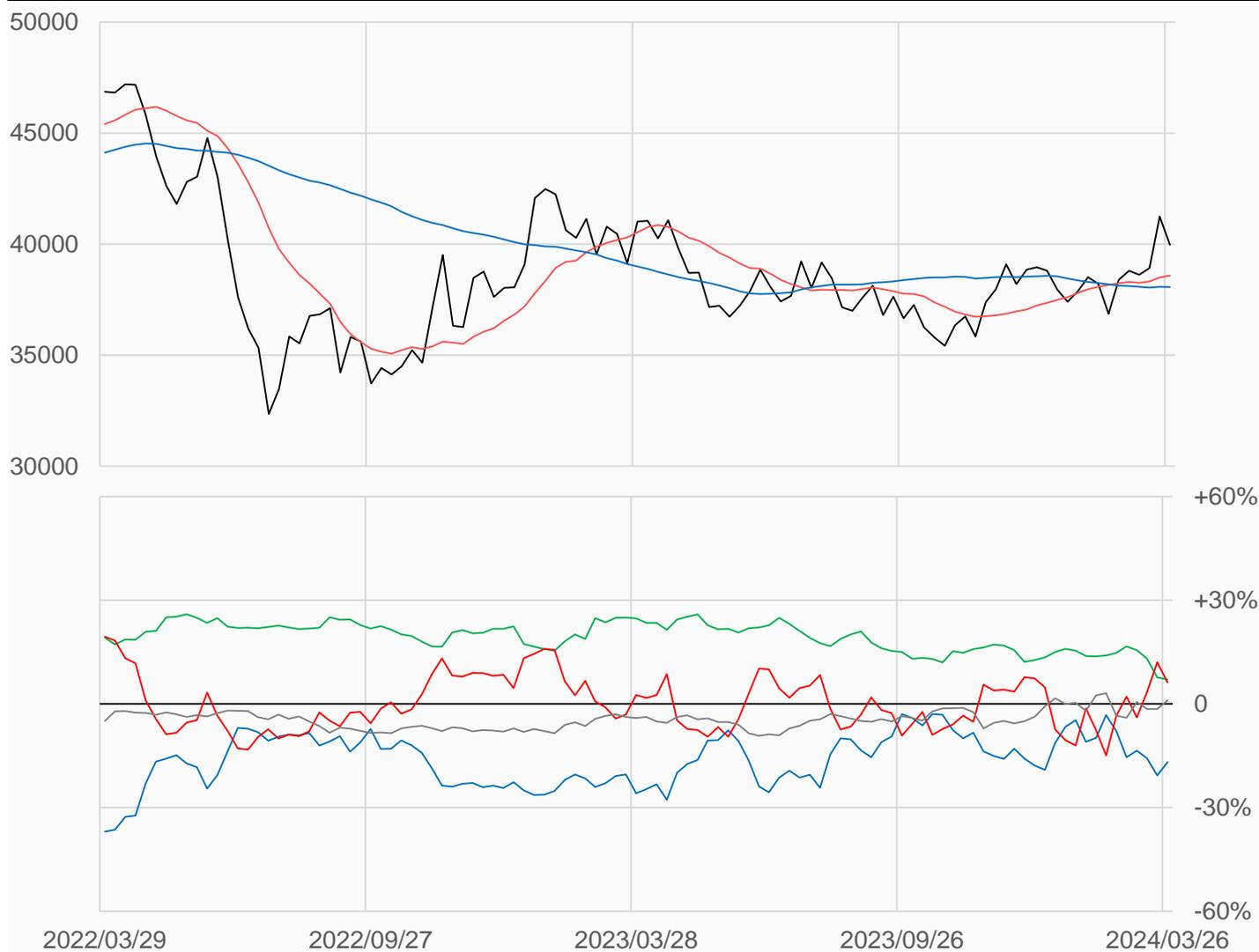
銅

銅較前一週下跌1275點收在39970點，
管理基金多單減少7632口，空單增加11369口，
淨多單較前一週減少19001口至20269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
2024/03/26	326032	326936	+904	+0.28%	39970	↓ -1275
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	30579	+9913	85684	-2506	-55105	+12419
互換交易	68287	+2557	45206	+4367	+23081	-1810
管理基金	142171	-7632	121902	+11369	+20269	-19001
其他	62269	-3575	58931	-11658	+3338	+8083

週五收盤價與13週與52週平均線

— HG — 13週 38579 — 52週 38063



淨部位佔總OI% 生產 -16.9% 互換 +7.1% 管理 +6.2% 其他 +1.0%

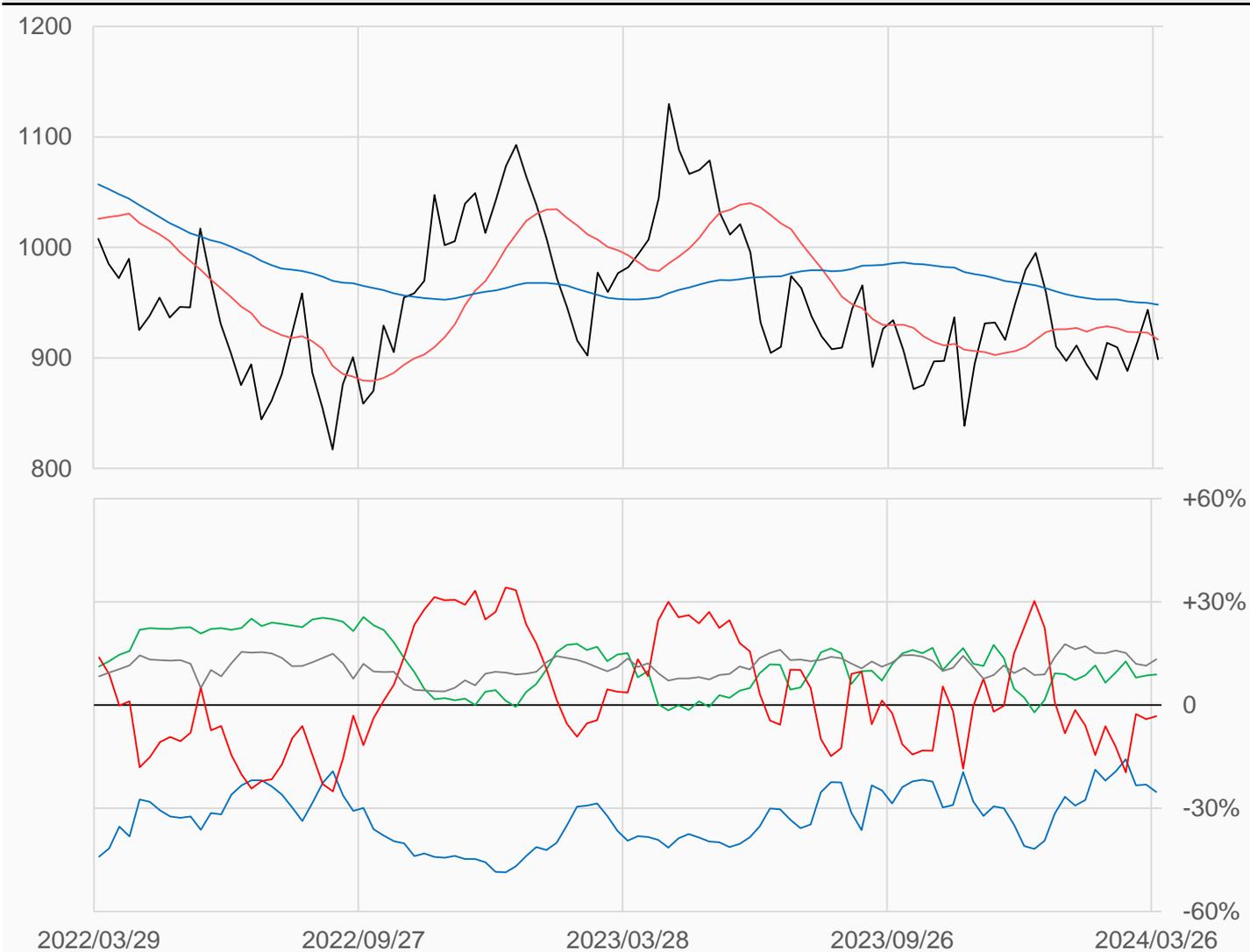
白金

白金較前一週下跌44.8點收在898.7點，
管理基金多單減少2716口，空單減少3800口，
淨空單較前一週減少1084口至2741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
2024/03/26	92856	85045	-7811	-8.41%	898.7	↓ -44.8
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	2817	-453	24314	-436	-21497	-17
互換交易	19729	-436	12173	-27	+7556	-409
管理基金	35663	-2716	38404	-3800	-2741	+1084
其他	17835	-2139	6512	-2859	+11323	+720

週五收盤價與13週與52週平均線

— PL — 13週 916.57 — 52週 948.07



淨部位佔總OI% 生產 -25.3% 互換 +8.9% 管理 -3.2% 其他 +13.3%

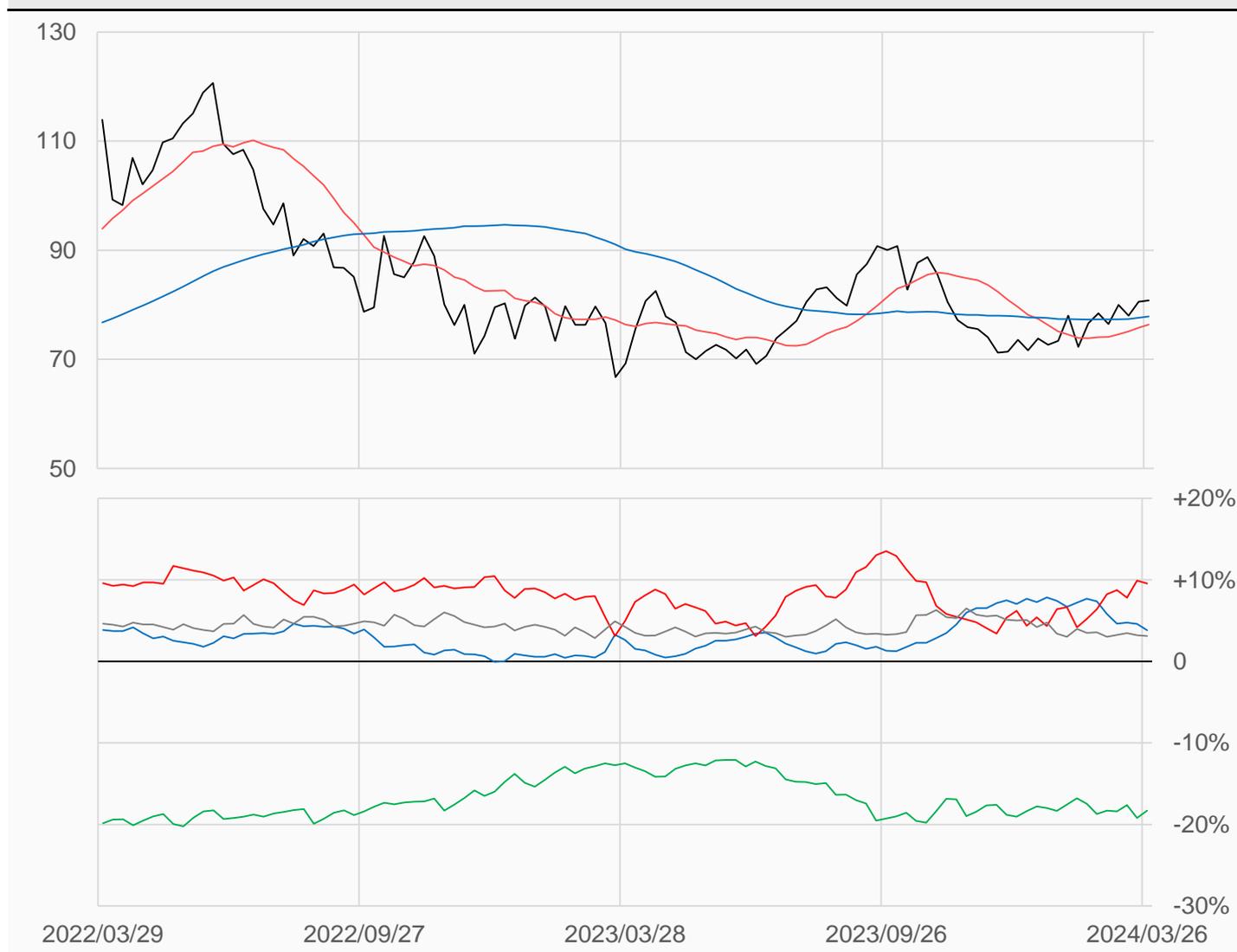
輕原油

輕原油較前一週上漲0.24點收在80.82點，
管理基金多單增加27963口，空單增加30489口，
淨多單較前一週減少2526口至217439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
2024/03/26	2218754	2276002	+57248	+2.58%	80.82	↑ +0.24
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	511479	+19444	424569	+34773	+86910	-15329
互換交易	220828	+1920	637695	-7137	-416867	+9057
管理基金	834533	+27963	617094	+30489	+217439	-2526
其他	609130	+5793	537916	+5645	+71214	+148

週五收盤價與13週與52週平均線

— CL — 13週 76.367 — 52週 77.851



淨部位佔總OI% 生產 +3.8% 互換 -18.3% 管理 +9.6% 其他 +3.1%

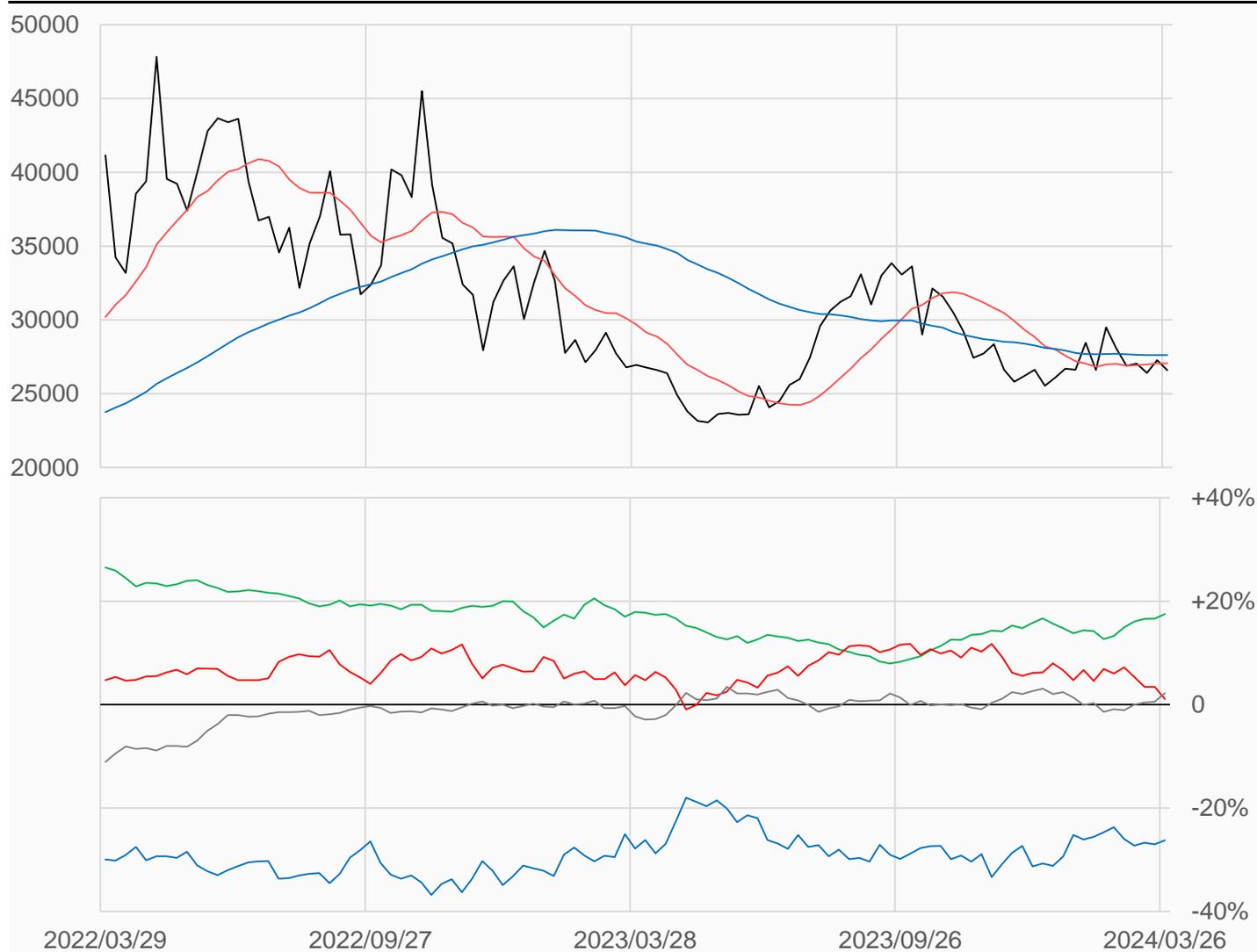
熱燃油

熱燃油較前一週下跌679點收在26591點，
管理基金多單增加4910口，空單增加12433口，
淨多單較前一週減少7523口至3444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
2024/03/26	316917	319220	+2303	+0.73%	26591	↓ -679
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	71365	-1761	155132	-3548	-83767	+1787
互換交易	70197	-679	14377	-3738	+55820	+3059
管理基金	82550	+4910	79106	+12433	+3444	-7523
其他	48025	+2113	41018	-3102	+7007	+5215

週五收盤價與13週與52週平均線

— HO — 13週 27055 — 52週 27612



淨部位佔總OI% 生產 -26.2% 互換 +17.5% 管理 +1.1% 其他 +2.2%

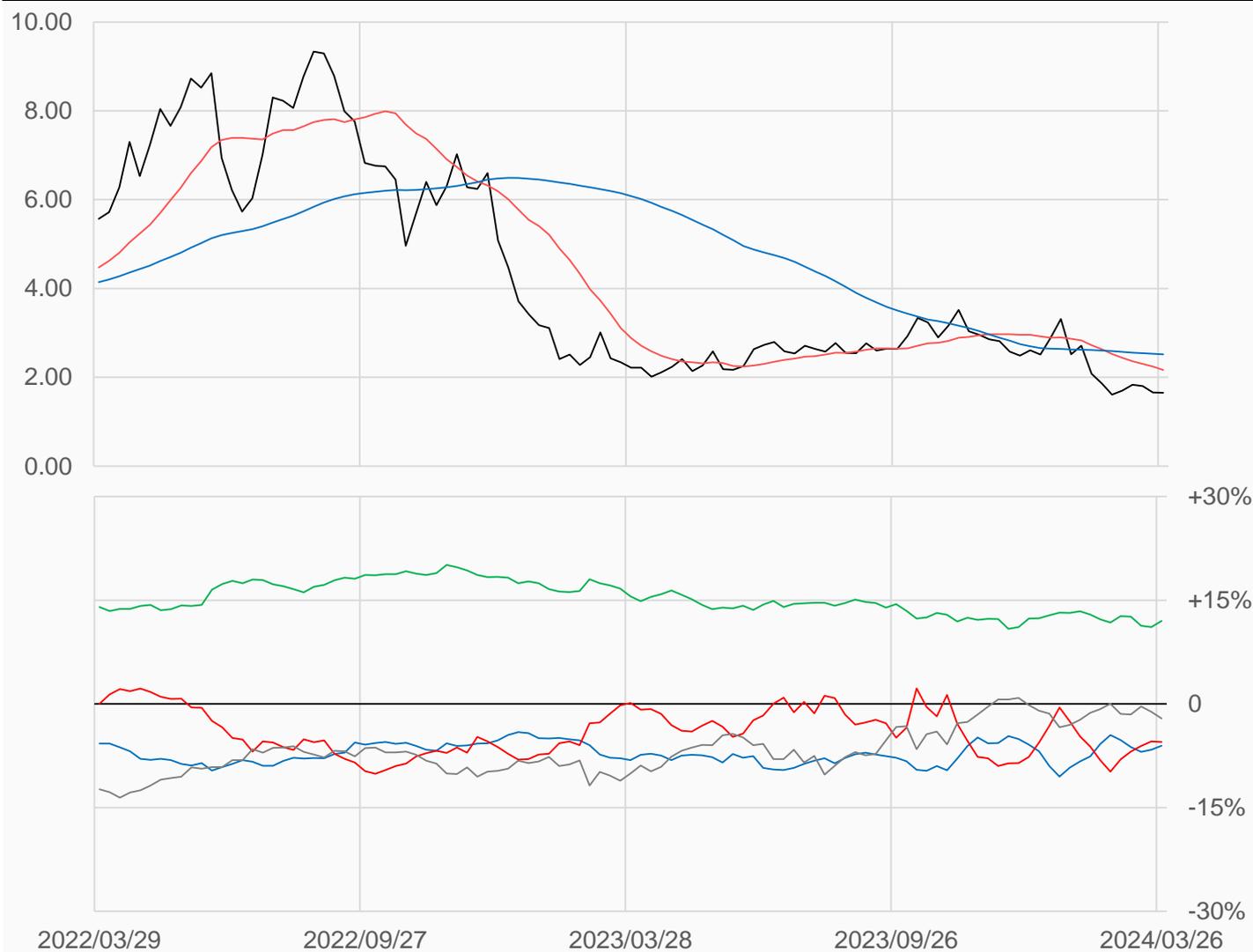
天然氣

天然氣較前一週下跌0.001點收在1.654點，
管理基金多單減少13939口，空單減少15941口，
淨空單較前一週減少2002口至85436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
2024/03/26	1609459	1557101	-52358	-3.25%	1.654	↓ -0.001
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	207739	-12442	301817	-24719	-94078	+12277
互換交易	354350	+6910	167607	-745	+186743	+7655
管理基金	655756	-13939	741192	-15941	-85436	+2002
其他	270624	-27988	303668	-13137	-33044	-14851

週五收盤價與13週與52週平均線

— NG — 13週 2.1652 — 52週 2.5168



淨部位佔總OI% 生產 -6.0% 互換 +12.0% 管理 -5.5% 其他 -2.1%

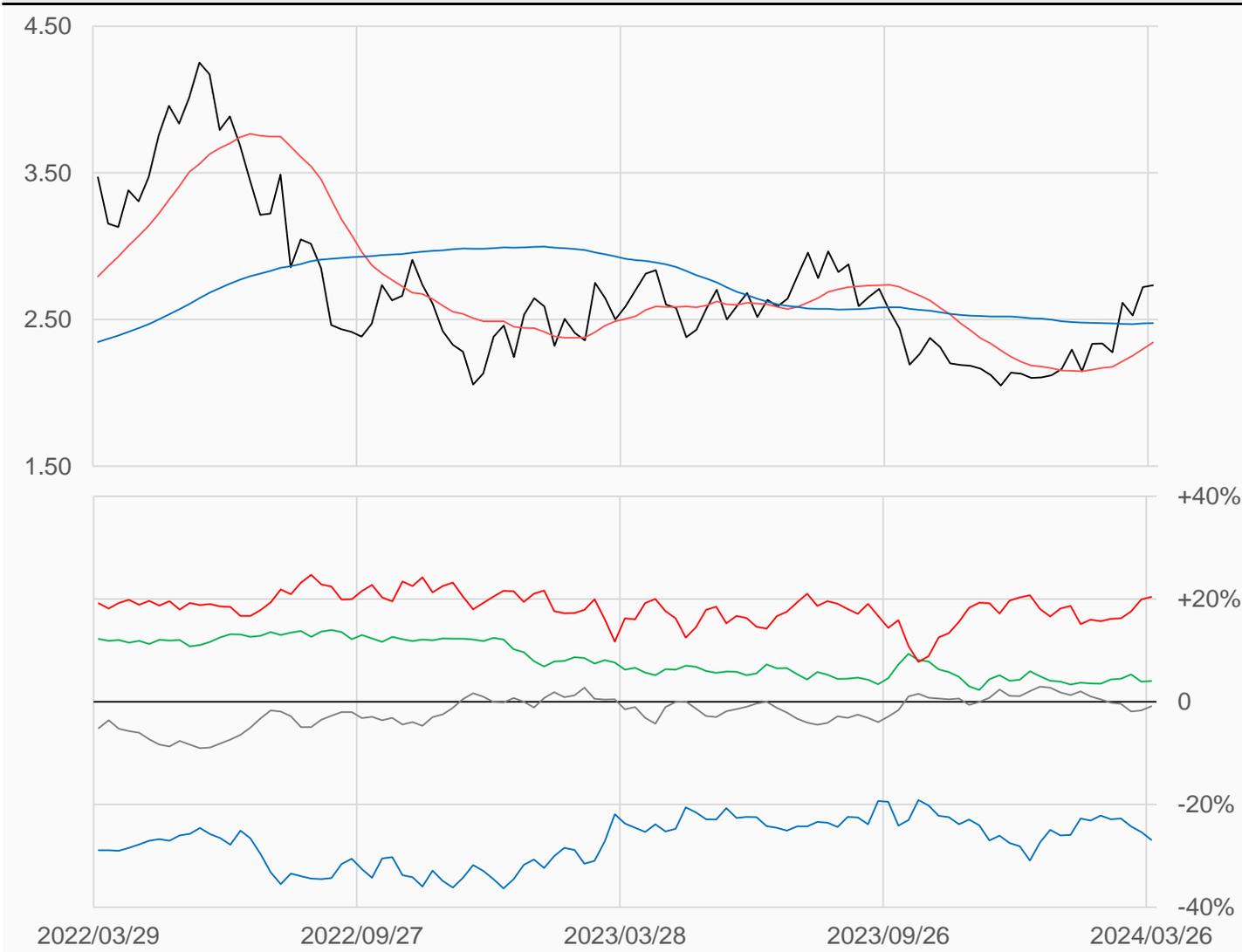
無鉛汽油

無鉛汽油較前一週上漲0.0136點收在2.7344點，
管理基金多單增加8656口，空單增加6148口，
淨多單較前一週增加2508口至79049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
2024/03/26	384040	386461	+2421	+0.63%	2.7344	↑ +0.0136
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	111627	-5557	215485	+1090	-103858	-6647
互換交易	60681	-1249	45004	-1743	+15677	+494
管理基金	147033	+8656	67984	+6148	+79049	+2508
其他	39224	-483	42505	-3624	-3281	+3141

週五收盤價與13週與52週平均線

— RB — 13週 2.3444 — 52週 2.4757



淨部位佔總OI% 生產 -26.9% 互換 +4.1% 管理 +20.5% 其他 -0.8%

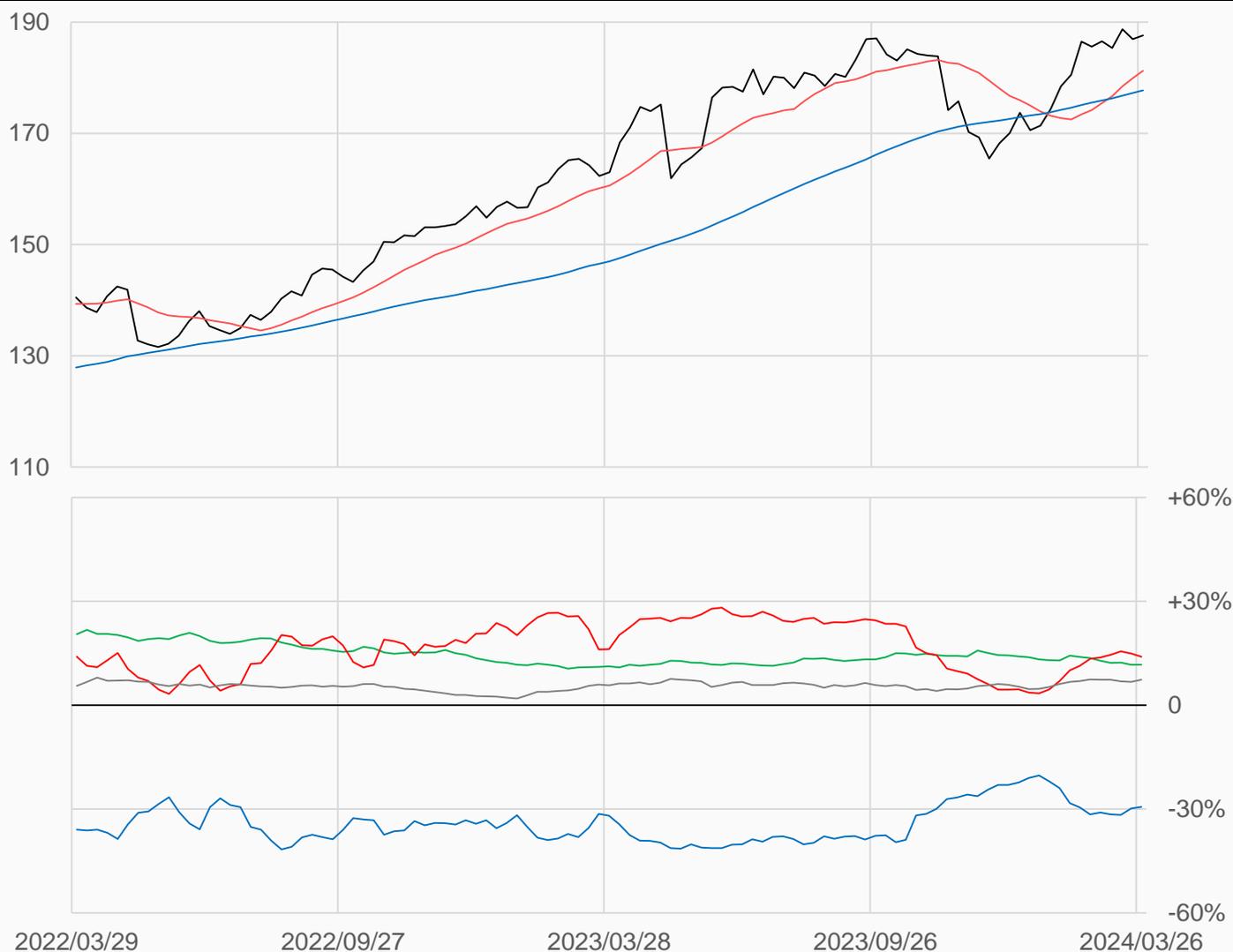
活牛

活牛較前一週上漲0.65點收在187.6點，
管理基金多單減少7254口，空單減少4027口，
淨多單較前一週減少3227口至59164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
2024/03/26	416928	422974	+6046	+1.45%	187.600	↑ +0.650
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	68870	-1678	193047	-1944	-124177	+266
互換交易	58159	+2132	8849	+1449	+49310	+683
管理基金	132934	-7254	73770	-4027	+59164	-3227
其他	126920	+12913	95821	+10070	+31099	+2843

週五收盤價與13週與52週平均線

— LC — 13週 181.25 — 52週 177.73



淨部位佔總OI% 生產 -29.4% 互換 +11.7% 管理 +14.0% 其他 +7.4%

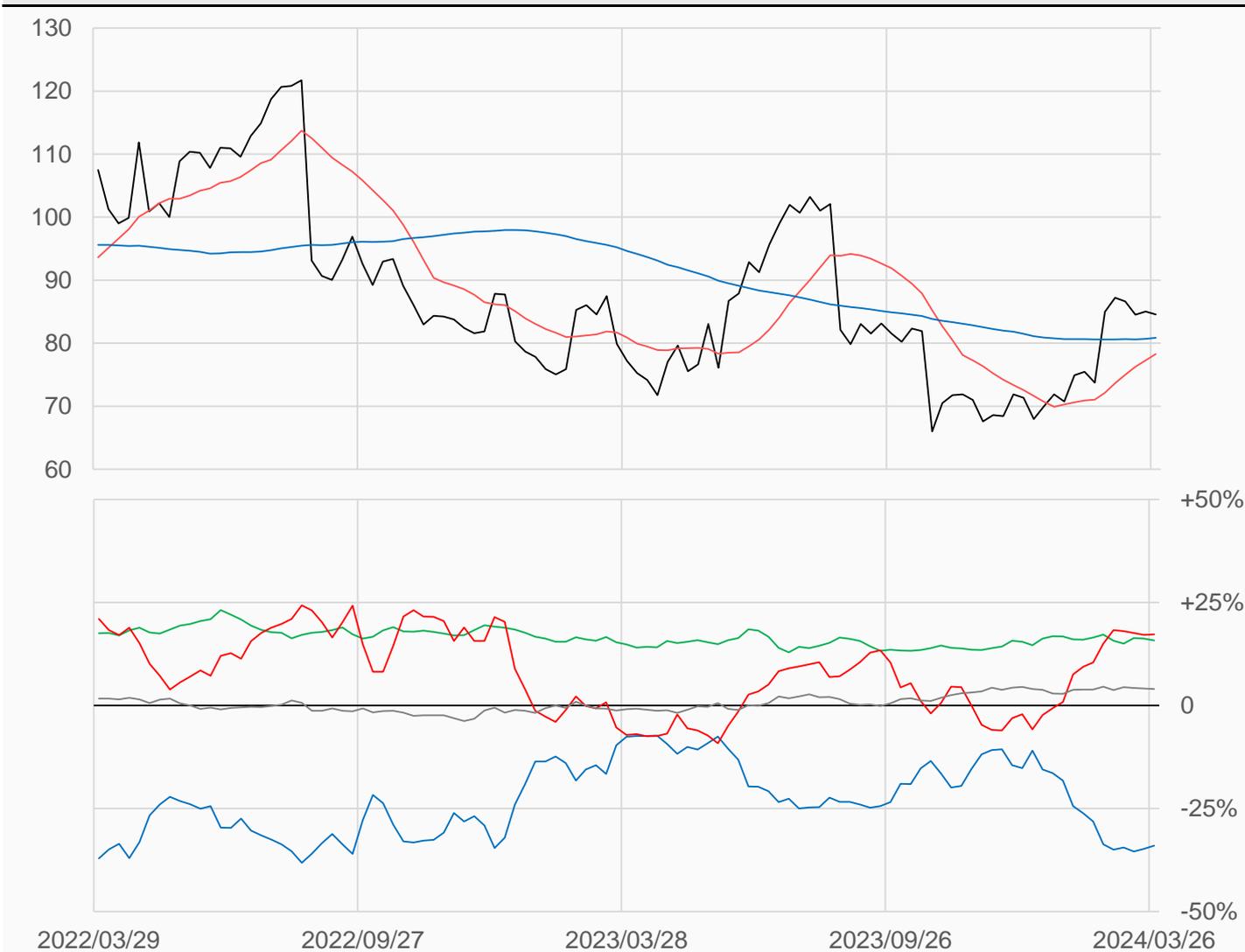
活豬

活豬較前一週下跌0.45點收在84.575點，
管理基金多單增加1624口，空單減少450口，
淨多單較前一週增加2074口至64951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
2024/03/26	366761	375591	+8830	+2.41%	84.575	↓ -0.450
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	39857	+923	167668	+1145	-127811	-222
互換交易	79031	+798	19619	+912	+59412	-114
管理基金	120429	+1624	55478	-450	+64951	+2074
其他	110689	+5235	95744	+5495	+14945	-260

週五收盤價與13週與52週平均線

— LH — 13週 78.283 — 52週 80.84



淨部位佔總OI% 生產 -34.0% 互換 +15.8% 管理 +17.3% 其他 +4.0%

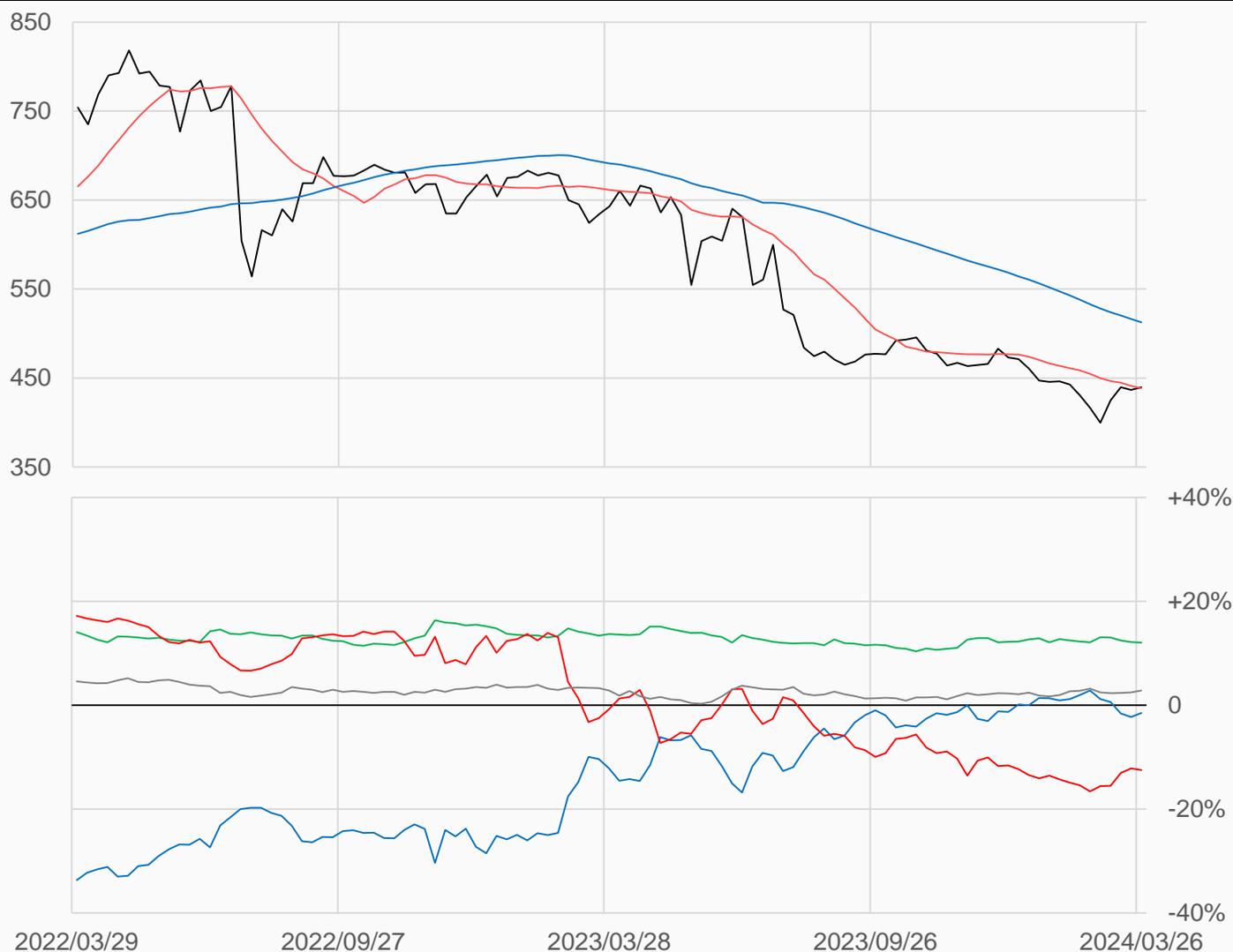
玉米

玉米較前一週上漲2.75點收在439.5點，
管理基金多單增加9707口，空單增加18449口，
淨空單較前一週增加8742口至251730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
2024/03/26	1999136	2017822	+18686	+0.93%	439.50	↑ +2.75
分類	多單OI	增減	空單OI	增減	多空淨部位	淨部位變動
生產商	474291	+6904	504101	-9009	-29810	+15913
互換交易	333799	+6128	90300	+5437	+243499	+691
管理基金	504698	+9707	756428	+18449	-251730	-8742
其他	498634	-435	441499	-7705	+57135	+7270

週五收盤價與13週與52週平均線

— ZC — 13週 438.54 — 52週 512.58



淨部位佔總OI% 生產 -1.5% 互換 +12.1% 管理 -12.5% 其他 +2.8%

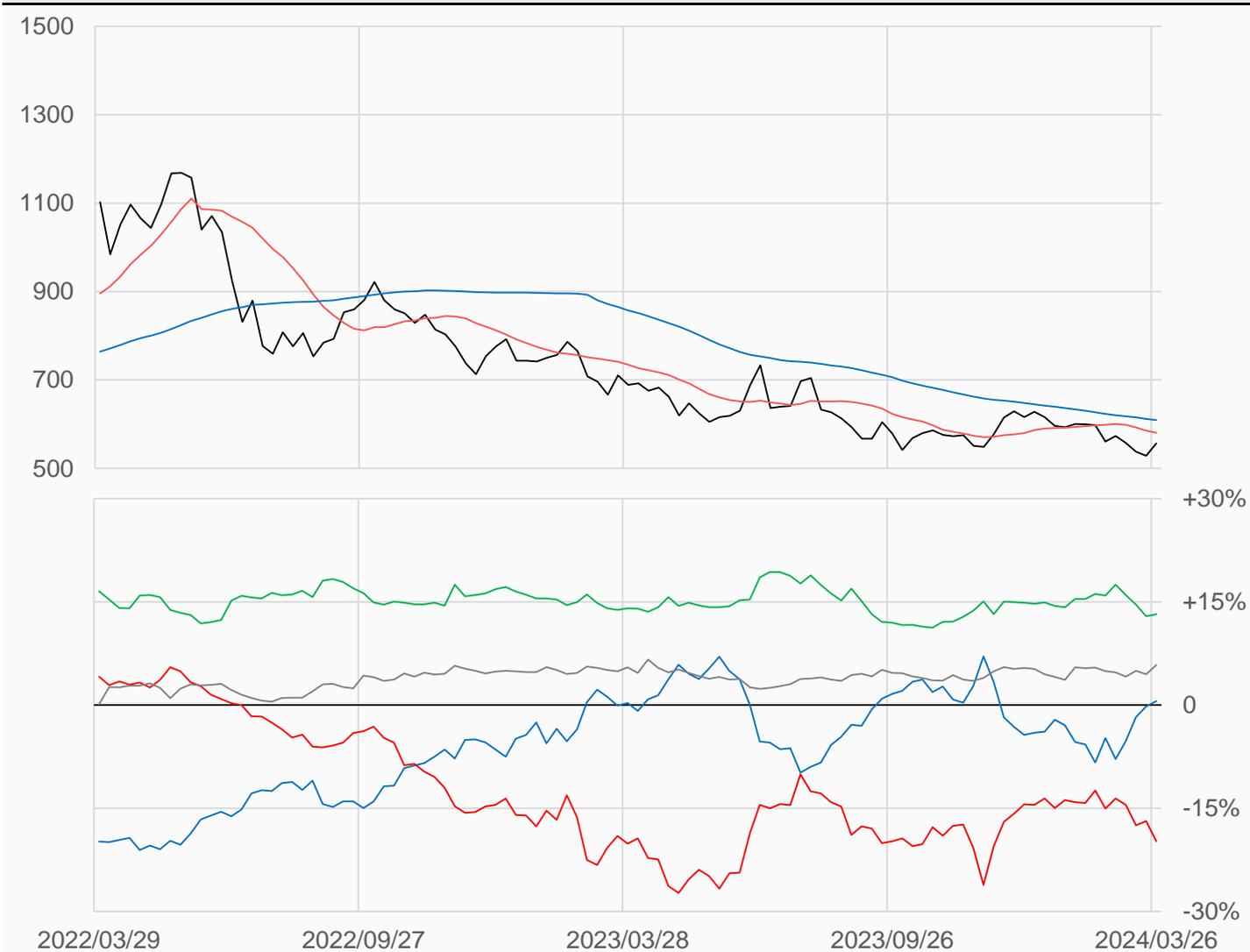
小麥

小麥較前一週上漲27.75點收在556.25點，
管理基金多單減少2379口，空單增加9153口，
淨空單較前一週增加11532口至92102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
2024/03/26	477569	465014	-12555	-2.63%	556.25	↑ +27.75
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	60011	-824	57348	-4438	+2663	+3614
互換交易	100572	+1853	39085	+1907	+61487	-54
管理基金	170379	-2379	262481	+9153	-92102	-11532
其他	98701	-11363	71627	-17097	+27074	+5734

週五收盤價與13週與52週平均線

— ZW — 13週 580.4 — 52週 609.22



淨部位佔總OI% 生產 +0.6% 互換 +13.2% 管理 -19.8% 其他 +5.8%

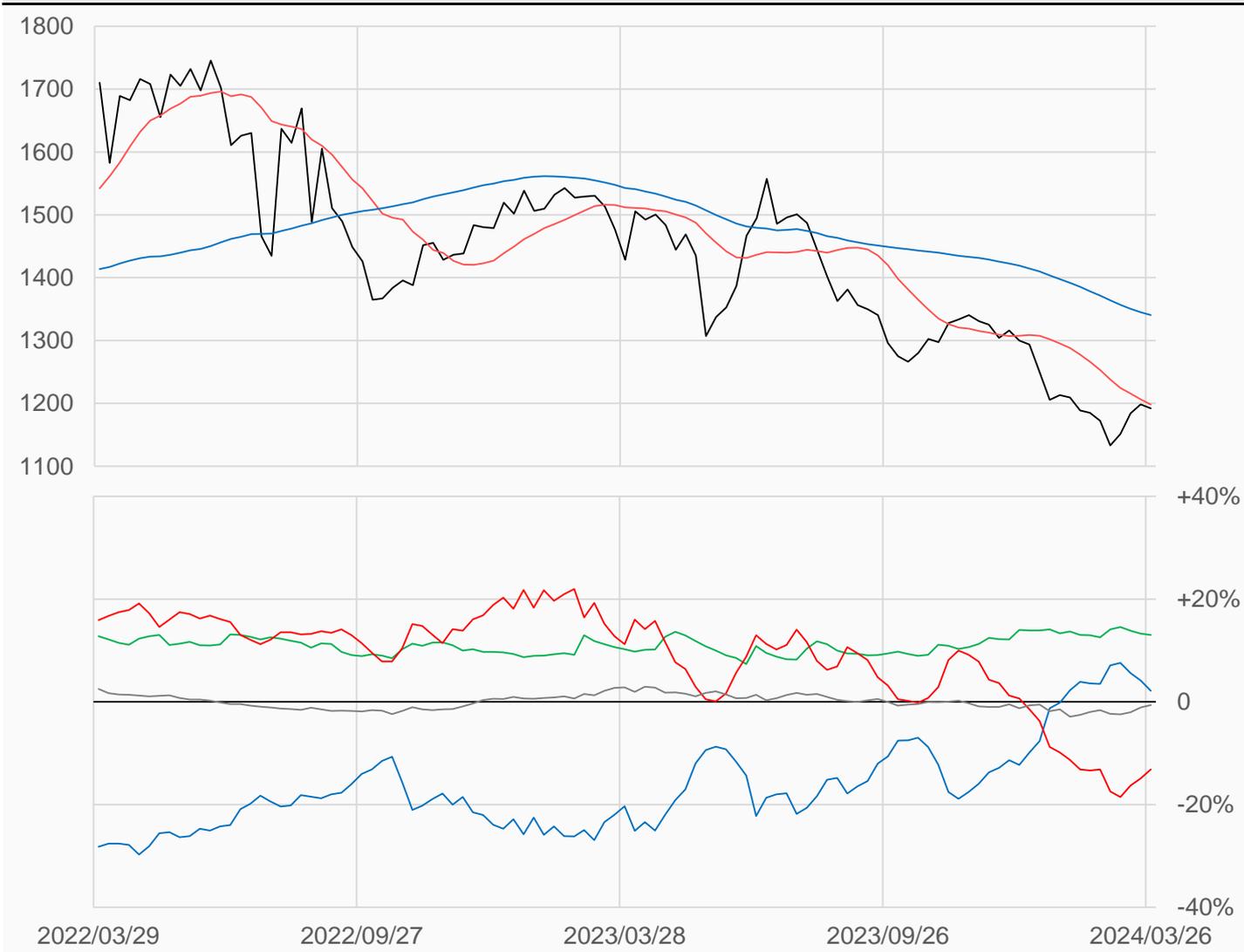
黃豆

黃豆較前一週下跌6.25點收在1192點，
 管理基金多單增加9428口，空單減少4131口，
 淨空單較前一週減少13559口至134780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
2024/03/26	995024	1022662	+27638	+2.78%	1192.00	↓ -6.25
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	362448	+6198	340396	+25371	+22052	-19173
互換交易	169060	+3878	35915	+3020	+133145	+858
管理基金	173465	+9428	308245	-4131	-134780	+13559
其他	257796	+8376	264061	+3691	-6265	+4685

週五收盤價與13週與52週平均線

— ZS — 13週 1198.1 — 52週 1340.5



淨部位佔總OI%	生產	+2.2%	互換	+13.0%	管理	-13.2%	其他	-0.6%
----------	----	-------	----	--------	----	--------	----	-------

黃豆油

黃豆油較前一週下跌1.67點收在47.75點，
 管理基金多單增加7915口，空單減少7784口，
 淨多單較前一週增加15699口至951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
2024/03/26	621449	623074	+1625	+0.26%	47.75	↓ -1.67
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	139025	-2761	251830	+9541	-112805	-12302
互換交易	142897	+3322	23687	+2168	+119210	+1154
管理基金	210293	+7915	209342	-7784	+951	+15699
其他	101555	-5836	112740	-1744	-11185	-4092

週五收盤價與13週與52週平均線

— BO — 13週 46.668 — 52週 54.554



淨部位佔總OI% 生產 -18.1% 互換 +19.1% 管理 +0.2% 其他 -1.8%

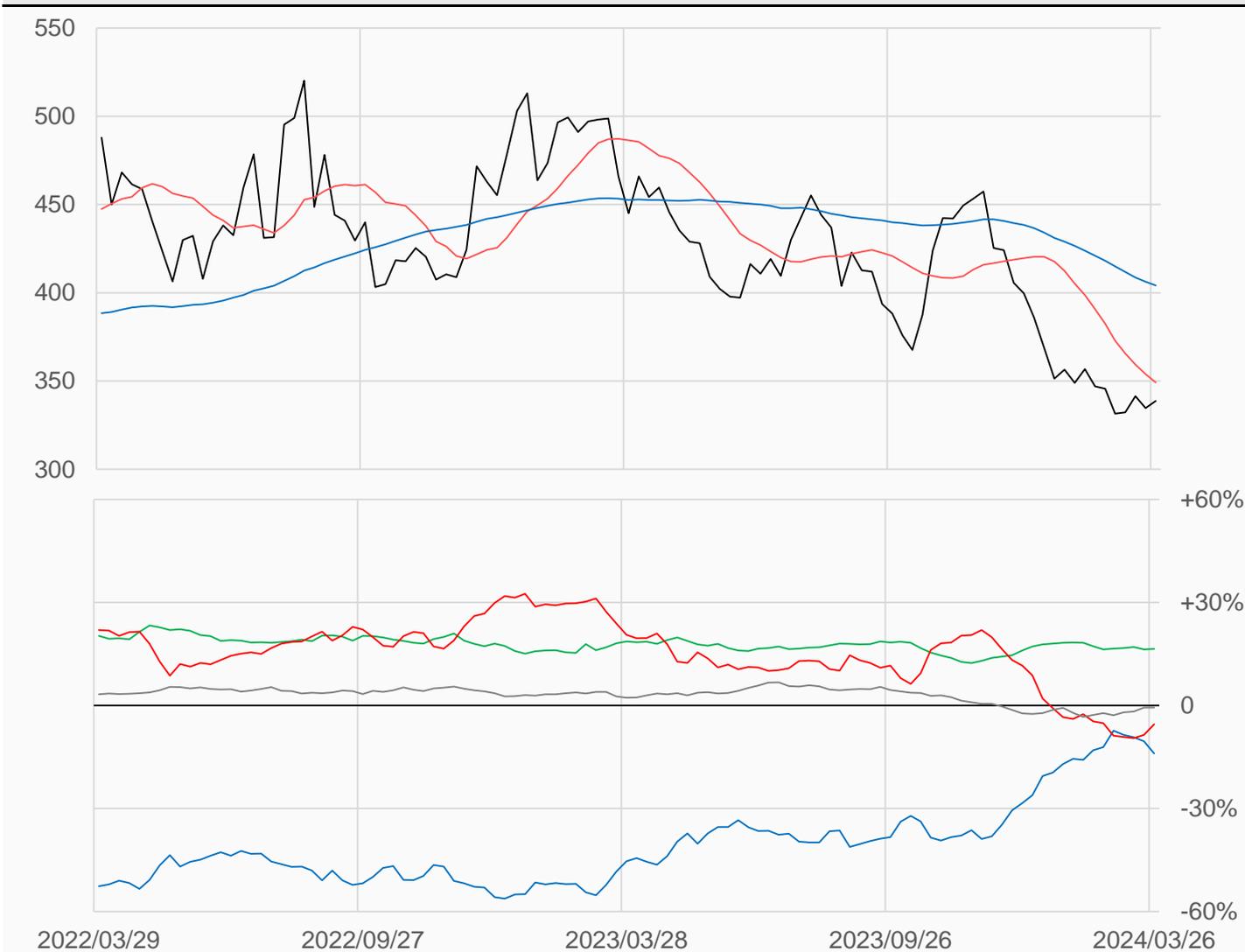
黃豆粉

黃豆粉較前一週上漲4點收在338.7點，
 管理基金多單增加7210口，空單減少9875口，
 淨空單較前一週減少17085口至29789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
2024/03/26	549577	544389	-5188	-0.94%	338.7	↑ +4.0
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	141429	-8116	217278	+10419	-75849	-18535
互換交易	109299	+2772	19439	+2764	+89860	+8
管理基金	148378	+7210	178167	-9875	-29789	+17085
其他	93643	-7332	96877	-7542	-3234	+210

週五收盤價與13週與52週平均線

— SM — 13週 349.18 — 52週 404.15



淨部位佔總OI% 生產 -13.9% 互換 +16.5% 管理 -5.5% 其他 -0.6%

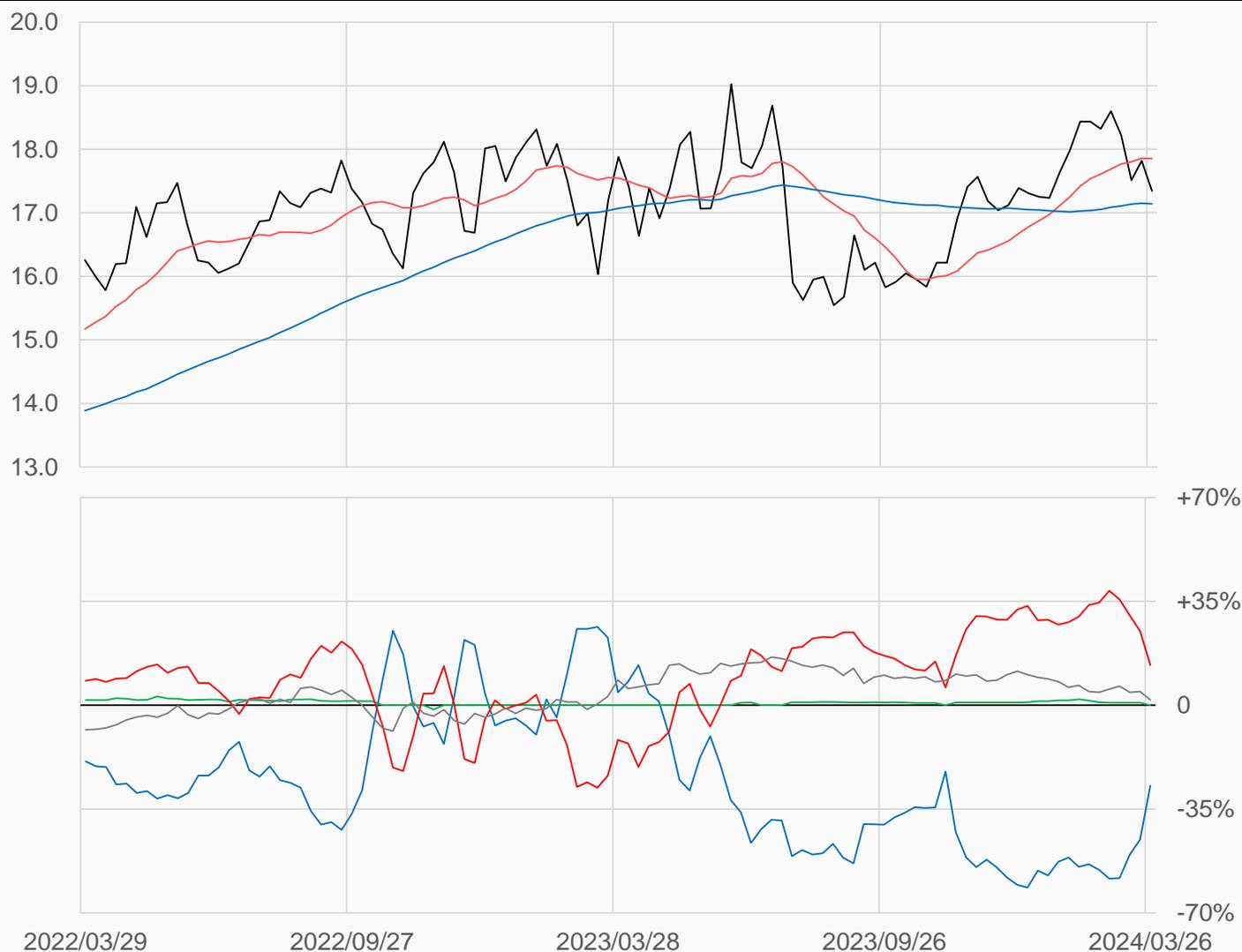
粗米

粗米較前一週下跌0.475點收在17.345點，
管理基金多單減少908口，空單增加480口，
淨多單較前一週減少1388口至1445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
2024/03/26	11335	10650	-685	-6.04%	17.345	↓ -0.475
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	3958	+713	6844	-1536	-2886	+2249
互換交易	0	-89	0	0	0	-89
管理基金	2671	-908	1226	+480	+1445	-1388
其他	1718	-45	1523	+280	+195	-325

週五收盤價與13週與52週平均線

— RR — 13週 17.853 — 52週 17.139



淨部位佔總OI% 生產 -27.1% 互換 0 管理 +13.6% 其他 +1.8%

咖啡

咖啡較前一週上漲1.2點收在185.05點，
管理基金多單增加6502口，空單增加940口，
淨多單較前一週增加5562口至47936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
2024/03/26	248741	267043	+18302	+7.36%	185.05	↑ +1.20
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	58333	+3109	115318	+6177	-56985	-3068
互換交易	43165	+1366	41054	+3343	+2111	-1977
管理基金	99468	+6502	51532	+940	+47936	+5562
其他	56813	+6246	51334	+6952	+5479	-706

週五收盤價與13週與52週平均線

— KC — 13週 187.13 — 52週 175.22



淨部位佔總OI% 生產 -21.3% 互換 +0.8% 管理 +18.0% 其他 +2.1%

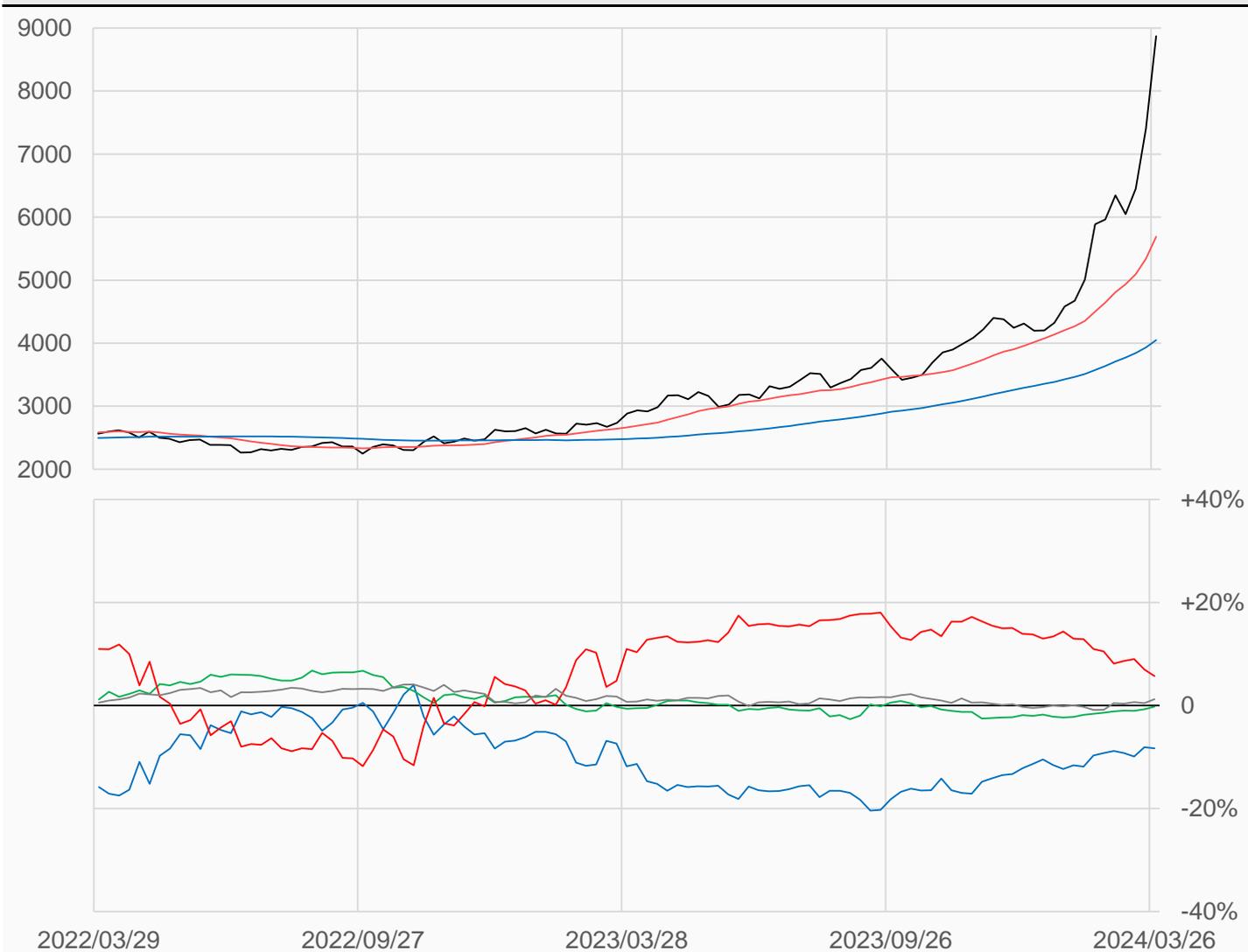
可可

可可較前一週上漲1467點收在8872點，
管理基金多單減少9105口，空單減少4227口，
淨多單較前一週減少4878口至21874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
2024/03/26	382910	383874	+964	+0.25%	8872	↑ +1467
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	92545	-916	124355	-110	-31810	-806
互換交易	23118	+1765	23873	-345	-755	+2110
管理基金	121270	-9105	99396	-4227	+21874	-4878
其他	132773	+8998	127981	+5946	+4792	+3052

週五收盤價與13週與52週平均線

— CC — 13週 5689.2 — 52週 4049



淨部位佔總OI% 生產 -8.3% 互換 -0.2% 管理 +5.7% 其他 +1.2%

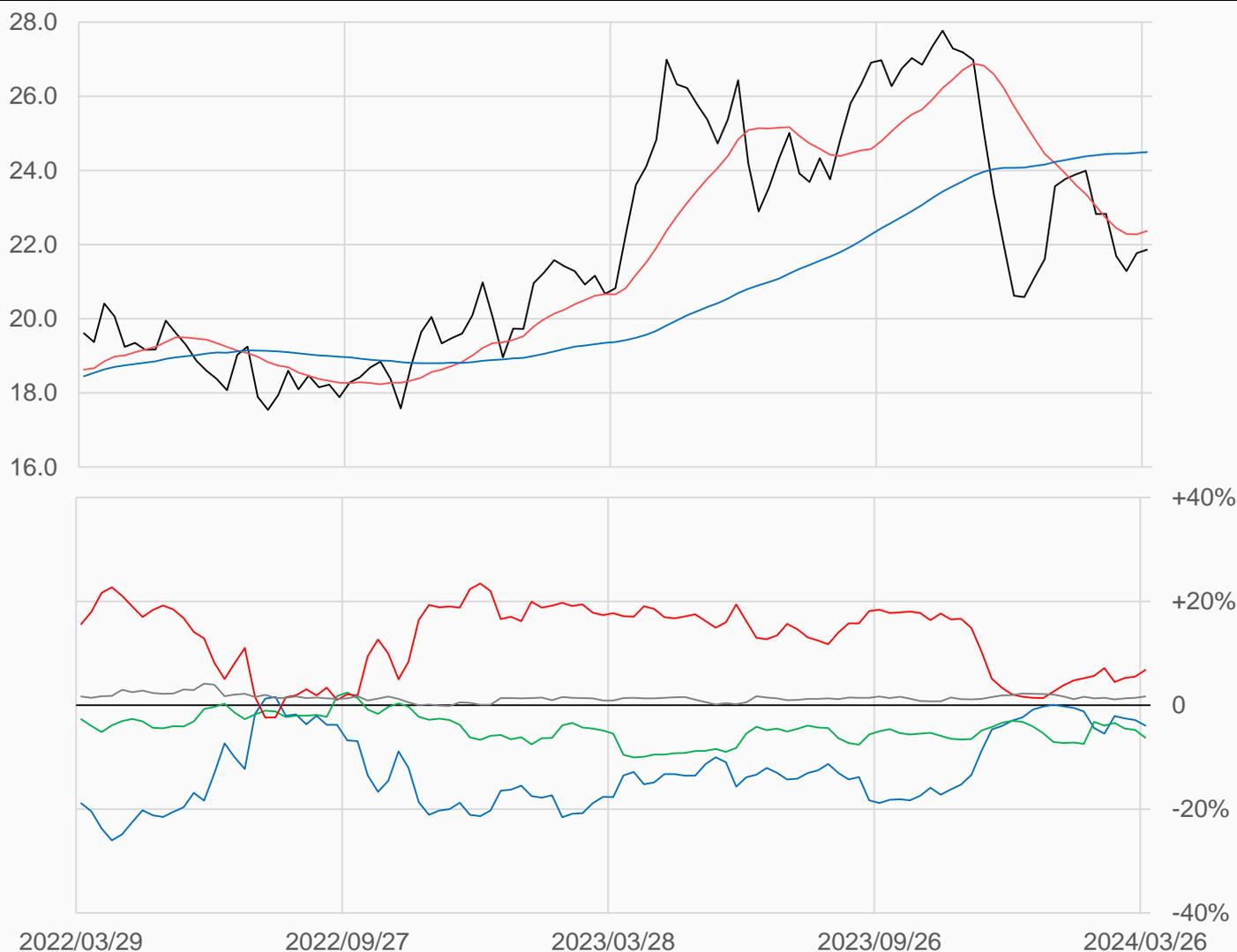
11號糖

11號糖較前一週上漲0.09點收在21.86點，
管理基金多單增加6533口，空單減少6471口，
淨多單較前一週增加13004口至68512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
2024/03/26	1006177	1010825	+4648	+0.46%	21.86	↑ +0.09
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	347043	-4826	386687	+6328	-39644	-11154
互換交易	155600	-3890	219057	+11554	-63457	-15444
管理基金	255966	+6533	187454	-6471	+68512	+13004
其他	171957	-257	155185	-2717	+16772	+2460

週五收盤價與13週與52週平均線

— SB — 13週 22.367 — 52週 24.495



淨部位佔總OI% 生產 -3.9% 互換 -6.3% 管理 +6.8% 其他 +1.7%

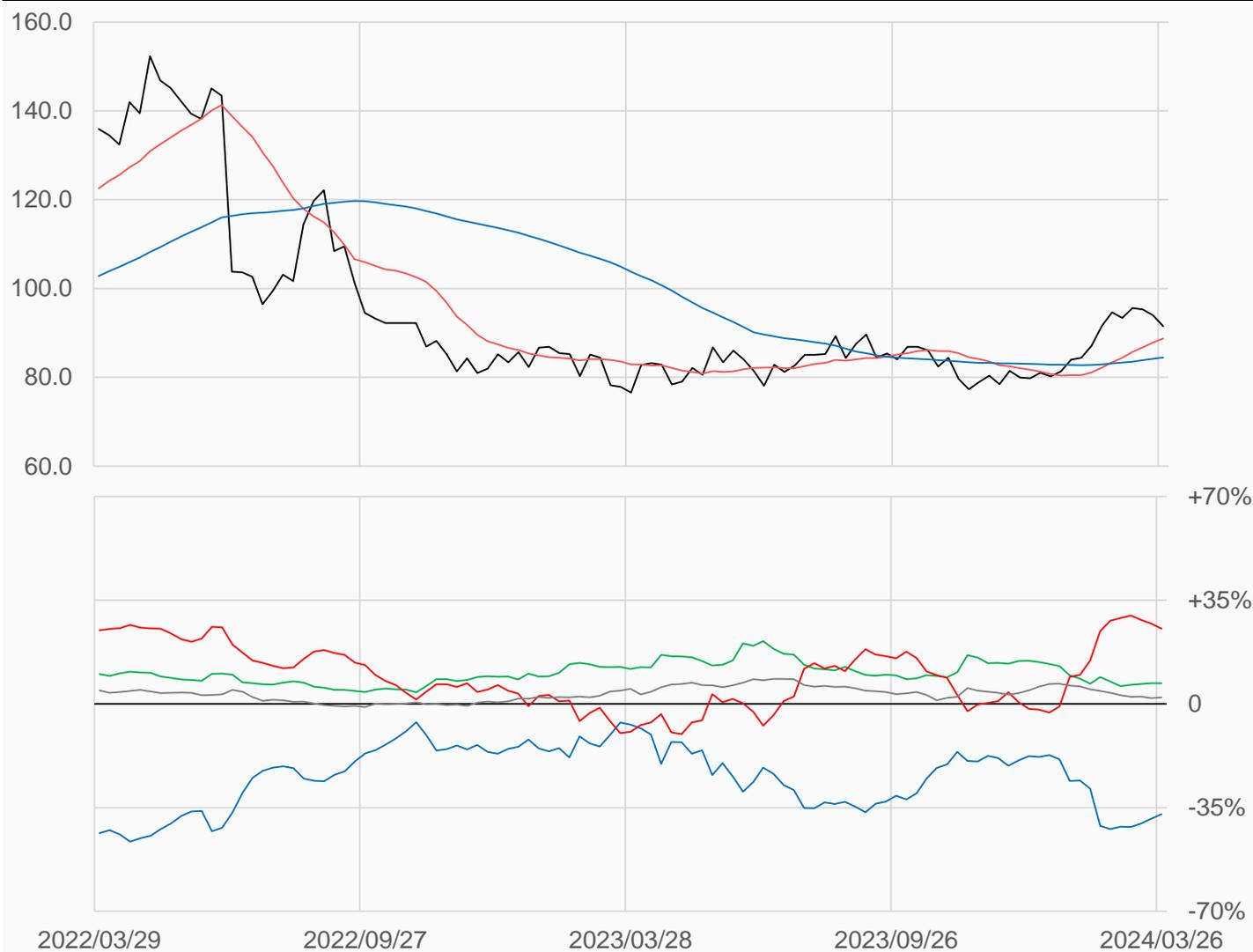
棉花

棉花較前一週下跌2.43點收在91.51點，
管理基金多單減少3530口，空單增加1524口，
淨多單較前一週減少5054口至84468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
2024/03/26	329988	332195	+2207	+0.67%	91.51	↓ -2.43
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	49816	+5847	173356	+1472	-123540	+4375
互換交易	65892	+78	42591	-238	+23301	+316
管理基金	123498	-3530	39030	+1524	+84468	-5054
其他	74171	+243	66785	-606	+7386	+849

週五收盤價與13週與52週平均線

— CT — 13週 88.752 — 52週 84.451



淨部位佔總OI% 生產 -37.2% 互換 +7.0% 管理 +25.4% 其他 +2.2%