

CFTC 大額交易人持倉報告

永豐期貨顧問事業部編製

2024/6/3

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 2024/05/28

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	97516	-3859	+8573	-3759	+8.79%
	VX	405069	-129994	+4702	-3966	+1.16%
	ES	3134901	+46759	-339317	-11518	-10.82%
	NQ	296576	+4944	-44327	-6136	-14.95%
債券	30年債	1840655	-88126	-362386	+12672	-19.69%
	10年債	5436709	+46362	-1281429	-13994	-23.57%
	5年債	6863156	+109864	-2562989	+19736	-37.34%
	2年債	4172934	-31513	-1792048	+68611	-42.94%
外匯	紐幣	57525	+8420	+2336	-2919	+4.06%
	綜美(未含)	943101	+31541	+28099	-9228	+2.98%
	英鎊	322998	+52248	+7713	+7289	+2.39%
	綜美(含美)	983255	+31730	+11838	-9564	+1.20%
	歐元	766385	+16253	-6083	+9143	-0.79%
	澳幣	214362	-4040	-11653	+6014	-5.44%
	瑞郎	107061	+6292	-12956	+75	-12.10%
	加幣	277291	+30222	-52626	+5696	-18.98%
	日圓	367070	+26341	-96419	-11684	-26.27%
	美元	40154	+189	-16261	-336	-40.50%

金融類投機部位每週變動表

數據日期 2024/05/28

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	773824	-157558	+179221	-14751	+23.16%
	白金	105956	+897	+20843	+269	+19.67%
	銅	402490	-34927	+63787	-11555	+15.85%
	白銀	254066	-16315	+39529	+1826	+15.56%
能源	無鉛汽油	387565	-13323	+39433	-5024	+10.17%
	輕原油	2227463	+78268	+201429	+29143	+9.04%
	天然氣	1522966	-41808	+42864	+28408	+2.81%
	熱燃油	405634	-4555	+11093	+1854	+2.73%
肉類	活牛	391190	+18106	+58556	+12076	+14.97%
	活豬	395706	+10276	+29392	-14105	+7.43%
農產	黃豆粉	536628	+7013	+118282	+17338	+22.04%
	粗米	10443	+122	+1050	-442	+10.05%
	黃豆	1007496	+1445	-14218	+12209	-1.41%
	小麥	516145	+1070	-25431	-838	-4.93%
	玉米	1963843	-29561	-133477	-12313	-6.80%
	黃豆油	597248	+8642	-41844	+4676	-7.01%
軟性	咖啡	291033	+14813	+56606	+4013	+19.45%
	可可	271237	+24804	+19512	+3554	+7.19%
	11號糖	1035917	+19100	-42151	-3773	-4.07%
	棉花	275358	+1085	-12765	+10607	-4.64%

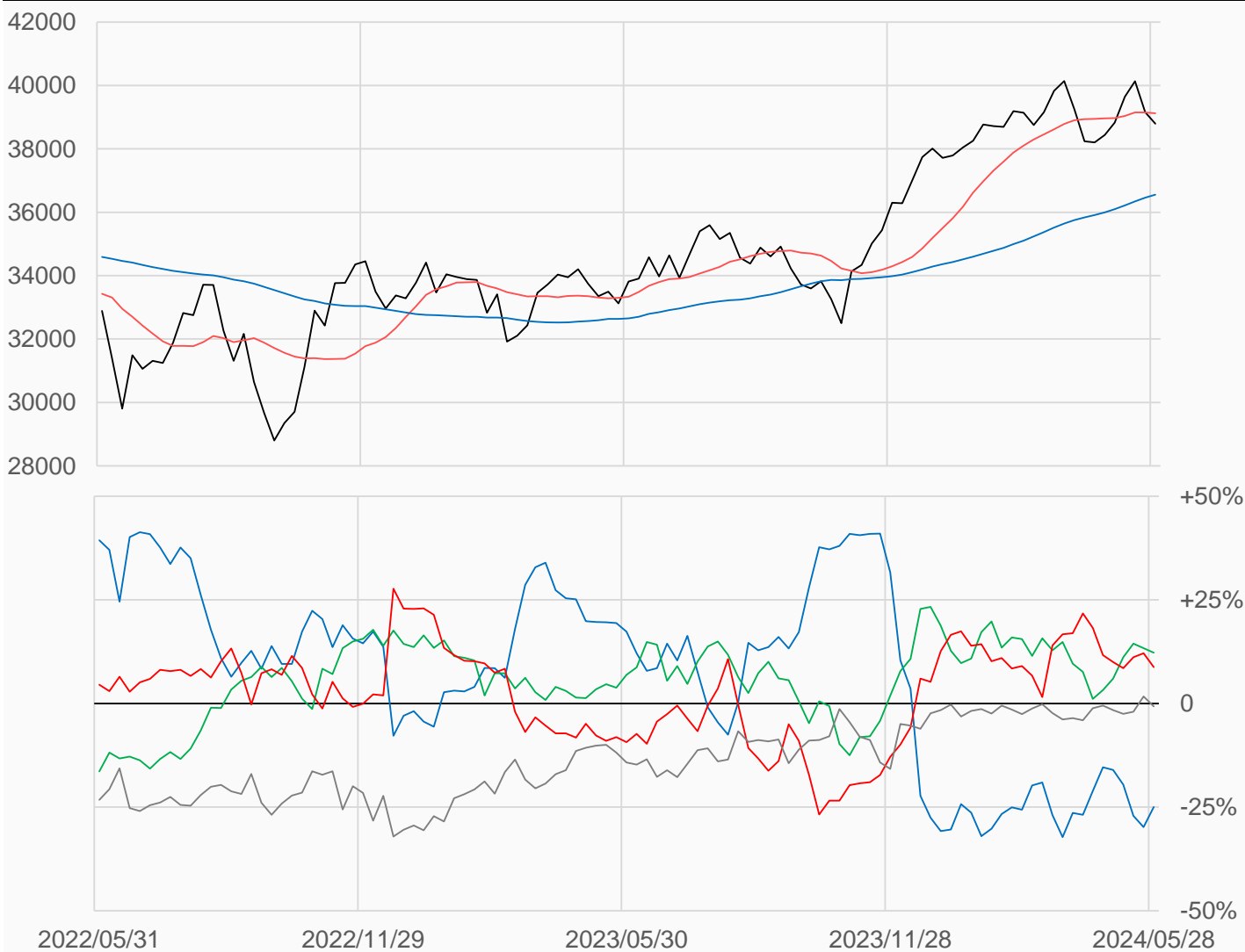
mini 道瓊

mini道瓊較前一週下跌366點收在38791點，
 槓桿基金多單減少5141口，空單減少1382口，
 淨多單較前一週減少30.48%或3759口至8573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
2024/05/28	101375	97516	-3859	-3.81%	38791	↓ -366
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	35821	+2266	60153	-3595	-24332	+5861
資產管理	20086	-1514	8146	+104	+11940	-1618
槓桿基金	23779	-5141	15206	-1382	+8573	-3759
其他	2335	-432	3020	+1992	-685	-2424

週五收盤價與13週與52週平均線

— YM — 13週 39121 — 52週 36555



淨部位佔總OI% 經紀 -25.0% 資管 +12.2% 槓桿 +8.8% 其他 -0.7%

mini NQ

miniNQ較前一週下跌285點收在18591點，
 槓桿基金多單減少1434口，空單增加4702口，
 淨空單較前一週增加6136口至44327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
2024/05/28	291632	296576	+4944	+1.70%	18591.00	↓ -285.00
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	49923	+888	94641	+7706	-44718	-6818
資產管理	118074	+4300	27647	-1358	+90427	+5658
槓桿基金	69712	-1434	114039	+4702	-44327	-6136
其他	12124	+1500	21569	-7868	-9445	+9368

週五收盤價與13週與52週平均線

— NQ — 13週 18231 — 52週 16509



淨部位佔總OI% 經紀 -15.1% 資管 +30.5% 槓桿 -14.9% 其他 -3.2%

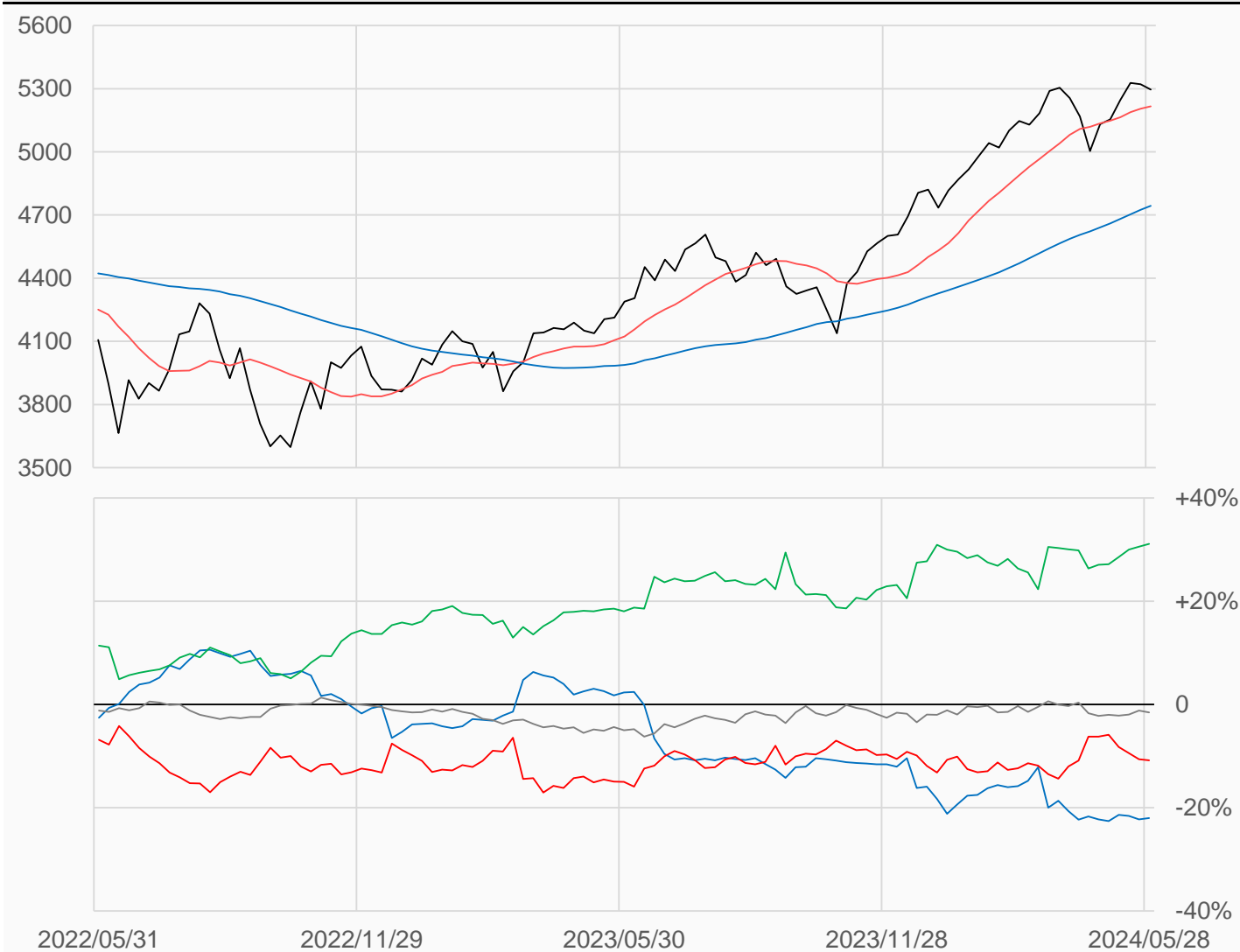
mini S&P

miniS&P較前一週下跌26點收在5295.5點，
 槓桿基金多單增加11644口，空單增加23162口，
 淨空單較前一週增加11518口至339317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
2024/05/28	3088142	3134901	+46759	+1.51%	5295.50	↓ -26.00
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	455111	+28654	1144190	+30834	-689079	-2180
資產管理	1290848	+12696	315703	-18827	+975145	+31523
槓桿基金	908848	+11644	1248165	+23162	-339317	-11518
其他	143224	-9074	192163	+2903	-48939	-11977

週五收盤價與13週與52週平均線

— ES — 13週 5216.1 — 52週 4743.6



淨部位佔總OI% 經紀 -22.0% 資管 +31.1% 槓桿 -10.8% 其他 -1.6%

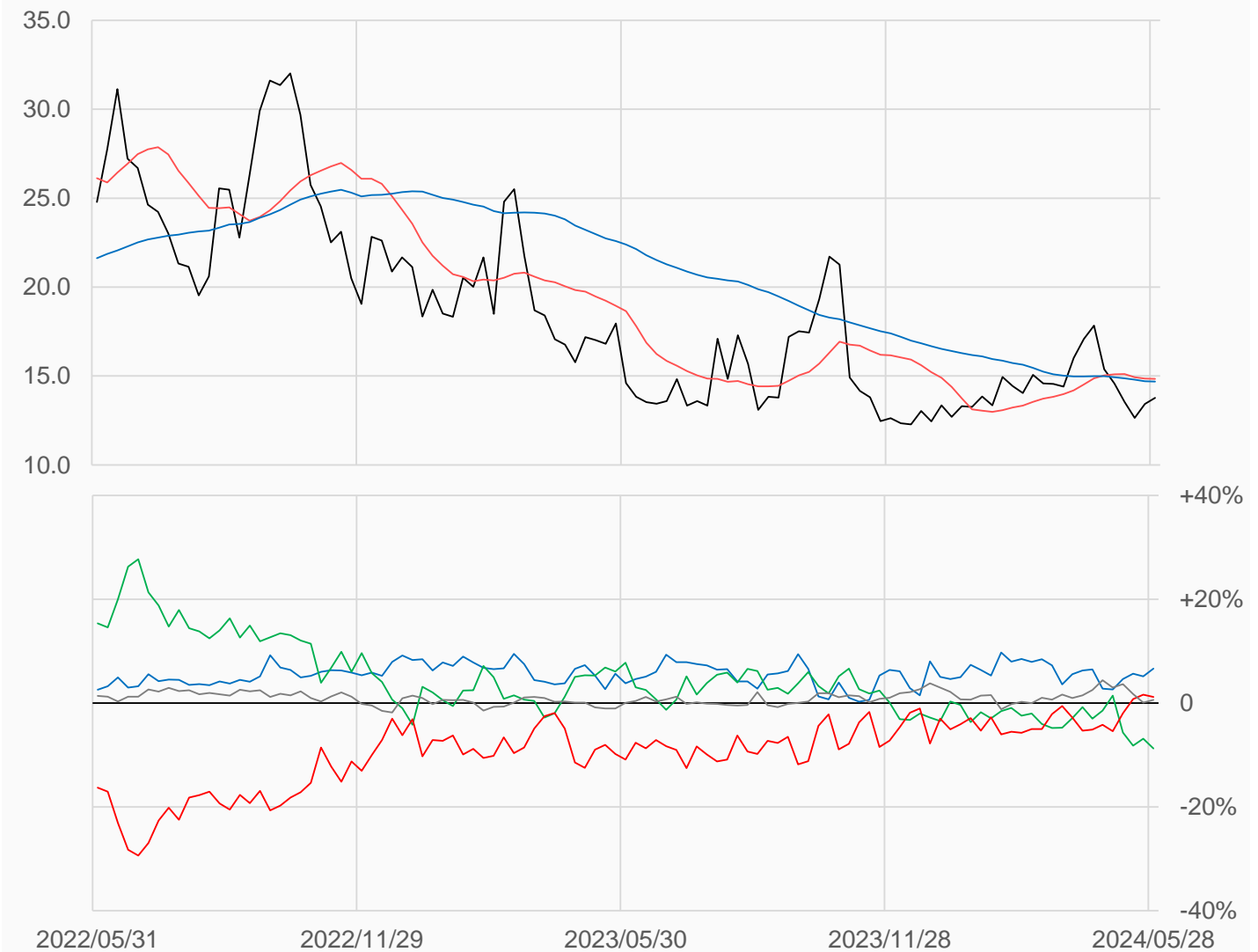
VIX

VIX較前一週上漲0.36點收在13.78點，
 槓桿基金多單減少31793口，空單減少27827口，
 淨多單較前一週減少3966口至4702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
2024/05/28	535063	405069	-129994	-24.30%	13.78	↑ +0.36
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	71490	-18772	44672	-18154	+26818	-618
資產管理	131457	-5317	166872	-6733	-35415	+1416
槓桿基金	154629	-31793	149927	-27827	+4702	-3966
其他	17226	-3832	14677	-5798	+2549	+1966

週五收盤價與13週與52週平均線

— VX — 13週 14.839 — 52週 14.689



淨部位佔總OI% 經紀 +6.6% 資管 -8.7% 槓桿 +1.2% 其他 +0.6%

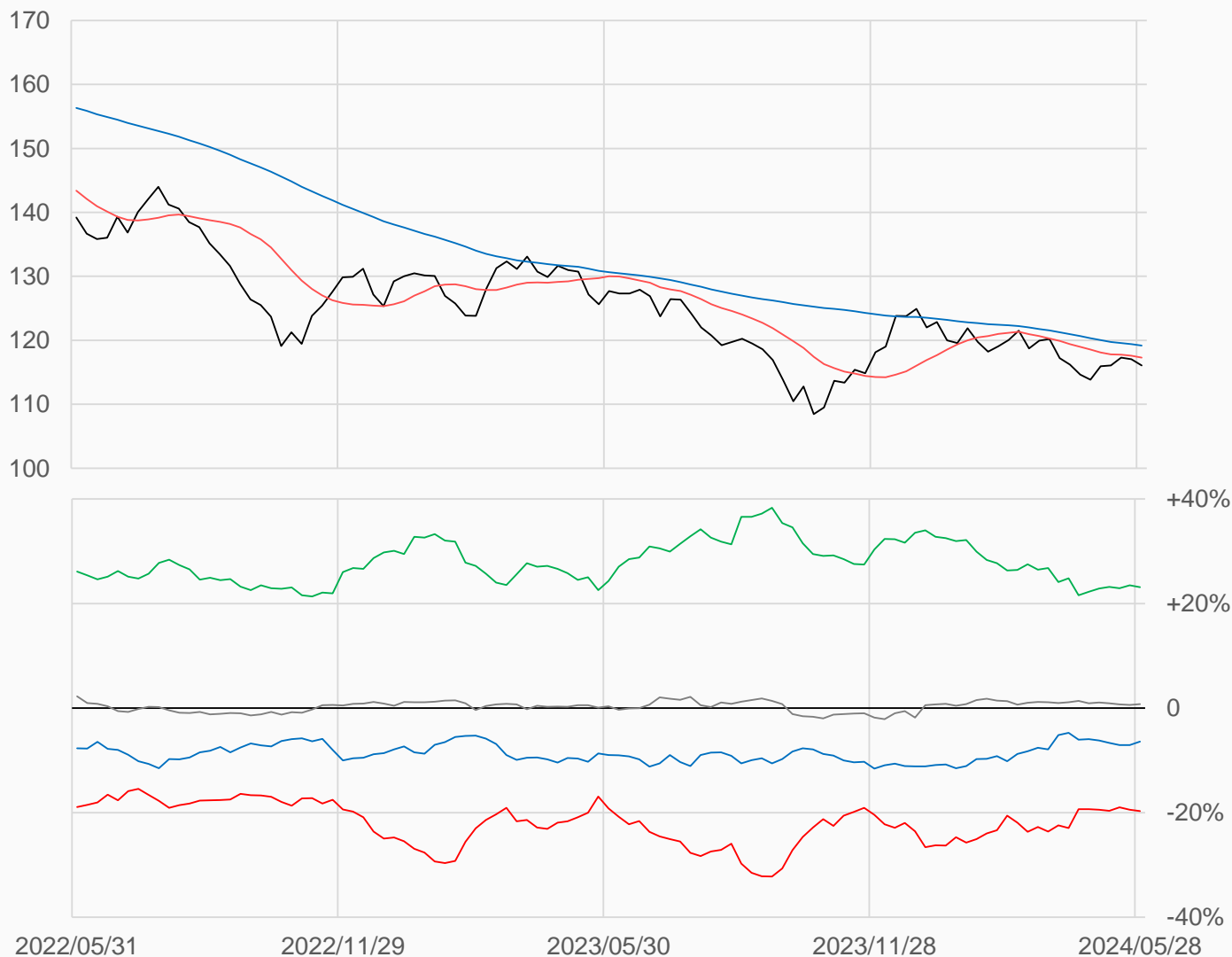
30年債

美國30年公債較前一週下跌0.9688點收在116.0625點，
 槓桿基金多單減少65320口，空單減少77991口，
 淨空單較前一週減少12671口至362386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
2024/05/28	1928781	1840655	-88126	-4.57%	116 2/32	↓ - 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	56411	-15822	174363	-34650	-117952	+18828
資產管理	1127379	+6368	701268	+33320	+426111	-26952
槓桿基金	320691	-65320	683077	-77991	-362386	+12671
其他	113898	-9569	99882	-11736	+14016	+2167

週五收盤價與13週與52週平均線

— US — 13週 117.29 — 52週 119.18



淨部位佔總OI% 經紀 -6.4% 資管 +23.1% 槓桿 -19.7% 其他 +0.8%

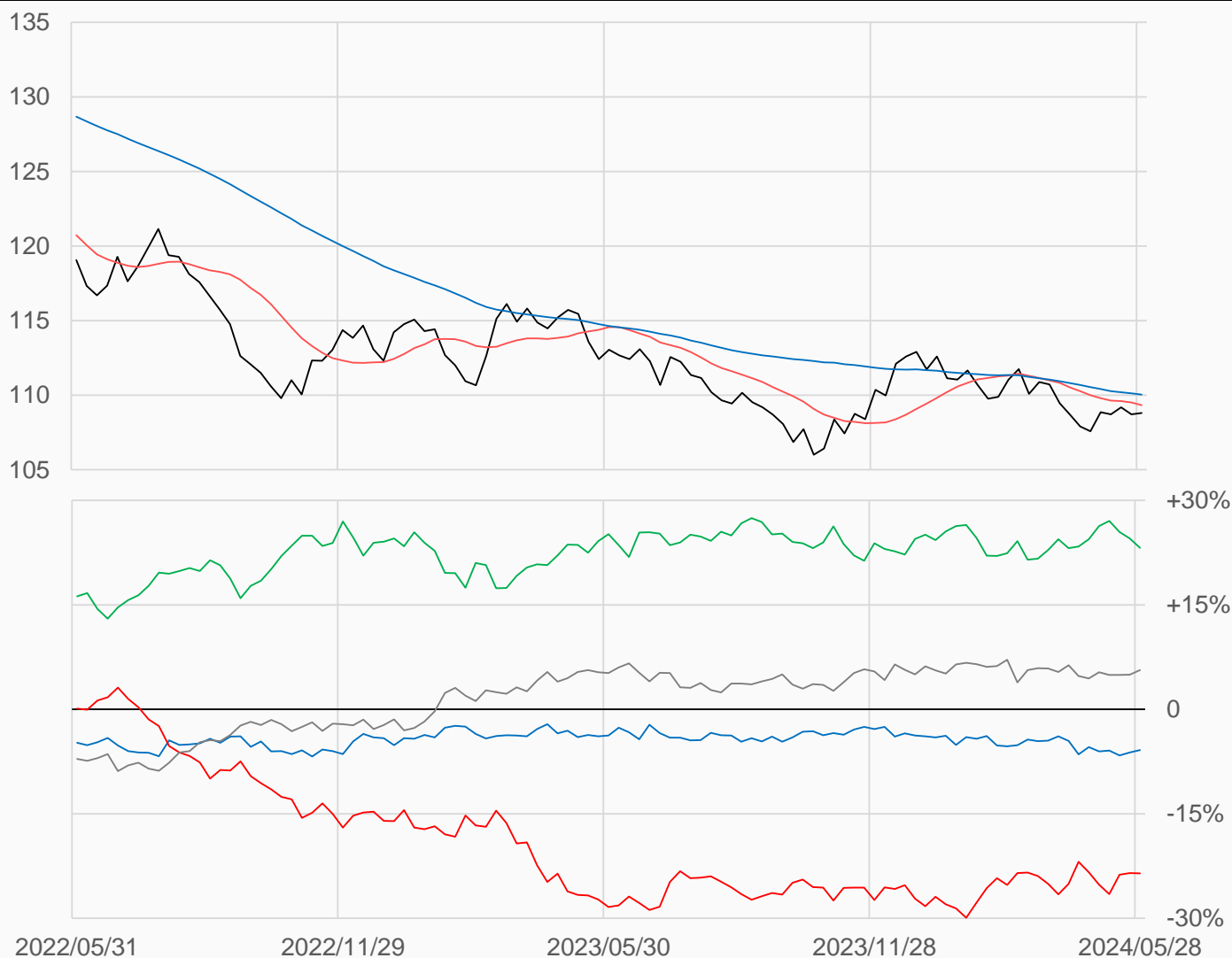
10年債

美國10年公債較前一週上漲0.0938點收在108.796875點，
 槓桿基金多單減少114097口，空單減少100102口，
 淨空單較前一週增加13995口至1281429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
2024/05/28	5390347	5436709	+46362	+0.86%	108 51/64	↑ + 6/64
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	339103	-5786	657782	-20971	-318679	+15185
資產管理	3140394	+91423	1879504	+153731	+1260890	-62308
槓桿基金	876652	-114097	2158081	-100102	-1281429	-13995
其他	574810	+5940	268173	-33766	+306637	+39706

週五收盤價與13週與52週平均線

— TY — 13週 109.33 — 52週 110.03



淨部位佔總OI% 經紀 -5.9% 資管 +23.2% 槓桿 -23.6% 其他 +5.6%

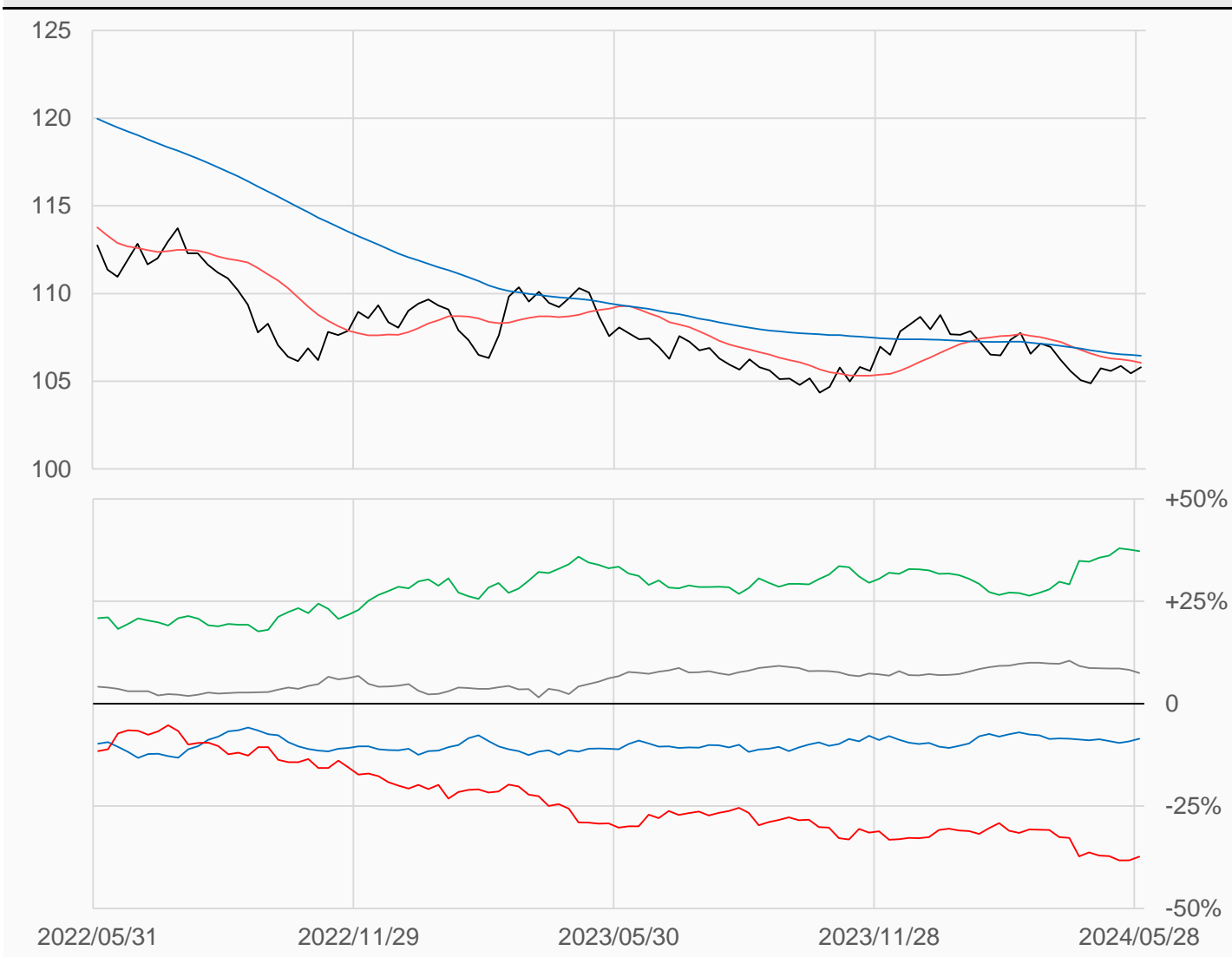
5年公債

美國5年公債較前一週上漲0.3516點收在105.796875點，
 槓桿基金多單增加121751口，空單增加102014口，
 淨空單較前一週減少19737口至2562989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
2024/05/28	6753292	6863156	+109864	+1.63%	105 102/128	↑ + 45/128
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	243547	-17728	829859	-52442	-586312	+34714
資產管理	4563715	+39953	2005775	+24315	+2557940	+15638
槓桿基金	921369	+121751	3484358	+102014	-2562989	+19737
其他	636155	-88475	119401	-48199	+516754	-40276

週五收盤價與13週與52週平均線

— FV — 13週 106.05 — 52週 106.45



淨部位佔總OI% 經紀 -8.5% 資管 +37.3% 槓桿 -37.3% 其他 +7.5%

2年公債

美國2年公債較前一週上漲0.3945點收在101.8515625點，

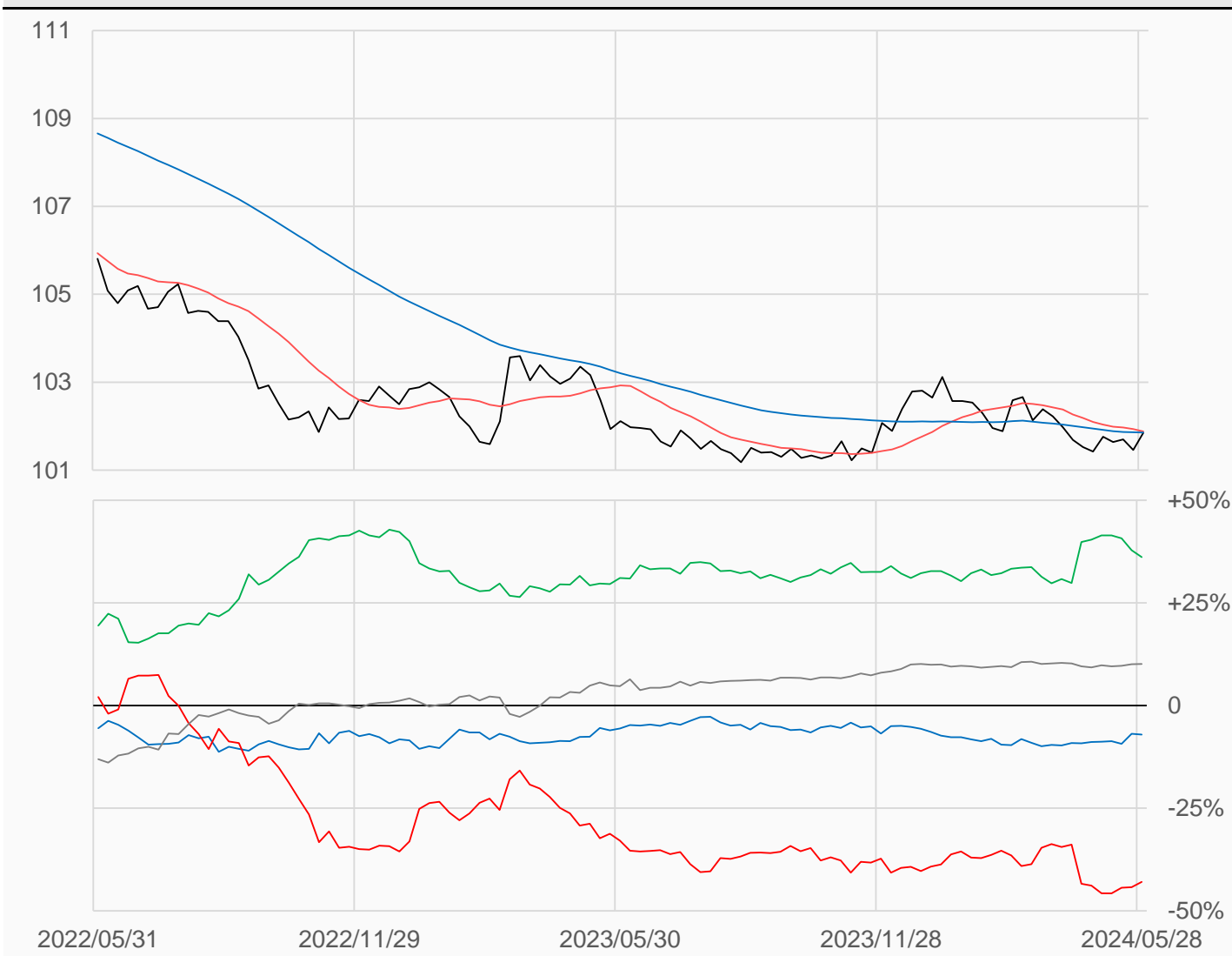
槓桿基金多單減少11878口，空單減少80488口，

淨空單較前一週減少68610口至1792048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
2024/05/28	4204447	4172934	-31513	-0.75%	101 109/128	↑ + 51/128
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	226959	+46806	521007	+52521	-294048	-5715
資產管理	2556552	-113767	1048819	-30141	+1507733	-83626
槓桿基金	500331	-11878	2292379	-80488	-1792048	+68610
其他	568252	-5488	144834	-6501	+423418	+1013

週五收盤價與13週與52週平均線

— TU — 13週 101.88 — 52週 101.86



淨部位佔總OI% 經紀 -7.0% 資管 +36.1% 槓桿 -42.9% 其他 +10.1%

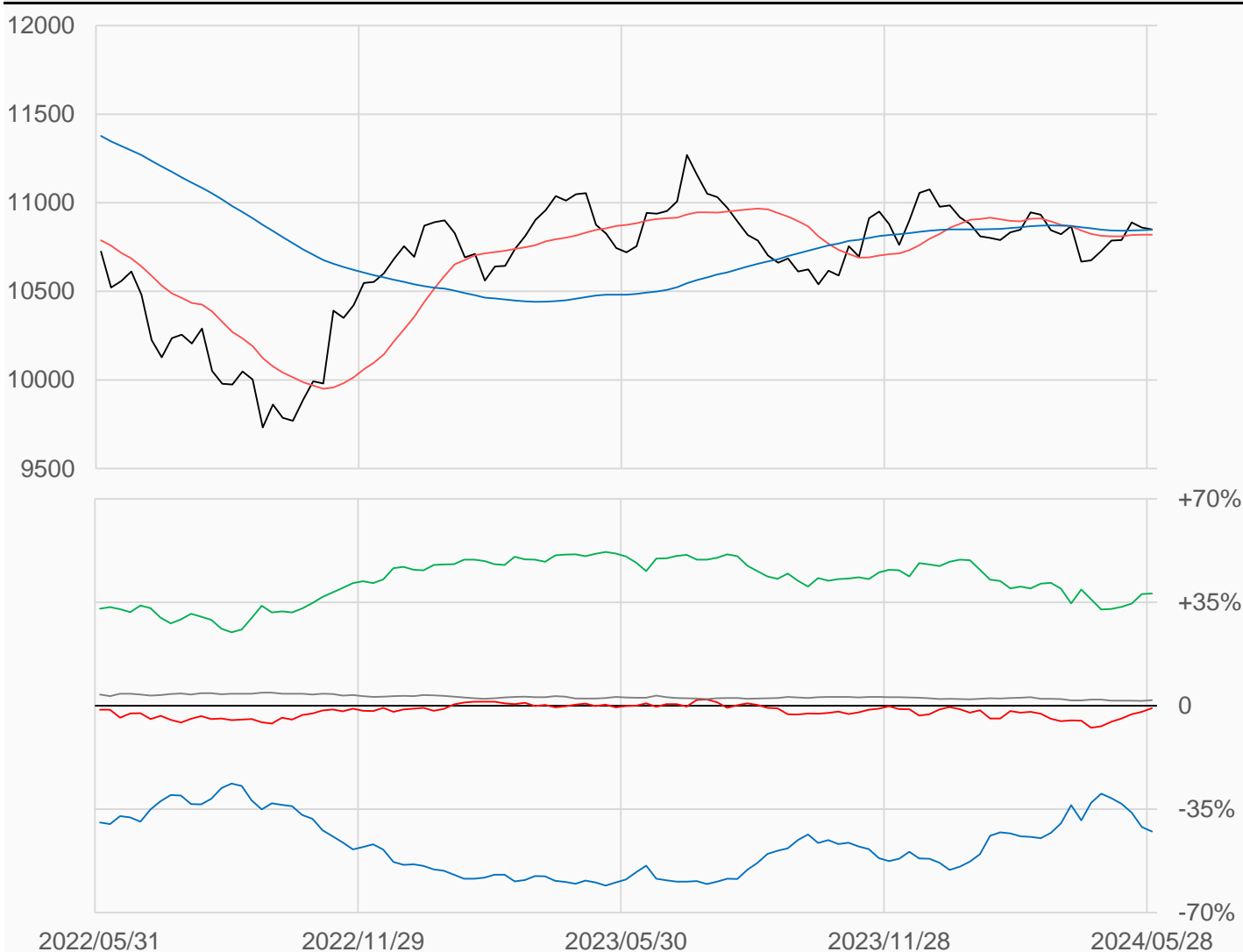
歐元

歐元較前一週下跌10.5點收在10850點，
 槓桿基金多單增加8102口，空單減少1041口，
 淨空單較前一週減少9143口至6083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
2024/05/28	750132	766385	+16253	+2.17%	10850.0	↓ -10.5
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	41648	+554	367958	+18792	-326310	-18238
資產管理	464095	+6165	173020	-1685	+291075	+7850
槓桿基金	145221	+8102	151304	-1041	-6083	+9143
其他	32896	-140	18599	-2191	+14297	+2051

週五收盤價與13週與52週平均線

— EC — 13週 10820 — 52週 10848



淨部位佔總OI% 經紀 -42.6% 資管 +38.0% 槓桿 -0.8% 其他 +1.9%

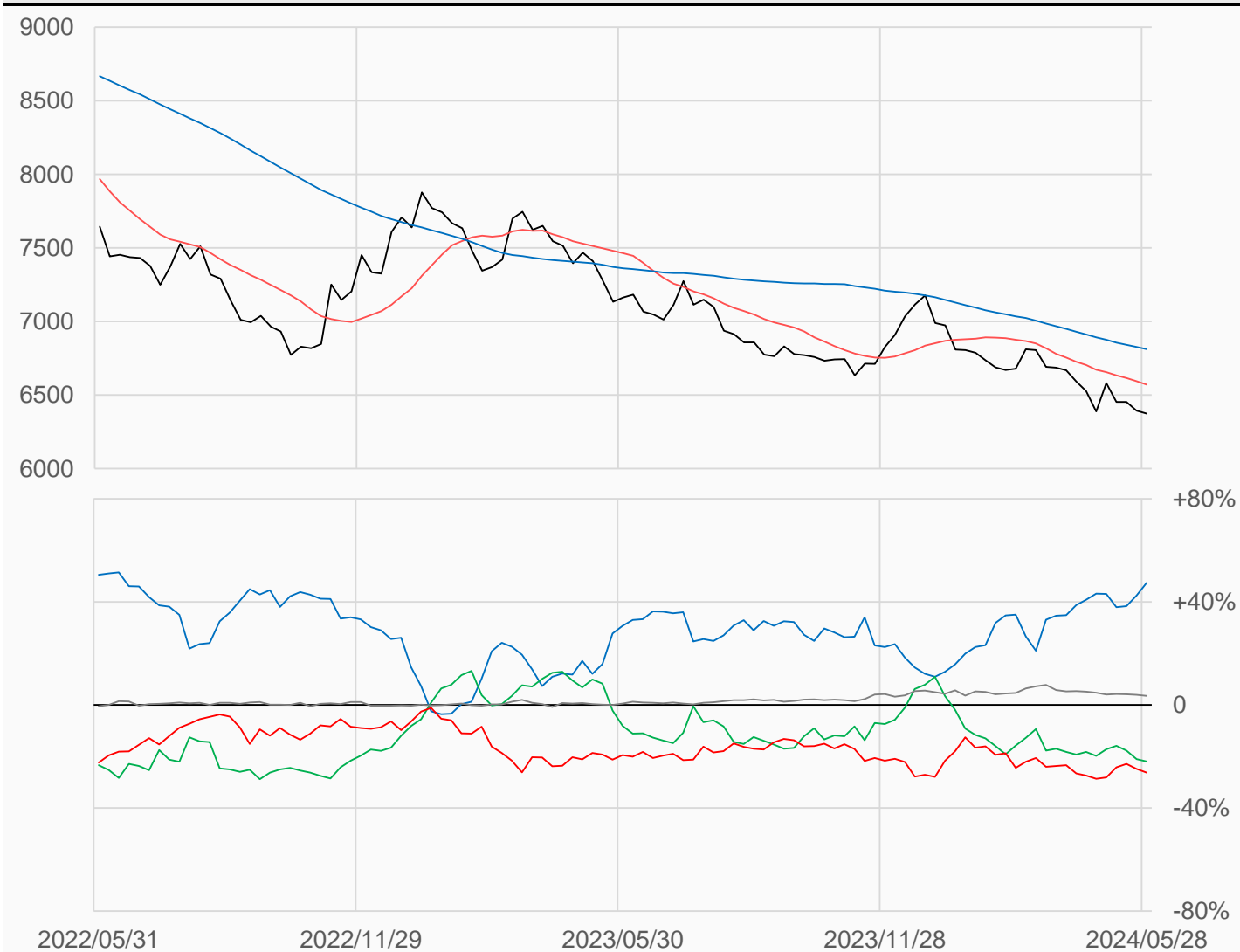
日圓

日圓較前一週下跌19點收在6373.5點，
 槓桿基金多單減少1984口，空單增加9701口，
 淨空單較前一週增加11685口至96419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
2024/05/28	340729	367070	+26341	+7.73%	6373.5	↓ -19.0
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	195993	+28447	22080	-733	+173913	+29180
資產管理	57431	-1600	138158	+7622	-80727	-9222
槓桿基金	50702	-1984	147121	+9701	-96419	-11685
其他	18446	+415	5609	+762	+12837	-347

週五收盤價與13週與52週平均線

— JY — 13週 6570.5 — 52週 6811.1



淨部位佔總OI% 經紀 +47.4% 資管 -22.0% 槓桿 -26.3% 其他 +3.5%

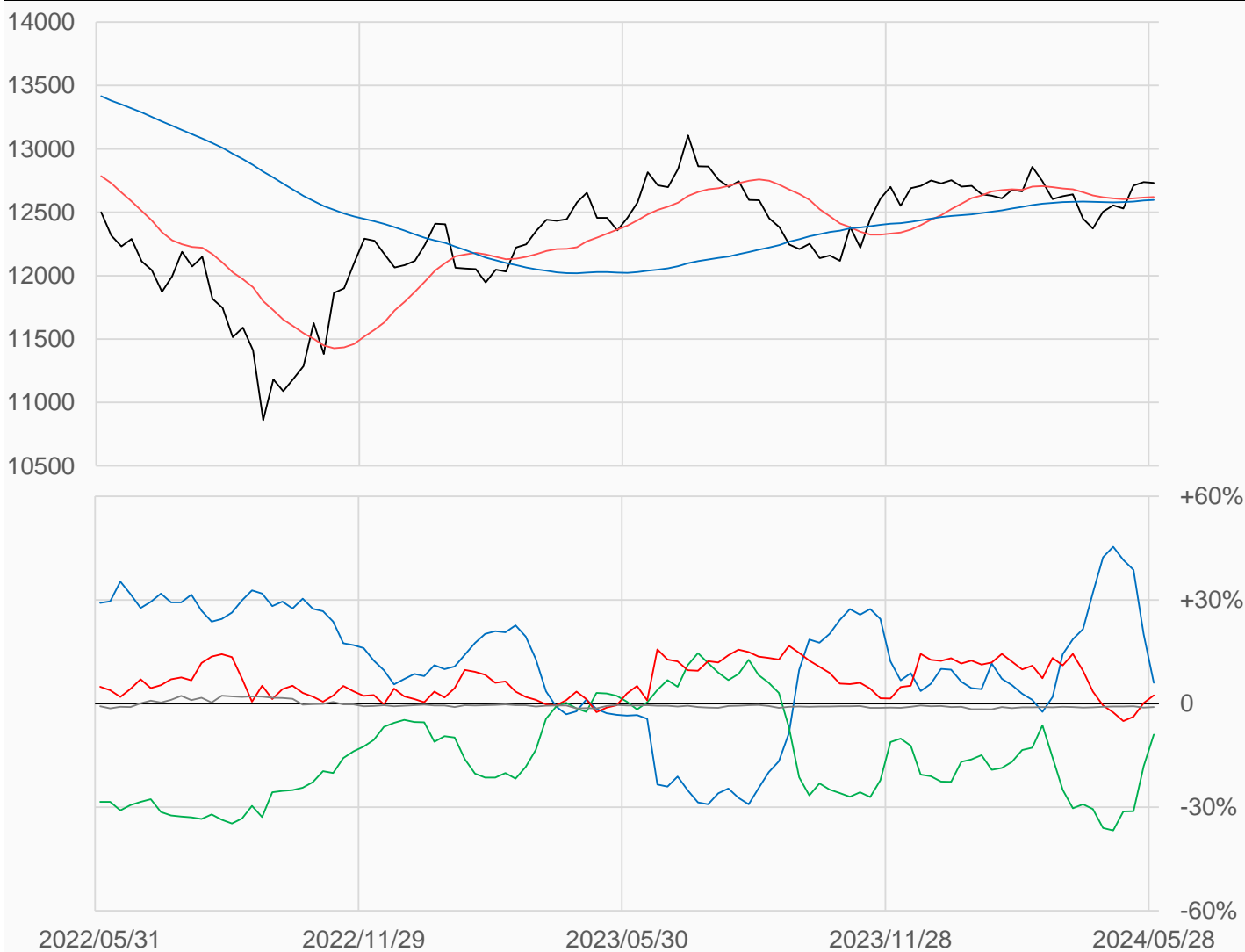
英鎊

英鎊較前一週下跌7點收在12732點，
 槓桿基金多單增加18818口，空單增加11528口，
 淨多單較前一週增加7290口至7713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
2024/05/28	270750	322998	+52248	+19.30%	12732	↓ -7
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	97772	+8588	78324	+43497	+19448	-34909
資產管理	68991	+20133	98010	-2	-29019	+20135
槓桿基金	120779	+18818	113066	+11528	+7713	+7290
其他	823	-311	4202	-78	-3379	-233

週五收盤價與13週與52週平均線

— BP — 13週 12621 — 52週 12598



淨部位佔總OI% 經紀 +6.0% 資管 -9.0% 槓桿 +2.4% 其他 -1.0%

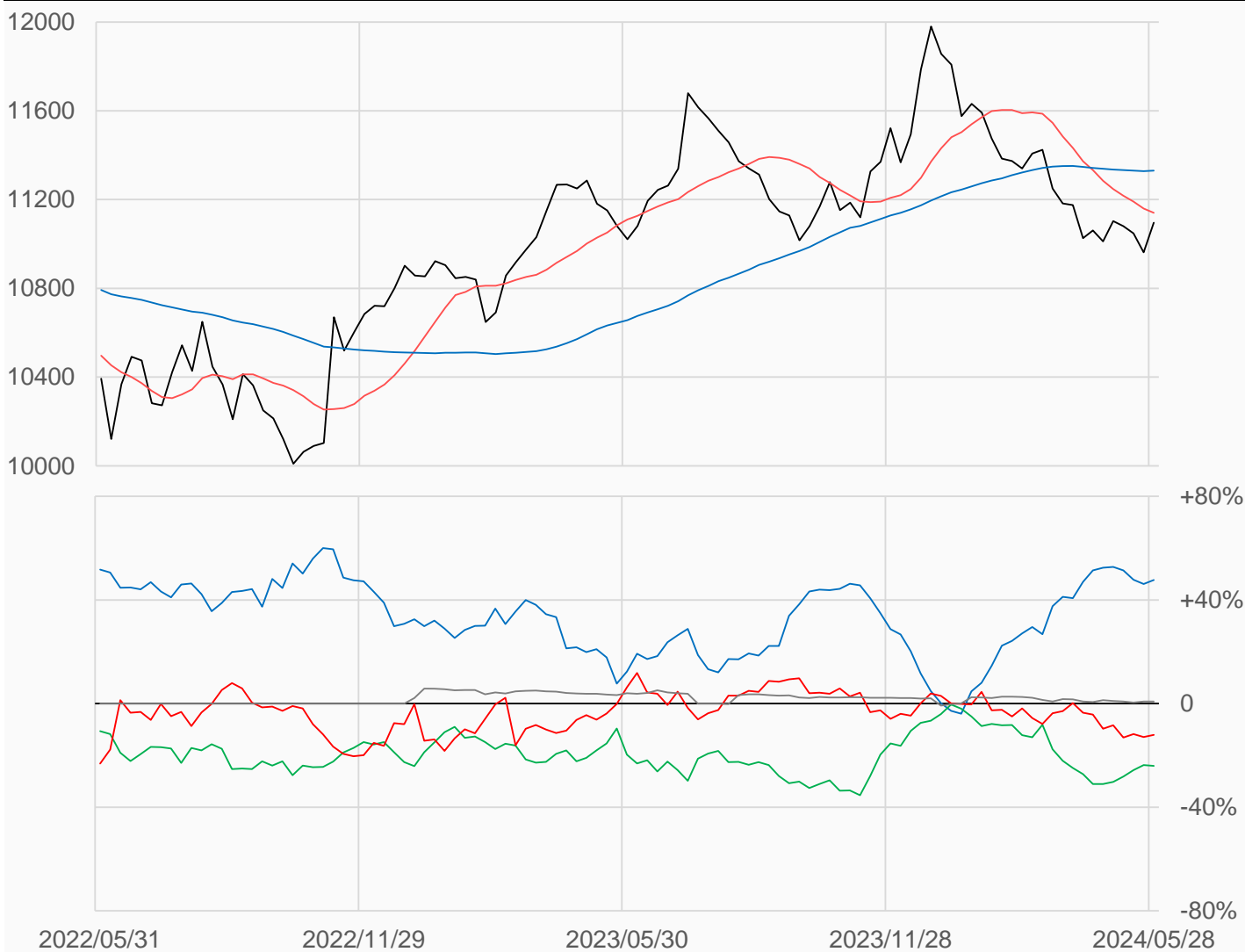
瑞郎

瑞郎較前一週上漲134點收在11095.5點，
 槓桿基金多單增加2124口，空單增加2048口，
 淨空單較前一週減少76口至12956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
2024/05/28	100769	107061	+6292	+6.24%	11096	↑ +134
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	54486	+4361	3442	-206	+51044	+4567
資產管理	23579	+1884	49354	+3690	-25775	-1806
槓桿基金	17723	+2124	30679	+2048	-12956	+76
其他	1210	+40	402	0	+808	+40

週五收盤價與13週與52週平均線

— SF — 13週 11140 — 52週 11330



淨部位佔總OI% 經紀 +47.7% 資管 -24.1% 槓桿 -12.1% 其他 +0.8%

加幣

加幣較前一週上漲17點收在7339點，
 槓桿基金多單增加4193口，空單減少1504口，
 淨空單較前一週減少5697口至52626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
2024/05/28	247069	277291	+30222	+12.23%	7339.0	↑ +17.0
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	118416	-6458	37402	+28488	+81014	-34946
資產管理	83111	+33662	116685	-3313	-33574	+36975
槓桿基金	29777	+4193	82403	-1504	-52626	+5697
其他	14683	-1510	6607	+3335	+8076	-4845

週五收盤價與13週與52週平均線

— CD — 13週 7341.8 — 52週 7406.7



淨部位佔總OI% 經紀 +29.2% 資管 -12.1% 槓桿 -19.0% 其他 +2.9%

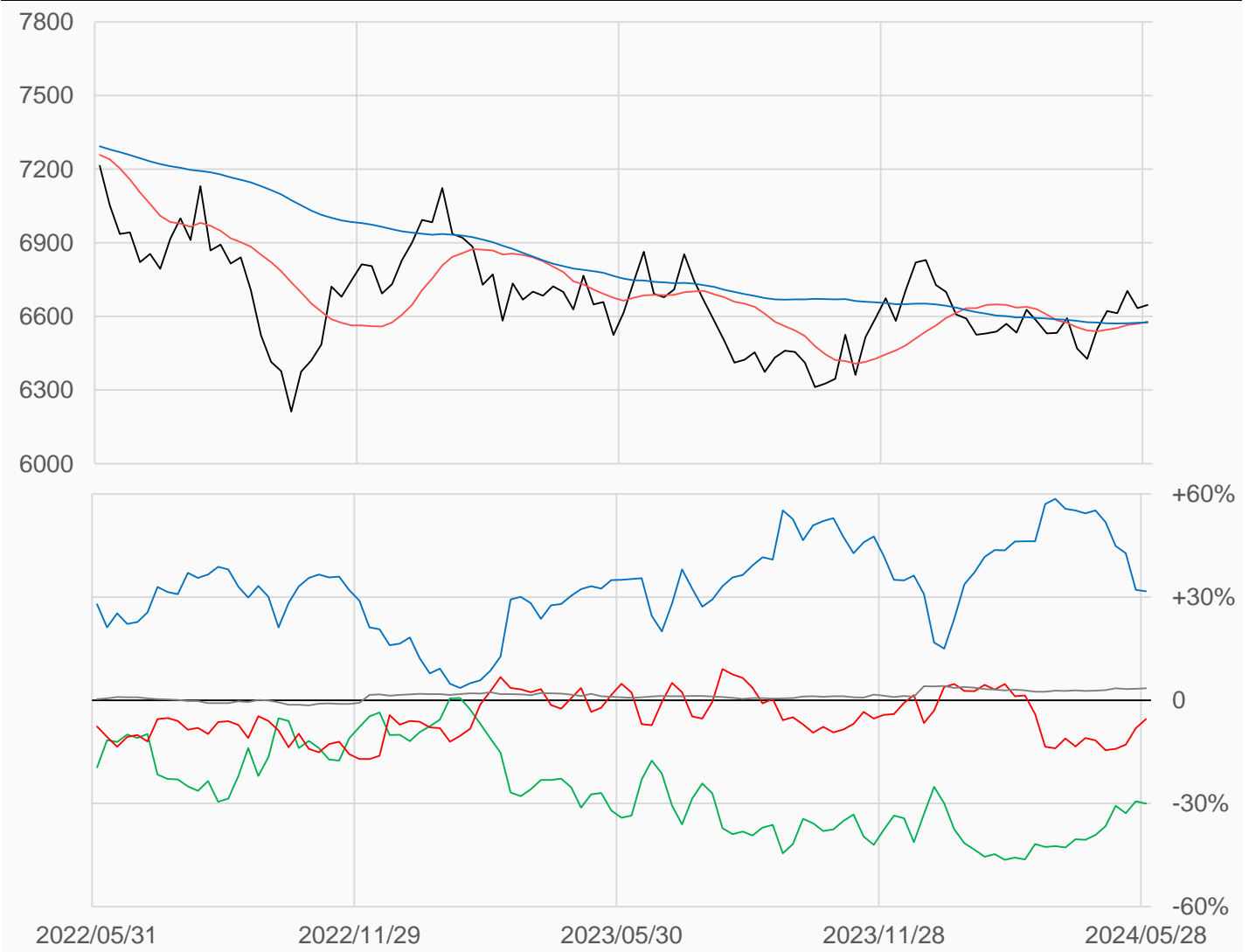
澳幣

澳幣較前一週上漲13點收在6646.5點，
 槓桿基金多單增加356口，空單減少5658口，
 淨空單較前一週減少6014口至11653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
2024/05/28	218402	214362	-4040	-1.85%	6646.5	↑ +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	87961	-906	19964	+1187	+67997	-2093
資產管理	52207	-276	116628	+82	-64421	-358
槓桿基金	39510	+356	51163	-5658	-11653	+6014
其他	8893	+742	1423	+611	+7470	+131

週五收盤價與13週與52週平均線

— AD — 13週 6579.2 — 52週 6575.1



淨部位佔總OI% 經紀 +31.7% 資管 -30.1% 槓桿 -5.4% 其他 +3.5%

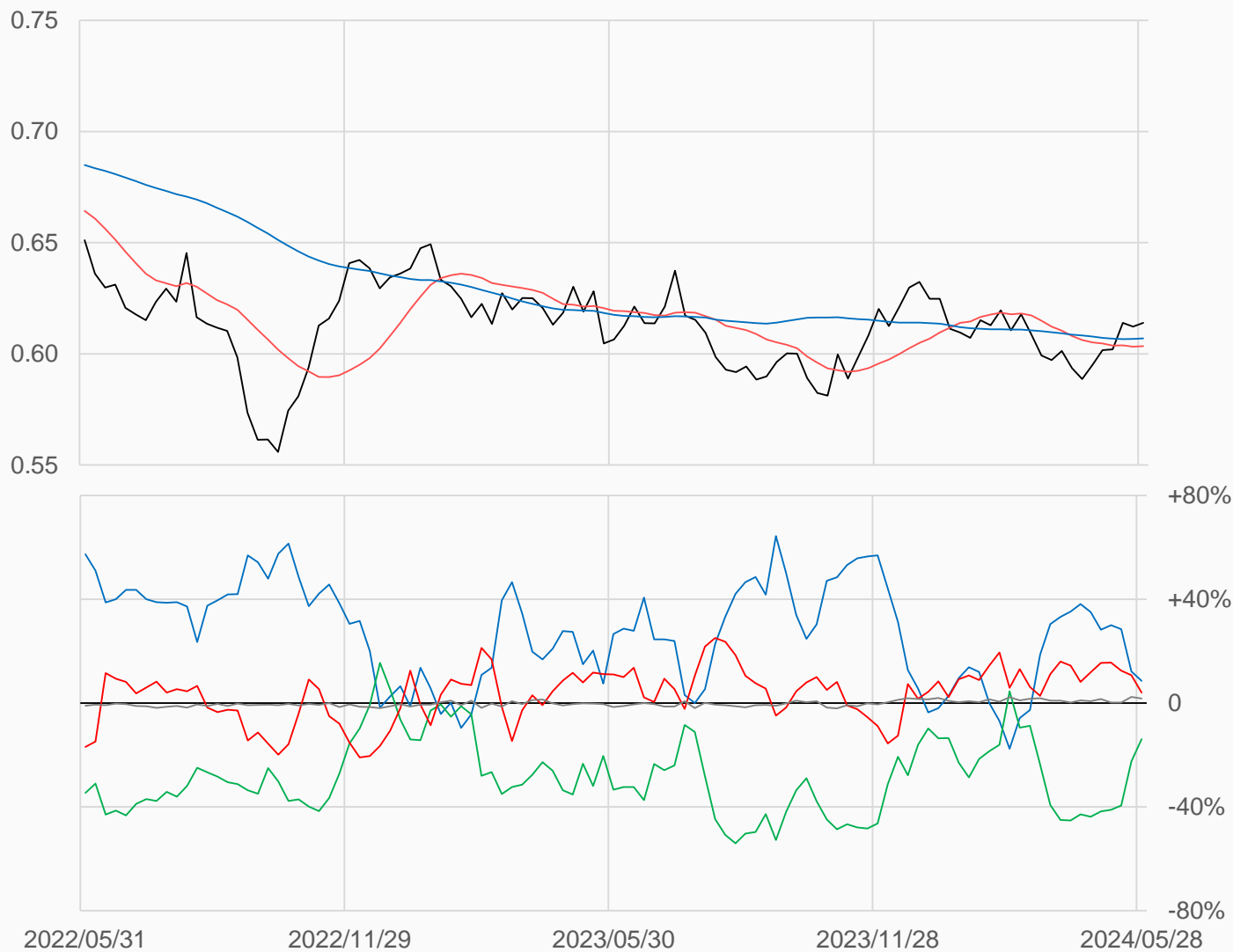
紐幣

紐幣較前一週上漲0.0017點收在0.6139點，
 槓桿基金多單增加3007口，空單增加5926口，
 淨多單較前一週減少2919口至2336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
2024/05/28	49105	57525	+8420	+17.15%	0.6139	↑ +0.0017
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	15725	+1012	10821	+2079	+4904	-1067
資產管理	15283	+3911	23282	+892	-7999	+3019
槓桿基金	21483	+3007	19147	+5926	+2336	-2919
其他	1347	+61	321	+201	+1026	-140

週五收盤價與13週與52週平均線

— NE — 13週 0.6035 — 52週 0.6069



淨部位佔總OI% 經紀 +8.5% 資管 -13.9% 槓桿 +4.1% 其他 +1.8%

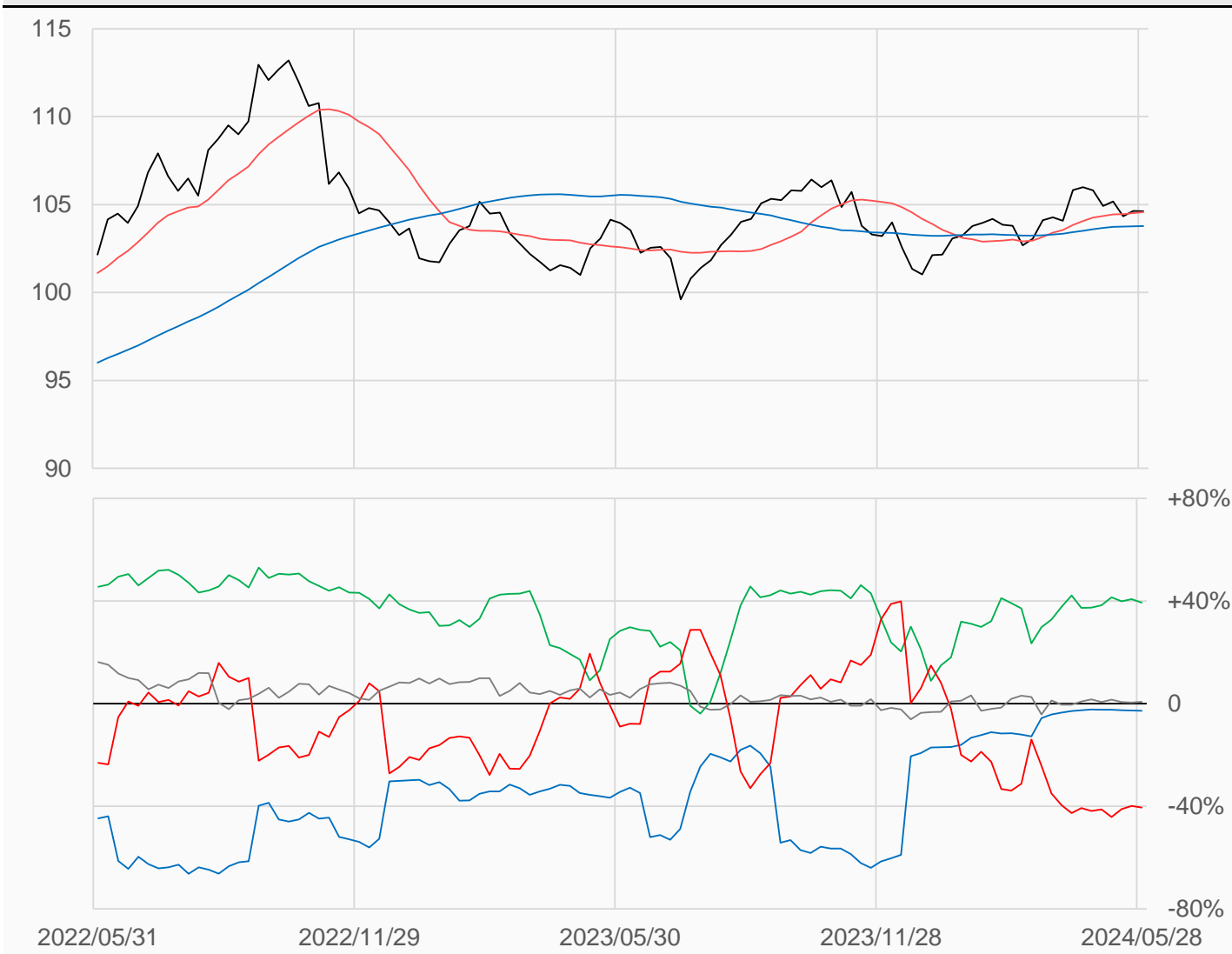
美元

美元較前一週下跌0.011點收在104.627點，
 槓桿基金多單減少110口，空單增加226口，
 淨空單較前一週增加336口至16261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
2024/05/28	39965	40154	+189	+0.47%	104.627	↓ -0.011
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	378	-45	1487	0	-1109	-45
資產管理	16815	-347	991	+83	+15824	-430
槓桿基金	16498	-110	32759	+226	-16261	-336
其他	2819	+195	2539	+79	+280	+116

週五收盤價與13週與52週平均線

— DX — 13週 104.58 — 52週 103.77



淨部位佔總OI% 經紀 -2.8% 資管 +39.4% 槓桿 -40.5% 其他 +0.7%

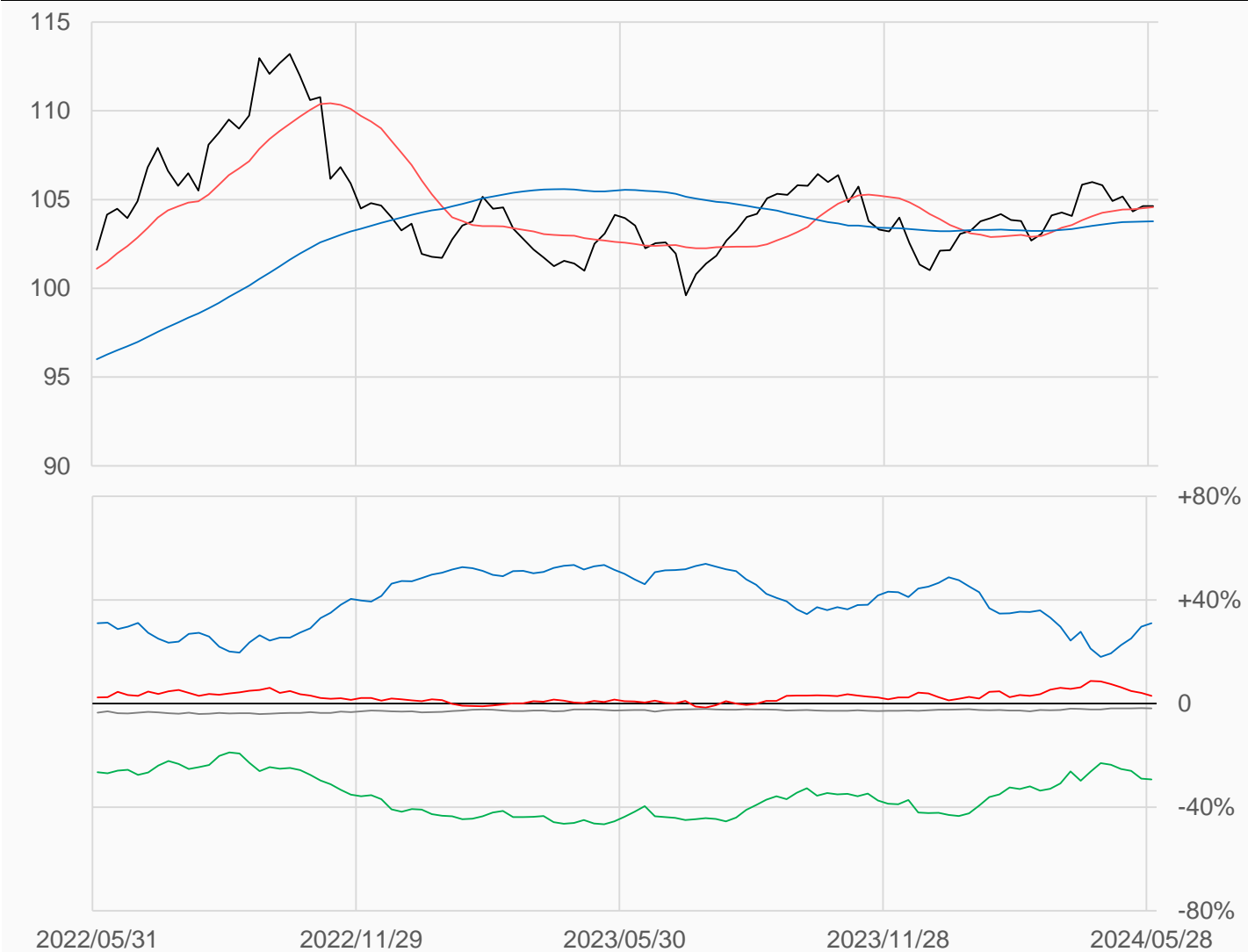
綜合美元 (不含美元)

綜合美元較前一週下跌0.011點收在104.627點，
槓桿基金多單增加1915口，空單增加11143口，
淨多單較前一週減少9228口至28099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
2024/05/28	911560	943100.8	+31541	+3.46%	104.627	↓ -0.011
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	400529	+27977	108270.3	+6296	+292259	+21681
資產管理	235218	-526	511760.6	+12073	-276543	-12599
槓桿基金	209369.4	+1915	181270.9	+11143	+28099	-9228
其他	21527.25	-1815	39230.29	-222	-17703	-1593

週五收盤價與13週與52週平均線

— DXY — 13週 104.58 — 52週 103.77



淨部位佔總OI% 經紀 +31.0% 資管 -29.3% 槓桿 +3.0% 其他 -1.9%

綜合美元 (含美元)

綜合美元較前一週下跌0.011點收在104.627點，
槓桿基金多單增加1805口，空單增加11369口，
淨多單較前一週減少9564口至11838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
2024/05/28	951525	983254.8	+31730	+3.33%	104.627	↓ -0.011
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	400907	+27932	109757.3	+6296	+291150	+21636
資產管理	252033	-873	512751.6	+12156	-260719	-13029
槓桿基金	225867.4	+1805	214029.9	+11369	+11838	-9564
其他	24346.25	-1620	41769.29	-143	-17423	-1477

週五收盤價與13週與52週平均線

— DXX — 13週 104.58 — 52週 103.77



淨部位佔總OI% 經紀 +29.6% 資管 -26.5% 槓桿 +1.2% 其他 -1.8%

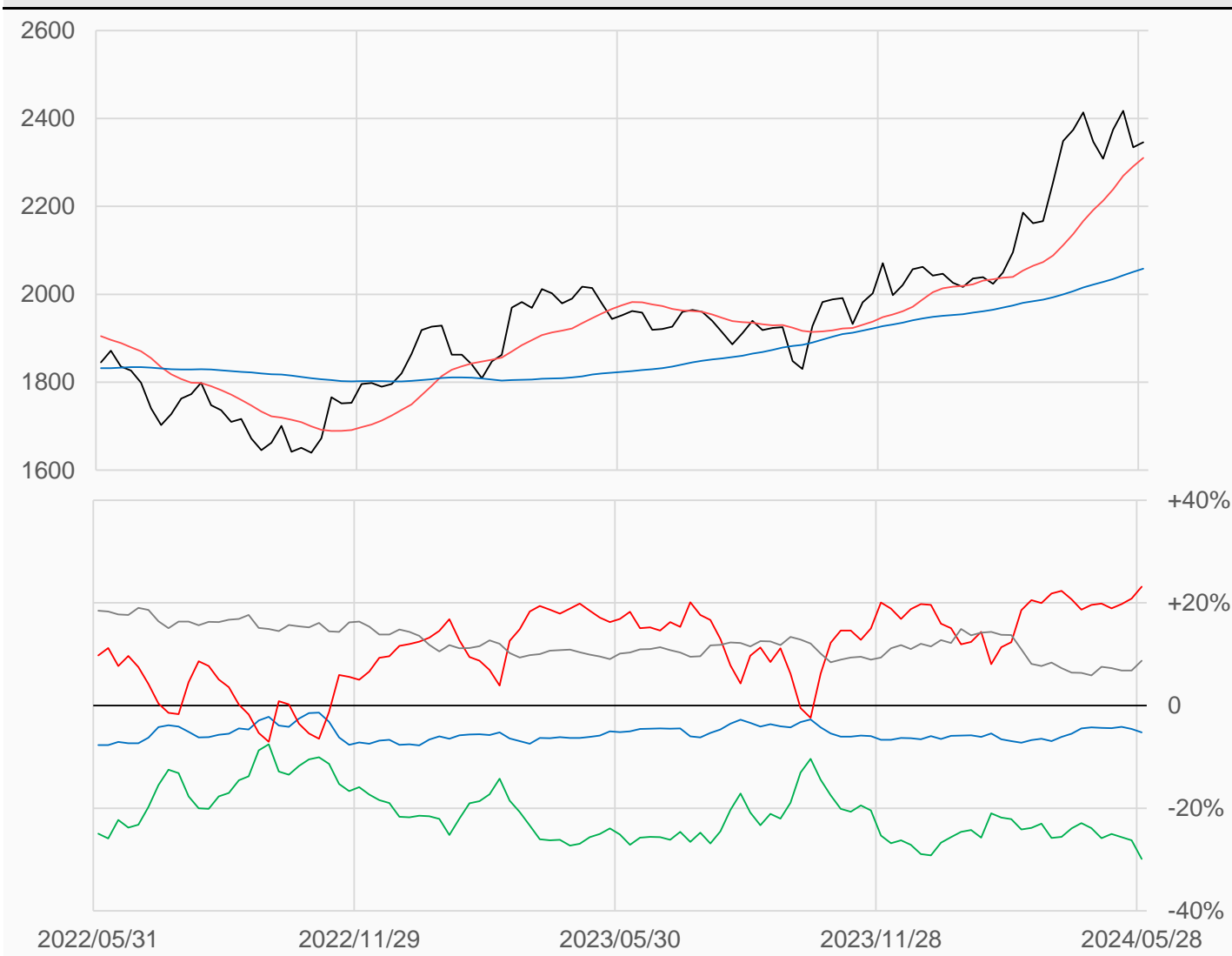
黃金

黃金較前一週上漲11.3點收在2345.8點，
 管理基金多單減少56296口，空單減少41545口，
 淨多單較前一週減少14751口至179221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
2024/05/28	931382	773824	-157558	-16.92%	2345.8	↑ +11.3
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	34449	-6290	74776	-8457	-40327	+2167
互換交易	151077	-24799	382328	-38261	-231251	+13462
管理基金	263918	-56296	84697	-41545	+179221	-14751
其他	266034	-63726	198390	-67974	+67644	+4248

週五收盤價與13週與52週平均線

— GC — 13週 2310.3 — 52週 2058.3



淨部位佔總OI% 生產 -5.2% 互換 -29.9% 管理 +23.2% 其他 +8.7%

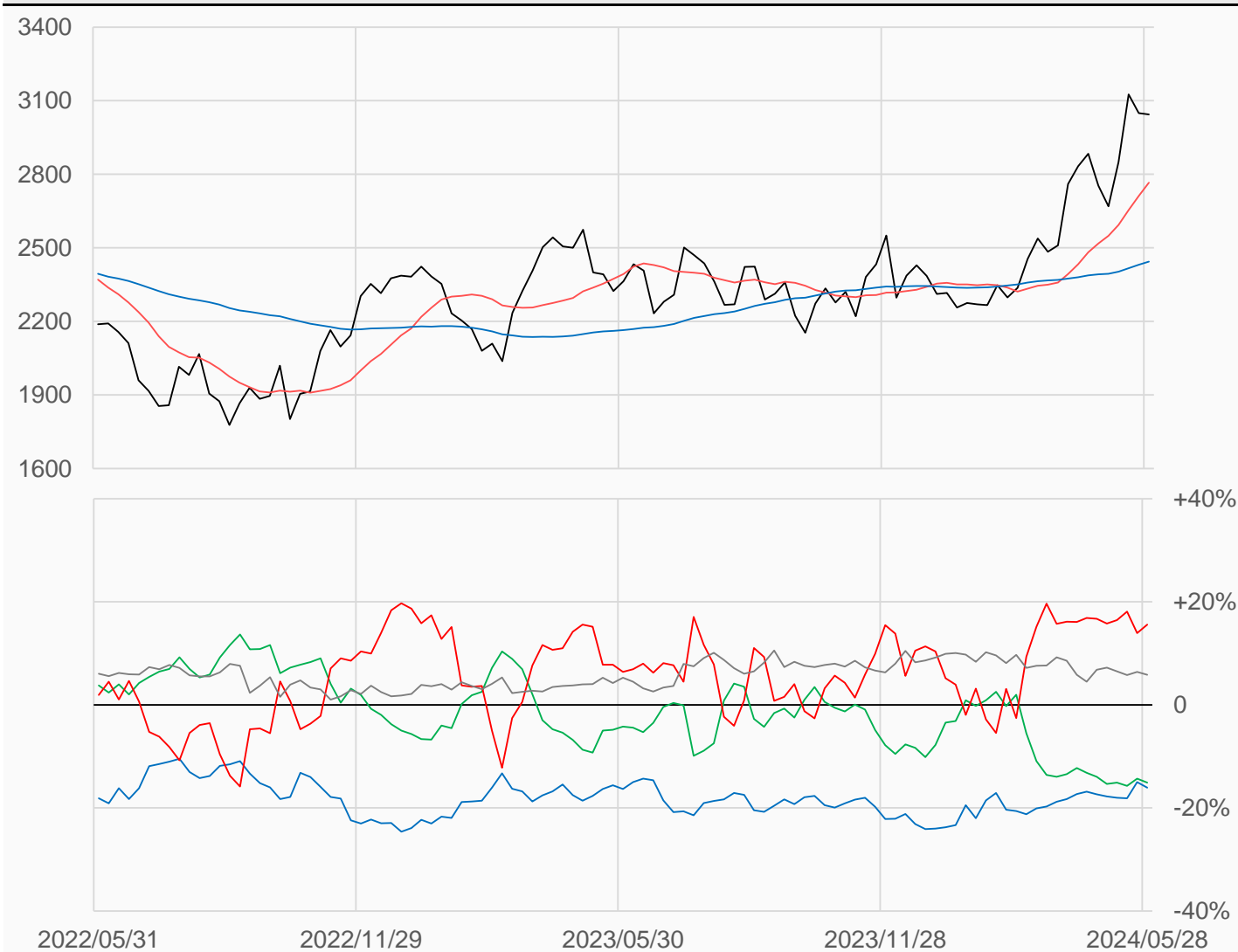
白銀

白銀較前一週下跌5.9點收在3044點，
管理基金多單減少288口，空單減少2114口，
淨多單較前一週增加1826口至39529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
2024/05/28	270380	254066	-16314	-6.03%	3044.0	↓ -5.9
分類	多單OI	增減	空單OI	增減	多空淨部位	淨部位變動
生產商	11394	-1488	52152	-1236	-40758	-252
互換交易	51636	-4103	89898	-4495	-38262	+392
管理基金	75799	-288	36270	-2114	+39529	+1826
其他	75495	-10830	60708	-8349	+14787	-2481

週五收盤價與13週與52週平均線

— SI — 13週 2765.9 — 52週 2443.9



淨部位佔總OI% 生產 -16.0% 互換 -15.1% 管理 +15.6% 其他 +5.8%

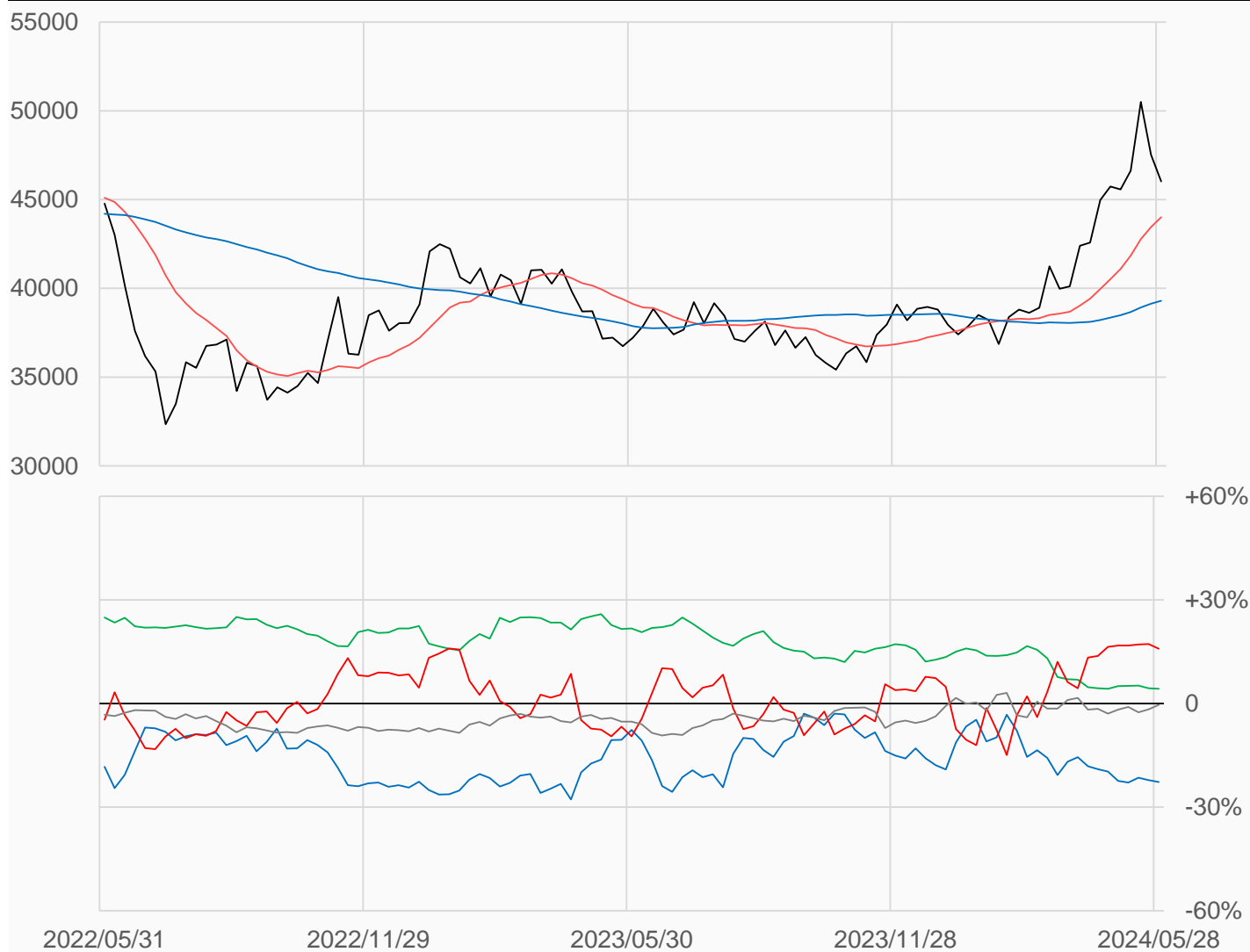
銅

銅較前一週下跌1515點收在46020點，
 管理基金多單減少22151口，空單減少10596口，
 淨多單較前一週減少11555口至63787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
2024/05/28	437417	402490	-34927	-7.98%	46020	↓ -1515
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	22591	+578	113988	-5084	-91397	+5662
互換交易	90790	+703	73541	+2647	+17249	-1944
管理基金	177615	-22151	113828	-10596	+63787	-11555
其他	84961	-13916	86523	-19650	-1562	+5734

週五收盤價與13週與52週平均線

— HG — 13週 44015 — 52週 39296



淨部位佔總OI% 生產 -22.7% 互換 +4.3% 管理 +15.8% 其他 -0.4%

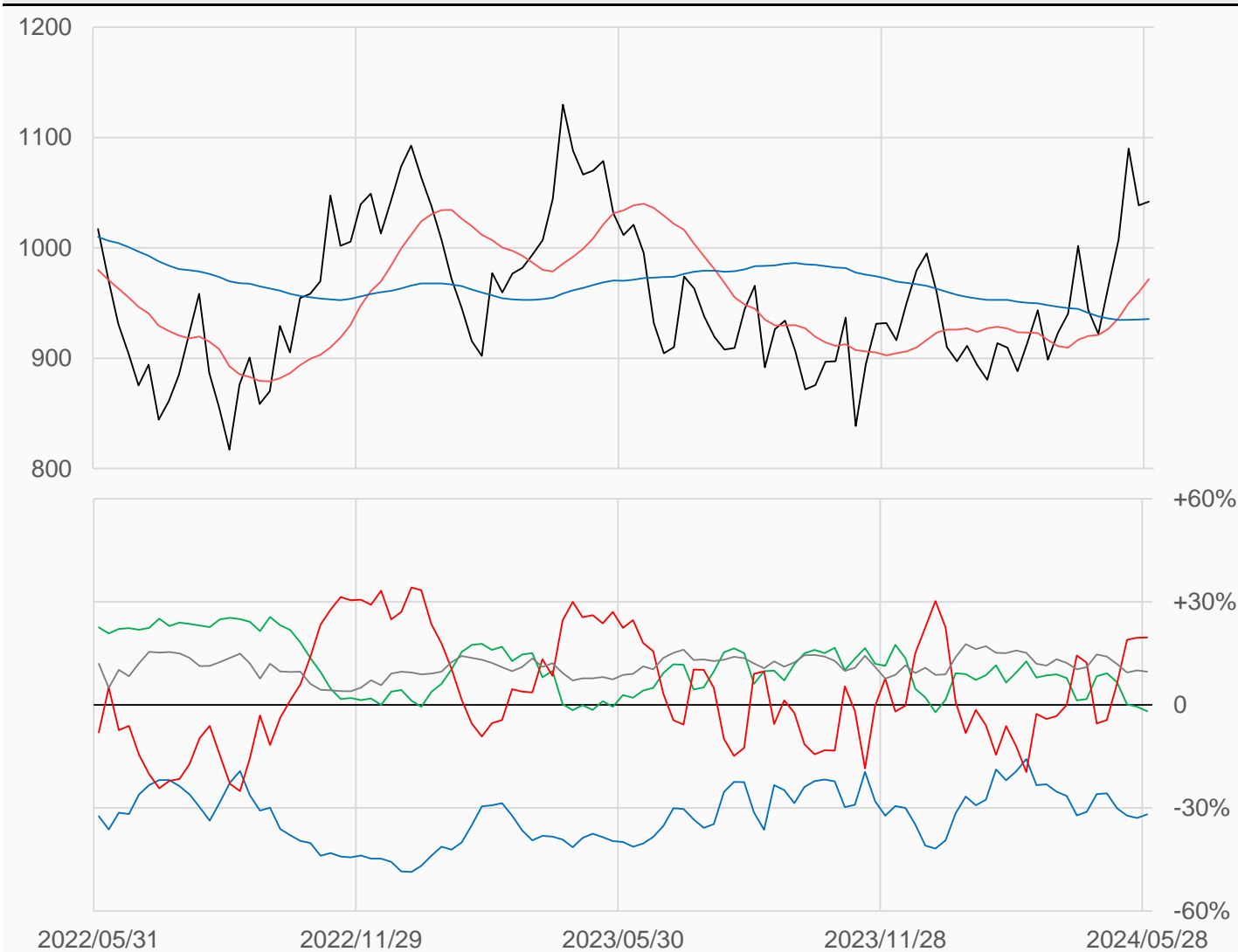
白金

白金較前一週上漲3.4點收在1042點，
管理基金多單增加504口，空單增加234口，
淨多單較前一週增加270口至20843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
2024/05/28	105059	105956	+897	+0.85%	1042.0	↑ +3.4
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	4207	+51	37947	-831	-33740	+882
互換交易	18545	+20	20513	+1390	-1968	-1370
管理基金	51164	+504	30321	+234	+20843	+270
其他	22432	+327	12208	+683	+10224	-356

週五收盤價與13週與52週平均線

— PL — 13週 971.62 — 52週 935.61



淨部位佔總OI% 生產 -31.8% 互換 -1.9% 管理 +19.7% 其他 +9.6%

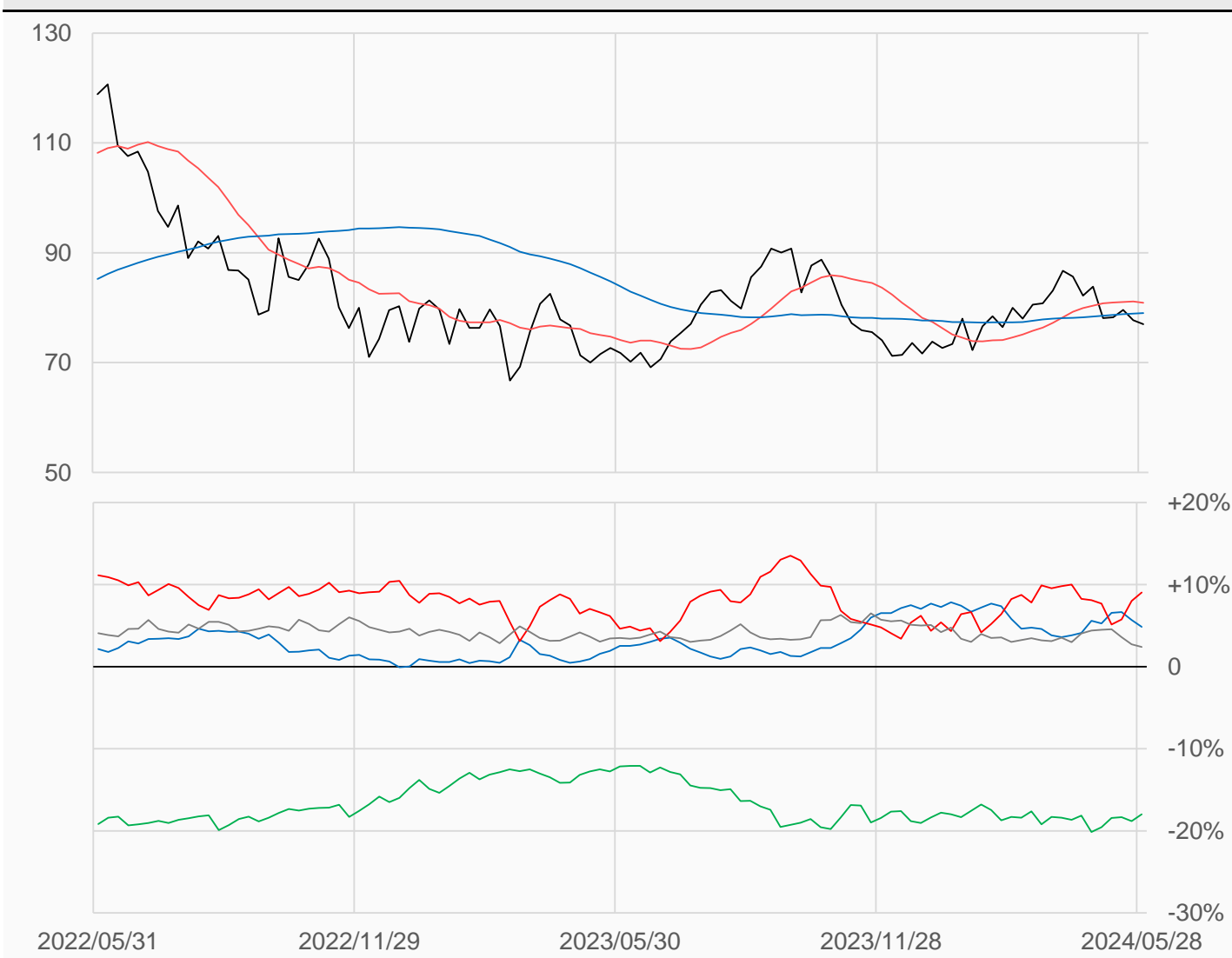
輕原油

輕原油較前一週下跌0.73點收在76.99點，
管理基金多單增加41767口，空單增加12624口，
淨多單較前一週增加29143口至201429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
2024/05/28	2149195	2227463	+78268	+3.64%	76.99	↓ -0.73
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	606502	+18835	498312	+32934	+108190	-14099
互換交易	226019	+5962	626891	+2582	-400872	+3380
管理基金	787420	+41767	585991	+12624	+201429	+29143
其他	511840	+16991	458275	+22038	+53565	-5047

週五收盤價與13週與52週平均線

— CL — 13週 80.895 — 52週 79.031



淨部位佔總OI% 生產 +4.9% 互換 -18.0% 管理 +9.0% 其他 +2.4%

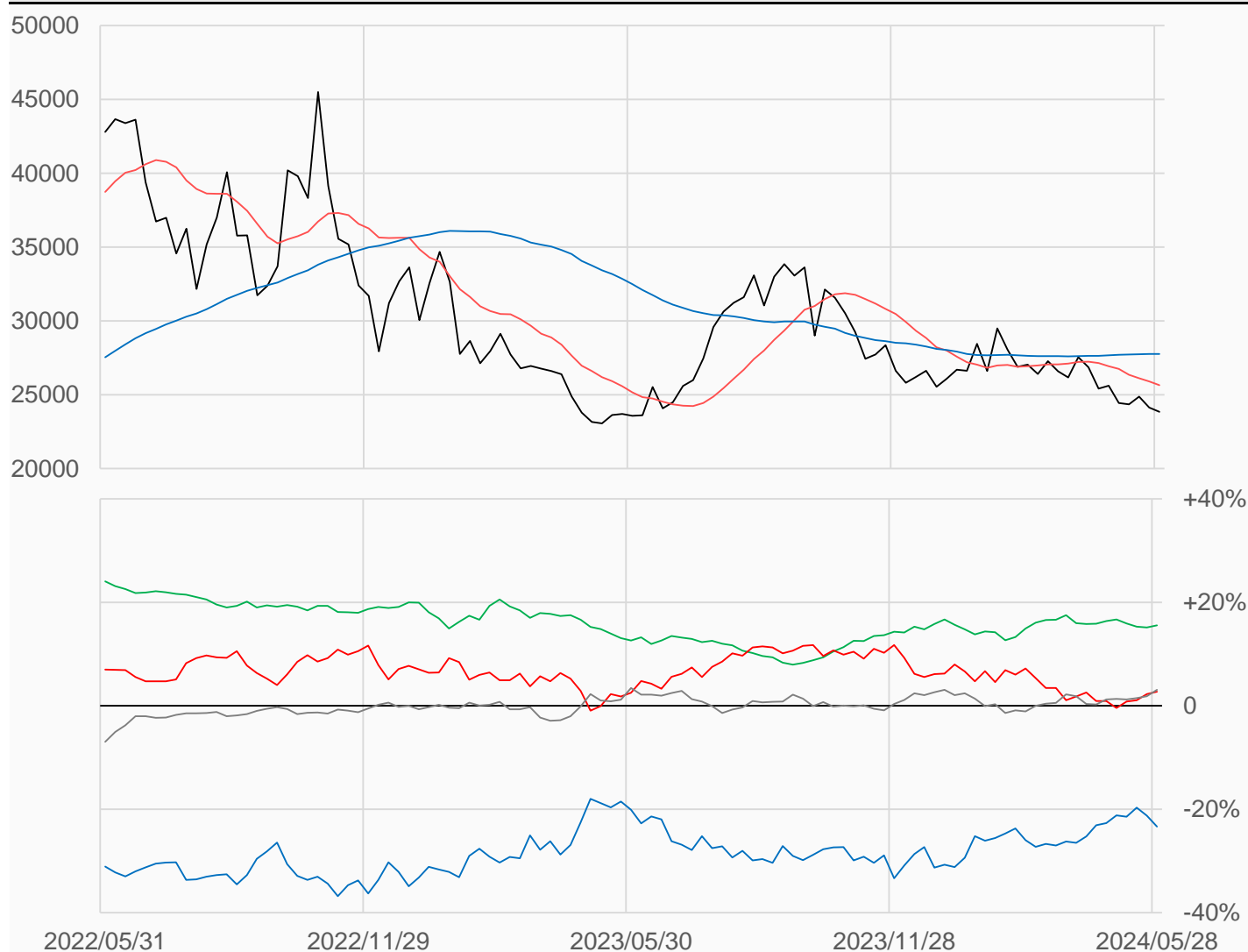
熱燃油

熱燃油較前一週下跌294點收在23842點，
管理基金多單增加1191口，空單減少663口，
淨多單較前一週增加1854口至11093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
2024/05/28	410189	405634	-4555	-1.11%	23842	↓ -294
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	105466	-9210	200189	-1614	-94723	-7596
互換交易	79611	-1120	16432	-2109	+63179	+989
管理基金	111100	+1191	100007	-663	+11093	+1854
其他	64718	+3155	52130	-1831	+12588	+4986

週五收盤價與13週與52週平均線

— HO — 13週 25652 — 52週 27759



淨部位佔總OI% 生產 -23.4% 互換 +15.6% 管理 +2.7% 其他 +3.1%

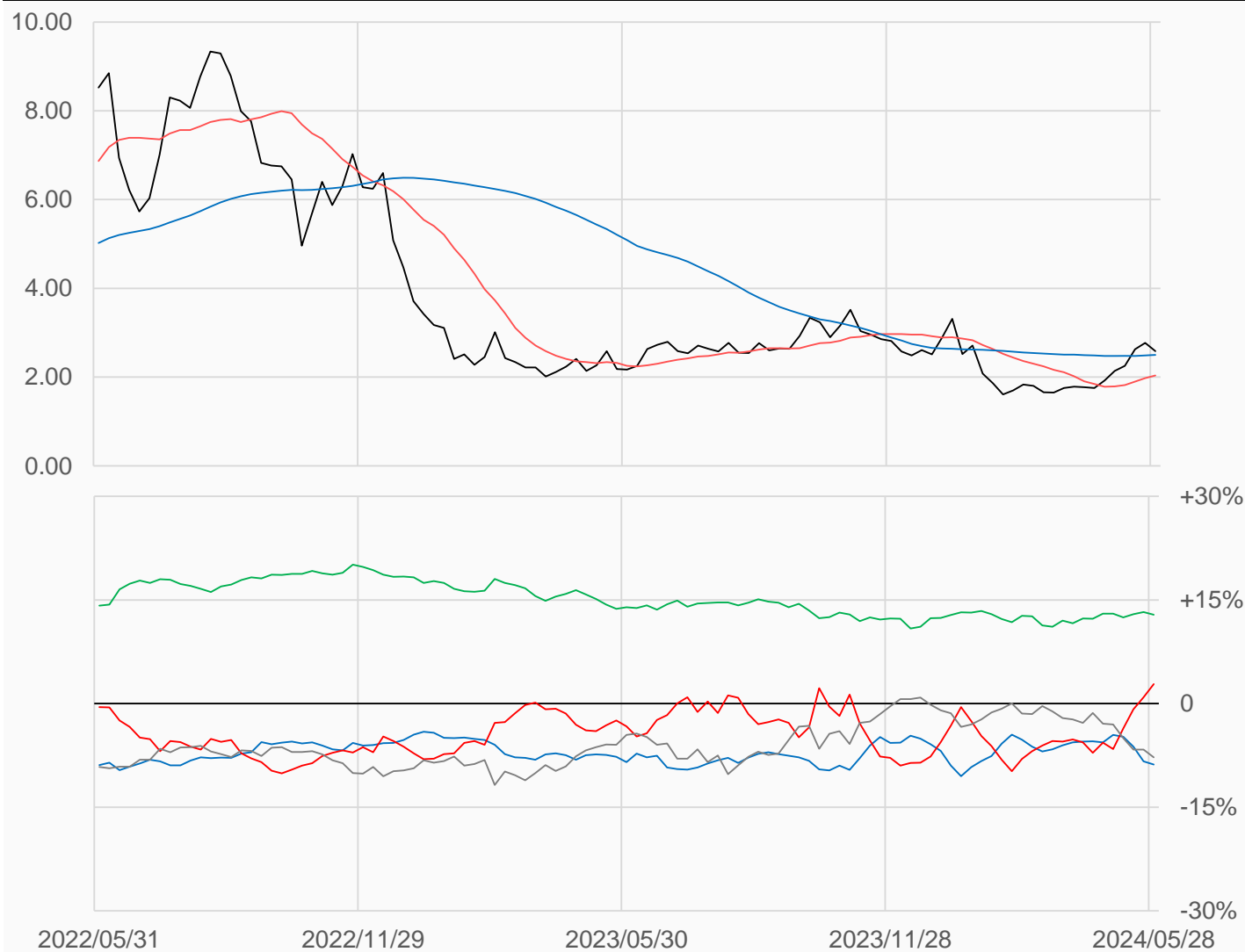
天然氣

天然氣較前一週下跌0.186點收在2.587點，
管理基金多單增加19998口，空單減少8411口，
淨多單較前一週增加28409口至42864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
2024/05/28	1564774	1522966	-41808	-2.67%	2.587	↓ -0.186
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	212615	-17466	347262	-13847	-134647	-3619
互換交易	367109	-15146	171531	-3291	+195578	-11855
管理基金	669975	+19998	627111	-8411	+42864	+28409
其他	220863	-27548	339650	-13146	-118787	-14402

週五收盤價與13週與52週平均線

— NG — 13週 2.0366 — 52週 2.4983



淨部位佔總OI% 生產 -8.8% 互換 +12.8% 管理 +2.8% 其他 -7.8%

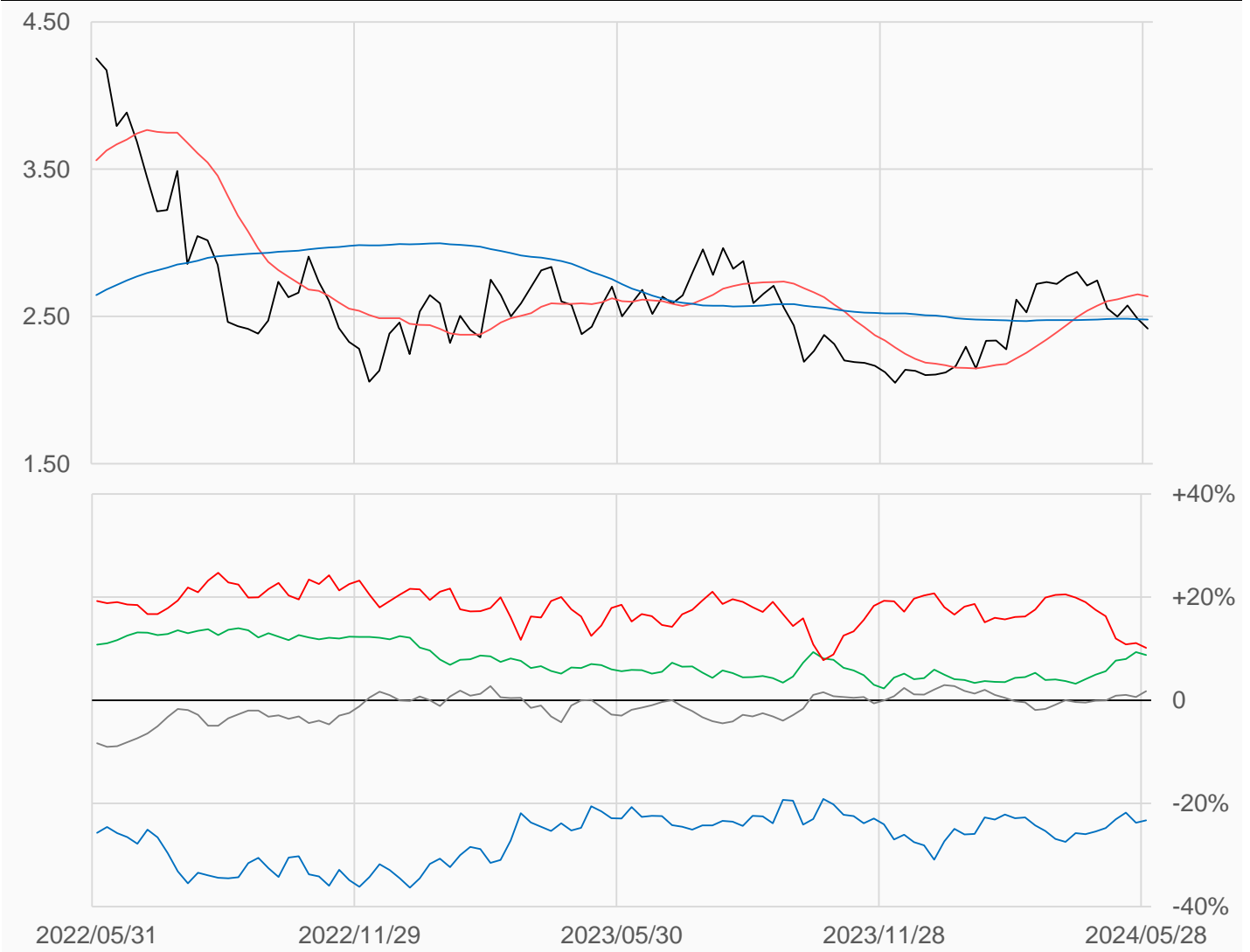
無鉛汽油

無鉛汽油較前一週下跌0.0668點收在2.4174點，
管理基金多單減少6358口，空單減少1334口，
淨多單較前一週減少5024口至39433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
2024/05/28	400888	387565	-13323	-3.32%	2.4174	↓ -0.0668
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	123170	-465	213344	-5355	-90174	+4890
互換交易	71494	-5071	37393	-1705	+34101	-3366
管理基金	119573	-6358	80140	-1334	+39433	-5024
其他	47751	-949	40965	-5068	+6786	+4119

週五收盤價與13週與52週平均線

— RB — 13週 2.6356 — 52週 2.4788



淨部位佔總OI% 生產 -23.3% 互換 +8.8% 管理 +10.2% 其他 +1.8%

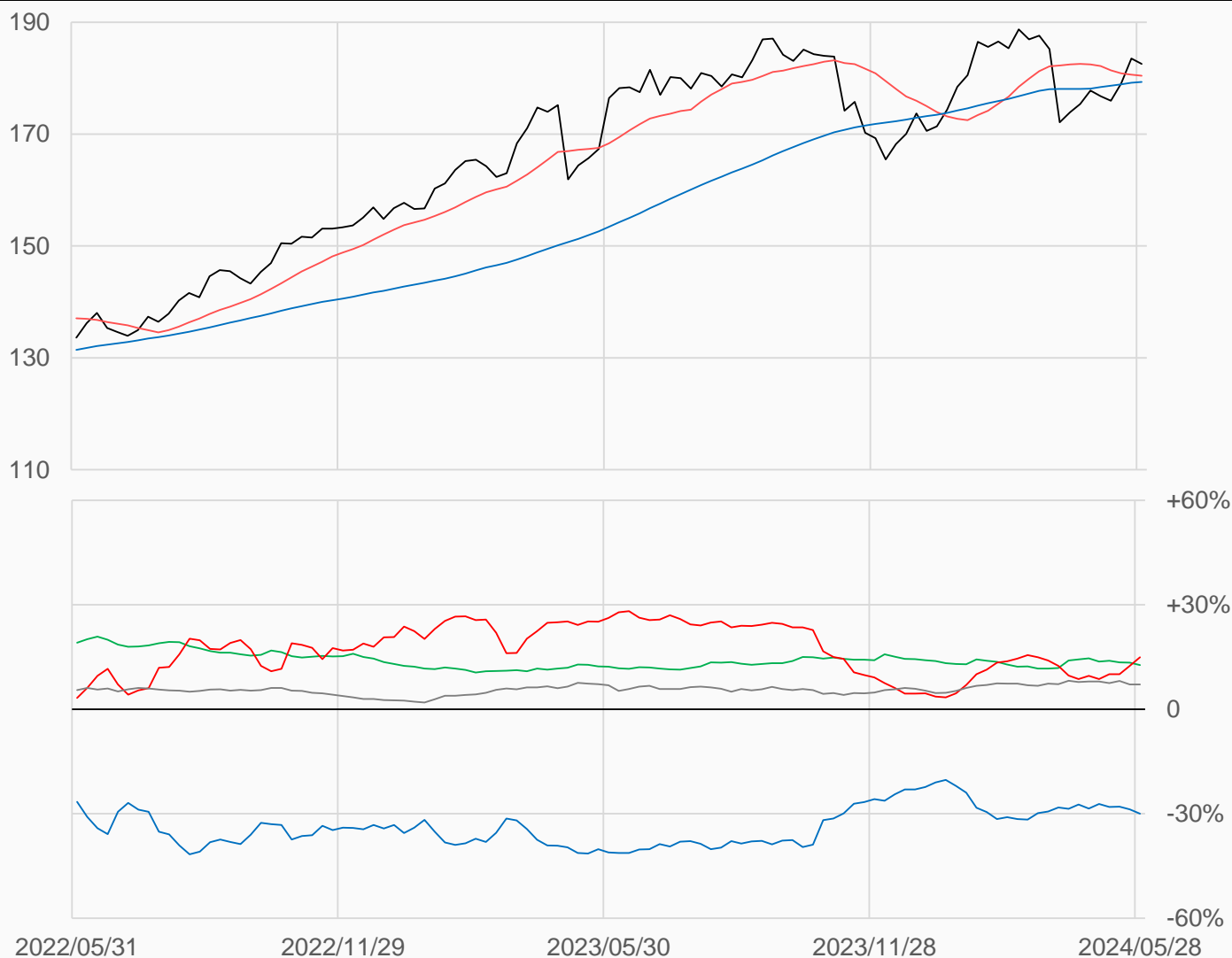
活牛

活牛較前一週下跌0.975點收在182.55點，
管理基金多單增加10712口，空單減少1364口，
淨多單較前一週增加12076口至58556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
2024/05/28	373084	391190	+18106	+4.85%	182.550	↓ -0.975
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	56889	+401	174098	+10503	-117209	-10102
互換交易	59560	-517	9805	-199	+49755	-318
管理基金	123331	+10712	64775	-1364	+58556	+12076
其他	120074	+8609	92276	+7367	+27798	+1242

週五收盤價與13週與52週平均線

— LC — 13週 180.43 — 52週 179.33



淨部位佔總OI% 生產 -30.0% 互換 +12.7% 管理 +15.0% 其他 +7.1%

活豬

活豬較前一週下跌0.55點收在93.975點，
管理基金多單減少2810口，空單增加11295口，
淨多單較前一週減少14105口至29392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
2024/05/28	385430	395706	+10276	+2.67%	93.975	↓ -0.550
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	48169	+5286	154729	-4518	-106560	+9804
互換交易	89760	+2683	23049	+2120	+66711	+563
管理基金	110530	-2810	81138	+11295	+29392	-14105
其他	121857	+4614	104051	+3195	+17806	+1419

週五收盤價與13週與52週平均線

— LH — 13週 91.492 — 52週 83.907



淨部位佔總OI% 生產 -26.9% 互換 +16.9% 管理 +7.4% 其他 +4.5%

玉米

玉米較前一週下跌18.5點收在446.25點，
管理基金多單增加5390口，空單增加17705口，
淨空單較前一週增加12315口至133477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
2024/05/28	1993404	1963843	-29561	-1.48%	446.25	↓ -18.50
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	448413	-3111	575890	-22319	-127477	+19208
互換交易	323134	-2166	82019	+764	+241115	-2930
管理基金	486815	+5390	620292	+17705	-133477	-12315
其他	515048	-27742	449662	-27266	+65386	-476

週五收盤價與13週與52週平均線

— ZC — 13週 446.5 — 52週 477.29



淨部位佔總OI% 生產 -6.5% 互換 +12.3% 管理 -6.8% 其他 +3.3%

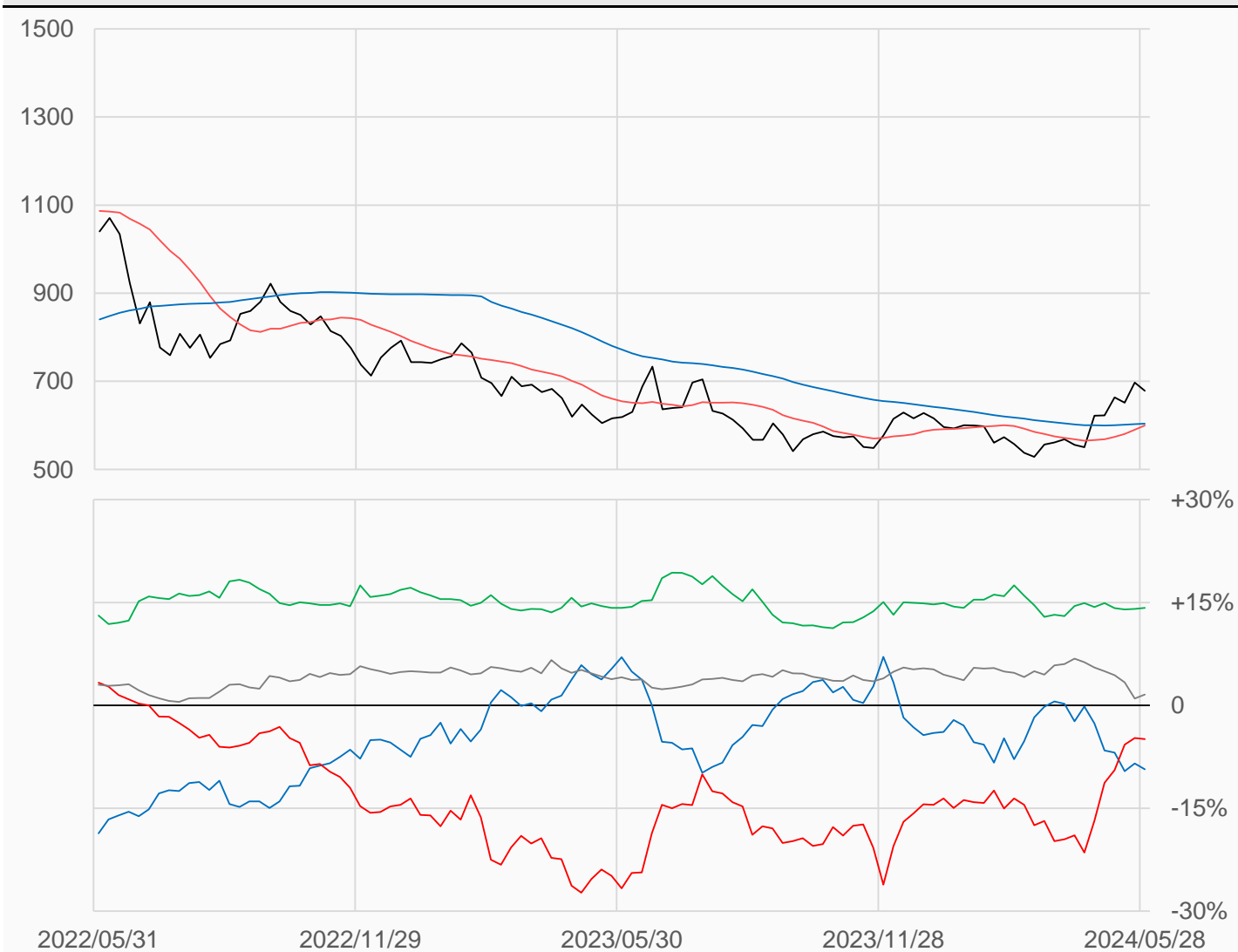
小麥

小麥較前一週下跌18.75點收在678.5點，
管理基金多單減少6024口，空單減少5186口，
淨空單較前一週增加838口至25431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
2024/05/28	515075	516145	+1070	+0.21%	678.50	↓ -18.75
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	63133	+1687	111180	+6147	-48047	-4460
互換交易	109575	+6335	36108	+5197	+73467	+1138
管理基金	174484	-6024	199915	-5186	-25431	-838
其他	133709	-2440	125546	-5542	+8163	+3102

週五收盤價與13週與52週平均線

— ZW — 13週 599.52 — 52週 603.99



淨部位佔總OI% 生產 -9.3% 互換 +14.2% 管理 -4.9% 其他 +1.6%

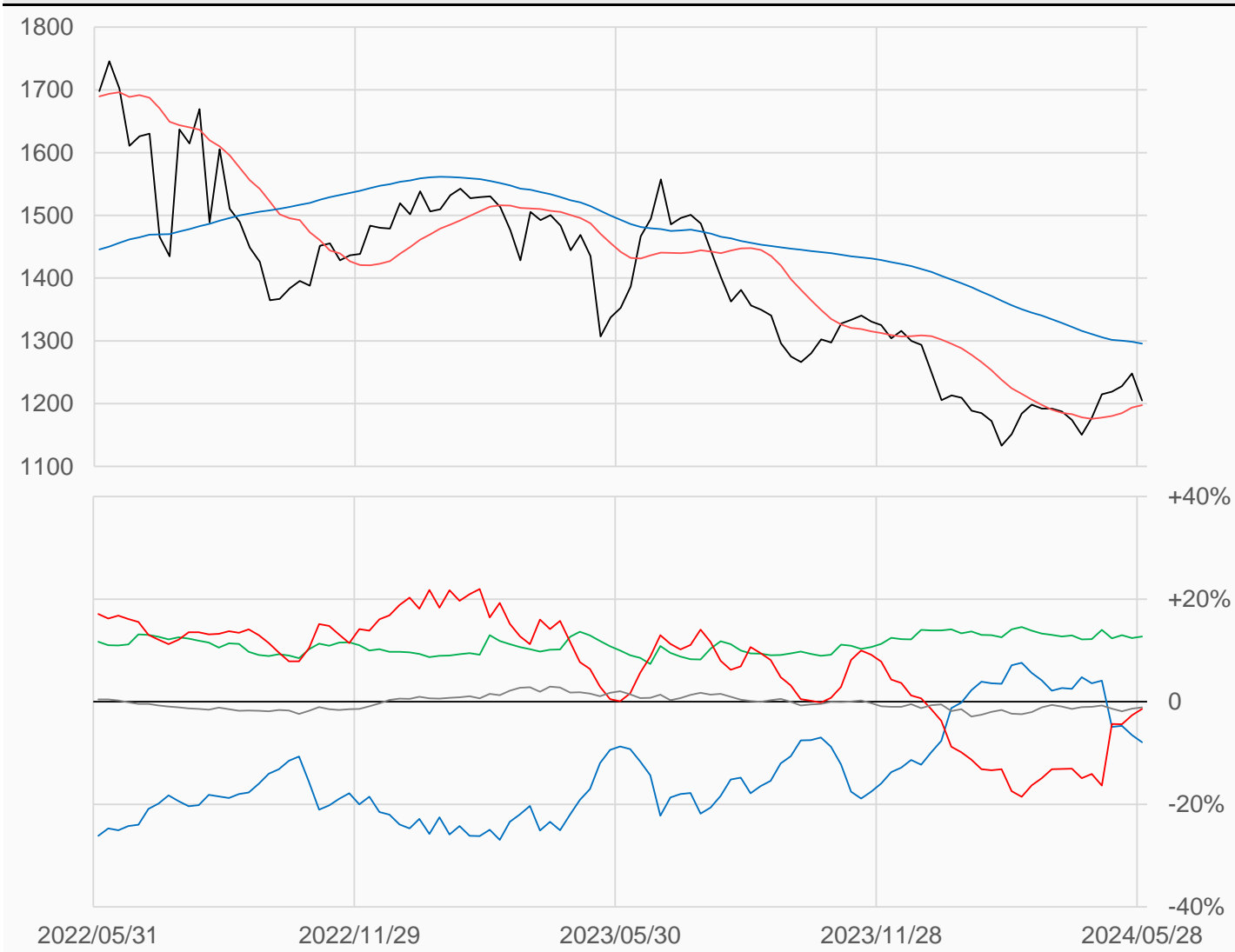
黃豆

黃豆較前一週下跌43點收在1205點，
 管理基金多單增加6411口，空單減少5797口，
 淨空單較前一週減少12208口至14218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
2024/05/28	1006051	1007496	+1445	+0.14%	1205.00	↓ -43.00
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	337342	+2681	416756	+16389	-79414	-13708
互換交易	173948	+1545	46126	-1743	+127822	+3288
管理基金	209773	+6411	223991	-5797	-14218	+12208
其他	224690	-7094	236032	-9550	-11342	+2456

週五收盤價與13週與52週平均線

— ZS — 13週 1197.7 — 52週 1295.6



淨部位佔總OI% 生產 -7.9% 互換 +12.7% 管理 -1.4% 其他 -1.1%

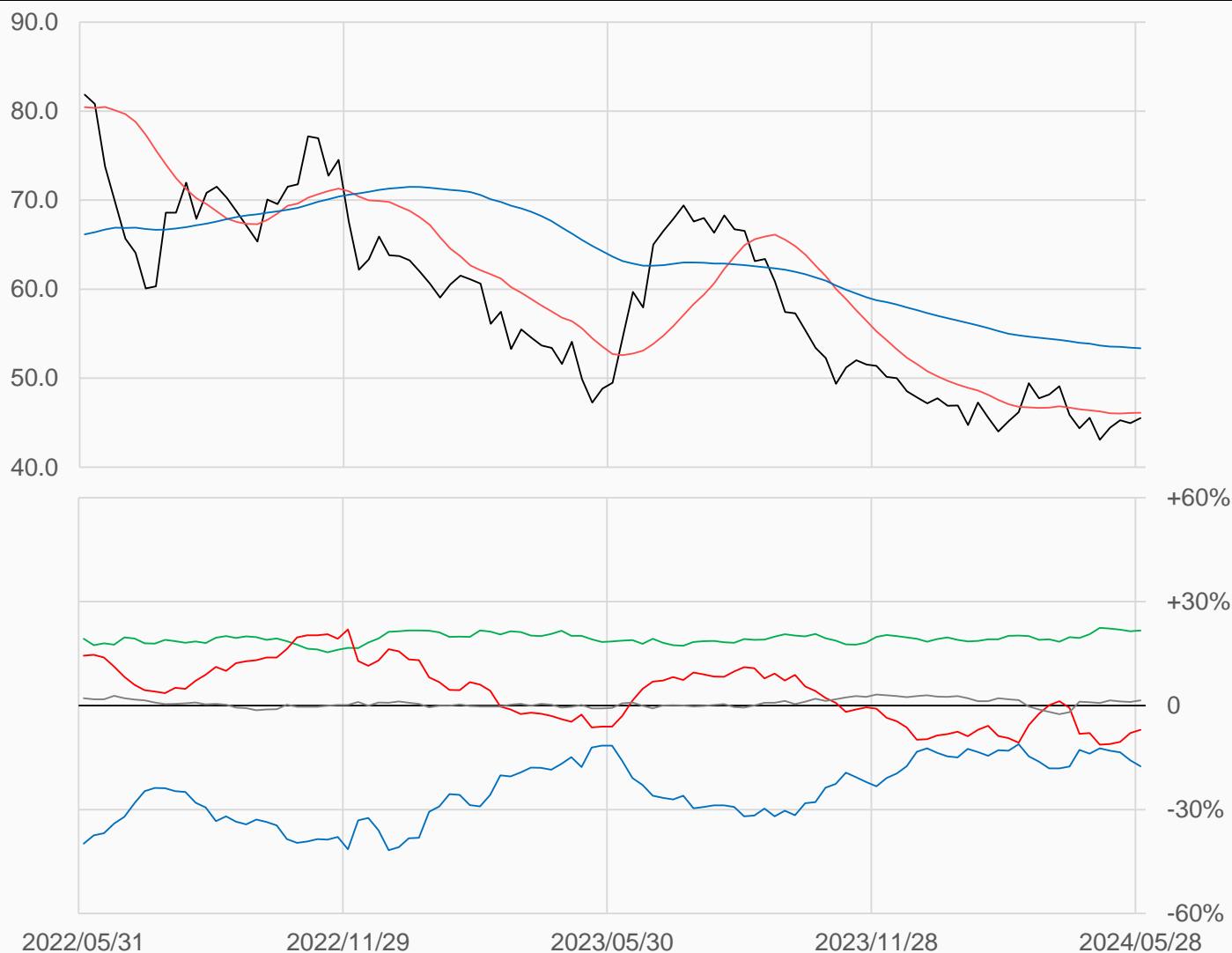
黃豆油

黃豆油較前一週上漲0.57點收在45.52點，
管理基金多單增加3887口，空單減少790口，
淨空單較前一週減少4677口至41844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
2024/05/28	588606	597248	+8642	+1.47%	45.52	↑ +0.57
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	161672	+4097	266225	+15612	-104553	-11515
互換交易	150818	+5756	21444	+2805	+129374	+2951
管理基金	144936	+3887	186780	-790	-41844	+4677
其他	106042	-4199	97202	-6817	+8840	+2618

週五收盤價與13週與52週平均線

— BO — 13週 46.128 — 52週 53.363



淨部位佔總OI% 生產 -17.5% 互換 +21.7% 管理 -7.0% 其他 +1.5%

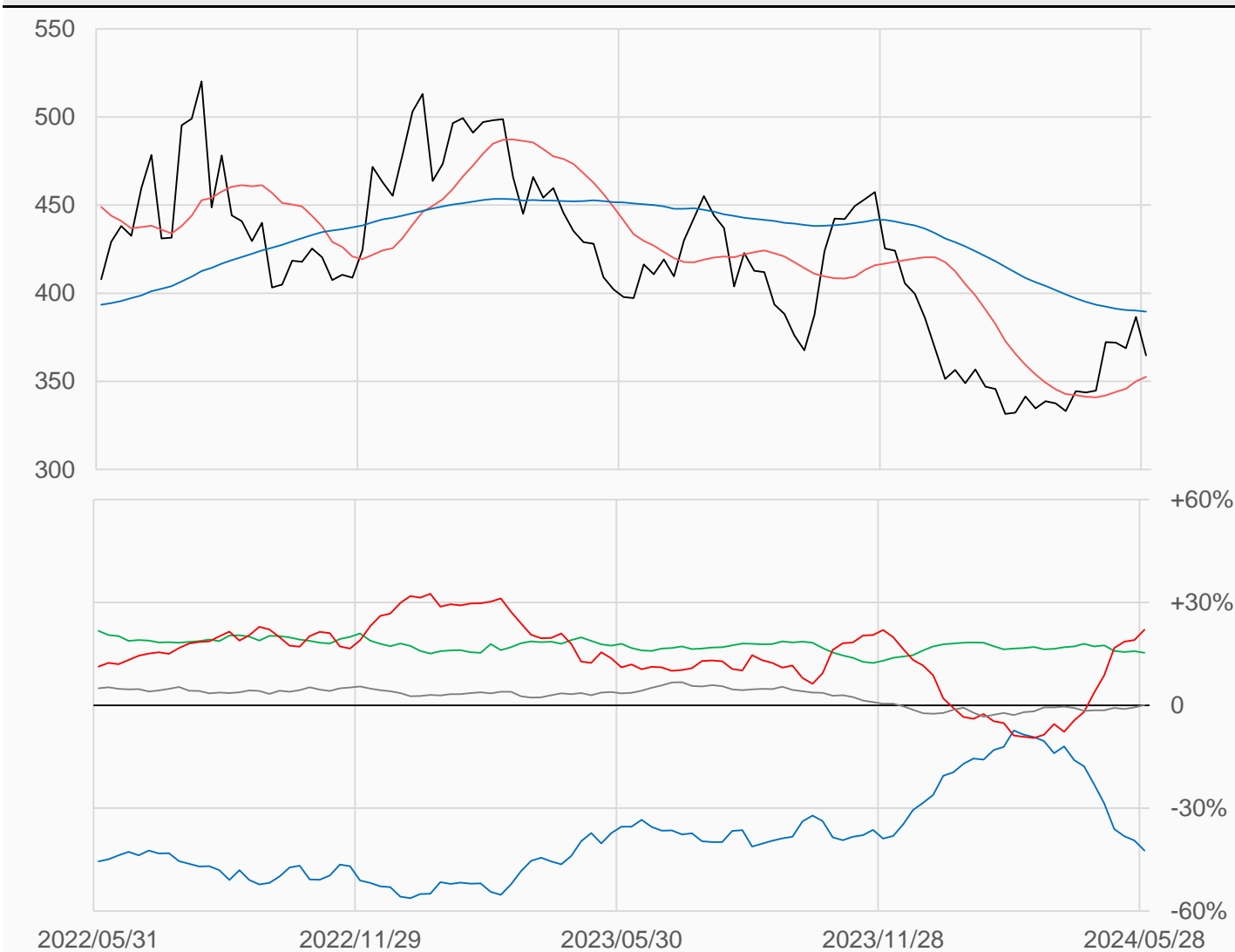
黃豆粉

黃豆粉較前一週下跌21.8點收在364.7點，
 管理基金多單增加15008口，空單減少2330口，
 淨多單較前一週增加17338口至118282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
2024/05/28	529615	536628	+7013	+1.32%	364.7	↓ -21.8
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	90531	-2739	317753	+15806	-227222	-18545
互換交易	98507	+248	16295	+1519	+82212	-1271
管理基金	213261	+15008	94979	-2330	+118282	+17338
其他	78557	-4243	78119	-7816	+438	+3573

週五收盤價與13週與52週平均線

— SM — 13週 352.49 — 52週 389.55



淨部位佔總OI% 生產 -42.3% 互換 +15.3% 管理 +22.0% 其他 +0.1%

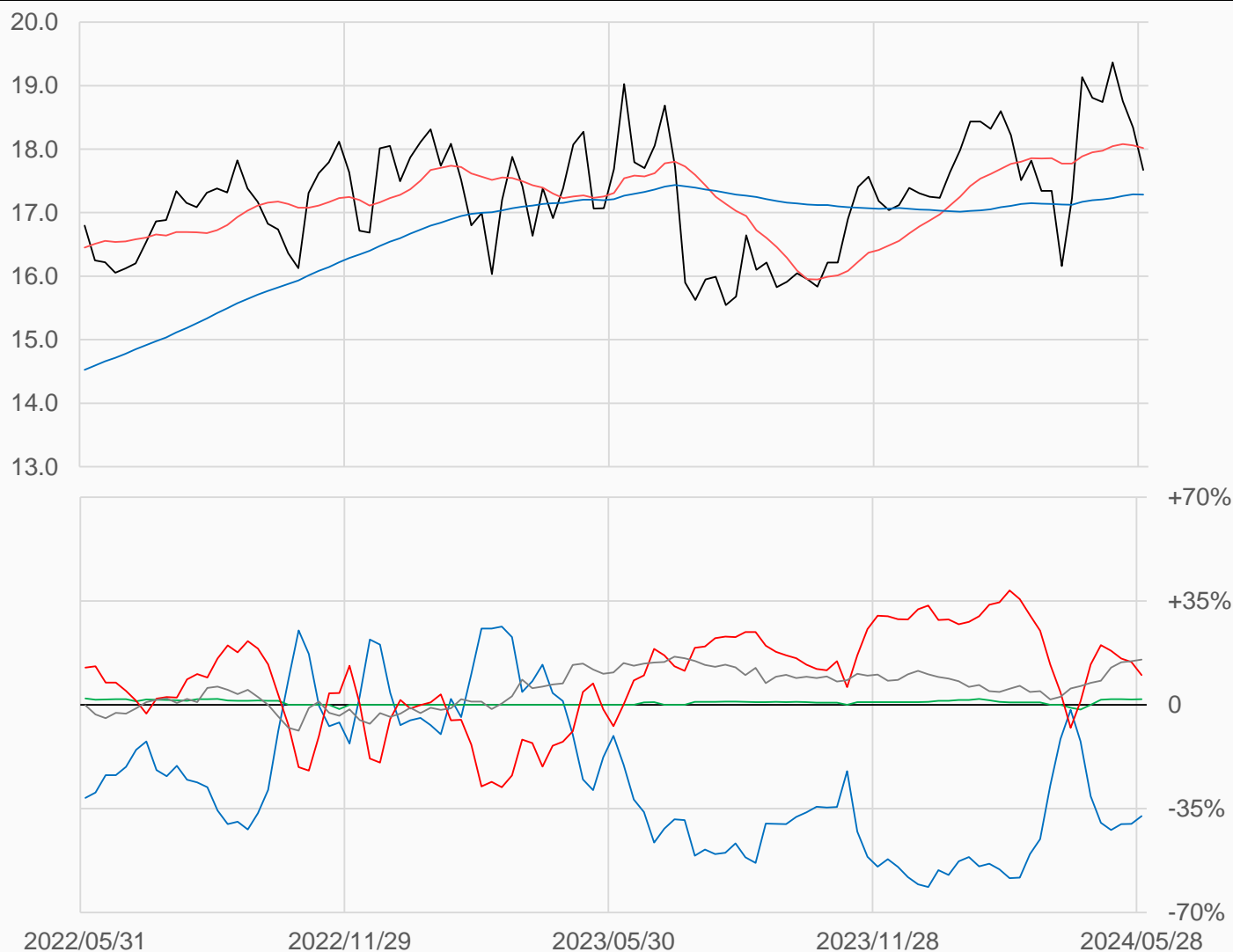
粗米

粗米較前一週下跌0.67點收在17.67點，
管理基金多單減少245口，空單增加197口，
淨多單較前一週減少442口至1050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
2024/05/28	10321	10443	+122	+1.18%	17.670	↓ -0.670
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	4153	+215	8068	-11	-3915	+226
互換交易	200	+12	0	0	+200	+12
管理基金	1730	-245	680	+197	+1050	-442
其他	2193	-7	601	-82	+1592	+75

週五收盤價與13週與52週平均線

— RR — 13週 18.017 — 52週 17.286



淨部位佔總OI% 生產 -37.5% 互換 +1.9% 管理 +10.1% 其他 +15.2%

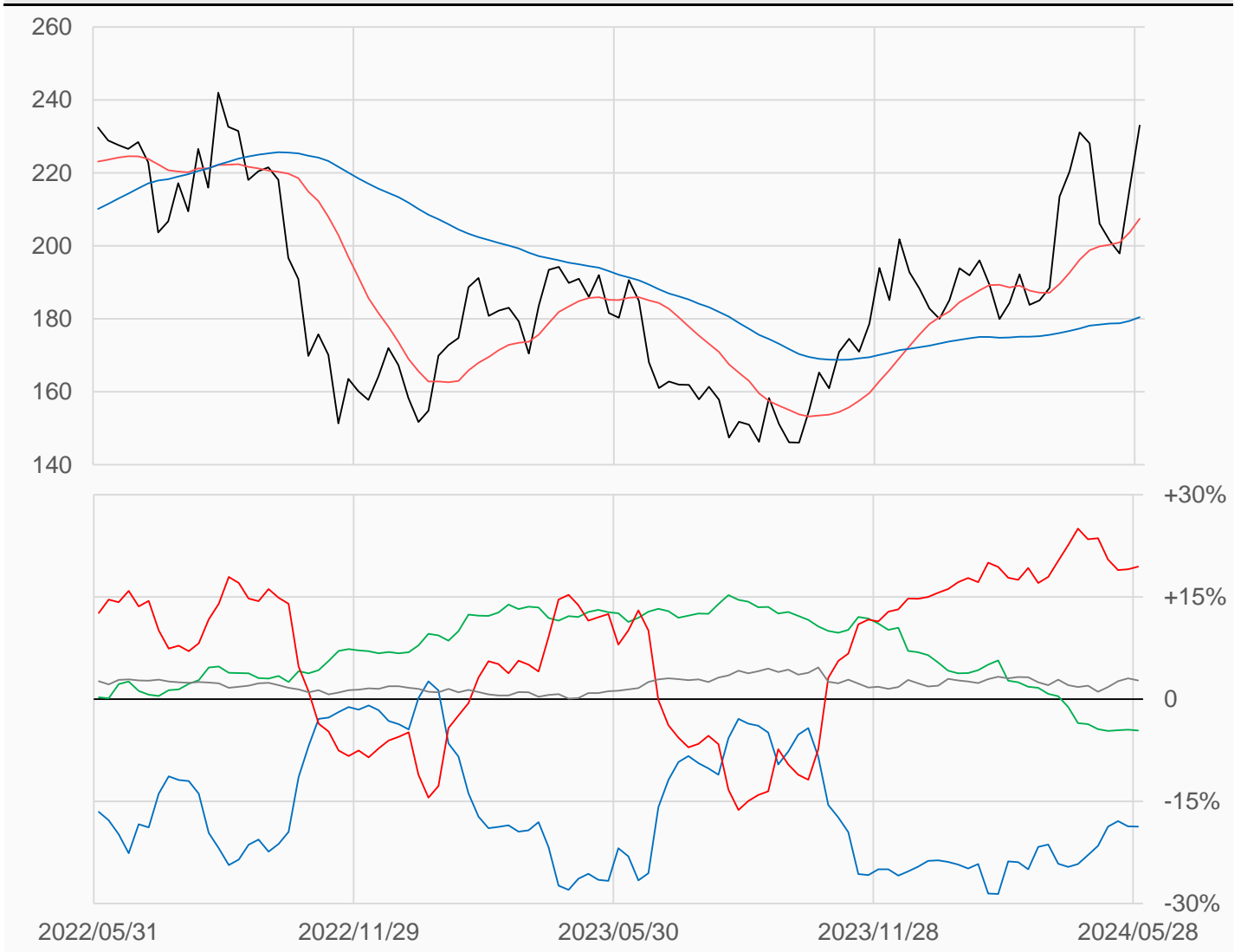
咖啡

咖啡較前一週上漲17.35點收在233點，
管理基金多單增加6248口，空單增加2235口，
淨多單較前一週增加4013口至56606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
2024/05/28	276219	291033	+14814	+5.36%	233.00	↑ +17.35
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	56002	+1091	110400	+3921	-54398	-2830
互換交易	43854	+1380	57279	+2458	-13425	-1078
管理基金	98241	+6248	41635	+2235	+56606	+4013
其他	83052	+6025	75092	+6508	+7960	-483

週五收盤價與13週與52週平均線

— KC — 13週 207.44 — 52週 180.47



淨部位佔總OI% 生產 -18.7% 互換 -4.6% 管理 +19.5% 其他 +2.7%

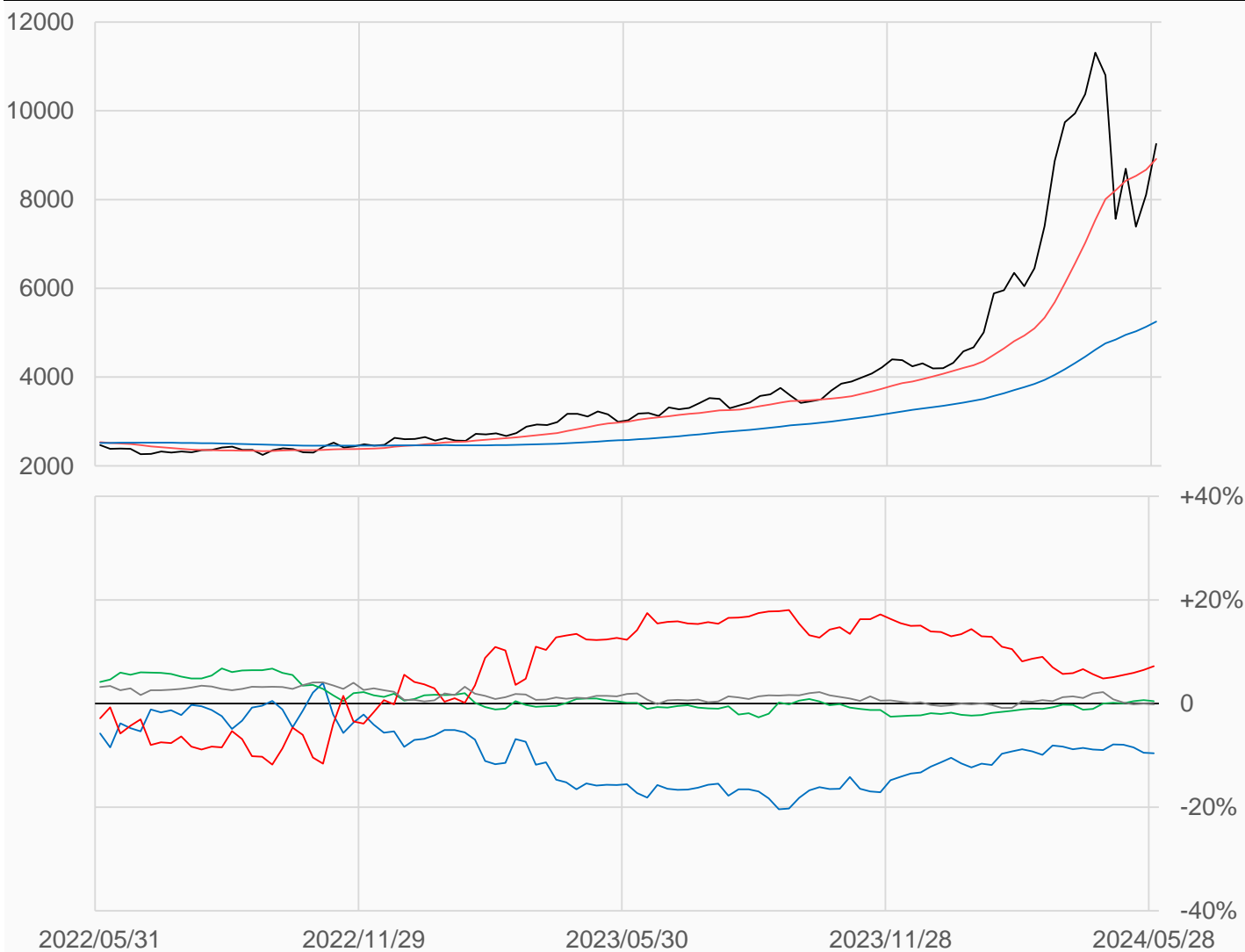
可可

可可較前一週上漲1148點收在9257點，
管理基金多單增加4611口，空單增加1055口，
淨多單較前一週增加3556口至19512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
2024/05/28	246433	271237	+24804	+10.07%	9257	↑ +1148
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	61110	+2935	87152	+5620	-26042	-2685
互換交易	25121	+5135	23934	+5629	+1187	-494
管理基金	78238	+4611	58726	+1055	+19512	+3556
其他	94964	+12160	95342	+12572	-378	-412

週五收盤價與13週與52週平均線

— CC — 13週 8916.5 — 52週 5250.8



淨部位佔總OI% 生產 -9.6% 互換 +0.4% 管理 +7.2% 其他 -0.1%

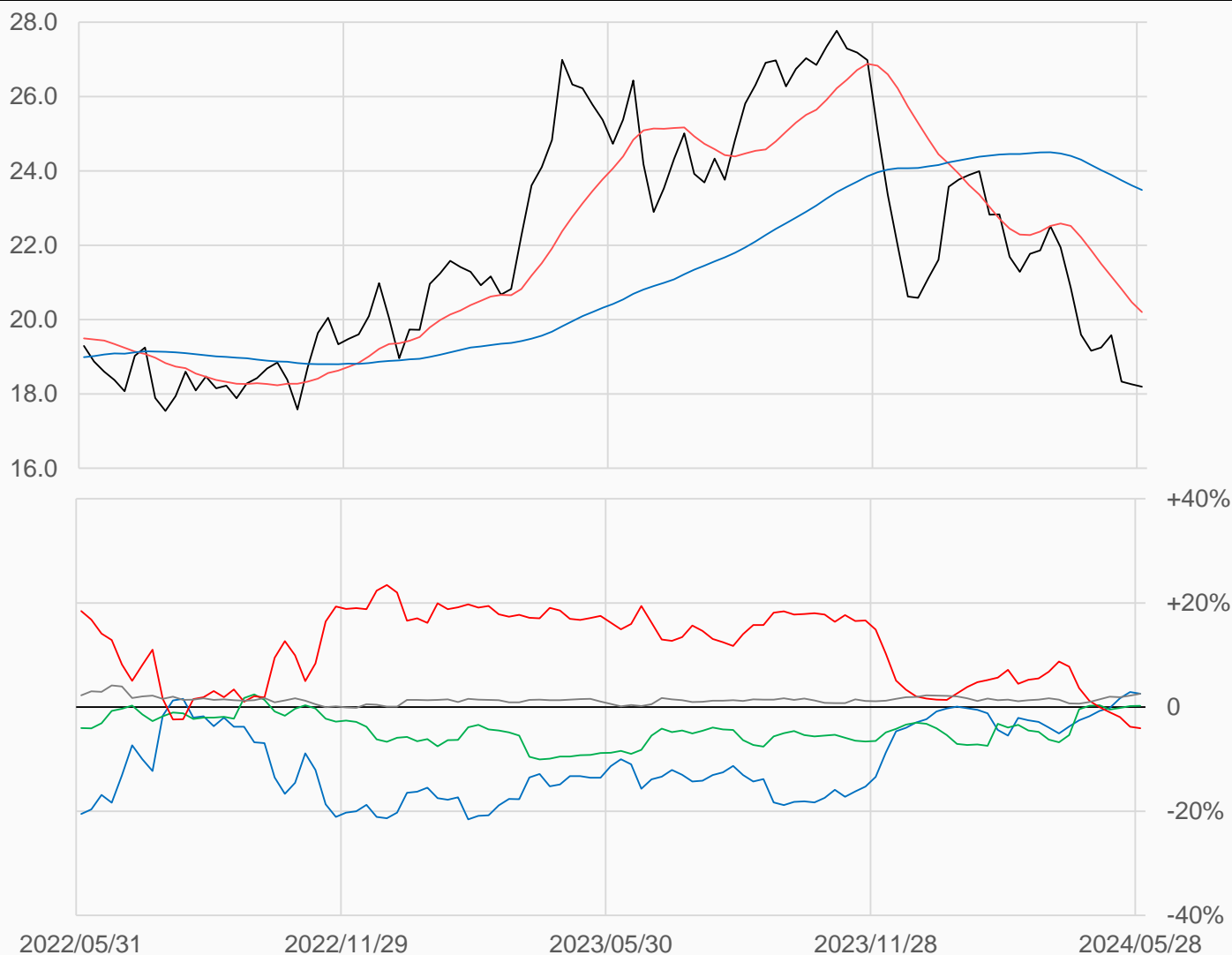
11號糖

11號糖較前一週下跌0.07點收在18.19點，
 管理基金多單增加14634口，空單增加18407口，
 淨空單較前一週增加3773口至42151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
2024/05/28	1016817	1035917	+19100	+1.88%	18.19	↓ -0.07
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	365383	-3933	338841	-1101	+26542	-2832
互換交易	171830	+1923	169509	+1490	+2321	+433
管理基金	252884	+14634	295035	+18407	-42151	-3773
其他	178767	+3298	152128	-915	+26639	+4213

週五收盤價與13週與52週平均線

— SB — 13週 20.198 — 52週 23.485



淨部位佔總OI% 生產 +2.6% 互換 +0.2% 管理 -4.1% 其他 +2.6%

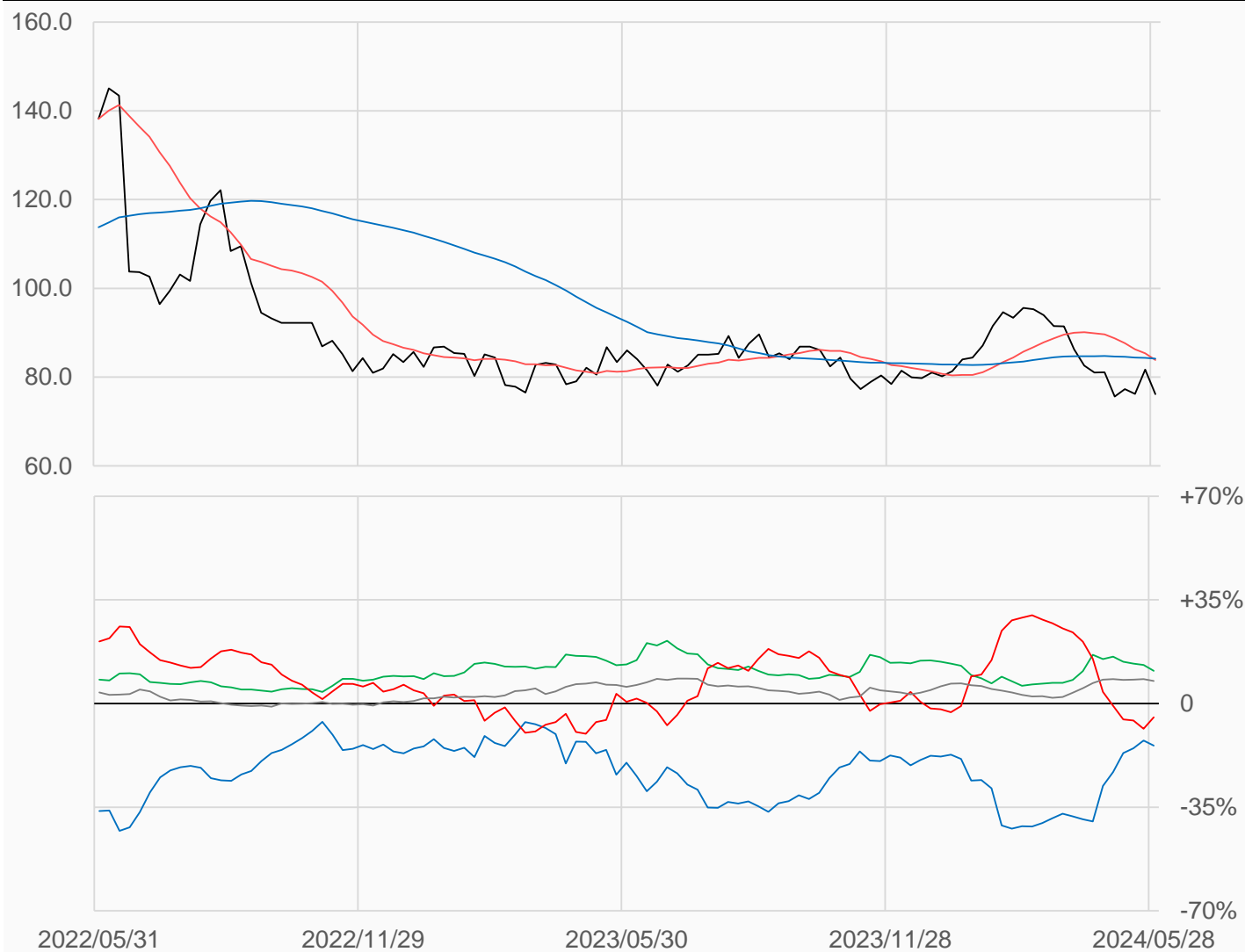
棉花

棉花較前一週下跌5.57點收在76.15點，
管理基金多單增加2455口，空單減少8152口，
淨空單較前一週減少10607口至12765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
2024/05/28	274272	275358	+1086	+0.40%	76.15	↓ -5.57
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	55280	+491	94377	+5399	-39097	-4908
互換交易	62850	-1909	32431	+3368	+30419	-5277
管理基金	65347	+2455	78112	-8152	-12765	+10607
其他	78420	-175	57381	+1405	+21039	-1580

週五收盤價與13週與52週平均線

— CT — 13週 83.858 — 52週 84.15



淨部位佔總OI% 生產 -14.2% 互換 +11.0% 管理 -4.6% 其他 +7.6%