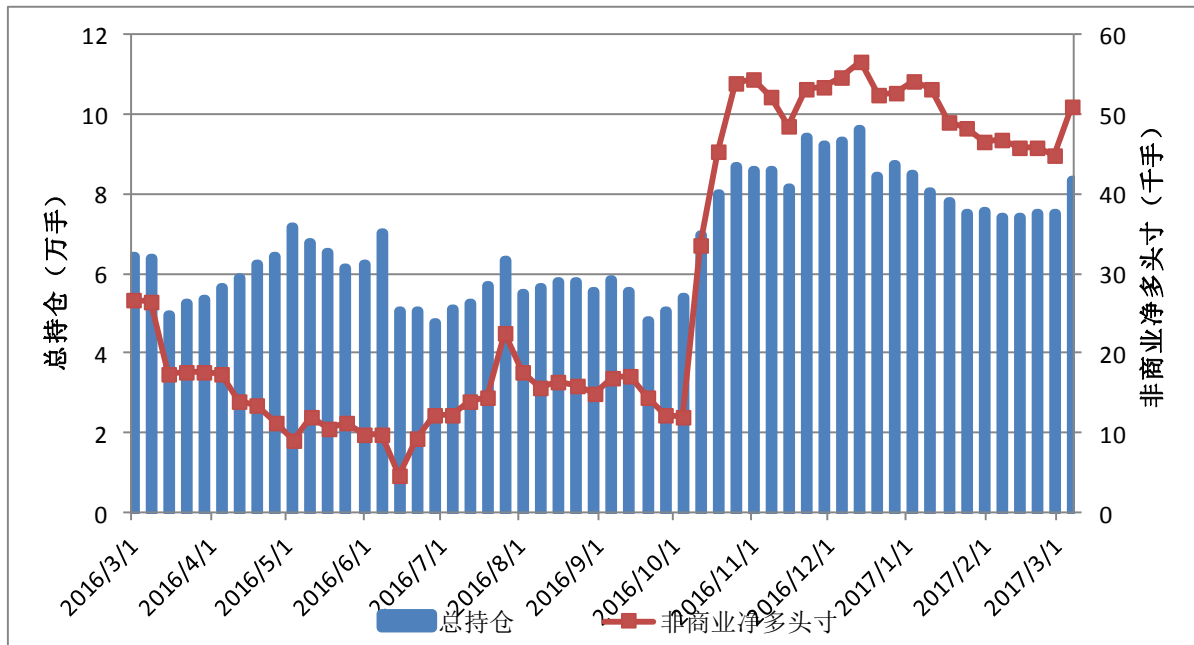


## CFTC 主要期货持仓变动 (170307)

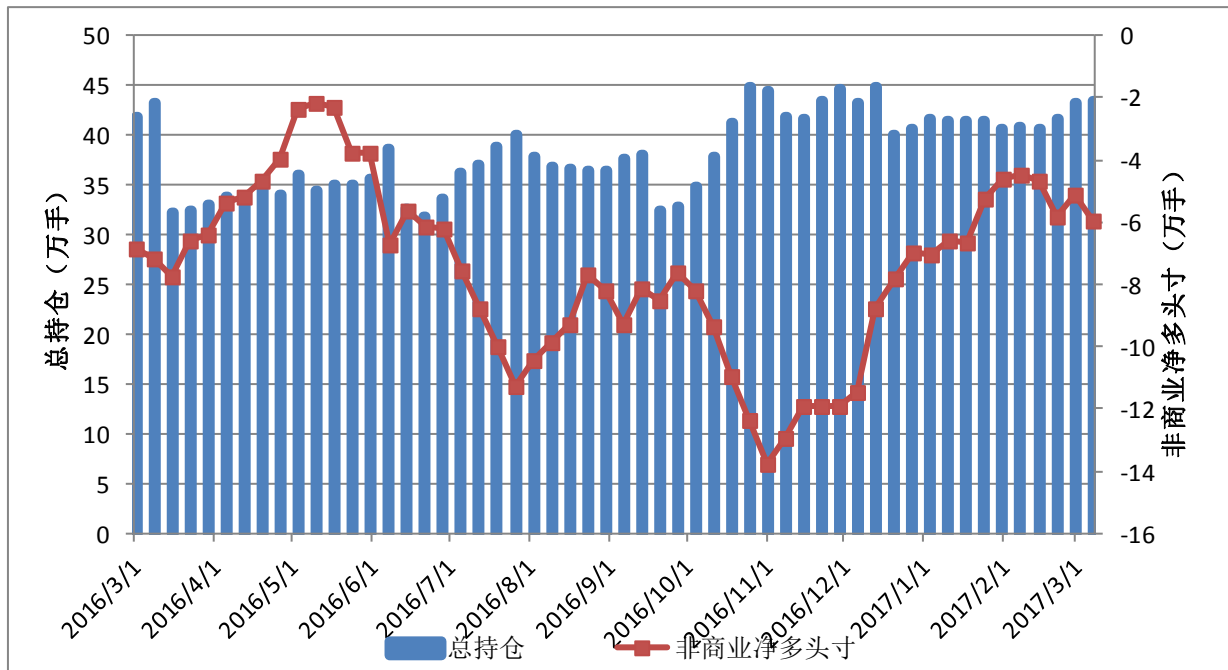
### 一、货币

图 1: ICE 美元指数期货 CFTC 持仓



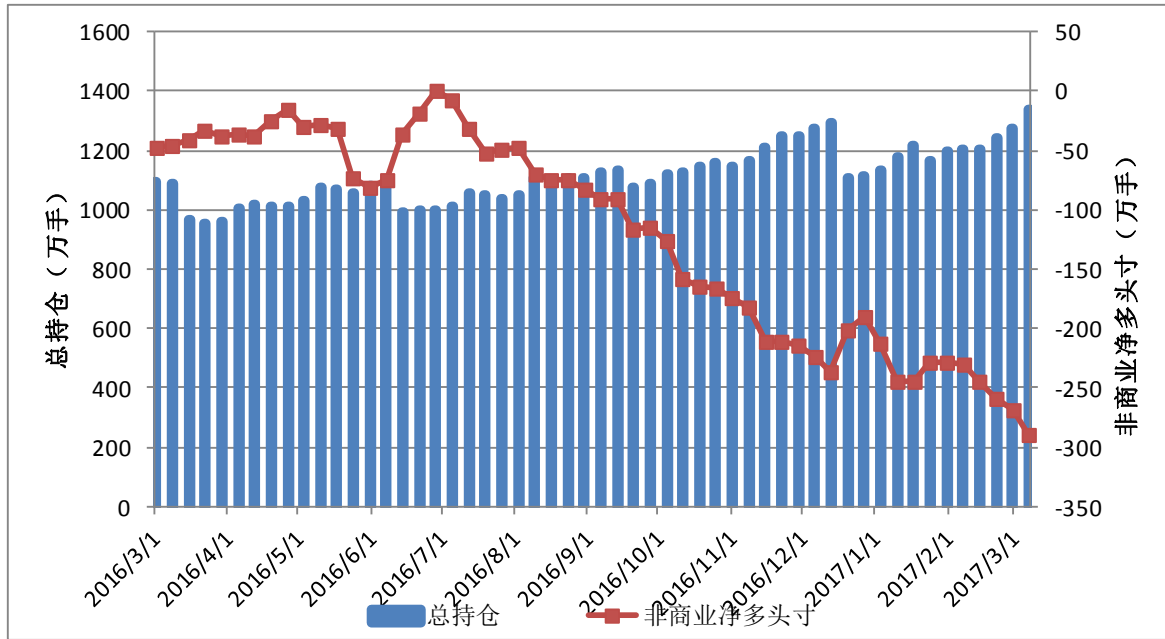
|           | 总持仓   | 非商业多头 | 非商业空头 | 非商业净多头寸 |
|-----------|-------|-------|-------|---------|
| 2017/3/7  | 83511 | 57540 | 6489  | 51051   |
| 2017/2/28 | 74909 | 52631 | 7821  | 44810   |
| 2017/2/21 | 74802 | 52656 | 6842  | 45814   |
| 2017/2/14 | 74210 | 53115 | 7254  | 45861   |
| 2017/2/7  | 73975 | 54335 | 7602  | 46733   |
| 2017/1/31 | 75601 | 54801 | 8229  | 46572   |
| 2017/1/24 | 74838 | 55098 | 6676  | 48422   |

图 2: CME 欧元期货 CFTC 持仓



|           | 总持仓    | 非商业多头  | 非商业空头  | 非商业净多头寸 |
|-----------|--------|--------|--------|---------|
| 2017/3/7  | 435309 | 137662 | 197163 | -59501  |
| 2017/2/28 | 431635 | 143584 | 194748 | -51164  |
| 2017/2/21 | 417129 | 130981 | 189232 | -58251  |
| 2017/2/14 | 406350 | 125333 | 172097 | -46764  |
| 2017/2/7  | 409178 | 126708 | 171659 | -44951  |
| 2017/1/31 | 405541 | 125689 | 171402 | -45713  |
| 2017/1/24 | 414447 | 131904 | 184252 | -52348  |

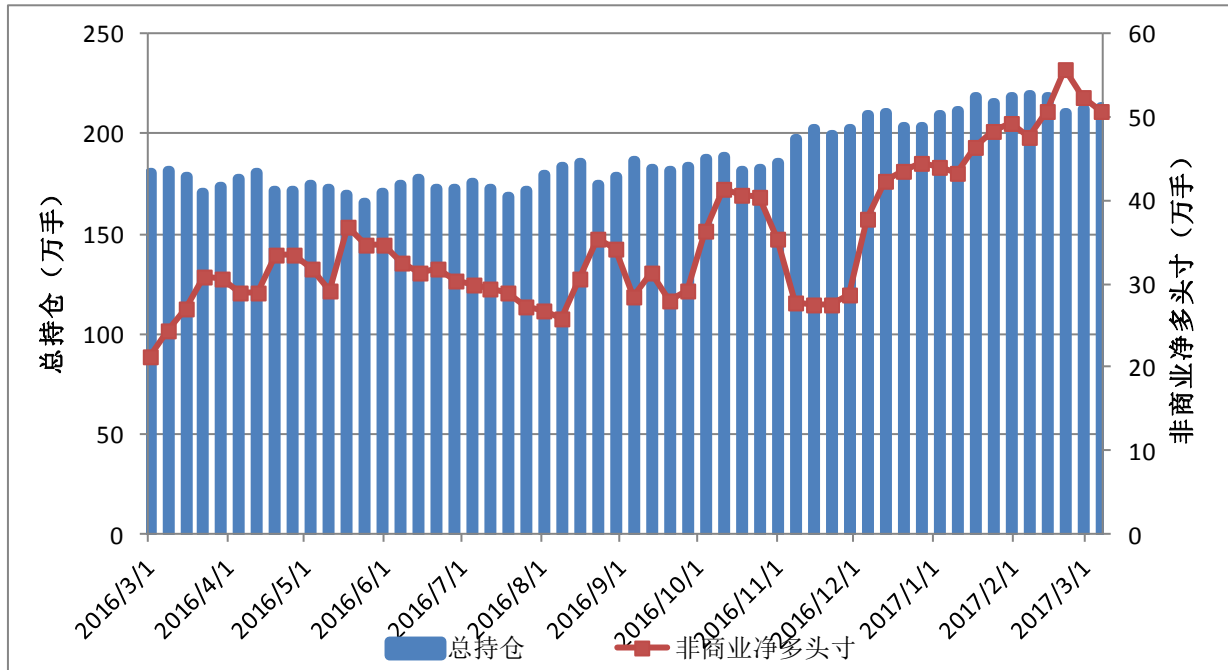
图 3: CME3 个月欧洲美元期货 CFTC 持仓



|           | 总持仓      | 非商业多头  | 非商业空头   | 非商业净多头寸  |
|-----------|----------|--------|---------|----------|
| 2017/3/7  | 13375593 | 413948 | 3304373 | -2890425 |
| 2017/2/28 | 12719279 | 393581 | 3073460 | -2679879 |
| 2017/2/21 | 12440977 | 464527 | 3051633 | -2587106 |
| 2017/2/14 | 12069047 | 469994 | 2907557 | -2437563 |
| 2017/2/7  | 12017000 | 386279 | 2685982 | -2299703 |
| 2017/1/31 | 11976194 | 379592 | 2669797 | -2290205 |
| 2017/1/24 | 11640840 | 308504 | 2596425 | -2287921 |

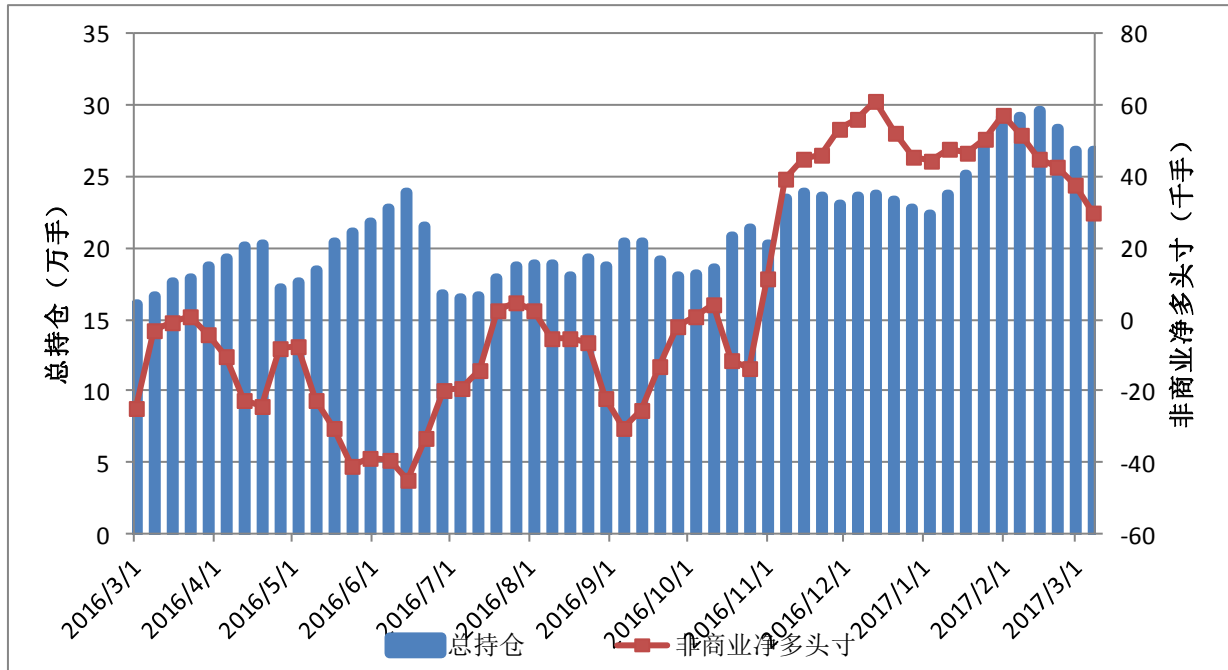
## 二、原油和金属

图 4: NYMEX 原油期货 CFTC 持仓



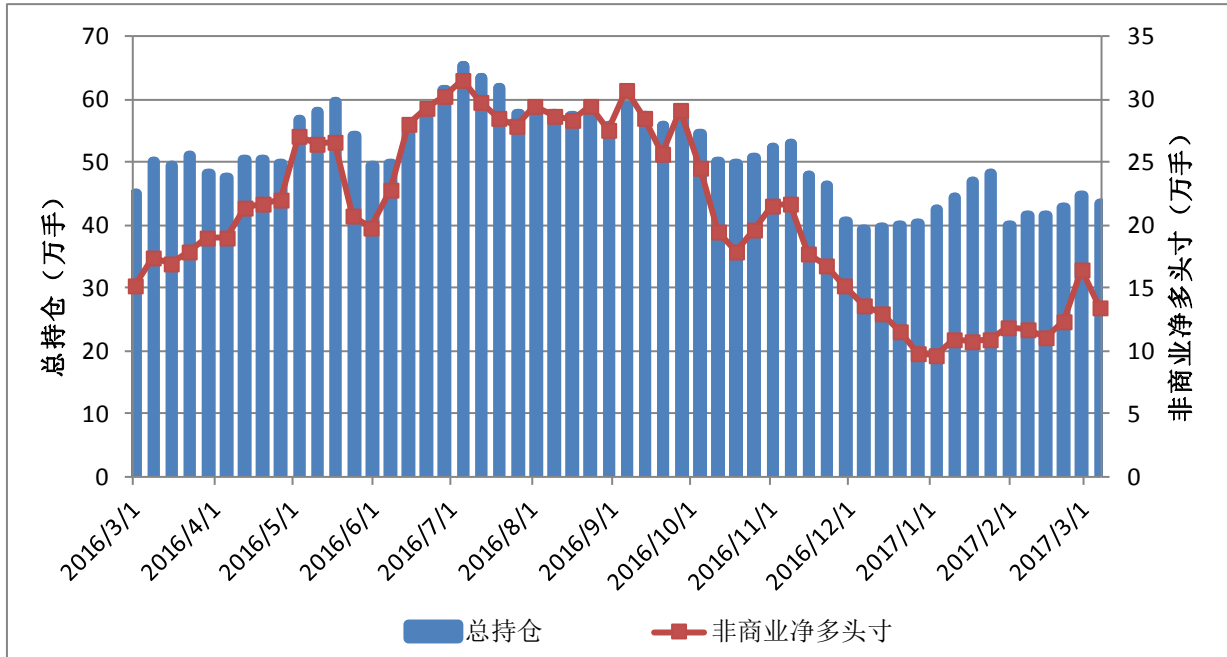
|           | 总持仓     | 非商业多头  | 非商业空头  | 非商业净多头寸 | 商业多头   | 商业空头    |
|-----------|---------|--------|--------|---------|--------|---------|
| 2017/3/7  | 2137532 | 682176 | 173651 | 508525  | 682956 | 1218455 |
| 2017/2/28 | 2120334 | 690281 | 165027 | 525254  | 677820 | 1223836 |
| 2017/2/21 | 2103278 | 712717 | 156110 | 556607  | 659481 | 1231266 |
| 2017/2/14 | 2183943 | 683254 | 174798 | 508456  | 734170 | 1260587 |
| 2017/2/7  | 2191158 | 661929 | 184939 | 476990  | 683625 | 1188108 |
| 2017/1/31 | 2181656 | 656710 | 164018 | 492692  | 677456 | 1186594 |
| 2017/1/24 | 2151809 | 642401 | 159878 | 482523  | 657946 | 1155886 |

图 5: CMX 铜期货 CFTC 持仓



|           | 总持仓    | 非商业多头  | 非商业空头 | 非商业净多头寸 | 商业多头  | 商业空头   |
|-----------|--------|--------|-------|---------|-------|--------|
| 2017/3/7  | 267379 | 117779 | 88060 | 29719   | 87052 | 123421 |
| 2017/2/28 | 267935 | 120913 | 82915 | 37998   | 90031 | 132757 |
| 2017/2/21 | 283805 | 128204 | 85410 | 42794   | 93995 | 141913 |
| 2017/2/14 | 296125 | 131446 | 86203 | 45243   | 92457 | 140974 |
| 2017/2/7  | 291924 | 131026 | 79467 | 51559   | 93332 | 147984 |
| 2017/1/31 | 291702 | 134989 | 77713 | 57276   | 89428 | 147207 |
| 2017/1/24 | 270892 | 128015 | 77705 | 50310   | 82224 | 133948 |

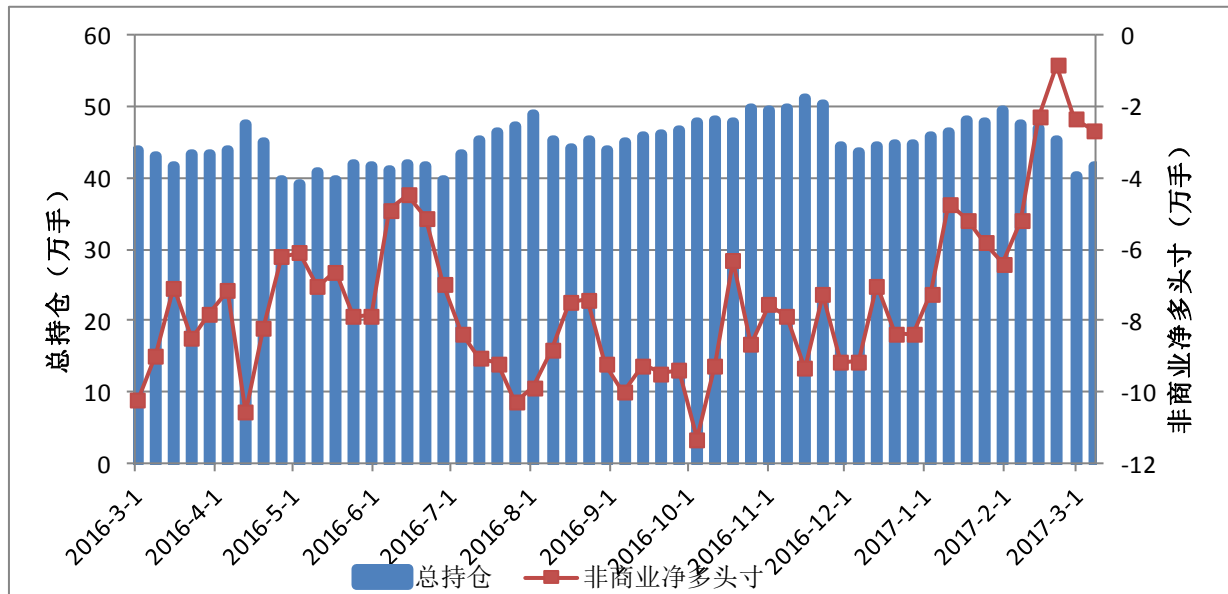
图 6: CMX 黄金期货 CFTC 持仓



|           | 总持仓    | 非商业多头  | 非商业空头  | 非商业净多头寸 | 商业多头   | 商业空头   |
|-----------|--------|--------|--------|---------|--------|--------|
| 2017/3/7  | 434401 | 229969 | 96284  | 133685  | 99484  | 252132 |
| 2017/2/28 | 446081 | 247494 | 83696  | 163798  | 100180 | 280087 |
| 2017/2/21 | 427168 | 219673 | 95910  | 123763  | 103861 | 243425 |
| 2017/2/14 | 415128 | 212259 | 102507 | 109752  | 105674 | 233462 |
| 2017/2/7  | 415543 | 216408 | 99259  | 117149  | 106024 | 240170 |
| 2017/1/31 | 398433 | 212414 | 93259  | 119155  | 101784 | 233587 |
| 2017/1/24 | 482374 | 209854 | 100447 | 109407  | 109000 | 235374 |

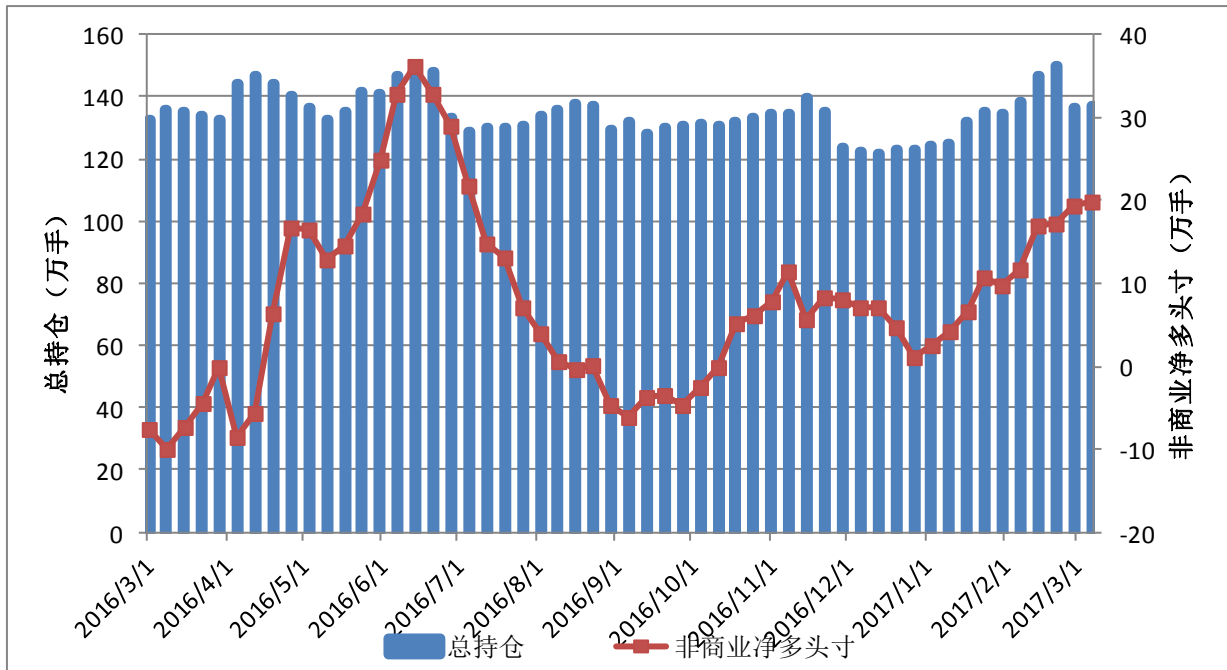
### 三、农产品

图 7: CBOT 小麦期货 CFTC 持仓



|           | 总持仓    | 非商业多头  | 非商业空头  | 非商业净多头寸 | 商业多头   | 商业空头   |
|-----------|--------|--------|--------|---------|--------|--------|
| 2017/3/7  | 415912 | 158764 | 185246 | -26482  | 157325 | 131509 |
| 2017/2/28 | 400986 | 157368 | 180884 | -23516  | 144650 | 124320 |
| 2017/2/21 | 452102 | 167062 | 175389 | -8327   | 165306 | 159015 |
| 2017/2/14 | 468083 | 159687 | 182730 | -23043  | 178291 | 156738 |
| 2017/2/7  | 476111 | 150093 | 201992 | -51899  | 187513 | 139906 |
| 2017/1/31 | 494355 | 148242 | 212316 | -64074  | 199926 | 139426 |
| 2017/1/24 | 477653 | 152656 | 210914 | -58258  | 186470 | 131524 |

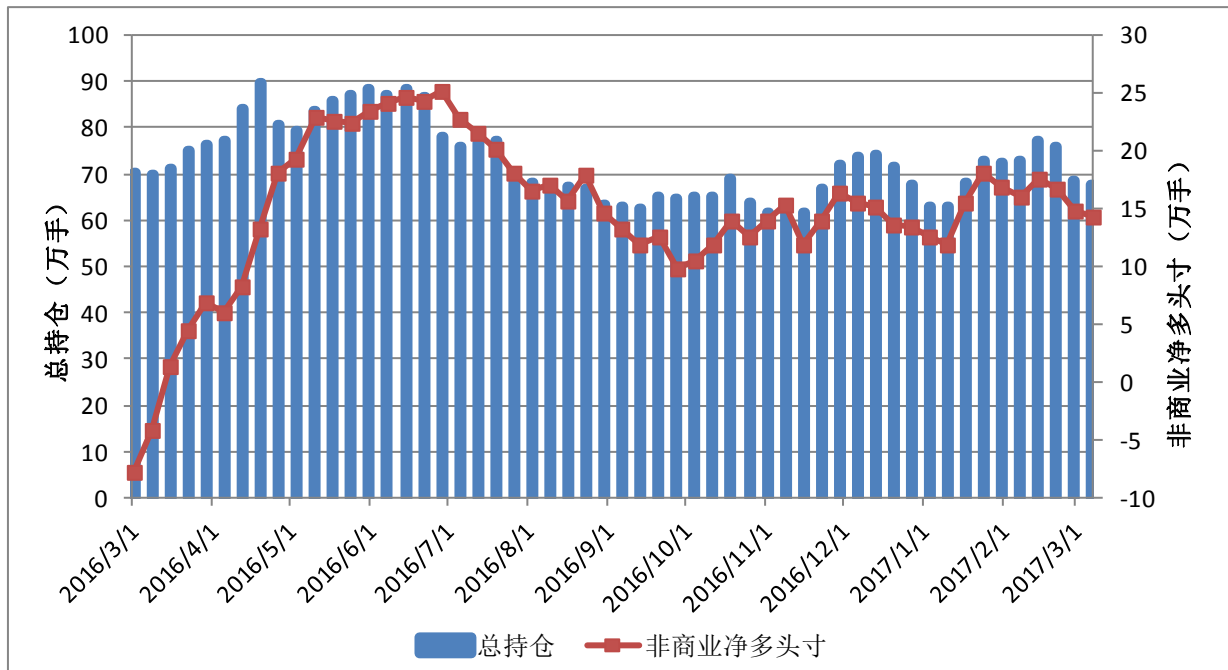
图 8: CBOT 玉米期货 CFTC 持仓



|           | 总持仓     | 非商业多头  | 非商业空头  | 非商业净多头寸 | 商业多头   | 商业空头   |
|-----------|---------|--------|--------|---------|--------|--------|
| 2017/3/7  | 1373407 | 447243 | 248353 | 198890  | 588360 | 740994 |
| 2017/2/28 | 1361513 | 436548 | 242101 | 194447  | 585523 | 738205 |
| 2017/2/21 | 1501027 | 455721 | 282783 | 172938  | 670356 | 784290 |
| 2017/2/14 | 1468620 | 460563 | 290147 | 170416  | 646025 | 754668 |
| 2017/2/7  | 1383789 | 413109 | 295927 | 117182  | 619392 | 683393 |
| 2017/1/31 | 1346772 | 390309 | 293286 | 97023   | 620972 | 670061 |
| 2017/1/24 | 1351289 | 415481 | 308744 | 106737  | 600569 | 656582 |

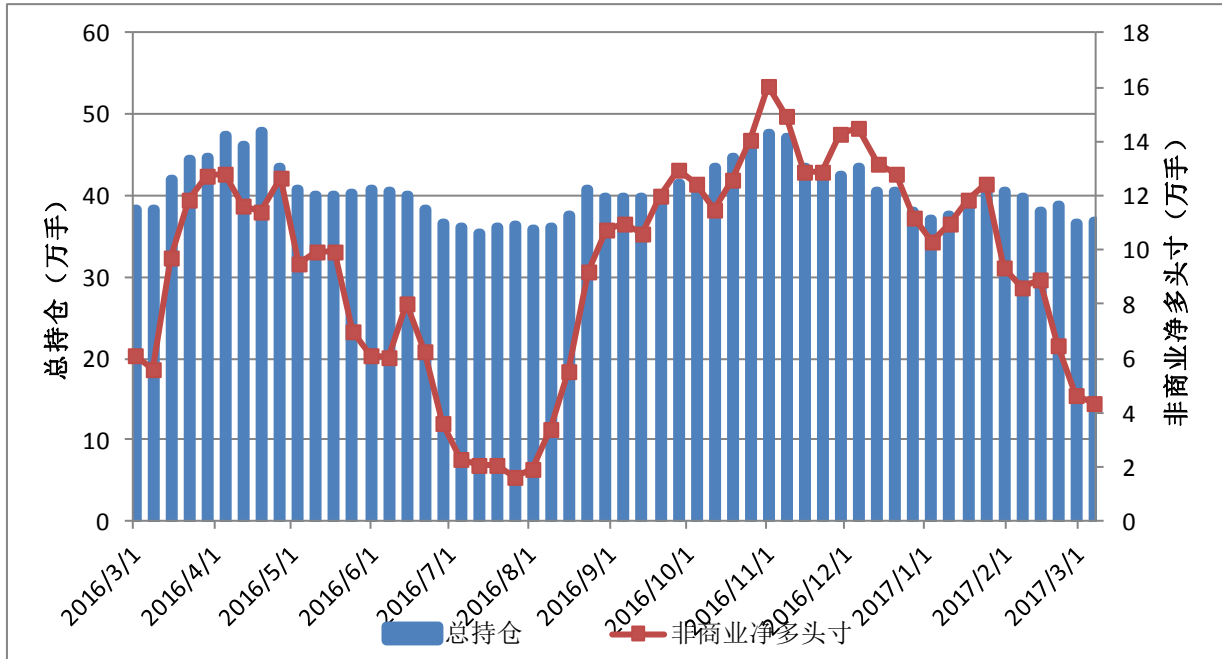


图 9: CBOT 大豆期货 CFTC 持仓



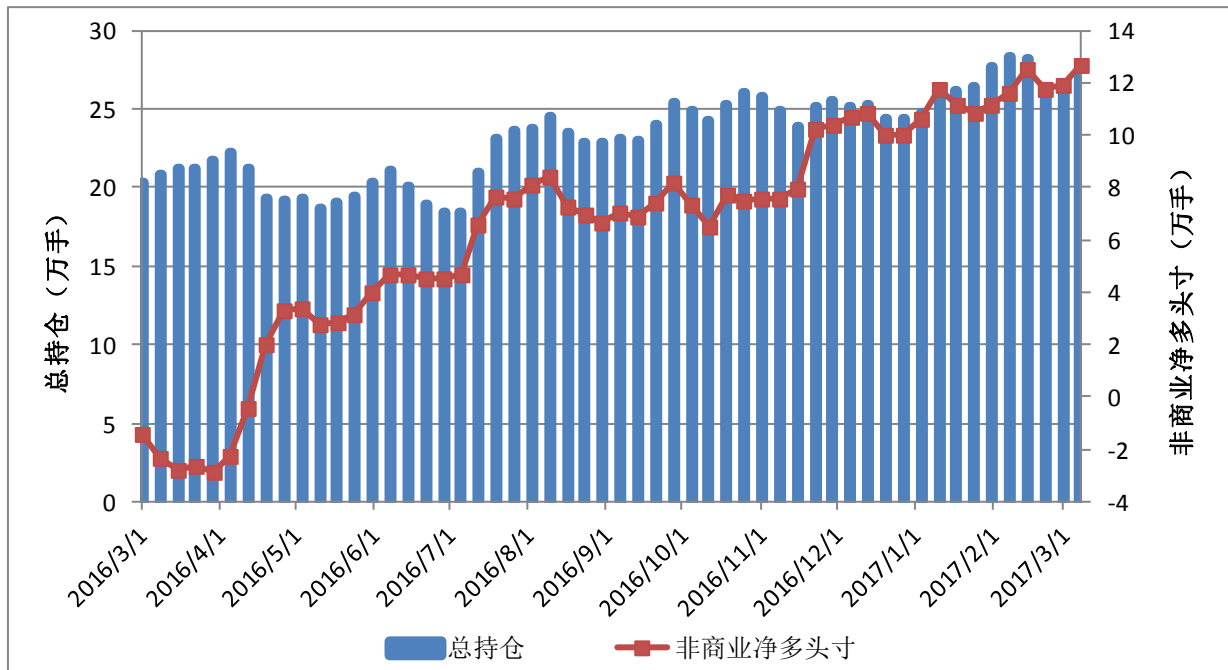
|           | 总持仓    | 非商业多头  | 非商业空头 | 非商业净多头寸 | 商业多头   | 商业空头   |
|-----------|--------|--------|-------|---------|--------|--------|
| 2017/3/7  | 676564 | 228137 | 84758 | 143379  | 314327 | 387509 |
| 2017/2/28 | 684523 | 231070 | 82878 | 148192  | 311577 | 392442 |
| 2017/2/21 | 756976 | 251562 | 84793 | 166769  | 343645 | 441965 |
| 2017/2/14 | 772254 | 261521 | 85200 | 176321  | 339978 | 449139 |
| 2017/2/7  | 729898 | 245413 | 84880 | 160533  | 337402 | 430353 |
| 2017/1/31 | 722216 | 252060 | 83611 | 168449  | 331882 | 431429 |
| 2017/1/24 | 728991 | 275598 | 94587 | 181011  | 323578 | 438594 |

图 10: CBOT 豆油期货 CFTC 持仓



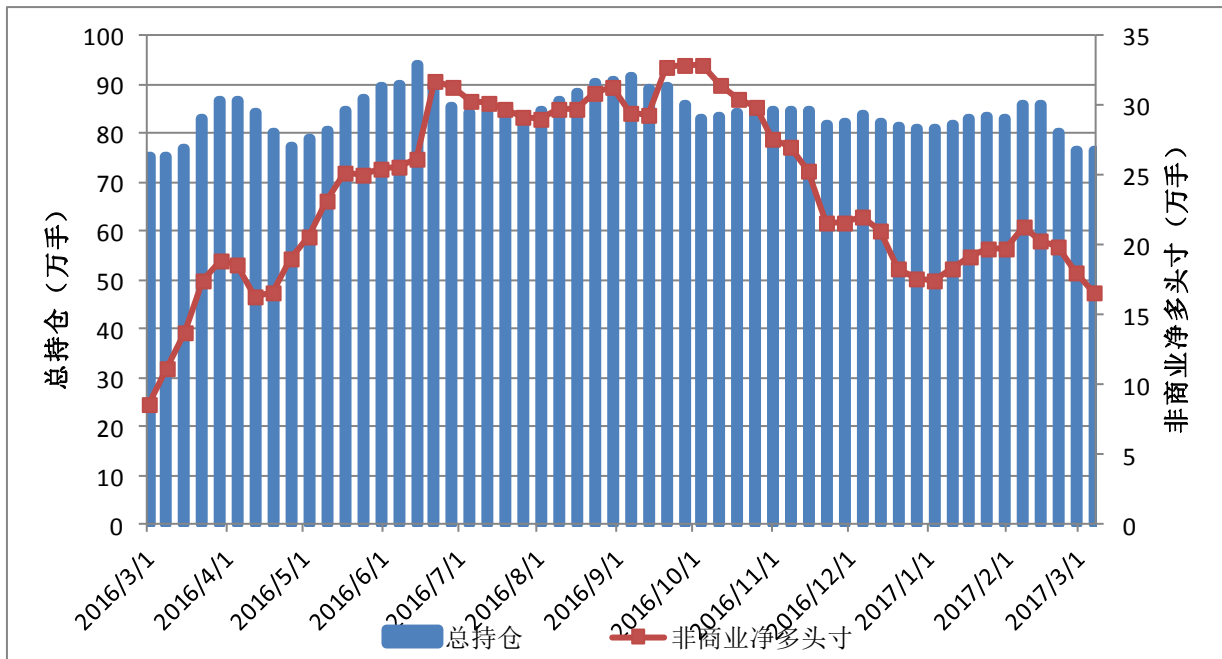
|           | 总持仓    | 非商业多头  | 非商业空头 | 非商业净多头寸 | 商业多头   | 商业空头   |
|-----------|--------|--------|-------|---------|--------|--------|
| 2017/3/7  | 367689 | 100171 | 56703 | 43468   | 169837 | 220229 |
| 2017/2/28 | 366440 | 98848  | 52364 | 46484   | 173352 | 224402 |
| 2017/2/21 | 387867 | 108582 | 43956 | 64626   | 171771 | 242396 |
| 2017/2/14 | 379239 | 113767 | 24810 | 88957   | 158603 | 252028 |
| 2017/2/7  | 397899 | 114073 | 28049 | 86024   | 161135 | 253785 |
| 2017/1/31 | 405339 | 130899 | 37242 | 93657   | 157133 | 258670 |
| 2017/1/24 | 408582 | 149402 | 24860 | 124542  | 144915 | 285460 |

图 11: ICE 棉花期货 CFTC 持仓



|           | 总持仓    | 非商业多头  | 非商业空头 | 非商业净多头寸 | 商业多头  | 商业空头   |
|-----------|--------|--------|-------|---------|-------|--------|
| 2017/3/7  | 273357 | 143307 | 16640 | 126667  | 85011 | 220064 |
| 2017/2/28 | 266379 | 137727 | 18788 | 118939  | 83751 | 211456 |
| 2017/2/21 | 261594 | 135847 | 18413 | 117434  | 83139 | 208056 |
| 2017/2/14 | 282058 | 144606 | 19394 | 125212  | 89911 | 225379 |
| 2017/2/7  | 283531 | 142052 | 25565 | 116487  | 91994 | 220071 |
| 2017/1/31 | 276602 | 137516 | 26085 | 111431  | 88212 | 210119 |
| 2017/1/24 | 264328 | 132523 | 24328 | 108195  | 84249 | 203684 |

图 12: ICE 白糖期货 CFTC 持仓



|           | 总持仓    | 非商业多头  | 非商业空头 | 非商业净多头寸 | 商业多头   | 商业空头   |
|-----------|--------|--------|-------|---------|--------|--------|
| 2017/3/7  | 765590 | 219523 | 53047 | 166476  | 363780 | 537485 |
| 2017/2/28 | 765789 | 223047 | 43280 | 179767  | 361295 | 558439 |
| 2017/2/21 | 802571 | 226927 | 27796 | 199131  | 368956 | 608425 |
| 2017/2/14 | 858862 | 239871 | 36795 | 203076  | 415667 | 656375 |
| 2017/2/7  | 859366 | 245518 | 31699 | 213819  | 396246 | 659151 |
| 2017/1/31 | 831344 | 233451 | 36030 | 197421  | 391892 | 628729 |
| 2017/1/24 | 834634 | 231324 | 34232 | 197092  | 402020 | 636794 |

报告日期: 2017年3月13日

### 免责声明

本报告的信息均来源于公开资料, 我公司对这些信息的准确性和完整性不作任何保证, 也不保证所包含的信息和建议不会发生任何变更。我们已力求报告内容的客观、公正, 但文中的观点、结论和建议仅供参考, 报告中的信息或意见并不构成所述品种的操作依据, 投资者据此做出的任何投资决策与本公司和作者无关。

# 新湖期货总部及分支机构

## 新湖期货研究所

上海总部：上海市裕通路100号洲际商务中心36层

杭州：杭州市江干区剧院路358号宏程国际12楼1202

大连：大连市沙河口区会展路129号大连国际金融中心A座期货大厦2702

### 公司总部

地址：上海市裕通路100号洲际中心36楼新湖期货有限公司  
邮编：200070  
电话：400-8888-398  
传真：021-22155559

### 上海营业部

地址：上海浦东新区世纪大道1589号长泰国际金融大厦1801-04单元  
邮编：200122  
电话：021-61657295  
传真：021-61657211

### 北京营业部

地址：北京市东城区东直门南大街甲3号居然大厦501室  
邮编：100007  
电话：010-64006876  
传真：010-64006010

### 沈阳营业部

地址：沈阳市沈河区惠工街10号卓越大厦1507室  
邮编：110013  
电话：024-31060016  
传真：024-31060013

### 大连营业部

地址：大连市沙河口区会展路129号期货大厦2701房间  
邮编：116023  
电话：0411-84807691  
传真：0411-84807519

### 郑州营业部

地址：郑州未来大道69号未来大厦1410室  
邮编：450008  
电话：0371-65613558  
传真：0371-65612810

### 太原营业部

地址：太原市小店区长风街705号和信商座32层  
3221-3223  
邮编：030006  
电话：0351-2239777  
传真：0351-2239771

### 西安营业部

地址：西安高新区高新一路2号国家开发银行大厦1105室  
邮编：710075  
电话：029-88377355  
传真：029-88377322

### 济南营业部

地址：济南市历下区历山路157号天鹅大厦601  
邮编：250013  
电话：0531-80973106  
传真：0531-80973196

### 青岛营业部

地址：青岛市东海西路39号世纪大厦1809室  
邮编：266071  
电话：0532-85796000  
传真：0532-85790098

### 成都营业部

地址：成都市青羊区锦里东路2号宏达大厦23楼B2  
邮编：610015  
电话：028-61332568  
传真：028-66154680

### 重庆营业部

地址：重庆市江北区建新东路36号平安国际大厦10-1  
邮编：400003  
电话：023-88518666  
传真：023-88518951

### 长沙营业部

地址：长沙市天心区芙蓉中路二段新世纪大厦1701-1704  
邮编：410015  
电话：0731-82772266  
传真：0731-82776031

### 武汉营业部

地址：武汉市武昌区友谊大道2号2008新长江广场3层1室303号  
邮编：430061  
电话：027-88310966  
传真：027-88329066

### 杭州营业部

地址：杭州市江干区剧院路358号宏程国际大厦1202室  
邮编：310020  
电话：0571-87782180  
传真：0571-87782193

### 温州营业部

地址：温州市车站大道金鳞花苑2幢1101室  
邮编：325000  
电话：0577-88991588  
传真：0577-88988180

### 台州营业部

地址：台州市椒江区市府大道557号万家灯火都市广场6楼  
邮编：318000  
电话：0576-88053555  
传真：0576-89892901

### 嘉兴营业部

地址：嘉兴市中环广场东区A座1203室  
邮编：314000  
电话：0573-82090662  
传真：0573-82052419

### 宁波营业部

地址：宁波市江北区江安路钻石商业广场18号1106-1107室  
邮编：315000  
电话：0574-83068858  
传真：0574-87633939

### 福州营业部

地址：福州市鼓楼区水部街道五一北路129号榕城商贸中心十一层02号  
邮编：350001  
电话：0591-87878217  
传真：0591-83337962

### 厦门营业部

地址：厦门市思明区厦禾路1032号中国外运大厦A座802  
邮编：361000  
电话：0592-5835135  
传真：0592-5835135

### 深圳营业部

地址：深圳市福田区金田路4028号荣超经贸中心2406室  
邮编：518035  
电话：0755-23811813  
传真：0755-23811800

### 海口营业部

地址：海口市国贸大道2号海南时代广场15层  
邮编：570106  
电话：0898-36627000  
传真：0898-36627135