



量化日报之微观数据

分析师：马海燕

从业资格证号：F03099962

投资咨询证号：Z0017813

道通期货研究所

2025年8月22日

一、跟踪品种要点

从波动情况看，今日涨幅前三，烧碱涨1.81%，玻璃涨1.61%，纯碱涨1.54%，下跌前三：碳酸锂跌-4.38%，红枣跌-1.95%，尿素跌-1.25%；今日34/62品种上涨，商品涨跌各半，建材系小幅反弹，工业品小幅下跌，贵金属、有色、软商品、化工、农产品震荡。从近一周涨跌幅来看，多晶硅、烧碱、红枣、油脂、焦煤多头持续性尚可，原油化工、鸡蛋、双硅空头持续性较好，各品种走势分化。

从资金角度情况看，黄金、铜沉淀资金最大，今日资金流入金额前三：黄金、烧碱、镍，流出品种中：碳酸锂、豆粕、玻璃流出较多资金；从资金流入比例看，流入排前的有：烧碱、生猪、镍，流出排前的为：碳酸锂、燃油、合成橡胶。今日仓单变化较大的有：螺纹（+21323）、不锈钢（-16715）。

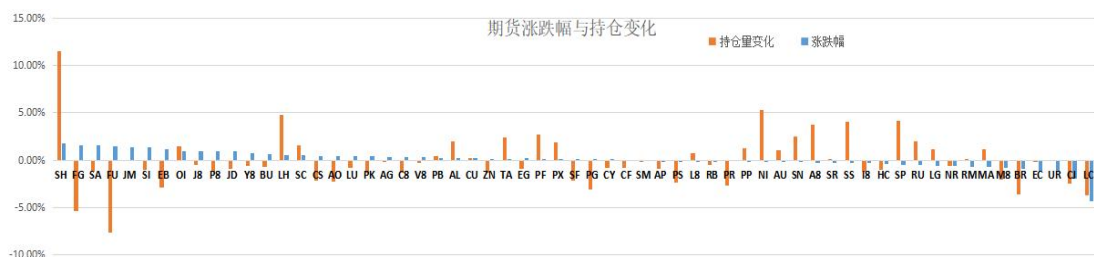
从持仓看，持仓量增加前三：PTA、鸡蛋、PX；在前20名会员持仓中，净多持仓增加明显的有：工业硅、欧线、黄金，净空持仓增加明显的有：塑料、铅、菜粕。其中欧线、玉米淀粉、20号胶、工业硅、铝多头增仓，鸡蛋、棕榈油、纸浆、苯乙烯、PX、PVC、镍、氧化铝空头增仓。

综合来看，近日可重点关注品种：焦煤、碳酸锂、棕榈油、鸡蛋、烧碱、PX

二、市场数据

	涨跌幅(收盘)	日振幅	5日涨跌幅	成交量	持仓量	持仓变化	沉淀资金(亿)	资金流向(亿)	资金流向比例	注册仓单数量	注册仓单增减	仓单持仓比
AU	-0.20	0.55	-0.66	184521	409002	1.04%	887.9618	7.38	0.83%	37455	813	9.16%
AG	0.34	0.81	-0.98	503121	730173	-0.07%	282.5260	0.73	0.26%	1109123	-5932	151.90%
CU	0.17	0.36	-0.36	88528	461629	0.22%	336.2541	0.73	0.22%	24148	-1009	5.23%
V8	0.28	0.72	-1.41	773188	1347391	-0.25%	47.3678	0.01	0.03%	82280	183	6.11%
AL	0.19	0.69	-0.31	233325	575286	1.97%	109.3389	2.18	2.00%	57144	-2746	9.93%
AO	0.45	1.38	-2.82	313438	362658	-2.27%	49.9541	-0.94	-1.87%	77746	1793	21.44%
ZN	0.13	0.34	-0.97	131393	211313	-1.36%	43.3101	-0.59	-1.37%	32791	503	15.52%
NI	-0.19	0.65	-1.38	162313	219114	5.33%	62.9639	3.07	4.88%	22552	-36	10.29%
SN	-0.21	0.87	-0.54	62023	48043	2.49%	30.6869	0.68	2.22%	7053	-205	14.68%
PB	0.21	0.34	0.02	43882	95595	0.39%	15.1288	0.04	0.23%	58946	-476	61.66%
LC	-4.38	5.65	-7.43	1231366	789520	-3.74%	124.0938	-51.17	-41.23%	24990	670	3.17%
SI	0.32	0.45	0.76	740090	523742	-1.01%	46.3000	0.14	0.30%	51049	-117	9.75%
RB	-0.10	0.60	-2.05	1282397	2991455	-0.55%	132.2556	-0.87	-0.65%	158633	21323	5.30%
PS	-0.05	2.54	1.83	546424	327469	-2.39%	113.8607	-2.85	-2.50%	6540	80	2.00%
I8	-0.35	1.11	-0.84	327648	829314	-1.24%	140.8121	-2.27	-1.61%	2000	0	0.24%
J8	0.96	1.46	-1.02	24405	47729	-0.46%	32.0162	0.16	0.49%	820	0	1.72%
JM	0.38	3.10	-3.32	1618224	898269	-0.12%	149.5792	1.86	1.24%	0	0	0.00%
HC	-0.36	0.68	-2.10	862634	2249217	-1.05%	105.8466	-1.49	-1.41%	33115	-1777	1.47%
SF	0.05	0.95	-4.42	235553	443285	-2.17%	20.1263	-0.49	-2.42%	20474	272	4.62%
SM	-0.03	0.93	-4.78	313093	589349	-0.07%	31.2043	-0.10	-0.31%	70094	-1726	11.89%
SS	-0.34	0.80	-1.99	147626	245395	4.05%	22.8370	0.73	3.18%	101925	-16715	41.54%
SA	0.54	2.00	-4.57	1765241	2016730	-1.20%	96.4675	0.26	0.27%	9064	-9	0.45%
PG	0.61	1.79	-1.98	1513447	1650125	-5.43%	75.0325	-3.08	-4.10%	1643	-545	0.10%
SH	0.81	2.62	5.39	881275	307634	11.51%	41.1789	4.75	11.53%	150	-10	0.05%
SC	0.53	1.41	1.74	125990	73408	1.57%	79.3427	1.65	2.07%	4767000	0	6493.84%
FU	0.43	2.56	1.65	1264010	509795	-7.70%	31.4680	-2.76	-8.78%	73710	0	14.46%
LU	0.43	2.19	1.48	186880	134596	-0.84%	10.3382	-0.04	-0.41%	11110	0	8.25%
PG	0.02	1.27	3.49	97738	188767	-3.13%	23.9391	-0.99	-4.12%	12887	-396	6.83%
TA	0.12	0.84	4.49	1258073	1483408	2.42%	53.1487	0.99	1.86%	30940	-2162	2.09%

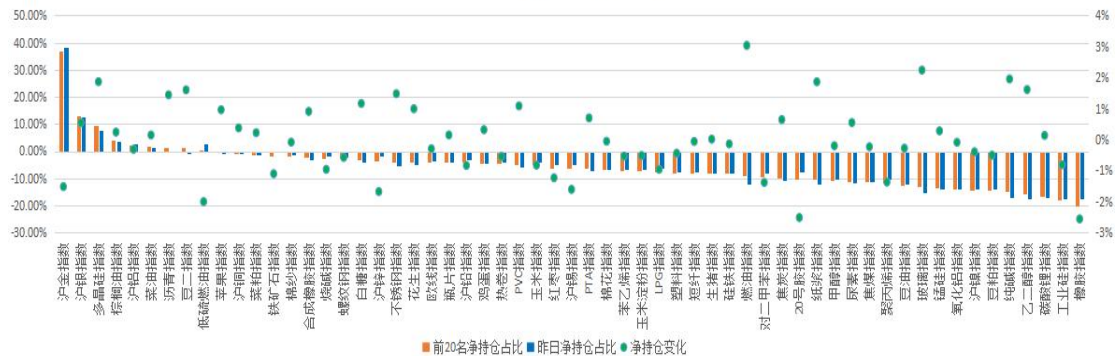
PP	-0.16	0.50	0.66	213136	621582	1.23%	30.5969	0.32	1.06%	14055	115	2.26%
PX	0.06	1.27	1.85	380677	280188	1.90%	16.1021	0.22	1.37%	0	0	0.00%
EE	1.18	1.59	1.65	548337	460935	-2.89%	24.9217	-0.85	-3.33%	688	0	0.15%
PF	0.06	0.85	1.18	271707	282886	2.73%	13.1518	0.34	2.36%	5753	0	2.03%
EG	0.07	0.94	1.62	196684	338312	-0.88%	23.0030	-0.41	-1.80%	2092	0	0.62%
L8	-0.08	0.45	0.67	278341	518247	0.76%	26.7417	0.18	0.68%	7684	0	1.48%
MA	-0.75	0.92	0.79	479850	1041341	1.15%	40.4917	0.06	0.15%	10666	-100	1.02%
BU	0.61	1.34	0.23	210728	421116	-0.68%	32.0304	-0.03	-0.08%	72650	0	17.25%
UR	-1.25	1.59	1.81	231734	310022	-0.01%	17.5309	-0.26	-1.46%	4073	500	1.31%
RU	-0.52	1.55	0.42	316541	173828	1.99%	53.7090	0.77	1.44%	178470	-40	102.67%
NR	0.63	1.76	0.18	82908	100188	-0.63%	25.1082	-0.32	-1.29%	44857	0	44.77%
ER	0.88	1.94	0.13	122447	60282	-3.66%	7.7399	-0.37	-4.72%	12190	0	20.22%
CF	-0.01	0.60	0.73	214219	727579	-0.86%	74.7786	-1.03	-1.38%	7198	-137	0.99%
CY	0.00	0.66	0.93	5599	22925	-0.86%	2.3594	-0.03	-1.11%	64	-5	0.28%
SR	-0.33	0.39	0.02	169662	469705	0.04%	37.8918	-0.26	-0.69%	15555	-196	3.31%
SP	-0.48	0.92	3.39	270558	304933	4.17%	25.6474	0.87	3.40%	251633	-405	82.52%
A8	-0.27	0.67	1.46	152211	344672	3.71%	19.4382	0.60	3.10%	12197	0	3.54%
M8	-0.79	1.09	1.92	1921487	4305986	-2.08%	184.9834	-6.19	-3.35%	10925	0	0.25%
RM	-0.67	1.45	2.95	369648	647871	0.11%	30.8626	-0.25	-0.82%	8253	-333	1.27%
Y8	0.70	1.21	0.86	474096	965874	-0.56%	117.2560	-0.59	-0.50%	15760	450	1.63%
OI	1.00	1.23	0.57	359297	403474	1.52%	71.9680	1.67	2.33%	3487	0	0.86%
P8	0.95	1.48	2.44	844118	654473	-1.28%	102.1890	-0.95	-0.93%	0	-790	0.00%
C8	0.32	1.20	1.84	961680	1709241	-1.30%	54.0846	-1.09	-2.01%	103290	-2561	6.04%
CS	0.48	1.68	2.93	235254	296937	-2.13%	9.7094	-0.32	-3.29%	7450	0	2.51%
PK	0.41	0.56	1.07	114917	262755	-1.36%	16.5363	-0.16	-0.97%	0	0	0.00%
CJ	-1.95	2.72	1.53	218892	199473	-2.44%	20.5550	-0.96	-4.69%	9891	65	4.96%
AP	-0.05	0.76	-0.27	34639	100632	-0.91%	16.2414	-0.16	-0.99%	0	0	0.00%
JD	0.94	1.52	4.75	843404	894306	-0.91%	39.9958	-0.15	-0.36%	0	0	0.00%
LH	0.54	0.98	0.43	36781	73260	4.84%	25.9563	1.33	5.13%	430	0	0.59%
EC	-1.21	3.32	3.71	25350	54255	-0.07%	14.2040	-0.18	-1.29%	0	0	0.00%
PR	-0.13	0.50	2.87	110815	61943	-2.65%	7.9825	-0.27	-3.36%	2017	0	3.26%
LG	-0.60	1.05	0.98	13763	28474	1.12%	3.6711	-0.01	-0.38%	858	0	3.01%

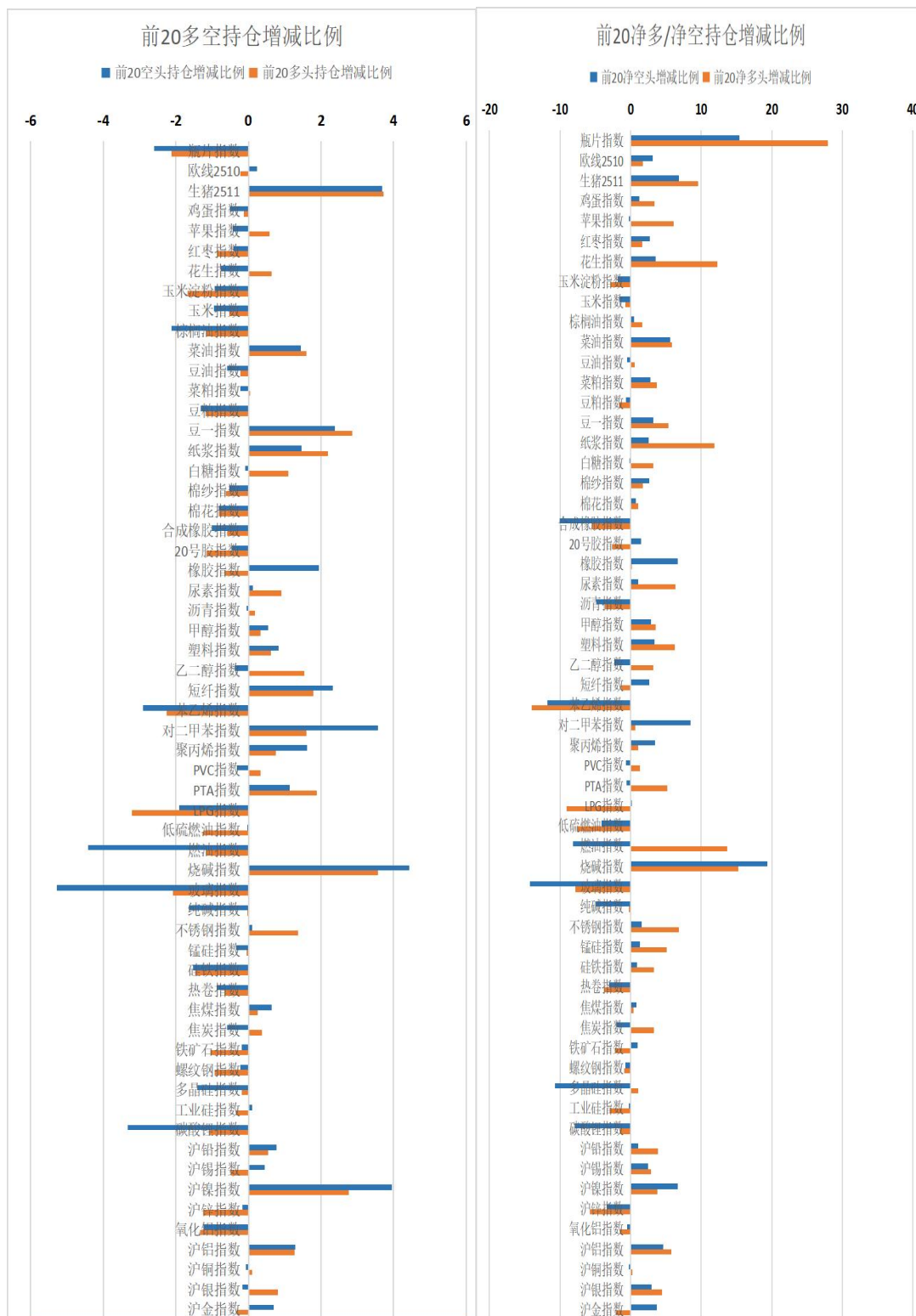


三、会员持仓数据

2025-8-22		2025-8-21		会员多头持仓										会员空头持仓									
当日	昨日	前20名总持仓	总持仓变化	前20名持仓占比	前10名总持仓	总持仓变化	前10名持仓占比	前20名总持仓	总持仓变化	前10名总持仓	总持仓变化	前20名总持仓	总持仓变化	前20名总持仓	总持仓变化	前10名总持仓	总持仓变化	前20名总持仓	总持仓变化	前10名总持仓	总持仓变化	前20名总持仓	总持仓变化
AU8888.SHF	沪金指数	208199	-0.61	-1271	172901	-0.02	-36	58141	6.08	2827	43462	5.28	1949										
AG8888.SHF	沪银指数	334691	0.84	5888	264651	1.99	6149	238414	-0.46	-1245	171088	0.30	376										
CU8888.SHF	沪铜指数	274498	-0.11	494	203213	0.52	1050	276401	-0.72	-310	213780	-0.13	-241										
AL8888.SHF	沪铝指数	364951	1.61	7352	265903	1.41	4950	350741	2.12	7412	244038	2.63	6271										
AO8888.SHF	氧化铝指数	182567	-1.72	-4868	124370	-1.86	-2354	233458	-1.70	-4497	172441	-2.74	-3718										
ZN8888.SHF	沪锌指数	111499	-2.38	-2605	83214	-2.39	-1932	119208	0.66	-340	88110	0.19	164										
NI8888.SHF	沪镍指数	111169	5.26	6069	80644	4.67	3633	142229	5.93	8673	109157	7.38	7257										
SN8888.SHF	沪锡指数	20844	-0.44	-232	15458	-2.19	-346	23895	3.18	211	18501	-0.50	-15										
FE8888.SHF	沪铁指数	57777	-1.41	517	42817	-0.82	467	61716	-0.01	744	49078	1.24	700										
LC8888.GFE	碳酸锂指数	479478	-0.57	-8458	389226	-0.06	-9808	611728	-1.45	-26326	514916	-1.17	-22000										
SI8888.GFE	工业硅指数	314006	-1.01	-1760	224455	-0.54	-1123	409300	0.04	556	309477	0.11	354										
PS8888.GFE	多晶硅指数	199215	-0.99	-582	168922	0.10	176	168458	-4.25	-4648	132665	-1.97	-2866										
RB8888.SHF	螺纹钢指数	1616876	-1.69	-27975	1200961	-1.63	-19880	1703120	-0.63	-6736	1287117	-0.38	-2607										
I8888.DCE	铁矿石指数	500840	-1.88	-8743	365880	-1.50	-5590	514538	-0.09	-1496	369322	0.29	-623										
JM8888.DCE	焦炭指数	229205	0.22	180	16793	1.94	320	27707	-1.00	-279	20638	-0.48	-99										
JW8888.DCE	焦煤指数	454303	1.22	2316	313784	0.39	1225	555758	1.36	5717	401210	1.31	3452										
HC8888.SHF	热卷指数	1404063	-1.10	-14590	1054864	0.08	-7270	1506628	-0.28	-19653	1116246	-1.06	-11901										
SP8888.CZC	硅铁指数	300139	-2.16	-6470	205662	-3.22	-6849	335852	-1.97	-6759	242985	-2.12	-5216										
SM8888.CZC	锰硅指数	381243	-0.08	-324	262233	0.04	113	460493	-0.43	-1964	348775	-0.74	-2616										
SS8888.SHF	不锈钢指数	110565	2.98	3369	82586	1.16	945	120290	0.08	273	92323	0.12	111										
SA8888.CZC	纯碱指数	1018327	-0.07	-749	649186	1.50	9577	1320636	-3.24	-33175	1015142	-3.53	-37197										
PG8888.CZC	玻璃指数	825865	-4.43	-34280	512162	-5.54	-15203	1039484	-7.93	-87139	810169	-10.44	-92482										
SH8888.CZC	烧碱指数	204124	4.44	10963	143819	3.10	4323	212064	6.08	13661	156507	3.66	6967										
FU8888.SHF	燃油指数	282226	-4.38	-5910	195254	-3.91	-5890	328506	-9.26	-22474	222522	-11.42	-12885										
IU8888.SHF	低硫燃油指数	67961	-4.58	-1670	50911	-4.46	-1865	67159	-0.78	-44	48496	-2.36	1038										
PG8888.DCE	LPG指数	107000	-5.09	-6046	83402	-5.42	-5132	121105	-3.44	-3587	96135	-2.94	-2944										
TA8888.CZC	PTA指数	881561	2.88	28029	654952	3.96	31097	976000	1.76	16847	742091	2.00	14583										
V8888.DCE	PVC指数	778429	0.16	4559	537201	-0.88	-1395	844504	-1.58	-4307	661912	-0.69	-2331										
PP8888.DCE	聚丙烯指数	370837	3.89	4627	283453	4.23	1883	442600	5.53	9995	348707	4.95	8272										
PI8888.CZC	对二甲苯指数	200496	2.21	4486	141133	3.33	5594	227190	3.95	10022	178609	2.29	4944										
EB8888.DCE	苯乙烯指数	278206	-5.20	-10381	220151	-5.00	-11650	311182	-4.21	-13384	249670	-5.81	-15368										
FE8888.CZC	短纤指数	202017	2.36	5049	136531	1.26	3029	224437	2.49	6602	154968	4.24	10522										
EC8888.DCE	乙二醇指数	184700	2.04	5226	140093	0.87	2499	238018	-0.94	-1281	178753	-0.78	66										
LI8888.DCE	塑料指数	277093	0.39	3176	200134	0.47	1778	317984	1.16	4315	252212	2.00	5212										
MA8888.CZC	甲醇指数	586112	0.30	3483	420743	0.06	1430	697615	0.74	5710	531165	1.61	8416										
RU8888.SHF	沥青指数	294937	-0.55	728	190640	1.36	2590	289144	-2.59	-114	193125	-1.28	-2494										
UR8888.CZC	尿素指数	175114	1.19	2797	112883	1.09	1515	209611	0.18	372	149071	2.75	5454										
RU8888.SHF	橡胶指数	88009	-2.16	-1120	60561	-5.06	-3095	123156	2.59	3384	95907	3.12	2867										
NR8888.SHF	20号胶指数	51032	28.51	-1173	38989	30.08	-862	61192	29.11	-451	45352	-18.86	-1886										
BR8888.SHF	合成橡胶指数	4914	-11.52	-354	3508	-7.17	25	6152	-16.91	-605	5250	-18.41	-398										
CF8888.CZC	棉花指数	486440	-1.22	-6011	364266	-0.63	-2093	534956	-1.11	-6001	413217	-1.63	-6868										
CT8888.CZC	棉纱指数	21821	-0.66	-142	18373	-1.11	37	22201	-0.57	-122	18120	-0.80	92										
SY8888.CZC	白糖指数	322447	1.58	5123	248815	1.14	2815	336667	-0.13	-422	260220	-0.07	-176										
SP8888.SHF	纸浆指数	148013	5.48	6663	103139	5.15	4175	179079	1.99	4448	136734	1.94	2604										
AB8888.CZC	豆一指数	227445	3.39	9875	184362	3.55	7201	231807	3.67	8207	180463	4.08	7080										
MB8888.DCE	豆粕指数	2667895	-3.11	-50743	1956821	-3.55	-67886	3289935	-2.27	-56404	2737960	-0.71	-21516										
RM8888.CZC	菜粕指数	390781	-0.03	122	299806	-0.98	-2926	399536	-0.38	-1506	288266	-0.37	-759										
Y8888.DCE	豆油指数	647453	-0.95	-2225	508071	-1.33	-5607	768920	-0.54	-5739	642743	-0.68	-4394										
OI8888.CZC	菜油指数	289673	2.28	6475	212572	3.01	6217	283410	2.09	5809	207475	3.14	6325										
PF8888.DCE	棕榈油指数	415804	-3.14	-7567	328772	-1.68	2074	390400	-3.63	-13813	278299	-4.24	-12337										
CS8888.DCE	玉米指数	1164756	-2.66	-8996	875723	-1.77	701	1248995	-1.47	-16204	1002116	-2.27	-18172										
CS8888.DCE	玉米淀粉指数	182678	-3.06	-5000	138884	-1.07	-365	204493	-2.23	-2781	169621	-0.53	-908										
PK8888.CZC	花生指数	161126	-0.16	1674	107720	0.63	678	171563	-1.74	-1987	112640	-1.98	-613										
CF8888.CZC	红枣指数	104562	-2.84	-1720	68642	-1.32	-921	117179	-0.71	-823	82393	-0.01	325										
AJ8888.CZC	苹果指数	56458	0.95	580	40381	1.44	575	56458	-0.77	-440	35295	-0.04	-13										
JD8888.DCE	鸡蛋指数	418652	0.64	-1124	300298	0.30	-793	456976	-0.11	-4618	326341	-1.69	-6604										
LR2511.DCE	生油2511	45051	5.79	2726	30807	5.41	1581	49631	5.47	2704	34571	5.92	2165										
EC2510.SHF	欧线2510	28388	-0.50	-119	18750	-1.56	-221	31701	0.24	129	21882	-2.10	-469										
FR8888.CZC	茄片指数	51660	-2.77	-1316	41660	-1.71	-723	54211	-2.92	-1610	41094	-5.33	-2313										

前20名会员净持仓占比





注：以上文中涉及数据来源为：同花顺iFind
请务必仔细阅读正文后免责声明

道通期货经纪有限公司（以下简称“本公司”）具有中国证监会核准的期货投资咨询业务资格。

本报告的观点和信息仅供本公司的合格投资者参考，无意针对或打算违反任何地区、国家、城市或其它法律管辖区域内的法律法规。本报告难以设置访问权限，若给您造成不便，敬请谅解。若您并非道通期货客户中的合格投资者，请勿阅读、订阅或接收任何相关信息。本报告不构成具体业务的推介，亦不应被视为任何投资、法律、会计或税务建议，且本公司不会因接收人收到本报告而视其为本公司的当然客户。请您根据自身的风险承受能力自行作出投资决定并自主承担投资风险，不应凭借本内容进行具体操作。

分析师声明

作者具有中国期货业协会授予的期货投资咨询执业资格或相当的专业胜任能力，力求报告内容独立、客观、公正。本报告仅反映作者的不同设想、见解及分析方法。作者所得报酬的任何组成部分无论是在过去、现在及将来均不会直接或间接地与研究报告所表述的具体建议或观点相联系。本报告所载的观点并不代表本公司或任何其附属或联营公司的立场，特此声明。

免责声明

本报告的信息来源于已公开的资料，但本公司对该等信息的准确性、完整性或可靠性不作任何保证。本报告所载的资料、意见及推测仅反映本公司于发布本报告当日的判断，本报告所指的期货标的的价格可升可跌，过往表现不应作为日后的表现依据。在不同时期，或因使用不同假设和标准，采用不同观点和分析方法，本公司可发出与本报告所载资料、意见及推测不一致的报告，对此本公司可不发出特别通知。本公司不保证本报告所含信息保持在最新状态。同时，本公司对本报告所含信息可在不发出通知的情形下做出修改，投资者应当自行关注相应的更新或修改。因使用不同假设和标准、采用不同观点和分析方法而与道通期货其它业务部门、单位或附属机构在制作类似的其他材料时所给出的意见不同或者相反，道通期货并不承担提示本报告的收件人注意该等材料的责任。

本报告中所指的研究服务可能不适合个别客户，不构成客户私人咨询建议，客户应考虑本报告中的任何意见或建议是否符合其特定状况。在任何情况下，本报告中的信息或所表述的意见均不构成对任何人的投资建议。在任何情况下，本公司、本公司员工或者关联机构不承诺投资者一定获利，不与投资者分享投资收益，也不对任何人因使用本报告中的任何内容所引致的任何直接或间接损失或与此有关的其他损失负任何责任。投资者务必注意，其据此做出的任何投资决策与本公司、本公司员工或者关联机构无关。市场有风险，投资需谨慎。投资者不应将本报告作为作出投资决策的唯一参考因素，亦不应认为本报告可以取代自己的判断。在决定投资前，如有需要，投资者务必向专业人士咨询并谨慎决策。

版权声明

本报告版权仅为本公司所有，未经书面许可，任何机构和个人不得以任何形式翻版、复制、发表或引用。如征得本公司同意进行引用、刊发的，需在允许的范围内使用，并注明出处为“道通期货研究”，提示使用本报告的风险，且不得对本报告进行任何有悖原意的引用、删节和修改。若本公司以外的其他个人或机构（以下简称“该个人或机构”）发送本报告，则由该个人或机构独自为此发送行

为负责。通过此途径获得本报告的投资者应自行联系该个人或机构以要求获悉更详细信息或进而交易本报告中提及的期货品种。本报告不构成本公司向该个人或机构之客户提供的投资建议，本公司、本公司员工或者关联机构亦不为该个人或机构之客户因使用本报告或报告所载内容引起的任何损失承担任何责任。

除非另有说明，本报告中使用的所有商标、服务标记及标记均为道通期货所有或经合法授权被许可使用的商标、服务标记及标记，未经道通期货或商标所有权人的书面许可，任何单位或个人不得使用该商标、服务标记及标记。

业务团队

南京事业部

电话：025-83276979， 电子邮箱：njsyb@doto-futures.com

产业事业部

电话：025-83276938， 电子邮箱：cysyb@doto-futures.com



道通期货
DotoFutures

分支机构

上海分公司

上海市虹口区东长治路359号2002A

电话：021-65041861， 电子邮箱：shanghai@dots-futures.com

北京蓝靛厂东路营业部

北京市海淀区蓝靛厂东路2号院2号楼(金源时代商务中心2号楼)10(9)层3单元(c座)10B-1

电话：010-88596442， 传真：010-88599543， 邮编：100089

电子邮箱：bjyyb@doto-futures.com

海口营业部

海南省海口市龙华区国贸路36号嘉陵国际大厦18楼1807室

电话：0898-31676621， 传真：0898-31676621， 邮编：570125

电子邮箱：hkyyb@doto-futures.com

宜兴营业部

江苏省宜兴市宜城街道瑞德康城花苑70号

电话：0510-87221878， 传真：0510-87077608， 邮编：214200

电子邮箱：yxyyb@doto-futures.com

张家港营业部

江苏省张家港市杨舍镇暨阳中路158号501室

电话：0512-35025818， 传真：0512-35025817， 邮编：215600

电子邮箱：zjgyb@doto-futures.com

宿迁营业部

江苏省宿迁市宿城区洪泽湖路88号皇冠国际公寓9#楼前02铺
电话：0527-84665888，传真：0527-84665888，邮编：223865
电子邮箱：sqyyb@doto-futures.com

高效、严谨、敬业
