CFTC: 对冲基金, CTAs 持有 WTI 原油 期货 净多头达到 37 万个

作者：寇健　发布于：2016-05-23

美国商品期货交易委员会 (Commodity Futures Trading Commission, CFTC) 是 美国联邦政府对 期货交易所和期货公司的监管机构. 每个星期五 CFTC 会公布 美国所有 期货交易所和所有产品的多空头持有报告.

上周我们密切关注的 芝商所布伦特 原油(交易代码 :BZ) 期货中的大空头 (Other Reportables), 这个星期的 大空头 减少 800. 现在的净空头寸 49000 个布伦特 原油(交易代码 :BZ) 期货 合同.

同时我们还注意到了 .

CTA 账户 净多头 220000. 对冲基金 净多头 150000. (看下图.) 比两个星期之前一共多增加了 7 万头.

"Managed Money" 这里的意思主要是 CTA 头寸.

" Other Reportables " 这 里的意思主要是 对冲基金和其他机构投资者.

非 原油生产者 持有这样大的 原油期货多头 实在是令 市场 人士担忧.

下图是 上周五 公布的芝商所 西德克萨斯原油(交易代码 :CL) 多空头持有报告. CFTC 所有统计数据 是截止于上星期二 (5 月 17 日).

CRUDE OIL, LIGHT SWEET - NEW YORK MERCANTILE EXCHANGE
Disaggregated Commitments of Traders - Futures Only, May 17, 2016

	Open Interest	Reportable Positions: Producer/Merchant/ Processor/User Long	Short	Swap Dealers Long	Short	Spreading	Managed Money Long	Short	Spreading	Other Reportables Long	Short	Spr
		(CONTRACTS OF 1,000 BARRELS)										
		Positions										
All	1,698,980	190,853	486,146	219,249	275,385	175,248	294,071	72,245	264,496	260,525	113,582	
Old	1,698,980	190,853	486,146	219,249	275,385	175,248	294,071	72,245	264,496	260,525	113,582	
Other	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	
		Changes in Commitments from: May 10, 2016										
	-26,007	-18,673	-6,914	-17,495	30,554	-890	9,501	-20,594	-14,346	23,296	-23,418	
		Percent of Open Interest Represented by Each Category of Trader										
All	100.0	11.2	28.6	12.9	16.2	10.3	17.3	4.3	15.6	15.3	6.7	
Old	100.0	11.2	28.6	12.9	16.2	10.3	17.3	4.3	15.6	15.3	6.7	
Other	100.0	0.0	0.0	0.0	0.0	0.0	0.0	0.0	0.0	0.0	0.0	
		Number of Traders in Each Category										
All	403	59	84	20	21	33	68	42	73	67	80	
Old	403	59	84	20	21	33	68	42	73	67	80	
Other	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	

	Percent of Open Interest Held by the Indicated Number of the Largest Traders: By Gross Position, 4 or Less Traders Long	Short	8 or Less Traders Long	Short	By Net Position, 4 or Less Traders Long	Short	8 or Less Traders Long	Short
All	16.5	11.3	26.4	20.4	15.5	9.7	23.5	16.6
Old	16.5	11.3	26.4	20.4	15.5	9.7	23.5	16.6
Other	0.0	0.0	0.0	0.0	0.0	0.0	0.0	0.0