

# 每日国内期货收盘数据和点评

制作日期：2024年6月13日

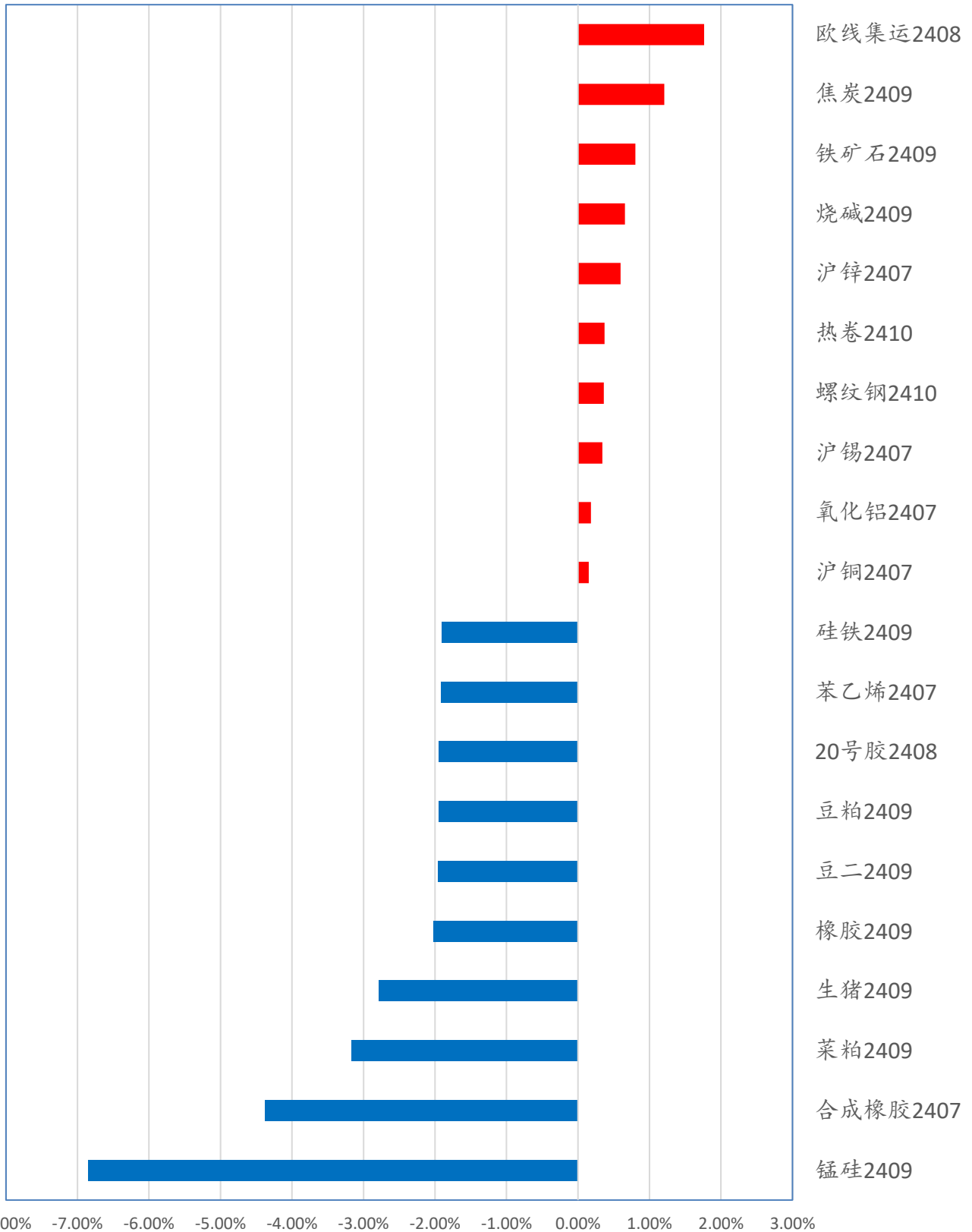
内容摘要：

- 每日商品期货涨跌幅排名
- 每日商品期货成交金额排名
- 每日商品期货资金沉淀排名
- 每日期货主要合约基差变化
- 每日主力合约期货价格历史百分位比较
- 每日热点评论



每日商品期货涨跌幅排名

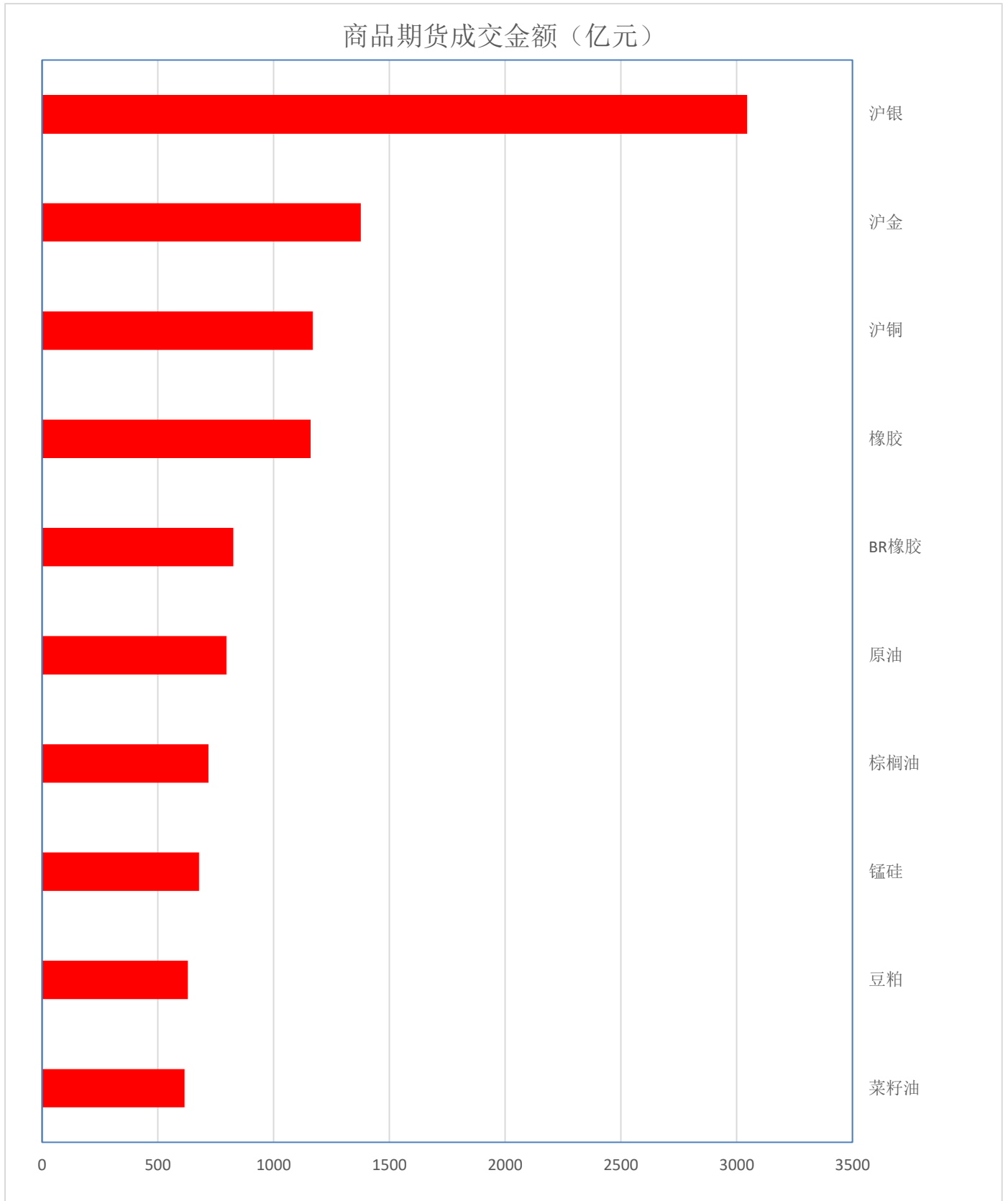
商品期货涨跌幅 (%)



数据来源：文华财经



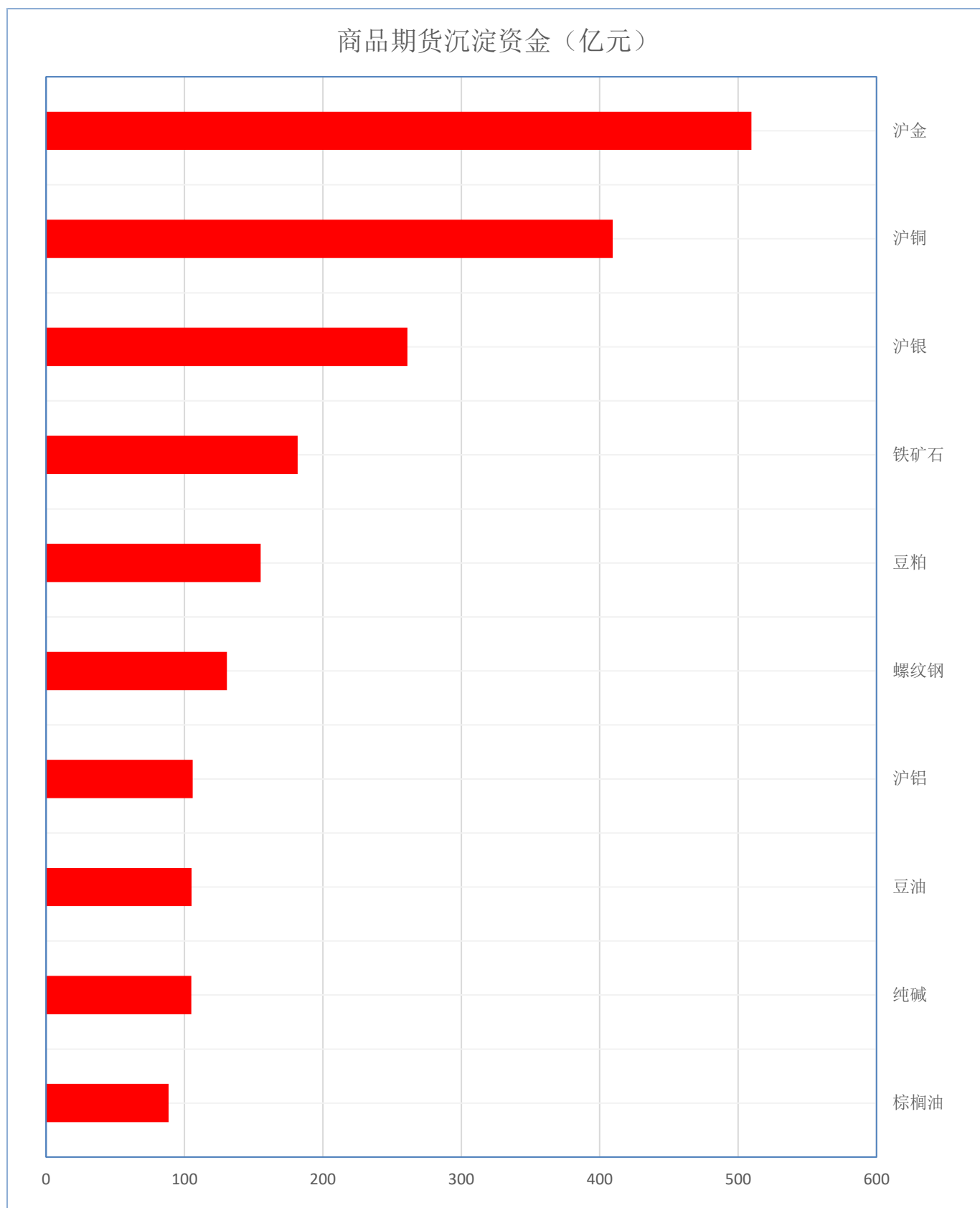
每日商品期货成交金额排名



数据来源：文华财经



每日商品期货资金沉淀排名



数据来源：文华财经



## 每日期货主要合约基差变化

### 期货主要品种基差

制表: 华鑫期货研究所

(收盘价计算)

2024/6/13

版块	代码	品种	基差	基差变动	基差率	期货 收盘 价	现货价	备注
		(主力连续)	(现货-期货)	(日环比)	(基差/现货)		(折合盘面价)	
金融	IF	沪深300	12.9	6.65	0.36%	3531.2	3544.1	
	IH	上证50	8.4	3.79	0.35%	2415.2	2423.6	
	IM	中证1000	35.9	10.94	0.69%	5180.6	5216.5	
	IC	中证500	23.0	4.08	0.44%	5210	5233.0	
金属	CU	铜	-330.0	-160.00	-0.41%	79880	79550	上海物贸
	AL	铝	0.0	75.00	0.00%	20800	20800	上海物贸
	ZN	锌	-30.0	20.00	-0.13%	23555	23525	上海物贸
	NI	镍	1620.0	460.00	1.15%	139770	141390	上海金属网
	AO	氧化铝	30.0	-84.00	0.77%	3870	3900	山东地区氧化铝中间价
	SS	不锈钢	380.0	-70.00	2.62%	14120	14500	304/2B冷轧不锈钢卷太钢无锡
黑色	RB	螺纹钢	-28.0	-41.00	-0.78%	3608	3580.0	上海HRB400E 20mm
	HC	热卷	6.0	-8.00	0.16%	3774	3780	上海Q235B 4.75mm
	J	焦炭	-161.0	-77.50	-7.76%	2236	2075	天津港准一级冶金焦
	JM	焦煤	162.0	-35.50	9.05%	1628	1790	山西晋中中硫主焦煤(S1.3)
	I	铁矿石	26.7	-9.00	3.19%	810.5	837.2	青岛港金布巴粉
	SM	锰硅	-164.0	-258.00	-1.98%	8464	8300.0	内蒙FeMn65Si17+地区贴水400
	FG	玻璃	-36.0	1.00	-2.21%	1666	1630.0	华北地区5mm浮法玻璃含税价
能化	SC	原油	-21.4	-7.48	-3.66%	605.3	583.9	原油(阿曼)
	PG	液化石油气	509.0	-31.00	10.02%	4571	5080.0	广州码头液化气(国产气)
	BU	沥青	212.0	-22.00	5.62%	3558	3770	华东主流市场价
	RU	天胶	-805.0	-270.00	-5.37%	15805	15000	上海云南国营全乳胶(SCRWF)
	NR	20号标胶	-362.7	-200.37	-2.79%	13380	13017	泰国STR20青岛保税区库提价
	MA	甲醇	25.0	-15.00	0.97%	2560	2585	华东市场低端价
	L	塑料	-13.0	-71.00	-0.15%	8613	8600	齐鲁石化7042出厂价
	PP	聚丙烯	-235.0	-53.00	-3.13%	7735	7500	延安炼化t30s出厂价
	EB	苯乙烯	160.0	-5.00	1.64%	9610	9770	华东市场低端价
	V	PVC	-390.0	-46.00	-6.66%	6242	5852	电石法全国均价
	PF	短纤	-14.0	-28.00	-0.19%	7464	7450	华东市场涤纶短纤1.4D主流价
	EG	乙二醇	-47.0	0.00	-1.04%	4567	4520	华东市场低端价
	TA	PTA	8.0	-16.00	0.13%	5962	5970	CCFEI价格指数(内盘)
	LC	碳酸锂	2050.0	-1450.00	2.04%	98450	100500	电池级碳酸锂市场价
SA	纯碱	50.0	-5.00	2.25%	2175	2225	华北地区沙河市场重质纯碱主流价	
UR	尿素	282.0	17.00	12.05%	2058	2340	河南地区小颗粒主流价	
农产品	A	豆一	73.0	-2.00	1.55%	4647	4720	哈尔滨巴彦国一等大豆
	Y	豆油	108.0	-84.00	1.34%	7942	8050	张家港四级豆油
	P	棕榈油	152.0	-22.00	1.93%	7728	7880	黄埔港
	OI	菜油	35.0	-29.00	0.40%	8625	8660	江苏南通四级菜油
	M	豆粕	-125.0	-18.00	-3.72%	3485	3360	张家港
	RM	菜粕	-77.0	-25.00	-2.88%	2747	2670	黄埔(加籽粕)
	SR	白糖	258.0	0.00	4.00%	6187	6445	广西一级糖报价
	CF	棉花	1239.0	-87.00	7.63%	14995	16234	中国棉花价格指数328
	C	玉米	322.5	-7.00	11.46%	2492	2815	收购价平均价
	CS	玉米淀粉	118.0	9.00	4.00%	2832	2950	长春出厂报价
	LH	生猪	870.0	15.00	4.53%	18330	19200	河南出厂价
JD	鸡蛋	-135.0	26.00	-3.49%	4005	3870	湖北孝感平均价	

备注: 数据均来自于wind, 现货价格仅代表部分可交割参考价格, 未含交割成本。基差及其变动仅供参考。



## 每日主力合约期货价格历史百分位比较

华鑫期货 CHINA FORTUNE FUTURES		主力合约期货价格历史百分位比较			2024/6/13
碳酸锂	7.93%	玻璃	35.51%	沪锡	61.56%
工业硅	8.36%	菜籽粕	36.06%	淀粉	63.41%
500股指	16.30%	纯碱	36.40%	豆粕	63.47%
不锈钢	17.25%	甲醇	37.02%	燃料油	64.49%
棉花	19.50%	聚丙烯	38.10%	原油	64.58%
PVC	20.02%	300股指	38.69%	白糖	70.09%
对二甲苯	23.90%	热卷	41.83%	玉米	70.88%
橡胶	24.65%	焦炭	42.10%	苯乙烯	70.89%
硅铁	25.62%	棕榈油	42.35%	二年债	72.42%
50股指	26.75%	螺纹钢	43.64%	沪铝	72.49%
苹果	28.13%	LU燃油	44.00%	国际铜	74.99%
塑料	28.38%	锰硅	44.55%	氧化铝	75.47%
菜籽油	29.00%	液化气	46.29%	沪银	83.17%
尿素	29.60%	豆二	47.29%	沪铜	88.12%
生猪	29.80%	鸡蛋	48.17%	五年债	88.99%
豆油	30.46%	短纤	49.56%	BR橡胶	89.36%
PTA	30.48%	铁矿石	49.70%	20号胶	89.95%
花生	31.82%	纸浆	50.53%	沪金	90.93%
1000股指	32.45%	烧碱	54.84%	三十年债	93.10%
红枣	32.45%	沪锌	56.28%	集运欧线	96.40%
焦煤	33.43%	豆一	57.22%	十年债	98.66%
沪镍	34.51%	沥青	58.90%		
乙二醇	34.63%	沪铅	61.41%		

注：底色标蓝的品种表示上市时间不超过3年该值的参考价值需要打折  
制表：华鑫期货研究所



## ■ 每日热点评论

### 1、螺纹热卷RB&HC

【盘面】螺纹主力合约收于3621，热卷主力合约收于3788。

【分析】宏观方面，美国公布5月CPI同比增长3.3%，为2021年4月以来最低水平，美联储降息预期升温，9月降息的概率增至七成，11月降息的可能性达到100%，利多商品。产业方面，本周螺纹表需环比下降1.7%，较去年同期下降幅度超20%，螺纹钢厂库存与社会库存均出现小幅累库。热卷表观需求环比几乎持平，较去年同期增加5%左右，热卷钢厂库存与社会库存小幅降库。当前是建筑钢材消费淡季，在宏观利多的情绪下，预计钢材价格震荡。

【估值】中等

【风险】宏观与政策

### 2、硅铁SF

【盘面】硅铁主力合约2409收于7102，跌1.91%。

【分析】宁夏地区“绿电”普及较高，单吨硅铁碳排放较往年明显下降，对硅铁企业能耗双控的可能性较低。兰炭价格保持低位，目前硅铁利润超300元/吨，上周硅铁周产量10.95万吨，环比增加2.4%，同比增加19%，高利润刺激复产增产，预计硅铁或将跌破7000。

【估值】偏高

【风险】供给干扰

### 3、锰硅SM

【盘面】今日锰硅主力合约2409收于7884，跌幅6.85%，盘中触及跌停板。

【分析】锰矿价格高企，高利润下刺激锰矿供应增加，弥补部分澳矿缺口。锰硅利润丰厚，锰硅企业增产积极，上周日均产量29460吨，增加1375吨。郑商所锰硅仓单库存超50万吨，创历史新高，多头较难消化大量锰硅现货，预计锰硅价格低位运行。

【估值】中性

【风险】锰硅企业限产、锰矿供应受阻。

### 4、油脂油料

【盘面】棕榈油豆油收涨，双粕与菜油收跌。豆油主力9月收7912，涨0.08%，日增仓约0.13万手；菜油主力9月收8495，跌0.96%，日增仓约0.90万手；棕榈油主力9月收7716，涨0.49%，日增仓约1.25万手。豆粕主力9月收3417，跌1.61%，日增仓约4.77万手；菜粕主力9月收2660，跌2.71%，日增仓约5.65万手。

【分析】USDA于凌晨公布的月度供需报告与上月相比变动幅度有限，其中美豆期末库存小幅上调约27万吨，巴西大豆小幅下调产量约100万吨，阿根廷维持不变。报告整体偏中性，对市场指引有



限，在这一不确定性公布后，美豆的丰产预期将继续压制CBOT大豆价格，国内双粕跟随CBOT大豆走低。预计油粕将维持震荡走势，继续关注新作天气情况，并重点关注6月28号的种植面积报告。

【估值】中性

【风险】产区天气 宏观

## 5、纸浆SP

【盘面】纸浆主力合约2409收于5970，跌1.52%。

【分析】供应端，阔叶浆新增产能不断投产，阔叶浆供应较宽松。需求端，国内需求将进入淡季，成品纸提价乏力，造纸厂对高价纸浆采购乏力。上期所仓单50万余吨左右，处于高位，其中俄针占比较高。预计纸浆09合约低位运行。

【估值】中等

【风险】供应事故扰动

## 6、集运欧线EC

【盘面】集运指数主力合约 2408 收于 4650.9 点，涨 4.51%。午后盘面有所抬升，远月合约整体走强。

【分析】马士基再次推涨 7 月上海→欧线 FAK 报价至\$5000/TEU、\$9000/FEU，预计其他航司后续运价也会上涨，近月合约受基本面支撑，运价上涨叠加供给偏紧，对期价形成提振。欧盟拟对中国产电动汽车加征临时关税，这些临时关税将对中国电动汽车出口和集装箱需求产生影响。08 合约继续关注实际订舱价的落地情况及 7、8 月货量需求兑现情况，预计仍维持震荡。

【估值】中等

【风险】地缘政治事件扰动 供应链突发事件扰动



## 注意事项

本文中的信息均来源于公开资料，华鑫期货研究所及相关研究人员力求准确可靠，但对这些信息的准确性及完整性不作任何保证。我们已力求文章内容客观、公正，但文章中的信息与所表达的观点不构成所述期货买卖的出价或询价的依据，该等信息、意见并未考虑到获取本文人员的具体投资目的、财务状况以及特定需求，在任何时候均不构成对任何人的个人推荐。对依据或者使用本文所造成的一切后果，华鑫期货及其关联人员均不承担任何法律责任。

本文中的资料、意见、预测均只反映文章初次发布时的判断，可能会随时调整。该等意见、评估及预测无需通知即可随时更改。华鑫期货没有将此意见及建议向文章所有接收者进行更新的义务。本文仅供内部参考交流使用，不构成投资建议。如未经授权，私自转载或者转发本文，所引起的一切后果及法律责任由私自转载或转发者承担。华鑫期货将保留随时追究其法律责任的权利。

华鑫期货研究所立足诚信和专业，秉承“高效研究 创造价值”的理念，深谙“知微见著，臻于至善”的投研内核，并基于宏观、产业、市场风偏和估值构建“四维一体”决策模型，助力各类客户包括产业型客户和交易型客户的成长。

侯梦倩

期货从业资格：F3070960

投资咨询资格：Z0017338

邮箱：houmq@shhxqh.com

华鑫期货有限公司

地址：上海市黄浦区福州路666号21、22楼

邮编：200001

电话：400-186-8822

华鑫期货

华鑫期评

