



每日国内期货收盘数据和点评

制作日期：2024年7月5日

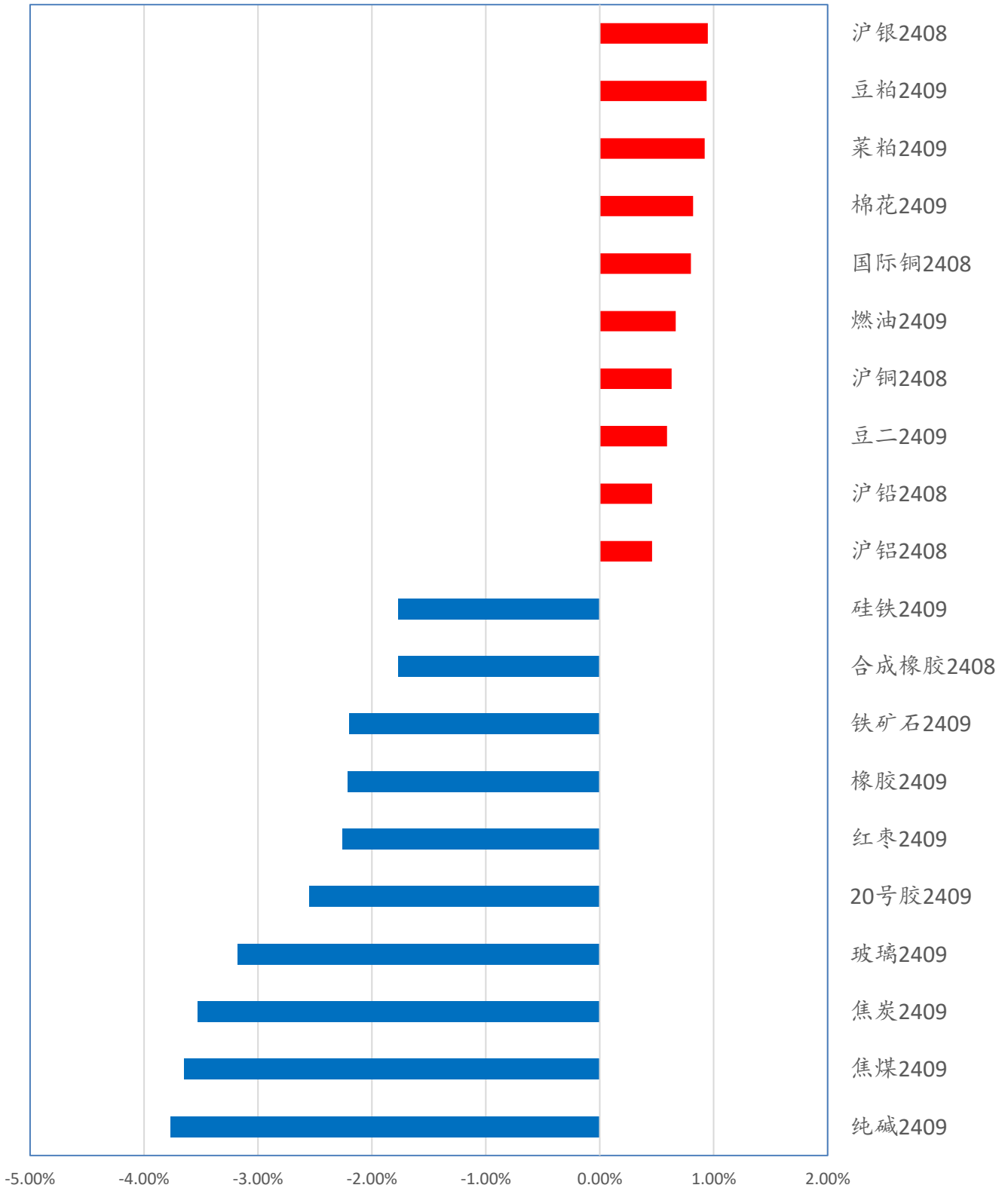
内容摘要：

- 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 (%)

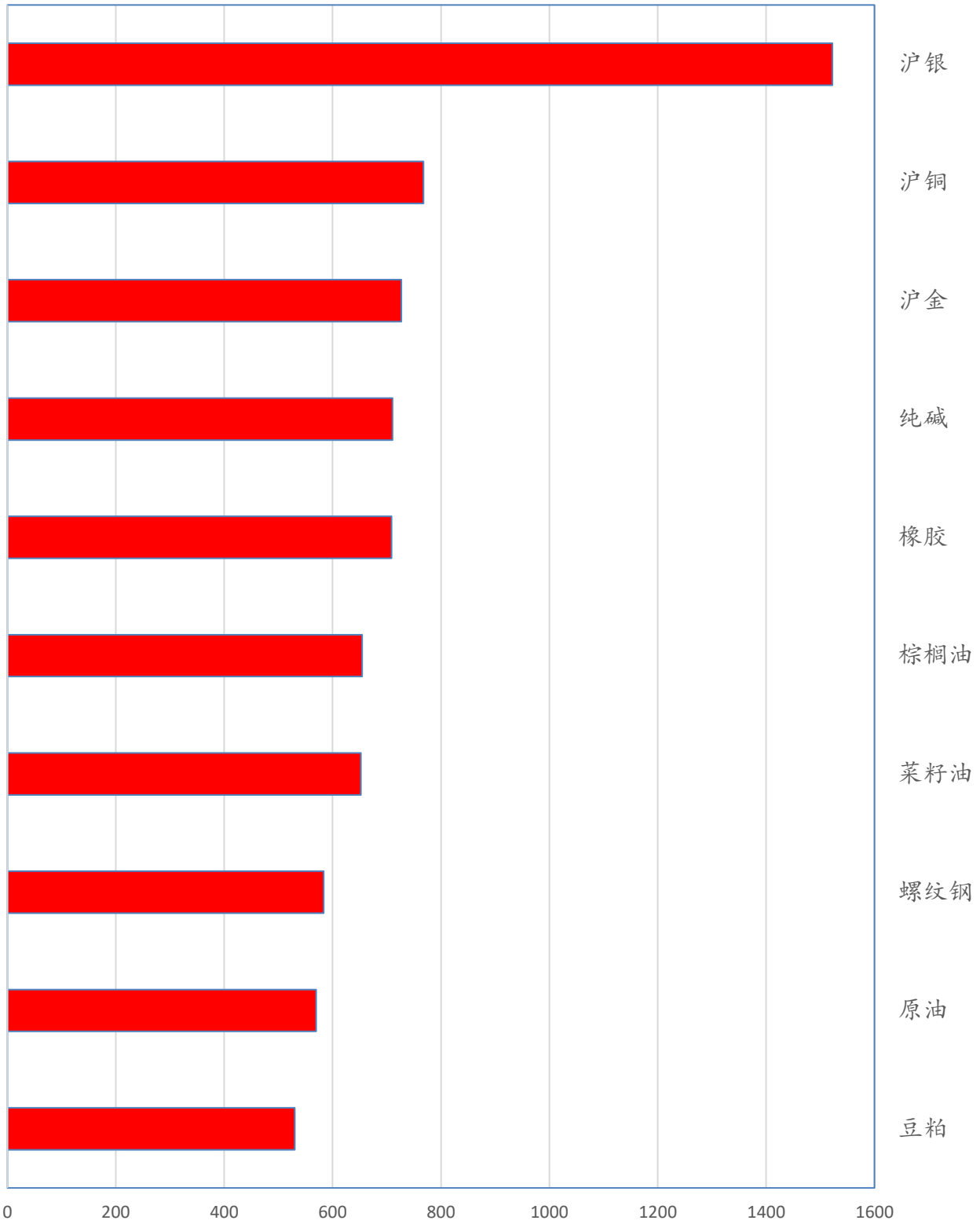


数据来源：文华财经



每日商品期货成交金额排名

商品期货成交金额（亿元）

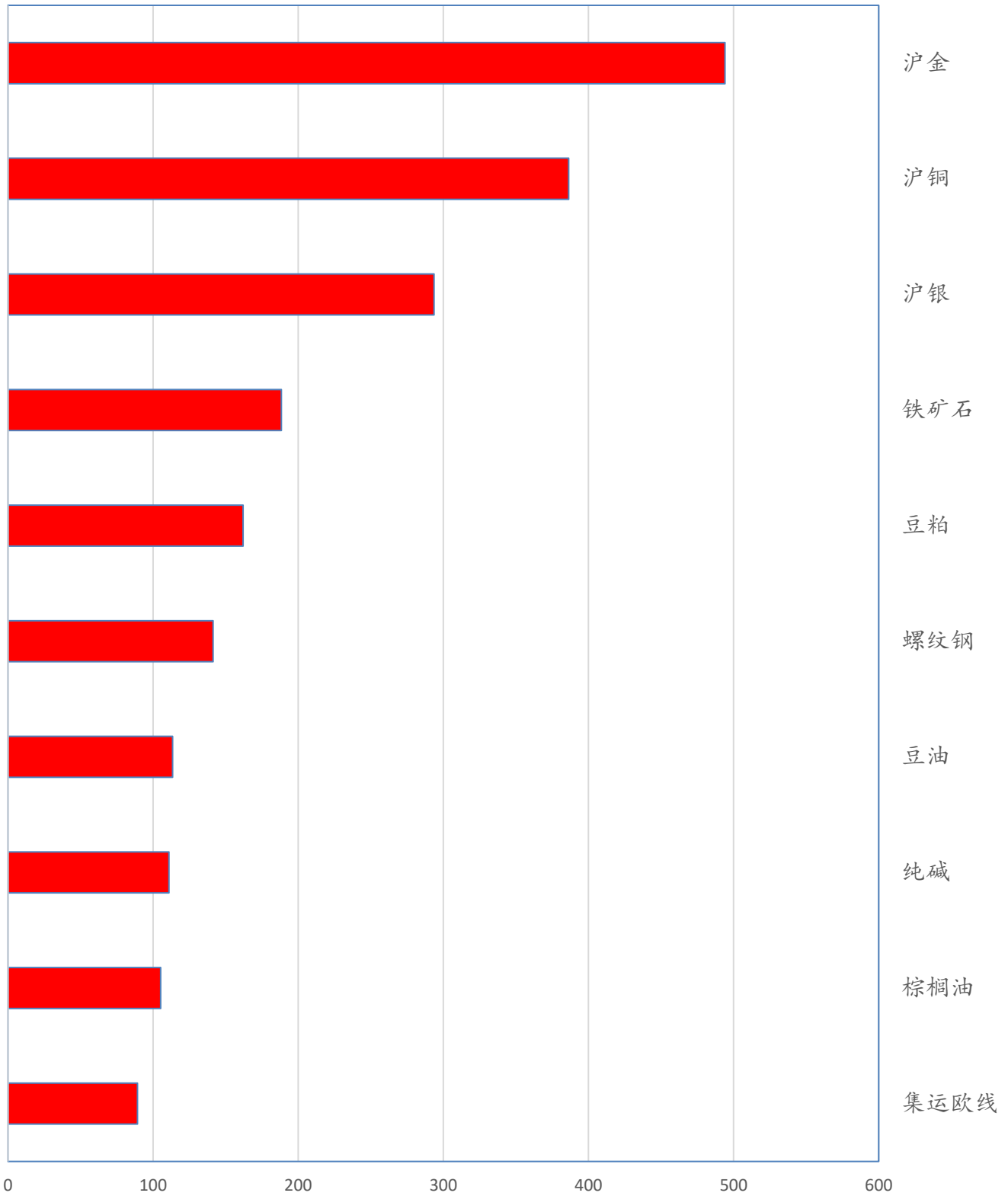


数据来源：文华财经



每日商品期货资金沉淀排名

商品期货沉淀资金（亿元）



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)

2024/7/5

| 板块 | 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 | 26.3 | -0.55 | 0.77% | 3404.8 | 3431.1 | |
| | IH | 上证50 | 33.2 | 1.90 | 1.39% | 2352.8 | 2386.0 | |
| | IM | 中证1000 | 32.6 | -0.27 | 0.63% | 4778.2 | 4810.8 | |
| | IC | 中证500 | 24.3 | -6.43 | 0.50% | 4842 | 4866.3 | |
| 金属 | CU | 铜 | -600.0 | -530.00 | -0.75% | 80370 | 79770 | 上海物贸 |
| | AL | 铝 | -10.0 | 30.00 | -0.05% | 20300 | 20290 | 上海物贸 |
| | ZN | 锌 | -20.0 | 65.00 | -0.03% | 24655 | 24635 | 上海物贸 |
| | NI | 镍 | -1480.0 | -2200.00 | -1.03% | 138090 | 136610 | 上海金属网 |
| | AO | 氧化铝 | 54.0 | 7.00 | 1.33% | 3846 | 3900 | 山东地区氧化铝中间价 |
| | SS | 不锈钢 | 270.0 | -55.00 | 1.96% | 14230 | 14500 | 304/2B冷轧不锈钢卷太钢无锡 |
| 黑色 | RB | 螺纹钢 | -13.0 | 33.00 | -0.37% | 3553 | 3540.0 | 上海HRB400E 20mm |
| | HC | 热卷 | 1.0 | 42.00 | 0.03% | 3759 | 3760 | 上海Q235B 4.75mm |
| | J | 焦炭 | -38.5 | 93.50 | -1.74% | 2253.5 | 2215 | 天津港准一级冶金焦 |
| | JM | 焦煤 | 193.0 | 59.00 | 11.03% | 1557 | 1750 | 山西晋中中硫主焦煤(S1.3) |
| | I | 铁矿石 | 34.1 | 10.40 | 3.88% | 845.5 | 879.6 | 青岛港金布巴粉 |
| | SM | 锰硅 | 210.0 | -16.00 | 2.69% | 7590 | 7800.0 | 内蒙FeMn65Si17+地区贴水400 |
| | FG | 玻璃 | 6.0 | 50.00 | 0.39% | 1524 | 1530.0 | 华北地区5mm浮法玻璃含税价 |
| 能化 | SC | 原油 | -15.4 | -2.40 | -2.43% | 635.5 | 620.1 | 原油(阿曼) |
| | PG | 液化石油气 | 395.0 | 12.00 | 7.73% | 4685 | 5080.0 | 广州码头液化气(国产气) |
| | BU | 沥青 | -26.0 | -1.00 | -0.71% | 3696 | 3670 | 华东主流市场价 |
| | RU | 天然胶 | -380.0 | 330.00 | -2.63% | 14580 | 14200 | 上海云南国管全乳胶(SCRWF) |
| | NR | 20号标胶 | 169.3 | 317.22 | 1.36% | 12235 | 12404 | 泰国STR20青岛保税区库提价 |
| | MA | 甲醇 | -25.0 | 9.00 | -0.99% | 2540 | 2515 | 华东市场低硫价 |
| | L | 塑料 | 80.0 | 69.00 | 0.93% | 8520 | 8600 | 齐鲁石化7042出厂价 |
| | PP | 聚丙烯 | -33.0 | 57.00 | -1.22% | 7743 | 7650 | 延安炼化t30s出厂价 |
| | EB | 苯乙烯 | 322.0 | 92.00 | 3.33% | 9348 | 9670 | 华东市场低硫价 |
| | V | PVC | -293.0 | 16.00 | -5.12% | 6013 | 5720 | 电石法全国均价 |
| | PF | 短纤 | 166.0 | 52.00 | 2.12% | 7664 | 7830 | 华东市场涤纶短纤1.4D主流价 |
| | EG | 乙二醇 | 12.0 | 1.00 | 0.26% | 4693 | 4705 | 华东市场低硫价 |
| | TA | PTA | 48.0 | 44.00 | 0.80% | 5972 | 6020 | CCFEI价格指数(内盘) |
| | LC | 碳酸锂 | -3400.0 | 50.00 | -3.76% | 93900 | 90500 | 电池级碳酸锂市场价 |
| SA | 纯碱 | -44.0 | 83.00 | -2.12% | 2119 | 2075 | 华北地区沙河市场重碱主流价 | |
| UR | 尿素 | 174.0 | 6.00 | 7.53% | 2136 | 2310 | 河南地区小颗粒主流价 | |
| 农产品 | A | 豆一 | -9.0 | -21.00 | -0.19% | 4729 | 4720 | 哈尔滨巴彦国产一等大豆 |
| | Y | 豆油 | 148.0 | 12.00 | 1.93% | 7952 | 8100 | 张家港四级豆油 |
| | P | 棕榈油 | 136.0 | -14.00 | 1.63% | 7954 | 8090 | 黄埔港 |
| | OI | 菜油 | 8.0 | 49.00 | 0.09% | 8732 | 8740 | 江苏南通四级菜油 |
| | M | 豆粕 | -118.0 | -71.00 | -3.66% | 3338 | 3220 | 张家港 |
| | RM | 菜粕 | -88.0 | -44.00 | -3.46% | 2628 | 2540 | 黄埔(加籽粕) |
| | SR | 白糖 | 174.0 | 6.00 | 2.70% | 6261 | 6435 | 广西一级糖报价 |
| | CF | 棉花 | 1007.0 | -135.00 | 6.33% | 14770 | 15777 | 中国棉花价格指数328 |
| | C | 玉米 | 345.5 | 3.00 | 12.23% | 2469 | 2815 | 收购价平均价 |
| | CS | 玉米淀粉 | 118.0 | -5.00 | 3.87% | 2932 | 3050 | 长春出厂报价 |
| | LH | 生猪 | 655.0 | 110.00 | 3.54% | 17845 | 18500 | 河南出厂价 |
| JD | 鸡蛋 | 210.0 | 57.00 | 4.87% | 4100 | 4310 | 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 | | | 2024/7/5 |
|-------------------------------|--------|-----------------|--------|------|----------|
| 工业硅 | 3.68% | 菜籽粕 | 34.86% | 沥青 | 63.06% |
| 碳酸锂 | 5.38% | 纯碱 | 35.21% | 淀粉 | 68.55% |
| 500股指 | 11.82% | 300股指 | 35.82% | 原油 | 69.59% |
| PVC | 17.92% | 甲醇 | 37.32% | 苯乙烯 | 69.81% |
| 不锈钢 | 19.46% | 乙二醇 | 38.08% | 玉米 | 70.10% |
| 棉花 | 19.54% | 聚丙烯 | 38.60% | 沪铝 | 70.22% |
| 1000股指 | 21.19% | 热卷 | 41.25% | 燃料油 | 70.96% |
| 橡胶 | 22.22% | 锰硅 | 41.60% | 沪铅 | 71.49% |
| 硅铁 | 24.19% | 焦炭 | 41.86% | 白糖 | 72.11% |
| 50股指 | 24.50% | 螺纹钢 | 42.16% | 氧化铝 | 73.52% |
| 苹果 | 24.66% | 棕榈油 | 45.05% | 三年债 | 75.75% |
| 对二甲苯 | 25.03% | 纸浆 | 45.24% | 20号胶 | 76.17% |
| 红枣 | 25.08% | 豆二 | 47.29% | 国际铜 | 76.75% |
| 花生 | 27.50% | 液化气 | 50.37% | BR橡胶 | 78.44% |
| 塑料 | 27.73% | LU燃油 | 51.04% | 三十年债 | 88.01% |
| 生猪 | 29.94% | 烧碱 | 51.27% | 沪铜 | 88.61% |
| 玻璃 | 30.55% | 鸡蛋 | 51.83% | 沪银 | 88.99% |
| PTA | 30.76% | 铁矿石 | 52.35% | 五年债 | 91.08% |
| 豆油 | 30.87% | 短纤 | 56.00% | 沪金 | 93.49% |
| 菜籽油 | 31.25% | 豆一 | 59.57% | 十年债 | 97.44% |
| 焦煤 | 31.60% | 沪锌 | 59.81% | 集运欧线 | 97.85% |
| 沪镍 | 34.31% | 豆粕 | 60.84% | | |
| 尿素 | 34.53% | 沪锡 | 62.01% | | |

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、股指

【盘面】今权益类市场走势风格再度转变，高股息权重蓝筹回调，而双创指数探底回升。全市场A股成交5774亿元，继续呈现低迷。盘中央行称已和几家主要金融机构签订债券借入协议的消息搅动了市场。IH跌超1%，IF跌近0.5%，而IM上涨超1%，IC涨超0.7%。

【分析】今日权重补跌，市场延续弱势，建议等成交量回归。

【估值】低

【风险】政策

2、黄金白银AU&AG

【盘面】夜盘沪金冲高回落，白天盘震荡反弹，创日内新高，主力8月收559.66，涨0.17%，震荡小幅上升，主力8月收于559.66，涨0.17%。成交量略减，总持仓量略增。沪银变动趋势跟随黄金，沪银主力8月收于8086，涨0.35%，成交略减，总仓增加超过1.5万手，本周白银持仓增加超过7.6万手，总持仓超过100万手。

【分析】本周金银强势，周线回归强势。市场对于美联储降息9月预期升温，美元走势偏弱。今晚美国劳工部将公布6月非农和失业率数据，关注数据与预期值的差距，上一期数据即6月7日公布的5月非农数据大幅好于预期，导致晚间外盘贵金属大幅下跌。维持贵金属中期做多策略，但基于目前价格处于高位，操作上重视持仓管理和风控。

【估值】偏高

【风险】美元

3、铜铝CU&AL

【盘面】夜盘沪铜冲高回落，早盘震荡，午后反弹，创日内新高，主力8月收80370，涨0.36%，成交略减，总仓增加2千余手。沪铝今日未随沪铜反弹，午后震荡走弱，8月收20300，跌0.85%，成交略放大，总仓减少超过1.3万手。

【分析】本周市场对于美联储9月降息预期升温，美元下行，铜与金银形成共振上涨，近期国内铜社会库存小幅回落，现货贴水逐步走平，显示回调后的价格，吸引部分买盘。关注今晚美国劳工部6月非农和失业率数据，上一期非农数据大幅好于预期，导致美元上涨，基本金属大跌。而铝本周表现偏弱，市场继续走基本面逻辑。

【估值】偏高

【风险】美元

4、螺纹热卷RB&HC

【盘面】螺纹热卷主力合约收跌。



【分析】短期南方强降雨天气导致建筑钢材需求放缓。上周247家钢厂日均铁水产量接近240万吨，钢材产量较好，螺纹开始累库。预计短期钢材价格偏弱运行。

【估值】中等

【风险】宏观与政策

5、油脂油料

【盘面】三大油脂双粕全线收跌。豆油主力9月收7952，跌0.97%；菜油主力9月收8732，跌0.89%；棕榈油主力9月收7954，跌1.00%。豆粕主力9月收3338，跌0.21%；菜粕主力9月收2628，跌0.53%。

【分析】印尼征收关税炒作降温，受制于油脂基本面偏空，多头获利离场，导致油脂主力合约下跌，且豆棕价差转负，原油价格的上涨可能会增加棕榈油作为替代能源的需求，从而提高棕榈油价格。随着进口大豆的持续到港，油厂开机率上升，豆粕库存持续升高，强供应弱需求的格局下，双粕主力合约价格均已跌破60日均价。短期内油粕供应宽松，自身驱动上涨的动力不足，后续需关注天气对农作物的影响。

【估值】中性

【风险】产区天气 宏观

6、集运欧线EC

【盘面】主力合约 2408 收于 5700.9 点，涨 0.61%。EC2410 正值换月，收于 4658.6 点，跌 3.75%。远月合约跌幅均超 5%。

【分析】今日盘后最新公布的 SCFI 欧洲航线运价为 4857 美元/TEU，较上期下跌 23 美元。即期运费方面，ONE 运价由 7589/9803 下调至 6553/8508，盘面出现跳水，午后再次小幅回升。7 月各船司运价增长趋缓，但总体上市场接受意愿有序推进，市场情绪向好。当前正值我国对欧洲出口的传统旺季，叠加地缘局势，盘面仍有上升空间。预计短期盘面维持偏强震荡。关注周一盘后公布的 SCFIS。

【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

