



# 每日国内期货收盘数据和点评

制作日期：2024年8月12日

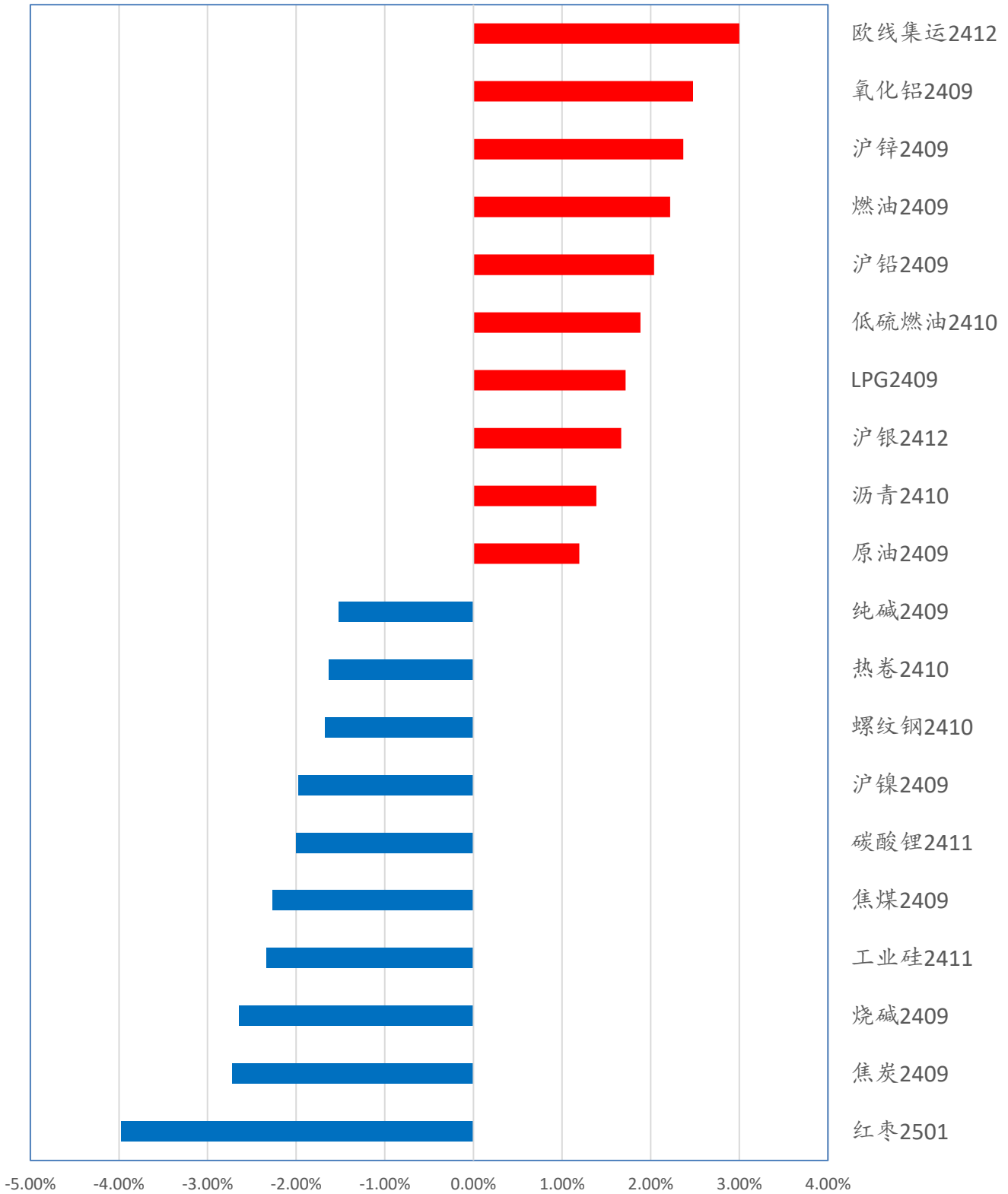
## 内容摘要：

- 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 (%)

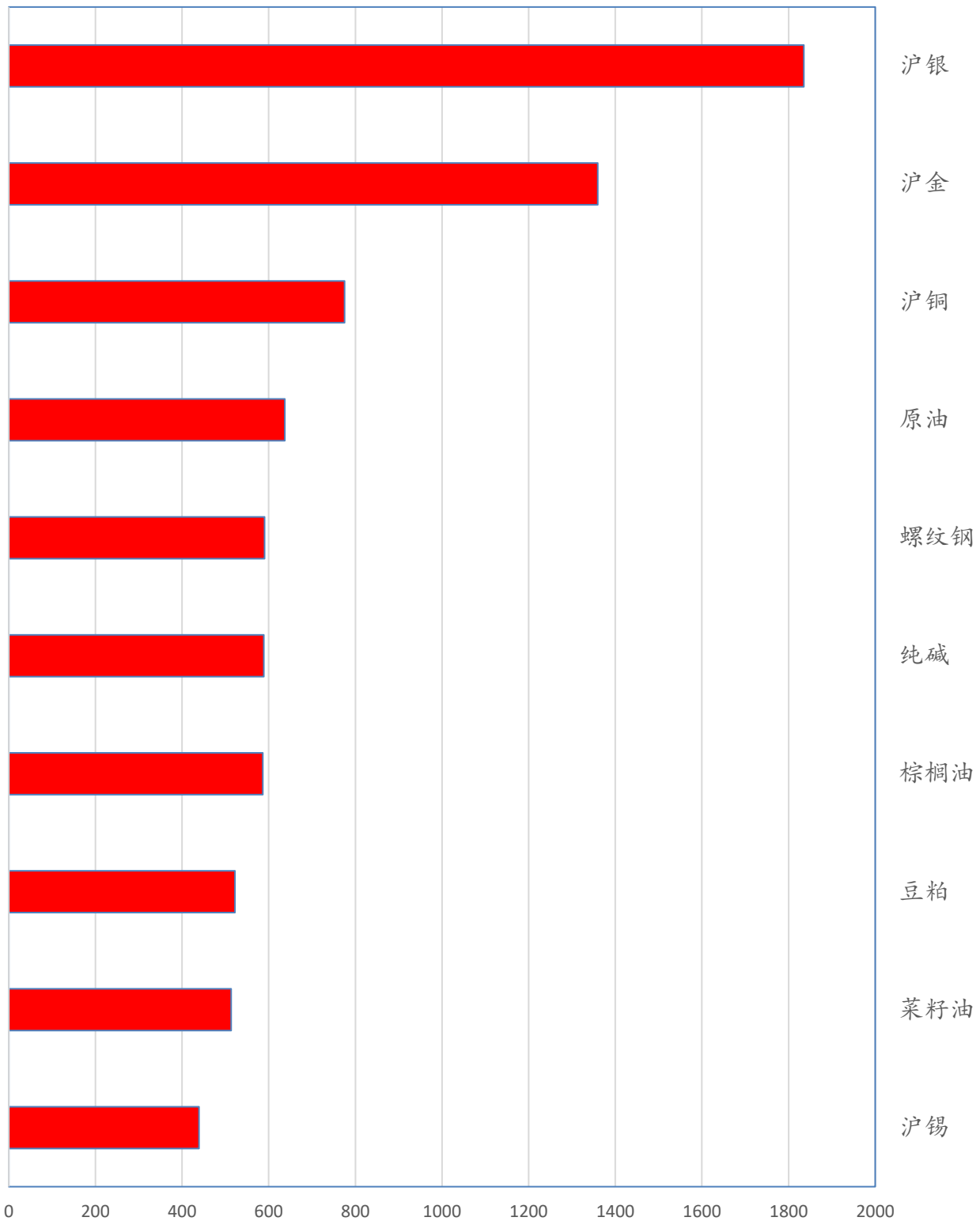


数据来源：文华财经



每日商品期货成交金额排名

商品期货成交金额（亿元）

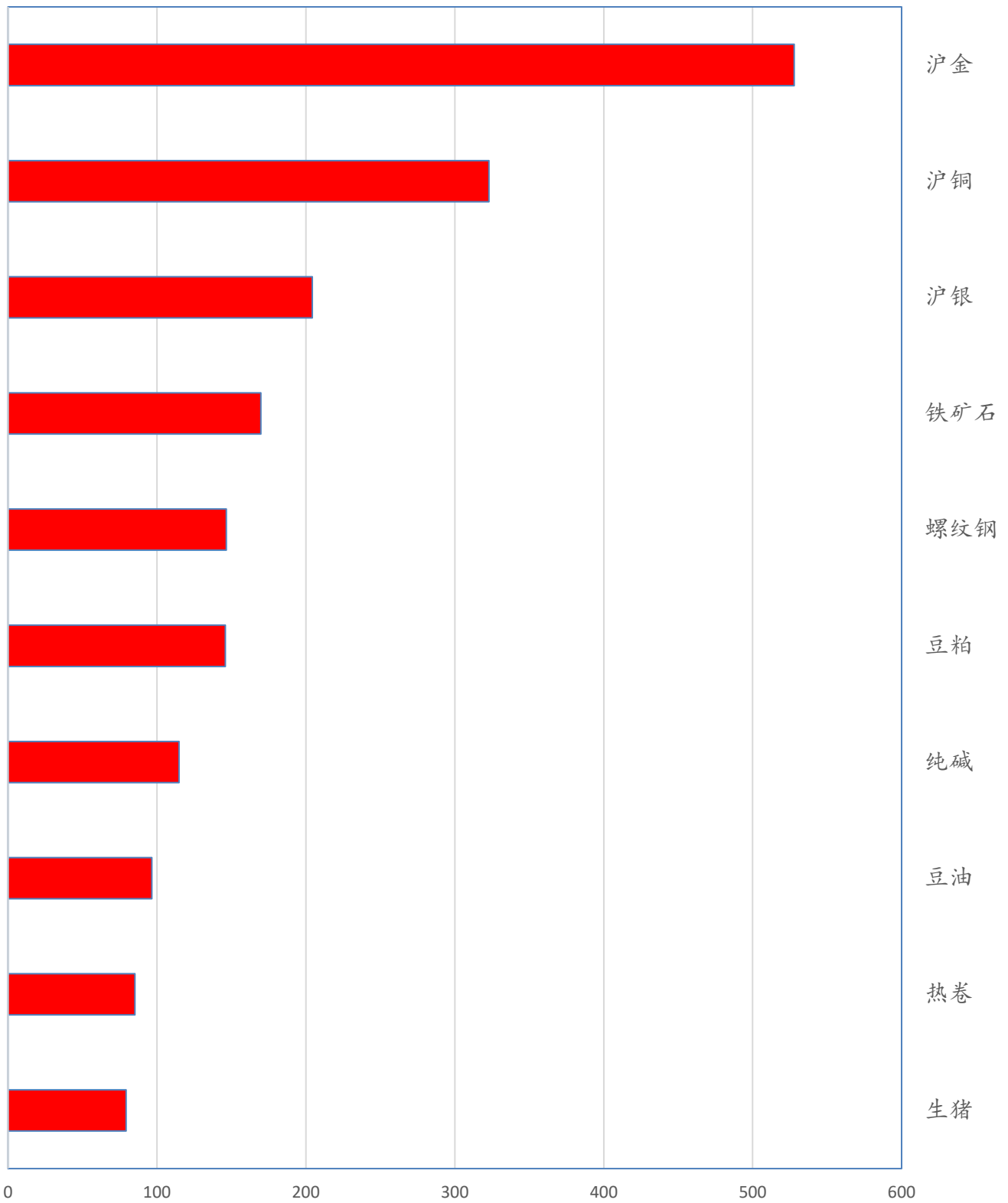


数据来源：文华财经



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)

2024/8/12

日期	代码	品种	基差	基差变动	基差率	期货收	现货价	备注
Date		(主力连续)	(现货-期货)	(日环比)	(基差/现货)	盘价	(折合盘面价)	
金融	IF	沪深300	0.1	-6.16	0.00%	3325.8	3325.9	
	IH	上证50	-0.7	-3.08	-0.03%	2317.6	2316.9	
	IM	中证1000	-4.3	-20.04	-0.09%	4678.4	4674.1	
	IC	中证500	-3.4	-15.95	-0.07%	4717.6	4714.2	
金属	CU	铜	-855.0	-665.00	-1.20%	72190	71335	上海物贸
	AL	铝	-190.0	-75.00	-1.00%	19180	18990	上海物贸
	ZN	锌	-285.0	-225.00	-1.25%	23140	22855	上海物贸
	NI	镍	10.0	-860.00	0.01%	128310	128320	上海金属网
	AO	氧化铝	-22.0	-95.00	-0.56%	3927	3905	山东地区氧化铝中间价
	SS	不锈钢	670.0	90.00	4.65%	13730	14400	304/2B冷轧不锈钢卷太钢无锡
黑色	RB	螺纹钢	-2.0	25.00	-0.06%	3222	3220.0	上海HRB400E 20mm
	HC	热卷	-4.0	56.00	-0.12%	3374	3370	上海Q235B 4.75mm
	J	焦炭	1.5	53.50	0.08%	1912.5	1914	天津港准一级冶金焦
	JM	焦煤	240.0	-8.50	15.00%	1360	1600	山西晋中中硫主焦煤(S1.3)
	I	铁矿石	58.0	11.00	7.32%	734	792.0	青岛港金布巴粉
	SM	锰硅	52.0	50.00	0.79%	6498	6550.0	内蒙FeMn65Si17+地区贴水400
	FG	玻璃	76.0	-6.00	5.51%	1304	1380.0	华北地区5mm浮法玻璃含税价
能化	SC	原油	-15.2	-6.72	-2.75%	568.1	552.9	原油(阿曼)
	PG	液化石油气	640.0	-27.00	12.31%	4560	5200.0	广州码头液化气(国产气)
	BU	沥青	261.0	-48.00	6.92%	3509	3770	华东主流市场价
	RU	天胶	-1505.0	-30.00	-10.42%	15955	14450	上海云南国管全乳胶(SCRWF)
	NR	20号标胶	13.1	-78.41	0.10%	12635	12648	泰国STR20青岛保税区库提价
	MA	甲醇	-8.0	-12.00	-0.33%	2418	2410	华东市场低端价
	L	塑料	117.0	-33.00	1.41%	8183	8300	齐鲁石化7042出厂价
	PP	聚丙烯	24.0	-22.00	0.32%	7556	7580	延安炼化t30s出厂价
	EB	苯乙烯	305.0	3.00	3.18%	9285	9590	华东市场低端价
	V	PVC	44.0	65.00	0.80%	5478	5522	电石法全国均价
	PF	短纤	176.0	-22.00	2.36%	7294	7470	华东市场涤纶短纤1.4D主流价
	EG	乙二醇	38.0	2.00	0.83%	4547	4585	华东市场低端价
	TA	PTA	448.0	-40.00	7.44%	5572	6020	CCFEI价格指数(内盘)
	LC	碳酸锂	4000.0	1550.00	5.00%	76000	80000	电池级碳酸锂市场价
SA	纯碱	117.0	-24.00	6.50%	1683	1800	华北地区沙河市场重质纯碱主流价	
UR	尿素	83.0	-2.00	3.90%	2047	2130	河南地区小颗粒主流价	
农产品	A	豆一	161.0	16.00	3.41%	4559	4720	哈尔滨巴彦国一等大豆
	Y	豆油	100.0	-36.00	1.32%	7480	7580	张家港四级豆油
	P	棕榈油	80.0	28.00	1.03%	7690	7770	黄埔港
	OI	菜油	0.0	-18.00	0.00%	8200	8200	江苏南通四级菜油
	M	豆粕	-41.0	10.00	-1.39%	2981	2940	张家港
	RM	菜粕	-38.0	-40.00	-1.70%	2268	2230	黄埔(加籽粕)
	SR	白糖	305.0	29.00	4.82%	6024	6329	广西一级糖报价
	CF	棉花	1145.0	45.00	7.75%	13625	14770	中国棉花价格指数3218B
	C	玉米	511.5	16.00	18.17%	2303	2815	收购价平均价
	CS	玉米淀粉	182.0	7.00	6.21%	2748	2930	长春出厂报价
	LH	生猪	2105.0	350.00	10.17%	18595	20700	河南出厂价
JD	鸡蛋	864.0	-230.00	17.93%	3956	4820	湖北孝感平均价	

备注：数据均来源于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		2024/8/12	
碳酸锂	0.06%	尿素	29.76%	豆一	55.73%
工业硅	0.41%	沪镍	29.82%	沪锡	56.66%
对二甲苯	4.51%	锰硅	30.62%	沥青	57.38%
500股指	10.20%	甲醇	32.80%	原油	58.69%
PVC	11.96%	焦炭	33.23%	淀粉	59.08%
烧碱	12.90%	热卷	33.63%	沪铅	61.15%
棉花	14.95%	300股指	33.81%	玉米	61.50%
不锈钢	15.64%	生猪	34.03%	燃料油	62.78%
纯碱	16.74%	乙二醇	34.94%	沪铝	62.85%
1000股指	18.16%	螺纹钢	34.95%	BR橡胶	64.95%
玻璃	21.23%	聚丙烯	35.57%	白糖	67.19%
菜籽粕	21.35%	集运欧线	41.84%	苯乙烯	68.93%
硅铁	21.50%	铁矿石	41.98%	沪银	73.86%
红枣	21.63%	棕榈油	42.06%	沪铜	77.75%
50股指	22.99%	纸浆	42.35%	二年债	78.55%
塑料	24.79%	短纤	45.17%	氧化铝	78.63%
焦煤	25.80%	LU燃油	46.44%	20号胶	82.40%
苹果	25.90%	鸡蛋	47.08%	三十年债	83.17%
橡胶	25.91%	豆二	47.29%	十年债	91.77%
豆油	25.98%	液化气	47.71%	五年债	92.40%
菜籽油	26.21%	豆粕	48.95%	沪金	94.77%
PTA	26.45%	国际铜	54.01%		
花生	28.00%	沪锌	54.24%		

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、黄金白银AU&AG

【盘面】今日开盘沪金震荡，午后小幅爬升，主力10月收于565.3，涨幅为0.88%。成交总量和持仓总量均略减。沪银主力和黄金走势相似，但弹性更强，主力12月收于7197，涨幅为1.83%，成交总量和持仓总量均略减。

【分析】市场逐渐从上周恐慌中恢复常态，黄金企稳，白银的弹性有所恢复，本周三美国将公布CPI数据，市场将对此解读未来美联储9月降息路径。本周我国也将公布重要经济数据，如M1、M2和社融。维持黄金偏多思路，但实操上，建议偏于谨慎，目前沪金处于550-570之间的窄幅波动，关注未来突破契机。

【估值】偏高

【风险】市场情绪 美联储降息

### 2、铜铝CU&AL

【盘面】沪铜夜盘冲高回落，周一上午窄幅波动，午后震荡回升，创日内新高，主力9月收72330，涨1.01%，成交和持仓均缩量。沪铝交易节奏基本同步于铜，主力9月收19180，涨0.52%，成交略减，总仓略增。

【分析】市场情绪逐步从上周的恐慌中走出，基本金属向上价格修复，本周三，美国将公布CPI数据，国内也将公布M1、M2和社融，市场除了聚焦未来美联储降息路径，也将对国内金融数据做进一步解读，5月以来，国内M1、M2和社融数据均差强人意，这也是从6月以来，国内基本金属持续下行的主要原因之一。沪铜目前跌近3月初向上突破前的平台，该平台超过12个月，预计沪铜已面临强支撑，但反弹动力还需宏观和产业数据的配合。

【估值】中性

【风险】宏观

### 3、螺纹热卷RB&HC

【盘面】螺纹热卷主力合约收跌，RB2410收于3222，跌1.68%，HC2410收于3374，跌1.63%。

【分析】产业端，上周螺纹热卷表观需求快速回落，钢厂普遍亏损，钢厂减产力度较大，螺纹与热卷产量下降幅较大，炉料需求下滑，铁矿与焦炭价格偏弱，负反馈逐步形成。但需要注意的是，立秋之后，气温逐渐下降，金九银十的钢材需求旺季将来临，对钢材价格或略有支撑。当前螺纹RB2410与HC2410均升水现货。预计螺纹与热卷价格震荡偏弱运行。

【估值】中等

【风险】宏观与政策

### 4、纸浆SP

【盘面】SP2409收于5692，跌0.42%，SP2501收于5824元/吨，跌0.17%。



【分析】宏观方面，全球经济衰退预期进一步加强，海外纸浆需求偏弱。供应端，巴西Suzano年产能255万吨桉木浆在7月已投产。今年国内新增680万吨木浆产能，下半年集中投产。由于最近三个月纸浆进口量偏少，进口货源库存较低，对浆价略有支撑。需求端，国内纸成品需求较弱，库存较高。上期所仓单49.3万吨，其中俄针占比较高，山东俄针现货价格5700元/吨。预计纸浆09合约震荡运行。

【估值】中等

【风险】供应事故扰动

## 5、油脂油料

【盘面】豆油主力9月收7480，跌0.29%；菜油主力9月收8200，涨0.50%；棕榈油主力9月收7690，涨0.00%；豆粕主力9月收2981，涨0.10%，菜粕主力01月收2268，跌0.26%。

【分析】MPOB今日公布的月度供需报告整体偏利好，数据显示产量和库存分别环比增加13.97%和39.92%，出口增幅要高于产量增幅，两者均高于市场预期；库存环比减少5.35%，低于市场预期。但ITS和AmSpec Agri数据显示，8月1-10马来西亚棕榈油出口环比降幅分别为12.2%和17.7%，马棕油走势偏弱。美豆破位下行，跌破1000美分/蒲式耳的关口。09合约即将完成主力合约换月，预计后市油粕走势偏震荡。

【估值】中性

【风险】产区天气 宏观

## 6、棉花CF

【盘面】棉花延续涨势，主力9月收13625，涨1.34%。

【分析】农业农村部公布的中国棉花供需平衡表与上月保持一致，预计单产为2031公斤/公顷，产量为558万吨。新疆棉花长势总体好于去年，棉花供应充裕，关注下游需求变化。预期短期内棉花维持震荡，中长期随着棉花季节性需求的回暖，可能会迎来反弹。

【估值】中性

【风险】产区天气 宏观

## 7、集运欧线EC

【盘面】集运指数整体翻红。主力合约 2412 收于 2832 点，涨 3.38%。

【分析】上周五盘后公布的 SCFI 欧线运价为 4786 美元/TEU，较上期环比下跌 2.5%，回落幅度较上期扩大了 0.8 个百分点，进入下行趋势，基本符合市场预期。由于季节性需求回落及旺季前置加班船运力宽松，现货端多家航司调低运价，需求端处于旺季转淡季的过程中，市场开始博弈降价的速度和幅度。盘后公布的 SCFIS 欧线为 6060.83 点，环比下跌 1.6%，覆盖 wk32 实际离港航次的成交价格，计入 08 合约首个交割标的指数。后续持续关注下旬运价调整幅度。

【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

