



# 每日国内期货收盘数据和点评

制作日期：2024年8月13日

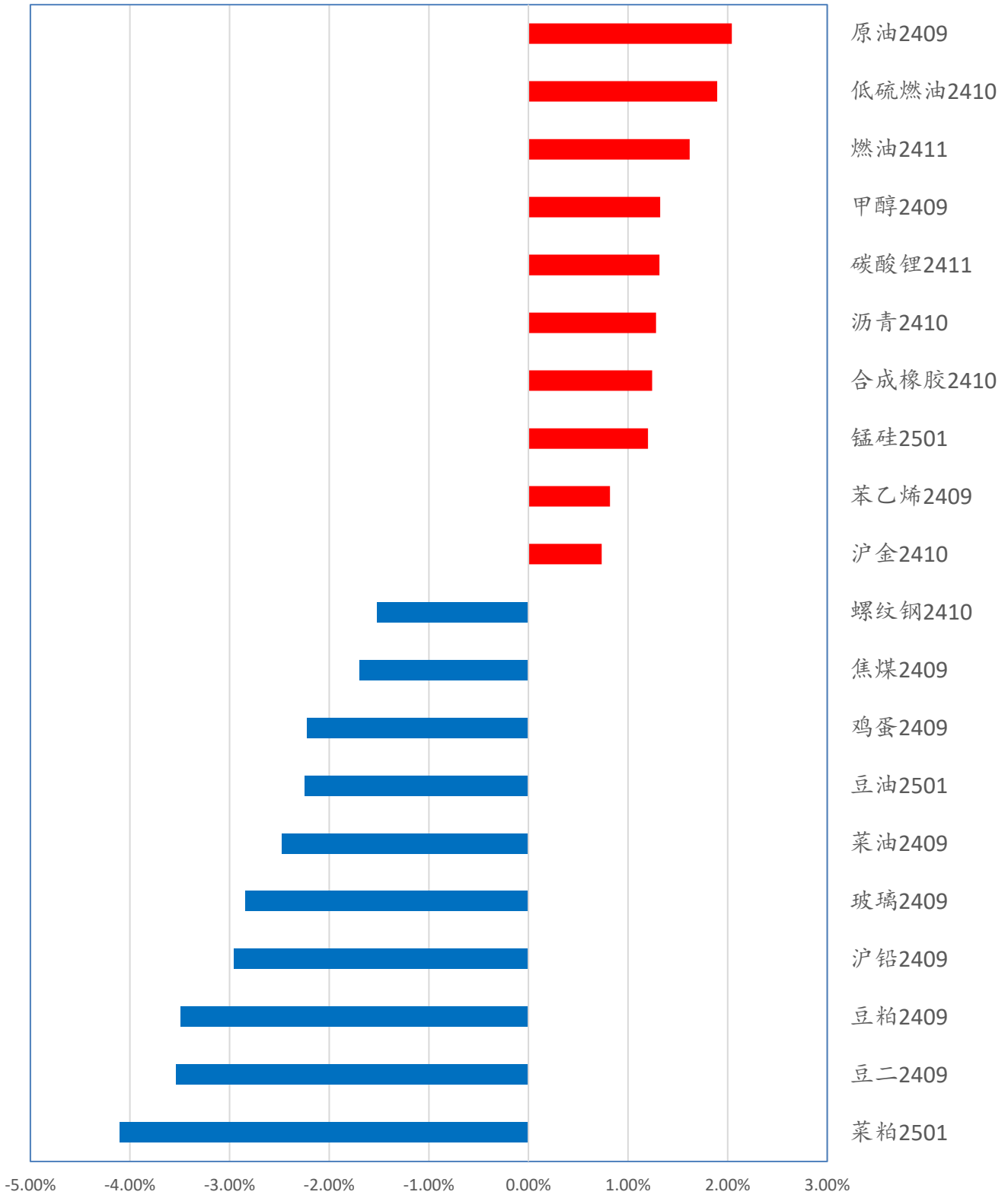
内容摘要：

- 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 (%)

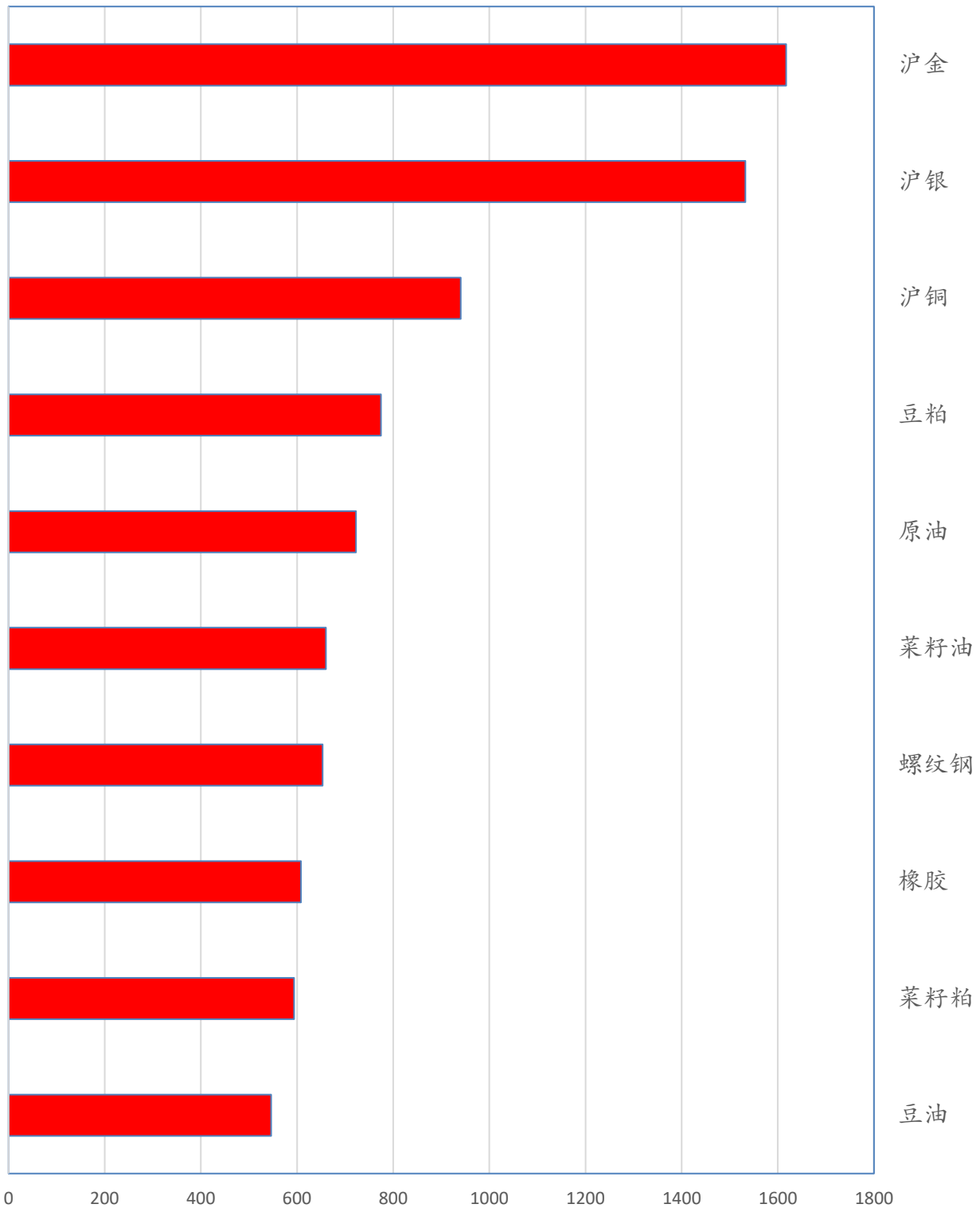


数据来源：文华财经



每日商品期货成交金额排名

商品期货成交金额（亿元）

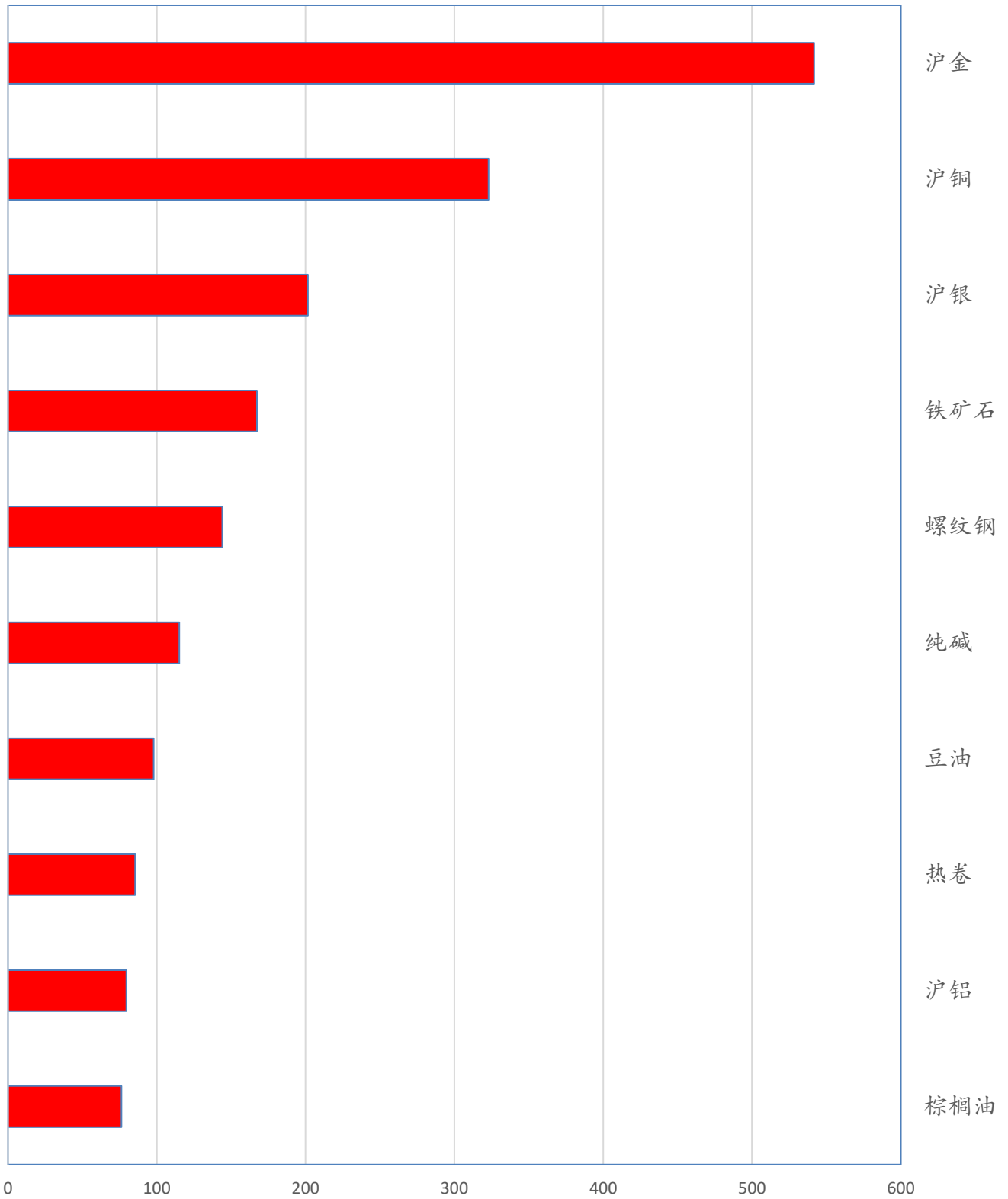


数据来源：文华财经



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)

2024/8/13

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	4.4	4.33	0.13%	3330	3334.4	
	IH	上证50	1.3	1.94	0.05%	2316.4	2317.7	
	IM	中证1000	7.8	12.08	0.17%	4689.8	4697.6	
	IC	中证500	2.6	6.08	0.06%	4729.2	4731.8	
金属	CU	铜	80.0	935.00	0.11%	72280	72360	上海物贸
	AL	铝	5.0	195.00	0.03%	18995	19000	上海物贸
	ZN	锌	-10.0	275.00	-0.04%	23065	23055	上海物贸
	NI	镍	1050.0	1040.00	0.81%	128330	129380	上海金属网
	AO	氧化铝	21.0	43.00	0.54%	3884	3905	山东地区氧化铝中间价
	SS	不锈钢	725.0	55.00	5.03%	13675	14400	304/2B冷轧不锈钢卷太钢无锡
黑色	RB	螺纹钢	27.0	19.00	0.84%	3173	3200.0	上海HRB400E 20mm
	HC	热卷	-35.0	39.00	-1.06%	3335	3300	上海Q235B 4.75mm
	J	焦炭	-17.0	-18.50	-0.91%	1888	1871	天津港准一级冶金焦
	JM	焦煤	253.0	13.00	15.91%	1337	1590	山西晋中中硫主焦煤(S1.3)
	I	铁矿石	67.5	9.50	8.42%	734.5	802.0	青岛港金布巴粉
	SM	锰硅	24.0	-28.00	0.36%	6576	6600.0	内蒙FeMn65Si17+地区贴水400
	FG	玻璃	113.0	37.00	8.19%	1267	1380.0	华北地区5mm浮法玻璃含税价
能化	SC	原油	-17.2	-11.36	-3.05%	579.7	562.5	原油(阿曼)
	PG	液化石油气	658.0	18.00	12.61%	4562	5220.0	广州码头液化气(国产气)
	BU	沥青	216.0	-45.00	5.73%	3554	3770	华东主流市场价
	RU	天胶	-1555.0	-50.00	-10.76%	16005	14450	上海云南国营全乳胶(SCRWF)
	NR	20号标胶	-8.2	-21.28	-0.06%	12660	12652	泰国STR20青岛保税区库提价
	MA	甲醇	-10.0	-7.00	-0.41%	2450	2440	华东市场低端价
	L	塑料	110.0	-7.00	1.33%	8190	8300	齐鲁石化7042出厂价
	PP	聚丙烯	-5.0	-29.00	-0.07%	7585	7580	延安炼化t30s出厂价
	EB	苯乙烯	299.0	-6.00	3.10%	9361	9660	华东市场低端价
	V	PVC	16.0	83.00	0.30%	5395	5411	电石法全国均价
	PF	短纤	189.0	-2.00	2.53%	7296	7485	华东市场涤纶短纤1.4D主流价
	EG	乙二醇	38.0	0.00	0.83%	4537	4575	华东市场低端价
	TA	PTA	420.0	-28.00	6.98%	5600	6020	CCFEI价格指数(内盘)
	LC	碳酸锂	1000.0	-1000.00	1.28%	77000	78000	电池级碳酸锂市场价
SA	纯碱	142.0	25.00	7.89%	1658	1800	华北地区沙河市场重质纯碱主流价	
UR	尿素	68.0	-15.00	3.19%	2062	2130	河南地区小颗粒主流价	
农产品	A	豆一	180.0	19.00	3.81%	4540	4720	哈尔滨巴彦国一等大豆
	Y	豆油	202.0	102.00	2.68%	7348	7550	张家港四级豆油
	P	棕榈油	62.0	-18.00	0.81%	7578	7640	黄埔港
	OI	菜油	53.0	53.00	0.66%	7997	8050	江苏南通四级菜油
	M	豆粕	63.0	104.00	2.14%	2877	2940	张家港
	RM	菜粕	-5.0	33.00	-0.23%	2175	2170	黄埔(加籽粕)
	SR	白糖	307.0	2.00	4.85%	6023	6330	广西一级糖报价
	CF	棉花	1355.0	210.00	9.09%	13545	14900	中国棉花价格指数3218B
	C	玉米	520.5	9.00	18.49%	2294	2815	收购价平均价
	CS	玉米淀粉	195.0	13.00	6.66%	2735	2930	长春出厂报价
	LH	生猪	2175.0	70.00	10.51%	18525	20700	河南出厂价
JD	鸡蛋	892.0	28.00	18.74%	3868	4760	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		2024/8/13	
碳酸锂	0.67%	沪镍	29.83%	豆一	55.30%
工业硅	1.63%	尿素	30.56%	沪锡	55.57%
对二甲苯	5.57%	锰硅	31.40%	沪铅	57.52%
500股指	10.35%	焦炭	32.61%	燃料油	57.86%
PVC	11.03%	热卷	32.86%	淀粉	58.41%
烧碱	13.82%	生猪	33.65%	沥青	58.75%
棉花	14.63%	螺纹钢	33.88%	原油	60.57%
不锈钢	15.22%	300股指	33.92%	玉米	61.04%
纯碱	15.68%	甲醇	33.99%	沪铝	61.64%
菜籽粕	17.86%	乙二醇	34.72%	白糖	67.17%
1000股指	18.50%	聚丙烯	36.04%	BR橡胶	68.26%
玻璃	19.66%	棕榈油	40.79%	苯乙烯	69.99%
红枣	20.31%	纸浆	41.41%	沪银	73.09%
硅铁	21.02%	集运欧线	41.57%	氧化铝	75.91%
50股指	22.94%	铁矿石	42.03%	沪铜	77.87%
菜籽油	24.29%	鸡蛋	44.17%	二年债	80.08%
豆油	24.62%	短纤	45.23%	20号胶	82.79%
塑料	24.85%	豆粕	45.49%	三十年债	87.58%
焦煤	25.12%	豆二	47.29%	十年债	93.26%
苹果	25.32%	液化气	47.75%	五年债	94.10%
橡胶	26.05%	LU燃油	48.09%	沪金	95.72%
花生	26.62%	沪锌	53.97%		
PTA	26.75%	国际铜	54.51%		

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】夜盘沪金一路走高，白天开盘略有上涨后回落，午后窄幅波动，沪金主力10月收于569.46，涨幅为1.22%，成交和持仓均放大。沪银走势弱于黄金，主力12月收于7152，涨幅为0.89%，成交与持仓均略减。

【分析】受到中东地缘冲突升温带动的避险需求，昨日COMEX黄金创收盘历史新高，市场关注明天晚八点半公布的美国PPI，会对美联储9月临近的降息路径产生进一步的参考。目前沪金处于550-580之间的震荡，维持多配策略，但需注意黄金处于高位后的短线调整压力，重视持仓管理。

【估值】偏高

【风险】市场情绪 美联储降息

### 2、铜铝CU&AL

【盘面】沪铜夜盘震荡走高，主力合约突破73000整数关，白天盘震荡回落，午后跌幅略有扩大，主力9月收72280，涨0.84%，成交略放大，总仓略减。沪铝夜盘高开低走，白天盘扩仓下行，午后再创日内新低，主力9月收18995，跌0.78%，成交放大，总仓增加接近1.7万手。

【分析】本周中美重要经济数据较多，如美国周三CPI，影响市场对于未来降息路径的判断，本周也将公布国内7月M1、M2和社融等数据，这些数据能反映国内经济的活性，5月和6月上述数据不佳，也是工业品价格包括有色价格持续下行的主要原因之一。建议谨慎对待本次沪铜的反弹，目前沪铜在跌近3月份的突破平台后获得支撑，该平台的时间跨度超过12个月，但向上反弹动力还需要宏观和产业方面数据支持，特别是做为宏观金属的铜，对于宏观数据的敏感度会更高一些。

【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3173，跌1.52%，HC2410收于3335，跌1.16%。

【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。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5660，跌0.56%，SP2501收于5794元/吨，跌0.52%。

【分析】宏观方面，全球经济衰退预期进一步加强，全球纸浆需求偏弱；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49万余吨，其中俄针占比较高，山东俄针现货价格5700元/吨，压制期货盘面价格。预计纸浆09合约震荡偏弱运行。

【估值】中等

【风险】供应事故扰动

## 5、油脂油料

【盘面】豆油主力1月收7348，跌2.44%；菜油主力9月收7997，跌2.32%；棕榈油主力9月收7578，跌1.71%；豆粕主力9月收2877，跌3.46%，菜粕主力01月收2175，跌3.93%。

【分析】USDA发布的8月供需报告数据偏空，新作大豆单产上调1.2蒲式耳/英亩至53.2蒲式耳/英亩，收割面积调增至86.3百万英亩，农场种植成本降至1080蒲式耳/英亩，产量调增至45.89亿蒲式耳。USDA报告利空，市场悲观情绪蔓延，美豆继续下探，国内油粕大幅下跌，双粕期价跌破四年低点。根据Mysteel数据显示，国内三大油脂商业库存同比增幅2.21%。在全球供应充裕的压力下，预计油粕跌多涨少。

【估值】中性

【风险】产区天气 宏观

## 6、棉花CF

【盘面】棉花震荡走弱，主力9月收13545，跌0.55%。

【分析】USDA8月供需报告显示，全球2024/2025年度棉花产量预估下调255万包至1.1764亿包，全球棉花消费量预估下调100万包，期初、期末库存也悉数下调，数据公布后美棉跳长3%。USDA周度作物生长报告显示，截至到8约11日当周，美棉优良率为46%，高于上周和去年同期。国内新疆棉花产区天气利好，市场丰产预期较强，预期短期内棉花震荡偏弱。

【估值】中性

【风险】产区天气 宏观

## 7、集运欧线EC

【盘面】集运主力合约 2412 收于 2818.1 点，涨 0.67%。

【分析】现货端，马士基开放 wk35 试舱运价，参考上海至弗利克斯托大柜 7000，低于上周二次调降后的大柜 7100，跌幅为 100 美元； ONE 也下调了上海至鹿特丹的运价至 5147/7808。10 合约当前交易的主要矛盾是运价回落的速度和幅度，当前市场对未来运价波动分歧较大，多空博弈激烈。地缘端，英美联军空袭也门西部荷台达省，沙特对也门北部的萨达省也进行了空袭，从盘面来看，其地缘消息影响程度和持续性都有所减弱。据以色列媒体报道：如果伊朗或真主党发动袭击，周四恢复停火谈判的会议可能无法举行。后续关注停火谈判是否顺利举行。

【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

