

商品期货

Commodity Futures

(公开版)

驭龙量化评估报告

基于驭龙指标体系的品种多周期量化评估



复核确认

复核人:胡俊 执业编号 Z0023785

2026年08月12日 15:34(公开版), 本报告全部量化数值、标准化中性描述文本由自研 Python 程序生成; 本人完成全部品种数据、文本合规复核, 全文无涨跌预判、无任何交易引导类表述, 数据核对无误, 同意公开渠道对外发布。

本报告仅作行情量化复盘交流, 不提供任何个性化交易咨询、操作策略服务。

公开提示

本公开版报告面向全市场普通投资者, 不构成任何投资咨询服务, 各类期货品种波动风险较高, 投资者自主承担全部盈亏。

【免责声明】 以下报告内容来自交易咨询部胡俊(执业编号Z0023785),以公开市场信息为主要依据,具有时效性、针对性和局限性,仅供参考或交流,内容不构成对任一方的操作建议,期货市场存在不可预知的潜在变化和 risk,若操作则盈亏自负。以下期货行情信息分析观点当日有效,不对该观点进行后续跟踪。具体交易咨询(策略)服务详见APP交易咨询服务社区。

技术指标作为辅助研判工具,有其客观固有缺陷,即概率性、导向性、局限性,不会降低投资市场和操作的固有风险,仅供参考使用。另提示,技术指标上的**【箭头或字母】**仅为标记作用,请谨慎参考。期货有风险,交易需谨慎!

【驭龙指标说明】 驭龙指标以历史行情数据为基础,通过加权算法构建而成;量化模型依托驭龙指标,结合历史乖离数据进行量化处理,形成客观分析依据。驭龙星级、龙轨指标为纯历史数据量化统计工具,存在滞后性,不保证对未来行情具备预测效力,不可单独作为交易依据。

【产业信息提示】 产业信息为当日公开历史资讯,后续供需、地缘可能发生变化,仅供静态复盘参考。

上海东亚期货有限公司

交易咨询业务:沪证监许可【2012】1515号

交易咨询部:胡俊(执业编号 Z0023785)

审核:唐韵(执业编号 Z0002422)

生成时间:2026年08月12日 15:34(公开版)

本报告仅供参考,不构成投资建议,投资有风险,入市需谨慎。



品种检索

[黑色系板块](#)

[有色金属板块](#)

[贵金属/新能源/欧线板块](#)

[化工板块](#)

[原油产业链板块](#)

[农产品板块](#)

[股指期货板块](#)

[其他板块](#)

本报告仅供参考,不构成投资建议,投资有风险,入市需谨慎。

黑色系板块分析

热卷

[返回检索](#)

黑色系板块 · 最新价:3239.0(日收盘)

日:下跌 | 中周期:震荡(龙轨下方) | 小周期:震荡(龙轨下方)

技术面解读: 价格在轨道下方运行,中周期在轨道下方震荡整理,小周期在轨道下方整理。三周期价格均运行于轨下,多周期方向一致。当前偏离程度在合理范围,价格运行延续性保持。偏离若扩大,后续可能出现向轨道收敛的技术波动。(本内容及观点仅供参考,不构成任何投资建议。)



资金情况: 多头269,158手(减3.1%) | 空头168,836手(减4.3%) | 净空收0.12万 | 多空比1.59

当日成交平稳,近10日主力总持仓回落至143.2万手附近(2026-07-30单日大幅增仓8.1%)。近10日多头持仓小幅回落(2026-07-30单日大幅增仓)。近10日净多持仓由11.0万手收窄至10.88万手。多头控盘格局稳固。近10日资金呈现缩量减仓迹象。

仓单分析: 当前注册仓单253,343张合计253,343张。近7日减少19,410张(-7.1%),近30日减少118,060张(-31.8%),增速明显加快。历史分位2.4%,处于近三年低位,交割节奏正常。(仓单数据来源于:同花顺iFinD)

基本面参考: 热卷供需双缩、累库未止:产量288万吨、表需286万吨,减产后仍累库。制造业用钢缺乏弹性,冷轧逆势去库形成结构性对比,热卷相对冷轧弱势扩大。钢厂盈利恶化、铁水回落对板材供给形成压制,但需求端同样缺乏亮点。核心关注点:制造业PMI及排产变化、卷螺价差运行、出口环境变化。(信息来源:东亚期货每日商品期市纵览2026年08月11日)

黑色系板块 · 最新价:1476.0(日收盘)

日:震荡 | 中周期:震荡(龙轨上方) | 小周期:震荡(龙轨上方)

技术面解读: 日线价格区间波动, 中周期在轨道上方震荡整理, 小周期在轨道上方整理。小周期价格运行于轨上。短周期价格运行于轨上, 短周期若维持轨上运行, 方向趋于明确。(本内容及观点仅供参考, 不构成任何投资建议。)



资金情况: 多头46,903手(增21.1%) | 空头24,927手(增17.5%) | 净空扩0.39万 | 多空比1.88

当日成交平稳,近10日主力总持仓回升至36.2万手附近(2026-08-11单日大幅增仓7.3%)。近10日多头持仓持续增仓(2026-08-03单日大幅增仓)。近10日净多持仓由1.48万手扩大至1.87万手。多头控盘格局稳固。近10日资金呈现放量增仓迹象。

仓单分析: 当前注册仓单2,100张合计2,100张。近7日减少101张(-4.6%), 近30日增加2,100张(+0.0%), 变动相对平稳。历史分位90.5%, 处于近三年高位水平, 注册仓单处于高位, 潜在交割压力较大, (仓单数据来源于:同花顺iFinD)

基本面参考: 供应端维持偏紧: 安监+蒙煤减量, 现货深度升水(基差+31%)。铁水从243降至238万吨已确认回落趋势, 焦煤刚需边际走弱。期货端前期暴跌后估值修复, 但钢厂亏损扩大对原料端形成负反馈压力。核心关注点: 铁水继续回落对焦煤刚需的冲击、蒙煤通关恢复、期现回归。(信息来源: 东亚期货每日商品期市纵览2026年08月11日)

硅铁

黑色系板块 · 最新价:5924.0(日收盘)

日:上涨 | 中周期:震荡(龙轨上方) | 小周期:震荡(龙轨上方)

技术面解读: 价格在轨道上方运行, 中周期在轨道上方震荡整理, 小周期在轨道上方整理。三周期价格均运行于轨上, 多周期方向一致。当前偏离程度在合理范围, 价格运行延续性保持。偏离若扩大, 后续可能出现向轨道收敛的技术波动。(本内容及观点仅供参考, 不构成任何投资建议。)



资金情况: 多头43,518手(增75.0%) | 空头52,614手(增62.0%) | 净空收0.12万 | 多空比0.83

当日成交平稳,近10日主力总持仓回升至38.3万手附近(2026-08-04单日大幅增仓47.6%)。近10日多头持仓持续增仓(2026-08-04单日大幅增仓)。近10日净空持仓由0.69万手扩大至0.81万手。近10日多空力量维持均衡。近10日资金呈现放量增仓迹象。

仓单分析: 当前注册仓单3,730张合计3,730张。近7日减少367张(-9.0%), 近30日增加661张(+21.5%), 呈温和变动。历史分位38.1%, 处于中等偏低水平, 交割节奏正常, (仓单数据来源于:同花顺iFinD)

基本面参考: 甘肃万利全线停炉日减700吨, 宁夏、青海、甘肃结算电价上涨, 成本支撑走强。样本企业库存8.85万吨环比增加, 供需趋向宽松。兰炭小料小幅上调, 电价托底效应明显。但钢厂盈利率走低、金属镁淡季检修增多, 需求边际走弱。(信息来源: 东亚期货每日商品期市纵览2026年08月11日)

螺纹钢

黑色系板块 · 最新价:3010.0(日收盘)

日:反弹 | 中周期:震荡(龙轨下方) | 小周期:震荡(龙轨下方)

技术面解读: 日线呈短期上行波动, 中周期在轨道下方震荡整理, 小周期在轨道下方整理。小周期价格率先下探至轨下。短期上行有减缓迹象。短周期若延续轨下运行, 短期上行终止概率增加。(本内容及观点仅供参考, 不构成任何投资建议。)



资金情况: 多头221,821手(减10.5%) | 空头198,208手(减10.1%) | 净空收0.55万 | 多空比1.12

当日缩量,近10日主力总持仓回落至216.6万手附近(2026-07-30单日大幅增仓13.6%)。近10日多头持仓明显减仓(2026-07-30单日大幅增仓)。近10日净多持仓由4.33万手收窄至3.78万手。近10日多空力量维持均衡。近10日资金呈现缩量减仓迹象。

仓单分析: 当前注册仓单97,712张合计97,712张。近7日增加9,618张(+10.9%), 近30日增加32,731张(+50.4%), 增速明显加快。历史分位85.7%, 处于近三年高位水平, 交割节奏正常, (仓单数据来源于:同花顺iFinD)

基本面参考: 最新产库数据呈需求崩塌格局: 螺纹表需178万吨(-10.28%)为近五周最低, 产量虽降5.25%但远不足以对冲。社库厂库同增, 钢厂盈利降至32%、吨钢亏损超320元, 负反馈正加速向上游传导。铁水产量已从前期高位243万吨回落至238万吨, 供给端缩减但需求拖累更重。核心关注点: 8月下旬旺季需求能否兑现、铁水产量是否继续回落、减产力度。(信息来源: 东亚期货每日商品期市纵览2026年08月11日)

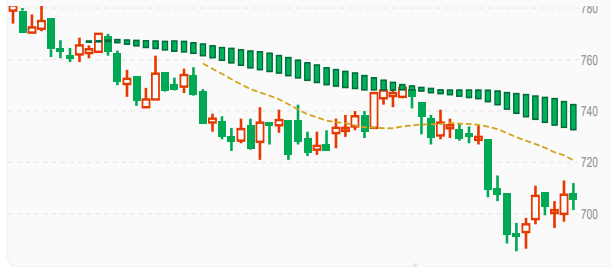
铁矿石

黑色系板块 · 最新价:705.5(日收盘)

日:反弹 | 中周期:震荡(龙轨下方) | 小周期:震荡(龙轨下方)

技术面解读: 日线呈短期上行波动，中周期在轨道下方震荡整理，小周期在轨道下方整理。小周期价格率先下探至轨下。短期上行有减缓迹象。短周期若延续轨下运行，短期上行终止概率增加。（本内容及观点仅供参考，不构成任何投资建议。）

近60日主连K线走势(数据来源:同花顺iFinD)



资金情况: 多头29,899手(增34.8%) | 空头40,059手(增17.6%) | 净空扩0.13万 | 多空比0.75

当日成交平稳,近10日主力总持仓回升至44.1万手附近(2026-07-30单日大幅增仓18.6%)。近10日多头持仓持续增仓(2026-08-12单日大幅增仓)。近10日净空持仓由1.1万手收窄至0.97万手。近10日多空力量维持均衡。近10日资金呈现放量增仓迹象。

仓单分析: 当前注册仓单4,800张合计4,800张。近7日增加1,750张(+57.4%)，近30日增加1,150张(+31.5%)，增速明显加快。历史分位100.0%，处于近三年高位水平，交割节奏正常，(仓单数据来源于:同花顺iFinD)需关注后续仓单增速是否放缓及下游承接能力。

基本面参考: 供给端宽松:港口库存累积至1.67亿吨，到港高位，海外发运维持。铁水已从前期243万吨高位回落至238万吨，需求端边际走弱确认。钢厂盈利率降至32%，低价补库意愿有限，现货外矿指数偏弱运行。核心关注点:铁水继续回落的速度、港口库存去化拐点、海外矿山发运节奏。（信息来源:东亚期货每日商品期市纵览2026年08月11日）

焦炭

黑色系板块 · 最新价:1906.0(日收盘)

日:震荡 | 中周期:震荡(龙轨上方) | 小周期:震荡(龙轨上方)

技术面解读: 日线价格区间波动，中周期在轨道上方震荡整理，小周期在轨道上方整理。小周期价格运行于轨上。短周期价格运行于轨上，短周期若维持轨上运行，方向趋于明确。（本内容及观点仅供参考，不构成任何投资建议。）

近60日主连K线走势(数据来源:同花顺iFinD)



资金情况: 多头5,836手(减11.3%) | 空头7,081手(增1.6%) | 净空收0.09万 | 多空比0.82

当日缩量,近10日主力总持仓回落至3.6万手附近(2026-08-06单日大幅减仓8.9%)。近10日多头持仓明显减仓(2026-08-06单日大幅减仓)。近10日净空持仓由0.02万手扩大至0.11万手。近10日空头控场优势进一步加强。近10日资金呈现缩量减仓迹象。

仓单分析: 当前注册仓单1,481张合计1,481张。近7日增加44张(+3.1%)，近30日减少102张(-6.4%)，变动相对平稳。历史分位54.8%，处于中等偏高水平，交割节奏正常，(仓单数据来源于:同花顺iFinD)

基本面参考: 焦炭第三轮降价已落地（湿熄降50元/吨、干熄降55元/吨），十轮提涨后正式进入降价周期。铁水降至238万吨叠加钢厂盈利率32%、吨钢亏损320+，刚需走弱+利润倒逼推动焦炭连续降价。焦化厂吨焦盈利由盈转亏（-112元），开工率降至68%，被动减产开始。核心关注点:钢厂检修计划及复产预期、焦化利润修复节点、第四轮降价幅度。（信息来源:东亚期货每日商品期市纵览2026年08月11日）

锰硅

黑色系板块 · 最新价:5814.0(日收盘)

日:反弹 | 中周期:穿越(站上) | 小周期:震荡(龙轨上方)

技术面解读: 中周期站上龙轨，向上突破，小周期在轨道上方整理，小周期价格回升，与日线短期上行波动方向一致。日线呈短期上行波动，短周期价格运行于轨上，短期上行状态暂时保持。（本内容及观点仅供参考，不构成任何投资建议。）

近60日主连K线走势(数据来源:同花顺iFinD)



资金情况: 多头61,196手(增69.4%) | 空头53,644手(增25.3%) | 净空扩1.23万 | 多空比1.14

当日成交平稳,近10日主力总持仓回升至46.5万手附近(2026-08-10单日大幅增仓24.8%)。近10日多头持仓持续增仓(2026-08-05单日大幅增仓)。近10日净多持仓由0.94万手收窄至0.29万手。近10日多头控场优势有所加强。近10日资金呈现放量增仓迹象。

仓单分析: 当前注册仓单65,858张合计65,858张。近7日减少857张(-1.3%)，近30日减少9,995张(-13.2%)，呈温和变动。历史分位7.1%，处于近三年低位，交割节奏正常，(仓单数据来源于:同花顺iFinD)

基本面参考: 周产量降至15.7万吨，连续六周下降，开工率28.2%。但样本企业库存累至46.3万吨，持续刷新近年新高。锰矿价格阴跌，天津港南非半碳酸酸降至36.5元/吨度，9月外盘报价进一步下调，化工焦仍有提降预期，成本支撑下移。河钢8月招标询盘5800元/吨环比跌150元，需求低迷。（信息来源:东亚期货每日商品期市纵览2026年08月11日）

有色金属板块分析

沪铅

[返回检索](#)

有色金属板块 · 最新价:15905.0(日收盘)

日:反弹 | 中周期:震荡(龙轨上方) | 小周期:震荡(龙轨上方)

技术面解读: 短期上行波动延续, 中周期在轨道上方震荡整理, 小周期在轨道上方整理。小周期价格回升, 与日线短期上行波动方向一致。短期上行尚未停止, 偏离若扩大, 上方可能出现轨道参考。(本内容及观点仅供参考, 不构成任何投资建议。)



资金情况: 多头4,951手(减47.6%) | 空头4,996手(减41.3%) | 净空收0.25万 | 多空比0.99

当日成交平稳,近10日主力总持仓回落至4.5万手附近(2026-08-05单日大幅减仓18.0%)。近10日多头持仓明显减仓(2026-08-10单日大幅减仓)。近10日净空持仓由0.4万手收窄至0.15万手。近10日空头控场优势进一步加强。近10日资金呈现缩量减仓迹象。

仓单分析: 当前注册仓单61,228张合计61,228张。近7日增加2,275张(+3.9%), 近30日减少3,362张(-5.2%), 变动相对平稳。历史分位42.9%, 处于中等偏低水平, 交割节奏正常, (仓单数据来源于:同花顺FinD)

基本面参考: 铅仍是供需双弱格局: 原生铅产量缓慢恢复, 再生端亏损和废电瓶货源偏紧限制增量, 但尚不足以形成主动减产; 蓄电池开工小幅回升, 终端补库力度仍弱。(信息来源: 东亚期货每日商品期市纵览2026年08月11日)

沪锡

[返回检索](#)

有色金属板块 · 最新价:431480.0(日收盘)

日:上涨 | 中周期:震荡(龙轨上方) | 小周期:震荡(龙轨上方)

技术面解读: 日线价格运行于龙轨上方, 中周期在轨道上方震荡整理, 小周期在轨道上方整理。三周期价格均运行于轨上, 多周期方向一致。目前与轨道偏离有限, 价格运行延续性保持。后续偏离若继续扩大, 价格可能向轨道方向收敛。(本内容及观点仅供参考, 不构成任何投资建议。)



资金情况: 多头4,736手(减11.0%) | 空头3,661手(减7.1%) | 净空收0.04万 | 多空比1.29

当日成交平稳,近10日主力总持仓回落至4.9万手附近(2026-07-31单日大幅增仓24.6%)。近10日多头持仓明显减仓(2026-07-31单日大幅增仓)。近10日多空力量维持均衡。近10日资金呈现缩量减仓迹象。

仓单分析: 当前注册仓单5,199张合计5,199张。近7日增加718张(+16.0%), 近30日减少21张(-0.4%), 呈温和变动。历史分位69.0%, 处于中等偏高水平, 交割节奏正常, (仓单数据来源于:同花顺FinD)

基本面参考: 缅甸锡矿复产进度不及预期, 原料端存在约束, 国内冶炼厂受原料制约, 产出释放有限。需求端处于传统消费淡季, 电子、马口铁行业开工偏弱, 下游仅维持刚需采购, 现货成交偏弱。(信息来源: 东亚期货每日商品期市纵览2026年08月11日)

沪铜

[返回检索](#)

有色金属板块 · 最新价:108210.0(日收盘)

日:上涨 | 中周期:远离(龙轨上方) | 小周期:远离(龙轨上方)

技术面解读: 日线价格运行于龙轨上方, 中周期偏离上轨较远, 距离拉大, 小周期偏离上轨, 距离较大。三周期价格均运行于轨上, 多周期方向一致。目前与轨道偏离有限, 价格运行延续性保持。后续偏离若继续扩大, 价格可能向轨道方向收敛。(本内容及观点仅供参考, 不构成任何投资建议。)



资金情况: 多头27,843手(增33.8%) | 空头17,316手(增18.0%) | 净空扩0.41万 | 多空比1.61

当日成交平稳,近10日主力总持仓回升至17.1万手附近(2026-07-30单日大幅增仓8.4%)。近10日多头持仓持续增仓(2026-07-30单日大幅增仓)。近10日净多持仓由0.57万手扩大至0.98万手。近10日多头控场优势有所加强。近10日资金呈现放量增仓迹象。

仓单分析: 当前注册仓单24,131张合计24,131张。近7日减少776张(-3.1%), 近30日减少45,948张(-65.6%), 增速明显加快。历史分位14.3%, 处于近三年低位, 交割节奏正常, (仓单数据来源于:同花顺FinD)

基本面参考: 铜精矿加工费维持低位, 海外矿产端扰动持续, 国内冶炼产出稳步释放。需求端处于传统消费淡季, 下游以刚需采购为主, 高价抑制主动补库, 部分地区物流扰动影响提货节奏。(信息来源: 东亚期货每日商品期市纵览2026年08月11日)

沪铝

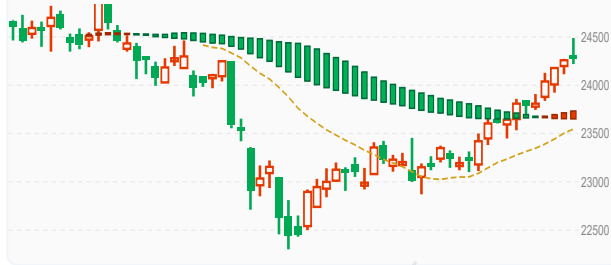
返回检索

有色金属板块 · 最新价:24290.0(日收盘)

日:上涨 | 中周期:震荡(龙轨上方) | 小周期:远离(龙轨上方)

技术面解读: 价格在轨道上方运行, 中周期在轨道上方震荡整理, 小周期偏离上轨, 距离较大。三周期价格均运行于轨上, 多周期方向一致。当前偏离程度在合理范围, 价格运行延续性保持。偏离若扩大, 后续可能出现向轨道收敛的技术波动。(本内容及观点仅供参考, 不构成任何投资建议。)

近60日主连K线走势(数据来源:同花顺iFinD)



资金情况: 多头32,347手(增21.5%) | 空头26,902手(增25.1%) | 净空扩0.04万 | 多空比1.20

当日成交平稳,近10日主力总持仓回升至21.4万手附近(2026-07-30单日大幅增仓9.1%)。近10日多头持仓持续增仓(2026-08-07单日大幅增仓)。近10日多空力量维持均衡。近10日资金呈现放量增仓迹象。

仓单分析: 当前注册仓单303,168张合计303,168张。近7日减少12,151张(-3.9%), 近30日减少112,824张(-27.1%), 呈温和变动。历史分位2.4%, 处于近三年低位, 交割节奏正常, (仓单数据来源于:同花顺iFinD)

基本面参考: 铝锭社会库存降至91.7万吨, 低库存与海外铝价高位共同支撑沪铝; 但电解铝利润超过7600元/吨、现货维持贴水, 显示当前价格领先于现实消费。(信息来源: 东亚期货每日商品期市纵览2026年08月11日)

沪镍

返回检索

有色金属板块 · 最新价:128710.0(日收盘)

日:下跌 | 中周期:接近(龙轨下方) | 小周期:震荡(龙轨下方)

技术面解读: 价格运行于轨下, 日线延续当前运行状态。中周期贴近龙轨下方运行, 偏离有限, 小周期在轨道下方整理。三周期价格均运行于轨下, 多周期方向一致。目前偏离合理, 价格运行延续。后续偏离若扩大, 可能向轨道回归。(本内容及观点仅供参考, 不构成任何投资建议。)

近60日主连K线走势(数据来源:同花顺iFinD)



资金情况: 多头14,115手(减0.7%) | 空头24,160手(减0.7%) | 净空扩0.01万 | 多空比0.58

当日缩量,近10日主力总持仓回落至14.0万手附近(2026-08-06单日大幅增仓10.4%)。近5日多头持仓小幅回落(2026-08-05单日大幅减仓)。空头控盘格局稳固。近10日资金呈现缩量减仓迹象。

仓单分析: 当前注册仓单100,769张合计100,769张。近7日减少232张(-0.2%), 近30日增加2,670张(+2.7%), 变动相对平稳。历史分位83.3%, 处于近三年高位水平, 交割节奏正常, (仓单数据来源于:同花顺iFinD)

基本面参考: 印尼镍铁、湿法产能持续释放, 国内电解镍冶炼存在成本压力, 镍矿港口库存维持高位。需求端不锈钢行业处于传统淡季, 新能源产业链排产有边际回暖, 但下游实业多以刚需采购为主, 现货成交一般。(信息来源: 东亚期货每日商品期市纵览2026年08月11日)

沪锌

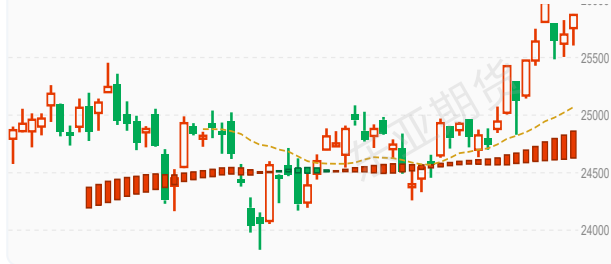
返回检索

有色金属板块 · 最新价:25870.0(日收盘)

日:上涨 | 中周期:远离(龙轨上方) | 小周期:远离(龙轨上方)

技术面解读: 日线在轨道上方, 中周期偏离上轨较远, 距离拉大, 小周期偏离上轨, 距离较大。三周期价格均运行于轨上, 多周期方向一致。偏离幅度不大, 价格运行于轨上。偏离若扩大, 可能出现向轨道收敛。(本内容及观点仅供参考, 不构成任何投资建议。)

近60日主连K线走势(数据来源:同花顺iFinD)



资金情况: 多头18,483手(增51.7%) | 空头7,748手(增24.8%) | 净空扩0.45万 | 多空比2.39

当日成交平稳,近10日主力总持仓回升至11.6万手附近(2026-08-03单日大幅增仓18.2%)。近10日多头持仓持续增仓(2026-08-05单日大幅增仓)。近10日净多持仓由0.55万手扩大至1.0万手。近10日多头控场优势有所加强。近10日资金呈现放量增仓迹象。

仓单分析: 当前注册仓单110,721张合计110,721张。近7日减少4,706张(-4.1%), 近30日减少5,417张(-4.7%), 变动相对平稳。历史分位9.5%, 处于近三年低位, 交割节奏正常, (仓单数据来源于:同花顺iFinD)

基本面参考: 锌精矿加工费维持低位, 矿端约束挤压冶炼利润, 炼厂产出释放受到一定牵制。需求端仍处在消费淡季, 下游镀锌企业开工一般, 仅维持刚需拿货, 现货成交表现平淡。(信息来源: 东亚期货每日商品期市纵览2026年08月11日)

氧化铝

返回检索

有色金属板块 · 最新价:2711.0(日收盘)

日:反弹 | 中周期:穿越(跌破) | 小周期:震荡(龙轨上方)

技术面解读:日线呈短期上行波动,中周期跌破龙轨,向下跌破,小周期在轨道上方整理。三周期方向不统一,各周期独立运行。短周期方向不一致,上行节奏不统一。等方向统一后,短期上行趋于明朗。(本内容及观点仅供参考,不构成任何投资建议。)

近60日主连K线走势(数据来源:同花顺iFinD)



资金情况:多头18,926手(增10.0%) | 空头20,804手(增7.9%) | 净空扩0.02万 | 多空比0.91

当日成交平稳,近10日主力总持仓回升至24.0万手附近(2026-07-30单日大幅增仓22.5%)。近10日多头持仓持续增仓(2026-07-30单日大幅增仓)。近10日多空力量维持均衡,近10日资金呈现放量增仓迹象。

仓单分析:当前注册仓单273,586张合计273,586张。近7日增加11,110张(+4.2%),近30日增加2,624张(+1.0%),变动相对平稳。历史分位73.8%,处于中等偏高水平,交割节奏正常,(仓单数据来源于:同花顺iFinD)

基本面参考:广西隆安和泰100万吨产能进入试生产,叠加现有运行产能边际增加,供应预期继续宽松。行业亏损及矿石成本对下方形成支撑,但在实质性减产出现前,成本更像减缓下行速度的缓冲垫,而非推动上行的发动机。关注新增项目达产速度及企业检修情况。(信息来源:东亚期货每日商品期市纵览2026年08月11日)

本报告仅供参考,不构成投资建议,投资有风险,入市需谨慎。

贵金属/新能源/欧线板块分析

多晶硅

返回检索

贵金属/新能源/欧线板块 · 最新价:38190.0(日收盘)

日:上涨 | 中周期:远离(龙轨上方) | 小周期:震荡(龙轨上方)

技术面解读:价格运行于轨上,日线延续当前运行状态。中周期偏离上轨较远,距离拉大,小周期在轨道上方整理。三周期价格均运行于轨上,多周期方向一致。目前偏离合理,价格运行延续。后续偏离若扩大,可能向轨道回归。(本内容及观点仅供参考,不构成任何投资建议。)

近60日主连K线走势(数据来源:同花顺iFinD)



资金情况:多头5,563手(减25.7%) | 空头9,388手(减25.9%) | 净空扩0.15万 | 多空比0.59

当日成交平稳,近10日主力总持仓回落至7.2万手附近(2026-08-04单日大幅减仓13.8%)。近10日多头持仓明显减仓(2026-08-04单日大幅减仓)。近10日净空持仓由0.57万手收窄至0.42万手。空头控盘格局稳固。近10日资金呈现缩量减仓迹象。

仓单分析:当前注册仓单21,900张合计21,900张。近7日增加720张(+3.4%),近30日增加6,150张(+39.0%),增速明显加快。历史分位100.0%,处于近三年高位水平,交割节奏正常,(仓单数据来源于:同花顺iFinD)

基本面参考:丰水期部分产能释放,虽有企业执行控产自律,但整体产出规模仍偏大,行业供应维持宽松格局。下游硅片企业开工有限,光伏终端承接力度不足,产业链以刚需拿货为主,现货成交偏弱。(信息来源:东亚期货每日商品期市纵览2026年08月11日)

工业硅

贵金属/新能源/欧线板块 · 最新价:8625.0(日收盘)

日:上涨 | 中周期:远离(龙轨上方) | 小周期:震荡(龙轨上方)

技术面解读: 价格在轨道上方运行, 中周期偏离上轨较远, 距离拉大, 小周期在轨道上方整理。三周期价格均运行于轨上, 多周期方向一致。当前偏离程度在合理范围, 价格运行延续性保持。偏离若扩大, 后续可能出现向轨道收敛的技术波动。
(本内容及观点仅供参考, 不构成任何投资建议。)

近60日主连K线走势(数据来源:同花顺iFinD)



资金情况: 多头23,730手(减31.9%) | 空头31,436手(减14.6%) | 净空收0.74万 | 多空比0.75

当日缩量,近10日主力总持仓回落至16.4万手附近(2026-08-03单日大幅减仓11.9%)。近10日多头持仓明显减仓(2026-08-07单日大幅减仓)。近10日净空持仓由0.42万手收窄至0.32万手。近10日空头控场优势进一步加强。近10日资金结构调整明显,多头减仓而空头增仓。

仓单分析: 当前注册仓单33,103张合计33,103张。近7日增加850张(+2.6%), 近30日增加1,327张(+4.2%), 变动相对平稳。历史分位97.6%, 处于近三年高位水平, 交割节奏正常, (仓单数据来源于:同花顺iFinD)

基本面参考: 西南丰水期部分产能复产, 部分企业受亏损约束主动控产, 整体供给依旧偏宽松。下游多晶硅有产能爬坡, 但有机硅、铝合金行业处于淡季, 终端实际拿货力度有限, 现货成交平淡。(信息来源: 东亚期货每日商品期市纵览2026年08月11日)

铂

贵金属/新能源/欧线板块 · 最新价:435.05(日收盘)

日:震荡 | 中周期:远离(龙轨上方) | 小周期:震荡(龙轨上方)

技术面解读: 日线价格区间波动, 中周期偏离上轨较远, 距离拉大, 小周期在轨道上方整理。小周期价格运行于轨上。短周期价格运行于轨上, 短周期若维持轨上运行, 方向趋于明确。(本内容及观点仅供参考, 不构成任何投资建议。)

近60日主连K线走势(数据来源:同花顺iFinD)



资金情况: 多头0手(平0%) | 空头0手(平0%) | 净空平0.0万 | 多空比0.00

当日缩量,近10日主力总持仓回升至1.6万手附近(2026-08-05单日大幅增仓7.0%)。近3日多头持仓维持稳定。空头控盘格局稳固。近10日资金呈现放量增仓迹象。

仓单分析: 当前注册仓单5,643张合计5,643张。近7日减少603张(-9.7%), 近30日增加230张(+4.2%), 呈温和变动。历史分位69.0%, 处于中等偏高水平, 交割节奏正常, (仓单数据来源于:同花顺iFinD)

基本面参考: 南非矿产扰动仍存, 市场延续年度缺口预期, 高价带动回收端产能有所释放。需求端汽车催化剂消费具备韧性, 氢能领域需求形成潜在增量。整体地上库存处于低位, 交易所仓单波动有限, 下游采购趋于谨慎, 实货成交未见明显放量。(信息来源: 东亚期货每日商品期市纵览2026年08月11日)

碳酸锂

贵金属/新能源/欧线板块 · 最新价:149700.0(日收盘)

日:反弹 | 中周期:穿越(站上) | 小周期:震荡(龙轨上方)

技术面解读: 中周期站上龙轨, 向上突破, 小周期在轨道上方整理, 小周期价格回升, 与日线短期上行波动方向一致。日线呈短期上行波动, 短周期价格运行于轨上, 短期上行状态暂时保持。(本内容及观点仅供参考, 不构成任何投资建议。)

近60日主连K线走势(数据来源:同花顺iFinD)



资金情况: 多头37,551手(减15.3%) | 空头44,739手(减6.0%) | 净空收0.43万 | 多空比0.84

当日成交平稳,近10日主力总持仓回落至23.4万手附近(2026-08-12单日大幅减仓8.2%)。近10日多头持仓明显减仓(2026-08-11单日大幅减仓)。近10日净空持仓由0.21万手扩大至0.65万手。近10日多空力量维持均衡。近10日资金呈现缩量减仓迹象。

仓单分析: 当前注册仓单32,551张合计32,551张。近7日增加4,898张(+17.7%), 近30日减少16,027张(-33.0%), 增速明显加快。历史分位21.4%, 处于中等偏低水平, 交割节奏正常, (仓单数据来源于:同花顺iFinD)

基本面参考: 国内锂盐厂检修造成阶段性产出收缩, 锂矿生产扰动带来短期情绪提振, 但远期海外锂资源增量预期仍存。下游锂电排产环比抬升, 储能需求具备韧性, 企业以刚需补库为主, 未出现大规模囤货, 产业链社会库存持续去化。(信息来源: 东亚期货每日商品期市纵览2026年08月11日)

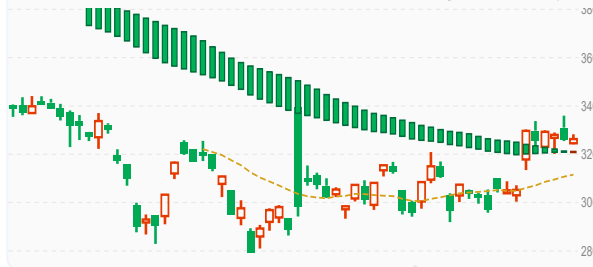
钼 [← BACK](#) [返回检索](#)

贵金属/新能源/欧线板块 · 最新价:326.3(日收盘)

日:震荡 | 中周期:震荡(龙轨上方) | 小周期:震荡(龙轨上方)

技术面解读: 日线价格区间波动, 中周期在轨道上方震荡整理, 小周期在轨道上方整理。小周期价格运行于轨上。短周期价格运行于轨上, 短周期若维持轨上运行, 方向趋于明确。(本内容及观点仅供参考, 不构成任何投资建议。)

近60日主连K线走势(数据来源:同花顺iFinD)



资金情况: 多头0手(平0%) | 空头0手(平0%) | 净空平0.0万 | 多空比0.00

当日缩量,近10日主力总持仓回升至1.0万手附近(2026-08-05单日大幅增仓7.5%)。近3日多头持仓维持稳定。空头控盘格局稳固。近10日资金呈现放量增仓迹象。

仓单分析: 当前注册仓单5,432张合计5,432张。近7日减少166张(-3.0%), 近30日增加378张(+7.5%), 变动相对平稳。历史分位45.2%, 处于中等偏低水平, 交割节奏正常, (仓单数据来源于:同花顺iFinD)

基本面参考: 矿产供给保持释放, 汽车催化回收货源增加, 市场整体呈供应过剩格局。需求端受电动车渗透率提升及铂代钼技术影响, 汽车领域需求延续承压, 下游企业采购偏谨慎。(信息来源: 东亚期货每日商品期市纵览2026年08月11日)

化工板块板块分析

苯乙烯 [← BACK](#) [返回检索](#)

化工板块板块 · 最新价:8330.0(日收盘)

日:上涨 | 中周期:接近(龙轨上方) | 小周期:穿越(跌破)

技术面解读: 日线在轨上运行, 中周期贴着龙轨上沿运行, 偏离不大, 小周期价格运行至龙轨下方。三周期方向不统一, 各周期独立运行。短周期方向不一致。等方向统一后, 运行特征趋于清晰。(本内容及观点仅供参考, 不构成任何投资建议。)

近60日主连K线走势(数据来源:同花顺iFinD)



资金情况: 多头35,822手(增1.6%) | 空头23,589手(减19.9%) | 净空扩0.77万 | 多空比1.52

当日成交平稳,近10日主力总持仓回落至14.4万手附近(2026-08-12单日大幅减仓10.1%)。多头持仓维持稳定(2026-08-11单日大幅减仓)。近10日净多持仓由0.11万手扩大至0.88万手。近10日多头控场优势有所加强。近10日资金呈现缩量减仓迹象。

仓单分析: 当前注册仓单0张合计0张。近30日减少520张(-100.0%)。历史分位23.8%, 处于中等偏低水平, 交割节奏正常, (仓单数据来源于:同花顺iFinD)

基本面参考: 供需层面, 苯乙烯市场低供给格局延续; 下游整体需求小幅走弱。成本方面, 纯苯市场货源供应有所增加, 场内流通偏紧局面得到缓解, 但原油持续走强带动纯苯商谈重心上行, 为苯乙烯形成稳固成本支撑。(信息来源: 东亚期货每日商品期市纵览2026年08月11日)

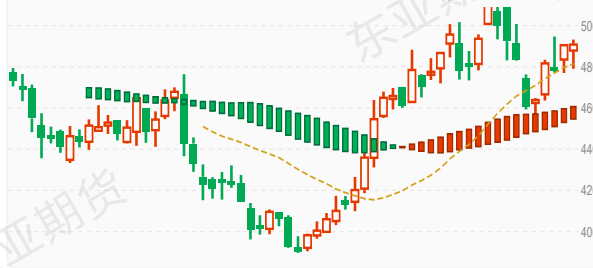
乙二醇 [← BACK](#) [返回检索](#)

化工板块板块 · 最新价:4908.0(日收盘)

日:上涨 | 中周期:震荡(龙轨上方) | 小周期:震荡(龙轨上方)

技术面解读: 日线价格运行于龙轨上方, 中周期在轨道上方震荡整理, 小周期在轨道上方整理。三周期价格均运行于轨上, 多周期方向一致。目前与轨道偏离有限, 价格运行延续性保持。后续偏离若继续扩大, 价格可能向轨道方向收敛。(本内容及观点仅供参考, 不构成任何投资建议。)

近60日主连K线走势(数据来源:同花顺iFinD)



资金情况: 多头36,602手(减2.8%) | 空头32,517手(减25.8%) | 净空扩1.07万 | 多空比1.13

当日成交平稳,近10日主力总持仓回落至32.2万手附近(2026-08-05单日大幅减仓14.6%)。近10日多头持仓小幅回落(2026-08-05单日大幅减仓)。近10日净多持仓由0.64万手收窄至0.43万手。近10日多头控场优势有所加强。近10日资金呈现缩量减仓迹象。

仓单分析: 当前注册仓单4,270张合计4,270张。近7日减少267张(-5.9%), 近30日减少1,163张(-21.4%), 呈温和变动。历史分位45.2%, 处于中等偏低水平, 交割节奏正常, (仓单数据来源于:同花顺iFinD)

基本面参考: 部分装置近期推迟检修, 8月产量可能小幅提升, 进口偏低, 华东港口库存整体处于去库通道, 到港压力不大, 当前交易主线更多偏地缘; 需求端下游聚酯开工率变化不大, 织造终端当前处于淡季, 所以下游聚酯产销依旧较差, 预期层面存在金九银十需求旺季的利多, 可能对价格形成支撑。(信息来源: 东亚期货每日商品期市纵览2026年08月11日)

玻璃

返回检索

化工板块板块 · 最新价:878.0(日收盘)

日:下跌 | 中周期:震荡(龙轨下方) | 小周期:震荡(龙轨下方)

技术面解读:日线价格运行于龙轨下方，中周期在轨道下方震荡整理，小周期在轨道下方整理。三周期价格均运行于轨下，多周期方向一致。目前与轨道偏离有限，价格运行延续性保持。后续偏离若继续扩大，价格可能向轨道方向收敛。（本内容及观点仅供参考，不构成任何投资建议。）



资金情况: 多头71,985手(减29.3%) | 空头149,995手(减14.6%) | 净空收0.77万 | 多空比0.48

当日成交平稳,近10日主力总持仓回落至122.4万手附近(2026-07-31单日大幅减仓9.9%)。近10日多头持仓明显减仓(2026-08-05单日大幅减仓)。近10日净空持仓由5.99万手扩大至6.76万手。近10日空头控场优势进一步加强。近10日资金呈现缩量减仓迹象。

仓单分析: 当前注册仓单1,311张合计1,311张。近7日增加1,311张(+0.0%)，近30日增加1,010张(+335.5%)，增速明显加快。历史分位100.0%，处于近三年高位水平，注册仓单处于高位，潜在交割压力较大，(仓单数据来源于:同花顺iFinD)

基本面参考: 日熔量降至14.22万吨，开工率66.55%，供应持续收缩。深加工订单环比改善至9.4天，但同比仍偏弱。企业总库存7489.8万重箱，环比微降0.6%，同比仍增21.1%，去库困难。全行业亏损加深，天然气/石油焦燃料产线亏损严重。（信息来源：东亚期货每日商品期市纵览2026年08月11日）

短纤

返回检索

化工板块板块 · 最新价:7368.0(日收盘)

日:反弹 | 中周期:震荡(龙轨上方) | 小周期:接近(龙轨上方)

技术面解读:日线价格运行于轨下呈短期上行，中周期在轨道上方震荡整理，小周期贴着上轨，偏离很小。小周期价格回升，与日线短期上行波动方向一致。短周期轨上运行配合上行波动，日线轨下为当前运行框架参考。（本内容及观点仅供参考，不构成任何投资建议。）



资金情况: 多头24,807手(增26.3%) | 空头25,383手(增51.0%) | 净空收0.31万 | 多空比0.98

当日成交平稳,近10日主力总持仓回升至19.5万手附近(2026-08-03单日大幅增仓20.3%)。近10日多头持仓持续增仓(2026-08-11单日大幅增仓)。近10日净空持仓由0.23万手收窄至0.07万手。近10日空头控场优势进一步加强。近10日资金呈现放量增仓迹象。

仓单分析: 当前注册仓单2,318张合计2,318张。近7日减少291张(-11.2%)，近30日减少82张(-3.4%)，呈温和变动。历史分位21.4%，处于中等偏低水平，交割节奏正常，(仓单数据来源于:同花顺iFinD)

基本面参考: 供需平衡，由于原料近期持续上涨，短纤利润再度大幅下滑至同比低位。纺织行业处于传统淡季，纱厂开工偏低，终端订单不足，下游仅刚需零星采买，现货成交清淡。当前成本端支撑占主导，等待下游需求改善，先关注利润修复情况。（信息来源：东亚期货每日商品期市纵览2026年08月11日）

PP

返回检索

化工板块板块 · 最新价:8356.0(日收盘)

日:上涨 | 中周期:震荡(龙轨上方) | 小周期:震荡(龙轨上方)

技术面解读:日线在轨道上方，中周期在轨道上方震荡整理，小周期在轨道上方整理。三周期价格均运行于轨上，多周期方向一致。偏离幅度不大，价格运行于轨上。偏离若扩大，可能出现向轨道收敛。（本内容及观点仅供参考，不构成任何投资建议。）



资金情况: 多头68,091手(减8.2%) | 空头49,899手(减23.9%) | 净空扩1.05万 | 多空比1.36

当日成交平稳,近10日主力总持仓回落至40.4万手附近(2026-08-12单日大幅减仓6.1%)。近5日多头持仓持续增仓(2026-08-05单日大幅减仓)。近10日净多持仓由0.26万手扩大至1.31万手。近10日多头控场优势有所加强。近10日资金结构调整明显,多头增仓而空头减仓。

仓单分析: 当前注册仓单26,379张合计26,379张。近7日增加1,153张(+4.6%)，近30日增加753张(+2.9%)，变动相对平稳。历史分位100.0%，处于近三年高位水平，交割节奏正常，(仓单数据来源于:同花顺iFinD)

基本面参考: 供应端目前呈现短期紧平衡，远期趋于宽松的格局。需求端目前尚处于淡季，下游消费量整体呈现弱势，塑编、BOPP薄膜、注塑等主要下游开工率长期处于年内低位。综合来看，当前聚丙烯最大支撑仍来自于成本，受油价偏强震荡影响，原料成本高位运行将托底 PP 现货价格，整体走势将面临供应端弱回归与需求疲软博弈。（信息来源：东亚期货每日商品期市纵览2026年08月11日）

合成橡胶

返回检索

化工板块板块 · 最新价:13420.0(日收盘)

日:震荡 | 中周期:震荡(龙轨上方) | 小周期:震荡(龙轨上方)

技术面解读: 日线价格区间波动, 中周期在轨道上方震荡整理, 小周期在轨道上方整理。小周期价格运行于轨上。短周期价格运行于轨上, 短周期若维持轨上运行, 方向趋于明确。(本内容及观点仅供参考, 不构成任何投资建议。)



资金情况: 多头3,827手(减20.0%) | 空头3,090手(减46.1%) | 净空扩0.17万 | 多空比1.24

当日成交平稳,近10日主力总持仓回落至3.2万手附近(2026-08-10单日大幅减仓11.6%)。近10日多头持仓明显减仓(2026-08-05单日大幅减仓)。近10日净多持仓由0.07万手扩大至0.1万手。近10日多头控场优势有所加强。近10日资金呈现缩量减仓迹象。

仓单分析: 当前注册仓单21,410张合计21,410张。近7日增加80张(+0.4%), 近30日增加8,490张(+65.7%), 增速明显加快。历史分位69.0%, 处于中等偏高水平, 交割节奏正常, (仓单数据来源于:同花顺iFinD)

基本面参考: 原油高位震荡带动原料端情绪, 现货市场报盘小幅上调。石脑油裂解成本有底部支撑, 但向上传导力度有限; 苯乙烯近期走弱, 对丁苯橡胶形成拖累。顺丁生产毛利维持尚可, 装置有生产积极性, 成本更多是区间托底, 难驱动大涨。丁二烯成本支撑 vs 轮胎淡季现实弱需求, 叠加金九银十旺季预期, 整体宽幅震荡, 暂无明确单边方向。(信息来源: 东亚期货每日商品期市纵览2026年08月11日)

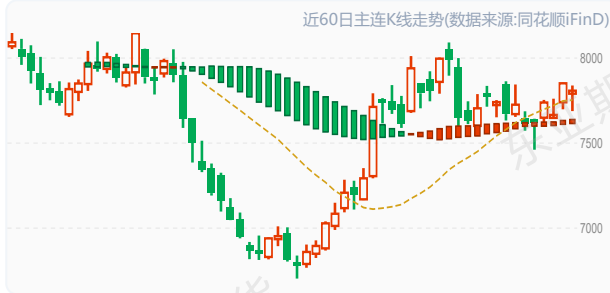
塑料

返回检索

化工板块板块 · 最新价:7809.0(日收盘)

日:上涨 | 中周期:震荡(龙轨上方) | 小周期:震荡(龙轨上方)

技术面解读: 价格运行于轨上, 日线延续当前运行状态。中周期在轨道上方震荡整理, 小周期在轨道上方整理。三周期价格均运行于轨上, 多周期方向一致。目前偏离合理, 价格运行延续。后续偏离若扩大, 可能向轨道回归。(本内容及观点仅供参考, 不构成任何投资建议。)



资金情况: 多头30,616手(增2.0%) | 空头46,683手(减11.9%) | 净空扩0.75万 | 多空比0.66

当日成交平稳,近10日主力总持仓回落至24.6万手附近(2026-08-10单日大幅减仓7.0%)。近5日多头持仓明显减仓(2026-08-10单日大幅减仓)。近10日净空持仓由2.6万手收窄至1.86万手。空头控盘格局稳固。近10日资金呈现缩量减仓迹象。

仓单分析: 当前注册仓单5,535张合计5,535张。近7日增加1,262张(+29.5%), 近30日减少267张(-4.6%), 增速明显加快。历史分位64.3%, 处于中等偏高水平, 交割节奏正常, (仓单数据来源于:同花顺iFinD)需关注后续仓单增速是否放缓及下游承接能力。

基本面参考: 美伊局势再度陷入僵持, 塑料短期受地缘影响较大。基本面上看, 短期PE供应逐步回升的趋势未改, 而同时需求端现实表现疲弱, 下游开工预计从9月份之后逐渐提升, 迎来需求真正的改善。短期交易一部分地缘紧张局势的反弹, 后续关注需求旺季对于塑料价格的支撑。(信息来源: 东亚期货每日商品期市纵览2026年08月11日)

尿素

返回检索

化工板块板块 · 最新价:1731.0(日收盘)

日:下跌 | 中周期:震荡(龙轨下方) | 小周期:震荡(龙轨下方)

技术面解读: 价格在轨道下方运行, 中周期在轨道下方震荡整理, 小周期在轨道下方整理。三周期价格均运行于轨下, 多周期方向一致。当前偏离程度在合理范围, 价格运行延续性保持。偏离若扩大, 后续可能出现向轨道收敛的技术波动。(本内容及观点仅供参考, 不构成任何投资建议。)



资金情况: 多头8,414手(减4.9%) | 空头8,902手(减7.2%) | 净空扩0.02万 | 多空比0.95

当日成交平稳,近10日主力总持仓回升至8.9万手附近(2026-08-03单日大幅增仓11.1%)。近5日多头持仓止跌回升。近10日多空力量维持均衡。近10日资金呈现放量增仓迹象。

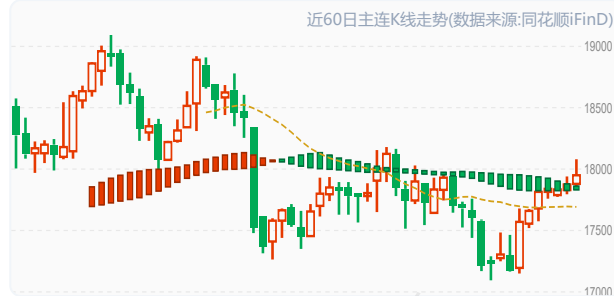
仓单分析: 当前注册仓单4,958张合计4,958张。近7日增加315张(+6.8%), 近30日增加2,261张(+83.8%), 增速明显加快。历史分位47.6%, 处于中等偏低水平, 交割节奏正常, (仓单数据来源于:同花顺iFinD)

基本面参考: 供应是当前最核心利空, 产量高位运行, 向下弹性有限, 向上被高供给压制。夏季大田追肥基本结束; 黄淮玉米少量补氮、新疆棉花追肥收尾, 仅零星用肥, 没有大规模田间采购, 进入季节性空档期。秋播备肥尚未启动, 要等到8月下旬-9月才会逐步显现。复合肥开工维持低位, 秋季原料备肥尚未大规模展开; 三聚氰胺、脱硝、板材、车用尿素均为刚需小单采购, 按需拿货, 贸易商低库存快进快出, 囤货意愿薄弱。现实供需偏弱, 靠出口招标、政策、秋肥预期托底, 震荡格局, 没有单边趋势。(信息来源: 东亚期货每日商品期市纵览2026年08月11日)

化工板块板块 · 最新价:17950.0(日收盘)

日:震荡 | 中周期:震荡(龙轨上方) | 小周期:震荡(龙轨上方)

技术面解读: 日线价格区间波动, 中周期在轨道上方震荡整理, 小周期在轨道上方整理。小周期价格运行于轨上, 短周期若维持轨上运行, 方向趋于明确。(本内容及观点仅供参考, 不构成任何投资建议。)



资金情况: 多头8,885手(增22.1%) | 空头11,640手(增7.8%) | 净空扩0.08万 | 多空比0.76

当日放量,近10日主力总持仓回升至10.2万手附近(2026-07-30单日大幅增仓7.3%)。近10日多头持仓持续增仓(2026-08-04单日大幅增仓)。近10日净空持仓由0.29万手收窄至0.21万手。近10日多空力量维持均衡。近10日资金呈现放量增仓迹象。

仓单分析: 当前注册仓单147,800张合计147,800张。近7日减少260张(-0.2%), 近30日减少3,350张(-2.2%), 变动相对平稳。历史分位2.4%, 处于近三年低位, 交割节奏正常, (仓单数据来源于:同花顺iFinD)

基本面参考: 7-9 月为东南亚主产区增产阶段, 泰国、越南新胶供应持续释放, 原料杯胶、胶水价格逐步松动。短期: 旺季供给宽松现实 VS 天气扰动 + 远期厄尔尼诺减产预期博弈。国内海南、云南近期降雨频繁, 阶段性干扰割胶, 短期国内新胶释放节奏放缓, 带来短期利多支撑; 库存: 青岛天然橡胶总库存 65.40 万吨, 环比小幅去库。(信息来源: 东亚期货每日商品期市纵览2026年08月11日)

化工板块板块 · 最新价:5764.0(日收盘)

日:反弹 | 中周期:穿越(站上) | 小周期:穿越(站上)

技术面解读: 短期上行波动延续, 中周期站上龙轨, 向上突破, 小周期价格运行至龙轨上方。小周期价格回升, 与日线短期上行波动方向一致。短期上行尚未停止, 偏离若扩大, 上方可能出现轨道参考。(本内容及观点仅供参考, 不构成任何投资建议。)



资金情况: 多头73,082手(减38.7%) | 空头124,114手(减14.2%) | 净空收2.72万 | 多空比0.59

当日成交平稳,近10日主力总持仓回落至64.7万手附近(2026-08-05单日大幅减仓11.0%)。近10日多头持仓明显减仓(2026-08-06单日大幅减仓)。近10日净空持仓由1.86万手扩大至4.58万手。近10日空头控场优势进一步加强。近10日资金呈现缩量减仓迹象。

仓单分析: 当前注册仓单24,979张合计24,979张。近7日减少1,062张(-4.1%), 近30日减少49,306张(-66.4%), 增速明显加快。历史分位9.5%, 处于近三年低位, 交割节奏正常, (仓单数据来源于:同花顺iFinD)

基本面参考: PTA装置因计划外短停产量快速下降, 接下来装置仍面临集中重启, 产量有增加预期, PTA加工费近期再度走高, 抬升估值, 短期上涨驱动可能受限, 未来供需面偏向于供需双增, 但供给增速可能略快于需求。成本端原油受地缘扰动波动较大, 短期注意风险。(信息来源: 东亚期货每日商品期市纵览2026年08月11日)

化工板块板块 · 最新价:4528.0(日收盘)

日:反弹 | 中周期:接近(龙轨上方) | 小周期:接近(龙轨上方)

技术面解读: 短期上行波动延续, 中周期贴着龙轨上沿运行, 偏离不大, 小周期贴着上轨, 偏离很小。小周期价格回升, 与日线短期上行波动方向一致。短期上行尚未停止, 偏离若扩大, 上方可能出现轨道参考。(本内容及观点仅供参考, 不构成任何投资建议。)



资金情况: 多头105,991手(减14.1%) | 空头115,312手(减4.7%) | 净空收1.2万 | 多空比0.92

当日成交平稳,近10日主力总持仓回落至68.4万手附近(2026-08-12单日大幅减仓6.6%)。近10日多头持仓明显减仓(2026-08-05单日大幅减仓)。近10日净空持仓由0.34万手扩大至0.87万手。近10日空头控场优势进一步加强。近10日资金呈现缩量减仓迹象。

仓单分析: 当前注册仓单118,656张合计118,656张。近7日减少532张(-0.4%), 近30日增加3,454张(+3.0%), 变动相对平稳。历史分位59.5%, 处于中等偏高水平, 交割节奏正常, (仓单数据来源于:同花顺iFinD)

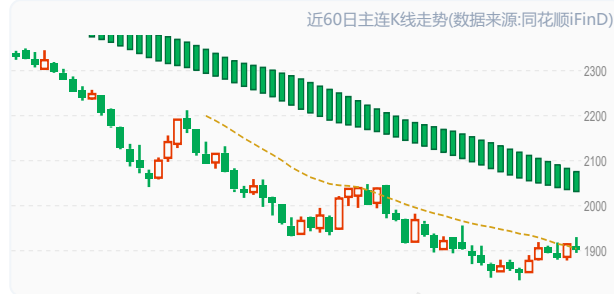
基本面参考: 供给端8月份装置检修偏少, 产量有提升预期, 需求端当前仍处于淡季, 市场期待8月下旬需求的改善, PVC短期有累库预期。成本端上游乙烯和电石涨价带来成本支撑, 而原料乙炔价格受地缘变化呈现高波动。(信息来源: 东亚期货每日商品期市纵览2026年08月11日)

烧碱

化工板块板块 · 最新价:1903.0(日收盘)

日:反弹 | 中周期:接近(龙轨上方) | 小周期:接近(龙轨上方)

技术面解读: 中周期贴着龙轨上沿运行, 偏离不大, 小周期贴着上轨, 偏离很小, 小周期价格回升, 与日线短期上行波动方向一致。日线呈短期上行波动, 短周期价格运行于轨上, 短期上行状态暂时保持。(本内容及观点仅供参考, 不构成任何投资建议。)



资金情况: 多头12,512手(增10.9%) | 空头15,164手(增29.8%) | 净空收0.19万 | 多空比0.83

当日放量,近10日主力总持仓回升至16.1万手附近(2026-08-12单日大幅增仓13.3%)。近10日多头持仓持续增仓(2026-08-03单日大幅增仓)。近10日净空持仓由0.06万手扩大至0.13万手。近10日空头控场优势进一步加强。近10日资金呈现放量增仓迹象。

仓单分析: 当前注册仓单583张合计583张。近7日减少52张(-8.2%), 近30日减少15张(-2.5%), 呈温和变动。历史分位83.3%, 处于近三年高位水平, 近期交割活跃叠加仓单高企, 近月合约面临注册仓单集中释放压力, (仓单数据来源于:同花顺iFinD)

基本面参考: 上周全国液碱环比去库, 山东和江苏液碱环比去库, 库存仍处同期高位。上周烧碱开工小幅回升, 开工处于同期低位, 液氯价格反弹, 山东氯碱负荷回升。氧化铝运行产能高位, 非铝需求弱势但旺季预期, 出口仍弱。烧碱绝对价格低位, 估值偏低, 短期价格震荡, 从中长期来看, 烧碱仍是供需过剩 (信息来源: 东亚期货每日商品期市纵览2026年08月11日)

甲醇

化工板块板块 · 最新价:2606.0(日收盘)

日:反弹 | 中周期:接近(龙轨上方) | 小周期:穿越(站上)

技术面解读: 日线呈短期上行波动, 中周期贴着龙轨上沿运行, 偏离不大, 小周期价格运行至龙轨上方。小周期价格回升, 与日线短期上行波动方向一致。短周期同步配合, 短期上行可能延续。(本内容及观点仅供参考, 不构成任何投资建议。)



资金情况: 多头53,991手(减29.5%) | 空头50,671手(减22.7%) | 净空收1.0万 | 多空比1.07

当日成交平稳,近10日主力总持仓回落至31.4万手附近(2026-08-12单日大幅减仓16.9%)。近10日多头持仓明显减仓(2026-08-11单日大幅减仓)。近10日净多持仓由1.79万手收窄至0.79万手。近10日多头优势有所减弱。近10日资金呈现缩量减仓迹象。

仓单分析: 当前注册仓单5,928张合计5,928张。近7日增加778张(+15.1%), 近30日增加838张(+16.5%), 呈温和变动。历史分位78.6%, 处于中等偏高水平, 交割节奏正常, (仓单数据来源于:同花顺iFinD)

基本面参考: 8月甲醇装置重启与检修并存, 基于重启体量或多于检修量, 初步预估8月国产供应环比7月微增。需求端整体依旧偏弱, MTO装置维持刚需运行, 加工利润承压, 后续检修计划增多; 甲醛、二甲醚等传统下游处于淡季, 采购保持随用随采, 缺乏主动补库动力; 甲醇港口库存或延续增量节奏, 整体力度或稍趋缓, 甲醇远期供应约束仍存, 价格相对有支撑。(信息来源: 东亚期货每日商品期市纵览2026年08月11日)

纯碱

化工板块板块 · 最新价:987.0(日收盘)

日:反弹 | 中周期:接近(龙轨下方) | 小周期:接近(龙轨上方)

技术面解读: 日线呈短期上行波动, 中周期贴近龙轨下方运行, 偏离有限, 小周期贴着上轨, 偏离很小。三周期方向不统一, 各周期独立运行。短周期方向不一致, 上行节奏不统一。等方向统一后, 短期上行趋于明朗。(本内容及观点仅供参考, 不构成任何投资建议。)



资金情况: 多头51,668手(减12.9%) | 空头95,783手(减22.2%) | 净空扩2.49万 | 多空比0.54

当日成交平稳,近10日主力总持仓回落至83.8万手附近(2026-08-10单日大幅减仓12.5%)。近10日多头持仓明显减仓(2026-08-11单日大幅减仓)。近10日净空持仓由8.26万手收窄至5.77万手。空头控盘格局稳固。近10日资金呈现缩量减仓迹象。

仓单分析: 当前注册仓单6,037张合计6,037张。近7日减少155张(-2.5%), 近30日增加1,381张(+29.7%), 呈温和变动。历史分位66.7%, 处于中等偏高水平, 交割节奏正常, (仓单数据来源于:同花顺iFinD)

基本面参考: 周产量74.64万吨, 产能利用率78.37%, 部分企业检修带来阶段性减量但力度有限。厂家库存累至184.95万吨, 重碱累库明显。浮法+光伏玻璃日熔量持续下滑, 重碱刚需走弱。联碱法、氨碱法均陷亏损, 行业盈利恶化。供需弱格局未改, 关注检修持续性 (信息来源: 东亚期货每日商品期市纵览2026年08月11日)

本报告仅供参考,不构成投资建议,投资有风险,入市需谨慎。

原油产业链板块分析

沥青

返回检索

原油产业链板块 · 最新价:4151.0(日收盘)

日:上涨 | 中周期:震荡(龙轨上方) | 小周期:震荡(龙轨上方)

技术面解读: 日线价格运行于龙轨上方, 中周期在轨道上方震荡整理, 小周期在轨道上方整理。三周期价格均运行于轨上, 多周期方向一致。目前与轨道偏离有限, 价格运行延续性保持。后续偏离若继续扩大, 价格可能向轨道方向收敛。(本内容及观点仅供参考, 不构成任何投资建议。)



资金情况: 多头33,944手(增19.5%) | 空头20,605手(增26.8%) | 净空扩0.11万 | 多空比1.65

当日成交平稳,近10日主力总持仓回升至24.3万手附近(2026-08-11单日大幅增仓10.0%)。近10日多头持仓持续增仓(2026-08-11单日大幅增仓)。近10日净多持仓由1.1万手扩大至1.2万手。近10日多头优势有所减弱。近10日资金呈现放量增仓迹象。

仓单分析: 当前注册仓单32,250张合计32,250张。近7日增加2,750张(+9.3%), 近30日减少1,630张(-4.8%), 呈温和变动。历史分位69.0%, 处于中等偏高水平, 交割节奏正常。(仓单数据来源于:同花顺iFinD)

基本面参考: 8月国内沥青排产环比明显回升, 主营、地炼多套装置复产提负, 整体供应环比抬升, 但同比依旧明显偏低, 重质油原料约束下产量难大幅爆发。部分炼厂有检修计划, 阶段性对冲增量; 进口沥青依旧维持低位。社会 + 厂库整体仍处在**历史同期偏低位置**, 局部区域现货资源偏紧, 对近月有支撑; 随着炼厂复产, 后期有累库风险, 重点看累库速度。(信息来源: 东亚期货每日商品期市纵览2026年08月11日)

燃油

返回检索

原油产业链板块 · 最新价:3760.0(日收盘)

日:上涨 | 中周期:震荡(龙轨上方) | 小周期:震荡(龙轨上方)

技术面解读: 价格在轨道上方运行, 中周期在轨道上方震荡整理, 小周期在轨道上方整理。三周期价格均运行于轨上, 多周期方向一致。当前偏离程度在合理范围, 价格运行延续性保持。偏离若扩大, 后续可能出现向轨道收敛的技术波动。(本内容及观点仅供参考, 不构成任何投资建议。)



资金情况: 多头13,146手(减3.3%) | 空头9,686手(减36.0%) | 净空扩0.48万 | 多空比1.36

当日成交平稳,主力总持仓维持在12.4万手附近(2026-07-31单日大幅减仓18.1%)。近5日多头持仓持续增仓(2026-08-04单日大幅增仓)。近10日净多持仓由0.15万手扩大至0.34万手。近10日多头控场优势有所加强。近5日资金呈现缩量增仓迹象。

仓单分析: 当前注册仓单35,420张合计35,420张。近7日增加18,980张(+115.5%), 近30日减少15,740张(-30.8%), 增速明显加快。历史分位92.9%, 处于近三年高位水平, 交割节奏正常。(仓单数据来源于:同花顺iFinD)需关注后续仓单增速是否放缓及下游承接能力。

基本面参考: 霍尔木兹海峡通航流量仍显著低于冲突前, 科威特 Al-Zour 炼厂外运受阻, 中东高硫货源释放受限; 俄罗斯燃料油出口持续受炼厂、物流扰动, 亚洲可流通高硫货源偏紧。新加坡现货维持高升水, 库存处在近四年同期低位; 国内 FU 仓单持续低位, 可交割资源有限, 保税现货紧张, 期现裂口维持高位。风险点: 若美伊谈判出现实质进展、海峡通航恢复, 中东货流回归, 高硫供应会快速修复, 地缘溢价将快速回落。(信息来源: 东亚期货每日商品期市纵览2026年08月11日)

液化气

返回检索

原油产业链板块 · 最新价:5417.0(日收盘)

日:震荡 | 中周期:震荡(龙轨上方) | 小周期:接近(龙轨上方)

技术面解读: 日线价格区间波动, 中周期在轨道上方震荡整理, 小周期贴着上轨, 偏离很小。小周期价格运行于轨上。短周期价格运行于轨上, 短周期若维持轨上运行, 方向趋于明确。(本内容及观点仅供参考, 不构成任何投资建议。)



资金情况: 多头10,066手(增3.8%) | 空头12,214手(增0.3%) | 净空扩0.03万 | 多空比0.82

当日成交平稳,近10日主力总持仓回升至10.0万手附近。近10日多头持仓有所回升。近10日多空力量维持均衡。近10日资金呈现放量增仓迹象。

仓单分析: 当前注册仓单3,303张合计3,303张。近30日增加1,634张(+97.9%)。历史分位78.6%, 处于中等偏高水平, 交割节奏正常。(仓单数据来源于:同花顺iFinD)

基本面参考: 近期LPG市场受原油影响强波动, 中东地缘局势推升能源板块整体风险溢价。LPG供应端或保持增长, 主要基于检修企业陆续恢复。未来三周预期国产供应量或增加, 或增至43.8万吨左右, 总计增幅2.15%。未来三周预期到港量在40-95万吨。需求方面, 下游企业前期检修装置逐步恢复, 需求呈现提升趋势。短期液化气供给增速大于需求, 液化气基本格局相对偏弱。(信息来源: 东亚期货每日商品期市纵览2026年08月11日)

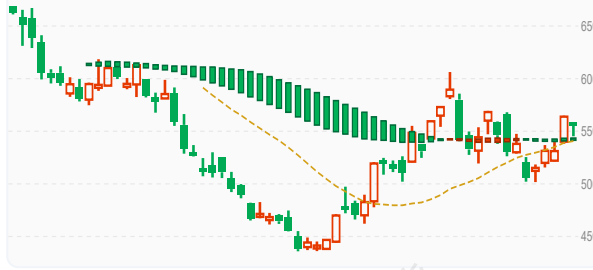
原油 [返回检索](#)

原油产业链板块 · 最新价:556.1(日收盘)

日:震荡 | 中周期:震荡(龙轨上方) | 小周期:震荡(龙轨上方)

技术面解读: 日线价格区间波动, 中周期在轨道上方震荡整理, 小周期在轨道上方整理。小周期价格运行于轨上。短周期价格运行于轨上, 短周期若维持轨上运行, 方向趋于明确。(本内容及观点仅供参考, 不构成任何投资建议。)

近60日主连K线走势(数据来源:同花顺iFinD)



资金情况: 多头0手(平0%) | 空头0手(平0%) | 净空平0.0万 | 多空比0.00

当日成交平稳,近10日主力总持仓回落至2.8万手附近(2026-07-31单日大幅减仓8.4%)。近3日多头持仓维持稳定。空头控盘格局稳固。近10日资金呈现缩量减仓迹象。

仓单分析: 当前注册仓单2,961,000张合计2,961,000张。历史分位100.0%, 处于近三年高位水平, 交割节奏正常, (仓单数据来源于:同花顺iFinD)

基本面参考: 行情核心受中东地缘局势主导, 近期主要变化在于消息面, 当前核心聚焦美伊是否会谈, 双方各执一词“谈判”的真假虚实构成当前市场最大不确定性。供应端OPEC+宣布9月增产18.8万桶/日, 增产幅度有限(不到全球需求的0.2%), 信号意义大于实际影响; 当前波斯湾产量仍低于战前约1,050万桶/日。需求端, 北半球夏季出行旺季支撑海外炼厂高开工; 国内检修炼厂陆续复工, 原油加工负荷小幅回升, 但化工产业链需求恢复偏慢。目前基本面对于油价偏利多, 关注地缘最新消息面。(信息来源: 东亚期货每日商品期市纵览2026年08月11日)

农产品板块分析

白糖 [返回检索](#)

农产品板块 · 最新价:5334.0(日收盘)

日:反弹 | 中周期:震荡(龙轨上方) | 小周期:震荡(龙轨上方)

技术面解读: 日线呈短期上行波动, 中周期在轨道上方震荡整理, 小周期在轨道上方整理。小周期价格回升, 与日线短期上行波动方向一致。短周期同步配合, 短期上行可能延续。(本内容及观点仅供参考, 不构成任何投资建议。)

近60日主连K线走势(数据来源:同花顺iFinD)



资金情况: 多头34,543手(增21.6%) | 空头58,950手(增24.9%) | 净空收0.55万 | 多空比0.59

当日成交平稳,近10日主力总持仓回升至47.2万手附近(2026-08-10单日大幅增仓8.2%)。近10日多头持仓持续增仓(2026-08-11单日大幅增仓)。近10日净空持仓由1.87万手扩大至2.42万手。空头控盘格局稳固。近10日资金呈现放量增仓迹象。

仓单分析: 当前注册仓单24,081张合计24,081张。近7日增加377张(+1.6%), 近30日增加1,173张(+5.1%), 变动相对平稳。历史分位61.9%, 处于中等偏高水平, 近期交割量高于均值, 近月移仓压力增加, (仓单数据来源于:同花顺iFinD)

基本面参考: 印度糖价受节日需求与供给紧缩双重推升, 巴西产糖低于预期, 预计全球糖供应紧缺。而目前我国糖库存量仍处于历年同期高位, 但短期国内现货糖成交量有所好转, 现货大厂报价纷纷上调。(信息来源: 东亚期货每日商品期市纵览2026年08月11日)

花生 [返回检索](#)

农产品板块 · 最新价:8202.0(日收盘)

日:反弹 | 中周期:震荡(龙轨下方) | 小周期:接近(龙轨下方)

技术面解读: 短期上行波动中, 中周期在轨道下方震荡整理, 小周期贴着下轨, 偏离很小。小周期价格率先下探至轨下。短周期若延续轨下运行, 短期上行终止概率增加。(本内容及观点仅供参考, 不构成任何投资建议。)

近60日主连K线走势(数据来源:同花顺iFinD)



资金情况: 多头17,055手(增10.3%) | 空头23,901手(增7.8%) | 净空收0.01万 | 多空比0.71

当日成交平稳,近10日主力总持仓回升至20.7万手附近(2026-08-10单日大幅增仓6.1%)。近10日多头持仓持续增仓(2026-07-30单日大幅减仓)。近10日多空力量维持均衡。近10日资金呈现放量增仓迹象。

仓单分析: 当前注册仓单0张合计0张。历史分位100.0%, 处于近三年高位水平, 交割节奏正常, (仓单数据来源于:同花顺iFinD)

基本面参考: 花生向上空间有限, 因为陈米结转库存体量偏大; 但向下空间同样有限, 因为成本底部支撑较强。后续关注主产区天气变化以及中秋备货的需求情况。(信息来源: 东亚期货每日商品期市纵览2026年08月11日)

棉花

农产品板块 · 最新价:16815.0(日收盘)

日:上涨 | 中周期:远离(龙轨上方) | 小周期:远离(龙轨上方)

技术面解读:日线在轨道上方,中周期偏离上轨较远,距离拉大,小周期偏离上轨,距离较大。三周期价格均运行于轨上,多周期方向一致。偏离幅度不大,价格运行于轨上。偏离若扩大,可能出现向轨道收敛。(本内容及观点仅供参考,不构成任何投资建议。)



资金情况:多头34,122手(增8.6%) | 空头45,558手(增0.7%) | 净空扩0.21万 | 多空比0.75

当日成交平稳,近10日主力总持仓回升至40.0万手附近(2026-08-12单日大幅增仓13.8%)。近10日多头持仓持续增仓(2026-08-11单日大幅增仓)。近10日净空持仓由1.45万手收窄至1.24万手。近10日多空力量维持均衡。近10日资金呈现放量增仓迹象。

仓单分析:当前注册仓单9,723张合计9,723张。近7日减少180张(-1.8%),近30日减少1,276张(-11.6%),呈温和变动。历史分位4.8%,处于近三年低位,近期交割量高于均值,近月移仓压力增加,(仓单数据来源于:同花顺iFinD)

基本面参考:8月10日,中国储备棉管理有限公司计划挂牌出库销售储备棉8023.683吨,实际成交8023.683吨,成交率100%。成交均价17197.07元/吨,较7日涨60.63元/吨,折3128B价格17772.81元/吨;成交最高价17820元/吨,最低价16530元/吨。棉花市场核心关注点依旧是储备棉的销售情况,目前成交均价持续上涨。若成交热度边际降温,或意味着下游承接力减弱,棉价重心有进一步下移风险;若成交持续活跃,则短期底部支撑仍将稳固。(信息来源:东亚期货每日商品期市纵览2026年08月11日)

棕榈油

农产品板块 · 最新价:9691.0(日收盘)

日:回调 | 中周期:震荡(龙轨上方) | 小周期:震荡(龙轨上方)

技术面解读:短期下行波动中,中周期在轨道上方震荡整理,小周期在轨道上方整理。小周期价格率先回升至轨上。短周期若延续轨上运行,短期下行终止概率增加。(本内容及观点仅供参考,不构成任何投资建议。)



资金情况:多头42,181手(增21.2%) | 空头34,534手(增5.8%) | 净空扩0.46万 | 多空比1.22

当日放量,近10日主力总持仓回升至43.0万手附近(2026-08-10单日大幅增仓11.0%)。近10日多头持仓持续增仓(2026-08-11单日大幅增仓)。近10日净多持仓由0.06万手扩大至0.4万手。近10日多头控场优势有所加强。近10日资金呈现放量增仓迹象。

仓单分析:当前注册仓单738张合计738张。近30日增加498张(+207.5%)。历史分位71.4%,处于中等偏高水平,交割节奏正常,(仓单数据来源于:同花顺iFinD)

基本面参考:马棕处于季节性增产周期,MPOB 7月库存预估261万吨为五个月高位,累库压力持续。国内港口库存83万吨,供需宽松。但印尼加里曼丹旱情持续,厄尔尼诺增强,远月减产预期强化;印尼B50政策推进、印度7月进口激增50%提供需求支撑。(信息来源:东亚期货每日商品期市纵览2026年08月11日)

生猪

农产品板块 · 最新价:12035.0(日收盘)

日:下跌 | 中周期:震荡(龙轨下方) | 小周期:穿越(跌破)

技术面解读:日线在轨道下方运行,中周期在轨道下方震荡整理,小周期价格运行至龙轨下方。三周期价格均运行于轨下,多周期方向一致。偏离幅度不大,价格运行于轨下。偏离若扩大,可能出现向轨道收敛。(本内容及观点仅供参考,不构成任何投资建议。)



资金情况:多头16,866手(增25.9%) | 空头22,022手(增13.0%) | 净空扩0.1万 | 多空比0.77

当日成交平稳,近10日主力总持仓回升至19.4万手附近(2026-08-06单日大幅增仓6.3%)。近10日多头持仓持续增仓(2026-08-03单日大幅增仓)。近10日净空持仓由0.54万手收窄至0.44万手。近10日多空力量维持均衡。近10日资金呈现放量增仓迹象。

仓单分析:当前注册仓单430张合计430张。近7日增加80张(+22.9%),近30日减少920张(-68.1%),增速明显加快。历史分位21.4%,处于中等偏低水平,交割节奏正常,(仓单数据来源于:同花顺iFinD)需关注后续仓单增速是否放缓及下游承接能力。

基本面参考:供给仍偏宽松,前期压栏及二育猪源持续释放,但西南大猪价格走强带动肥标价差走阔,二育入场积极性提升,现货止跌反弹。能繁母猪存栏降至3780万头,产能去化趋势明确,远月供给收缩预期强化。短期消费淡季需求支撑有限,冻品库存高位,8月出栏计划环比增加,供需博弈加剧。(信息来源:东亚期货每日商品期市纵览2026年08月11日)

红枣

返回检索

农产品板块 · 最新价:8320.0(日收盘)

日:下跌 | 中周期:震荡(龙轨下方) | 小周期:接近(龙轨下方)

技术面解读:日线价格运行于龙轨下方,中周期在轨道下方震荡整理,小周期贴着下轨,偏离很小。三周期价格均运行于轨下,多周期方向一致。目前与轨道偏离有限,价格运行延续性保持。后续偏离若继续扩大,价格可能向轨道方向收敛。(本内容及观点仅供参考,不构成任何投资建议。)

近60日主连K线走势(数据来源:同花顺iFinD)



资金情况:多头6,096手(增26.9%) | 空头14,706手(增26.5%) | 净空收0.17万 | 多空比0.41

当日成交平稳,近10日主力总持仓回升至14.0万手附近(2026-08-11单日大幅增仓9.3%)。近10日多头持仓持续增仓(2026-08-06单日大幅增仓)。近10日净空持仓由0.64万手扩大至0.81万手。空头控盘格局稳固。近10日资金呈现放量增仓迹象。

仓单分析:当前注册仓单8,267张合计8,267张。近7日减少219张(-2.6%),近30日增加135张(+1.7%),变动相对平稳。历史分位52.4%,处于中等偏高水平,交割节奏正常,(仓单数据来源于:同花顺iFinD)

基本面参考:红枣破新低后快速收回,基本面暂无亮点变化:旧季红枣高库存,弱需求。技术上不过分看空,部分空头逐步离场,推动价格止跌回升。(信息来源:东亚期货每日商品期货市场纵览2026年08月11日)

苹果

返回检索

农产品板块 · 最新价:7819.0(日收盘)

日:上涨 | 中周期:震荡(龙轨上方) | 小周期:震荡(龙轨上方)

技术面解读:价格运行于轨上,日线延续当前运行状态。中周期在轨道上方震荡整理,小周期在轨道上方整理。三周期价格均运行于轨上,多周期方向一致。目前偏离合理,价格运行延续。后续偏离若扩大,可能向轨道回归。(本内容及观点仅供参考,不构成任何投资建议。)

近60日主连K线走势(数据来源:同花顺iFinD)



资金情况:多头14,994手(增2.1%) | 空头11,500手(增5.6%) | 净空收0.04万 | 多空比1.30

当日成交平稳,近3日主力总持仓回落至12.2万手附近(2026-07-31单日大幅增仓19.5%)。近10日多头持仓有所回升(2026-08-10单日大幅增仓)。近10日多空力量维持均衡。近3日资金呈现减仓但沉淀资金回升迹象。

仓单分析:当前注册仓单0张合计0张。历史分位50.0%,处于中等偏低水平,交割节奏正常,(仓单数据来源于:同花顺iFinD)

基本面参考:苹果维持7400-7900震荡。去库仍较缓慢,新季早熟价格连续回落,叠加新季增产预期,另外夏令鲜果供应依然充足,苹果消费替代压力不减(信息来源:东亚期货每日商品期货市场纵览2026年08月11日)

菜粕

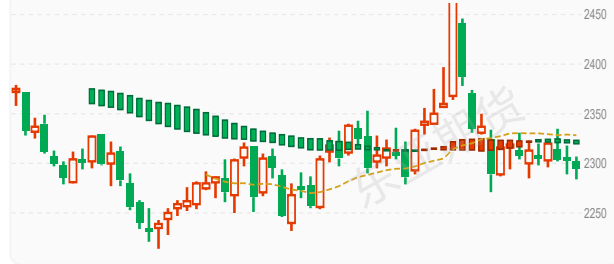
返回检索

农产品板块 · 最新价:2295.0(日收盘)

日:下跌 | 中周期:震荡(龙轨下方) | 小周期:震荡(龙轨下方)

技术面解读:日线价格运行于龙轨下方,中周期在轨道下方震荡整理,小周期在轨道下方整理。三周期价格均运行于轨下,多周期方向一致。目前与轨道偏离有限,价格运行延续性保持。后续偏离若继续扩大,价格可能向轨道方向收敛。(本内容及观点仅供参考,不构成任何投资建议。)

近60日主连K线走势(数据来源:同花顺iFinD)



资金情况:多头21,672手(减43.0%) | 空头28,760手(减22.6%) | 净空收1.14万 | 多空比0.75

当日成交平稳,近10日主力总持仓回落至27.3万手附近(2026-08-12单日大幅减仓10.1%)。近10日多头持仓明显减仓(2026-08-10单日大幅减仓)。近10日净空持仓由0.53万手扩大至0.61万手。近10日空头控场优势进一步加强。近10日资金呈现缩量减仓迹象。

仓单分析:当前注册仓单183张合计183张。近7日增加183张(+0.0%),近30日减少2,238张(-92.4%),增速明显加快。历史分位33.3%,处于中等偏低水平,交割节奏正常,(仓单数据来源于:同花顺iFinD)

基本面参考:港口菜粕库存30.65万吨,环比大增31.94%,远月菜籽买船增加,供应预期宽松。加拿大草原天气有利油菜籽生长,优良率77%高于去年,ICE油菜籽上涨空间有限。水产旺季刚需稳固,贸易商低价建仓成交放量,但全球菜籽丰产预期压制远期价格。(信息来源:东亚期货每日商品期货市场纵览2026年08月11日)

豆粕

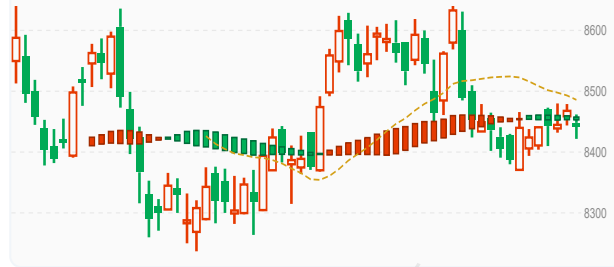
返回检索

农产品板块 · 最新价:8442.0(日收盘)

日:下跌 | 中周期:震荡(龙轨下方) | 小周期:震荡(龙轨下方)

技术面解读:日线在轨道下方运行,中周期在轨道下方震荡整理,小周期在轨道下方整理。三周期价格均运行于轨下,多周期方向一致。偏离幅度不大,价格运行于轨下。偏离若扩大,可能出现向轨道收敛。(本内容及观点仅供参考,不构成任何投资建议。)

近60日主连K线走势(数据来源:同花顺iFinD)



资金情况:多头48,511手(增7.3%) | 空头127,389手(增10.9%) | 净空收0.88万 | 多空比0.38

当日成交平稳,近10日主力总持仓回升至52.6万手附近(2026-08-05单日大幅增仓9.1%)。近10日多头持仓持续增仓(2026-08-10单日大幅增仓)。近10日净空持仓由6.6万手扩大至7.48万手。空头控盘格局稳固。近10日资金呈现放量增仓迹象。

仓单分析:当前注册仓单18,166张合计18,166张。近7日增加7,666张(+73.0%),近30日减少6,898张(-27.5%),增速明显加快。历史分位23.8%,处于中等偏低水平,交割节奏正常,(仓单数据来源于:同花顺iFinD)需关注后续仓单增速是否放缓及下游承接能力。

基本面参考:港口豆粕库存142.8万吨,周环比继续累库,8-9月大豆到港量偏高叠加储备拍卖,供应预期宽松。下游消费平淡,现货基差承压。美豆油受原油反弹及买油卖粕套利提振,但国内基本面压力限制跟涨幅度。短期豆粕跟随外围震荡,关注USDA及MPOB报告预期差。(信息来源:东亚期货每日商品期市纵览2026年08月11日)

豆粕

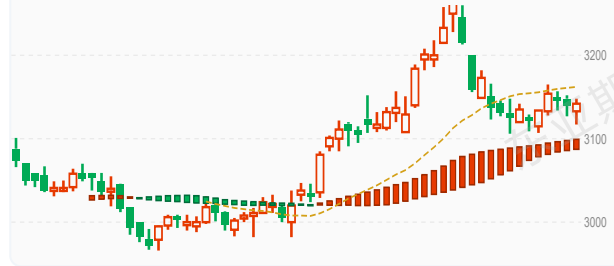
返回检索

农产品板块 · 最新价:3142.0(日收盘)

日:回调 | 中周期:接近(龙轨上方) | 小周期:穿越(站上)

技术面解读:短期下行波动中,中周期贴着龙轨上沿运行,偏离不大,小周期价格运行至龙轨上方。小周期价格率先回升至轨上。短周期若延续轨上运行,短期下行终止概率增加。(本内容及观点仅供参考,不构成任何投资建议。)

近60日主连K线走势(数据来源:同花顺iFinD)



资金情况:多头231,402手(增36.5%) | 空头525,627手(增18.0%) | 净空收1.61万 | 多空比0.44

当日成交平稳,近10日主力总持仓回升至224.3万手附近(2026-08-05单日大幅增仓8.6%)。近10日多头持仓持续增仓(2026-08-06单日大幅增仓)。近10日净空持仓由26.36万手扩大至27.97万手。空头控盘格局稳固。近10日资金呈现放量增仓迹象。

仓单分析:当前注册仓单25,100张合计25,100张。近7日增加4,500张(+21.8%),近30日减少16,104张(-39.1%),增速明显加快。历史分位21.4%,处于中等偏低水平,交割节奏正常,(仓单数据来源于:同花顺iFinD)需关注后续仓单增速是否放缓及下游承接能力。

基本面参考:美豆产区天气改善,优良率63%持平上周,天气升水有所回吐,但8月结荚灌浆关键期天气仍敏感。国内大豆到港量维持千万吨级别,油厂高开机下豆粕库存累至近97万吨,供应充足。饲料企业随采随用,养殖亏损压制需求增量。短期连粕跟随外盘震荡,关注8月12日USDA供需报告指引。(信息来源:东亚期货每日商品期市纵览2026年08月11日)

鸡蛋

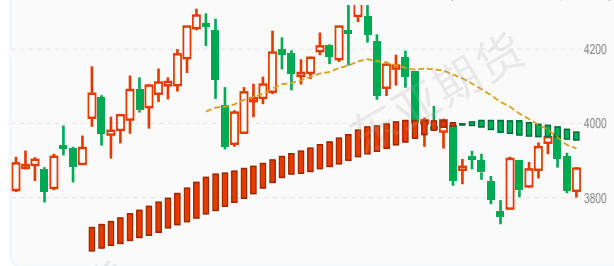
返回检索

农产品板块 · 最新价:3878.0(日收盘)

日:下跌 | 中周期:震荡(龙轨下方) | 小周期:震荡(龙轨下方)

技术面解读:价格在轨道下方运行,中周期在轨道下方震荡整理,小周期在轨道下方整理。三周期价格均运行于轨下,多周期方向一致。当前偏离程度在合理范围,价格运行延续性保持。偏离若扩大,后续可能出现向轨道收敛的技术波动。(本内容及观点仅供参考,不构成任何投资建议。)

近60日主连K线走势(数据来源:同花顺iFinD)



资金情况:多头18,051手(增25.7%) | 空头25,214手(增27.3%) | 净空收0.13万 | 多空比0.72

当日放量,近10日主力总持仓回升至28.4万手附近(2026-08-10单日大幅增仓15.0%)。近10日多头持仓持续增仓(2026-08-06单日大幅增仓)。近10日净空持仓由0.39万手扩大至0.52万手。近10日多空力量维持均衡。近10日资金呈现放量增仓迹象。

仓单分析:当前注册仓单0张合计0张。近7日减少2张(-100.0%)。历史分位81.6%,处于近三年高位水平,交割节奏正常,(仓单数据来源于:同花顺iFinD)需关注库存去化持续性 & 补库需求。

基本面参考:鸡蛋,旺季需求表现一般,供应端随着淘鸡延迟以及前期补栏陆续开产,产能也有所恢复。但是考虑8月是鸡蛋现货价格高位,因此预计现货价格即使回落,空间也不大。9、10月合约市场定价锚定国庆长假后需求回落的淡季基本面。(信息来源:东亚期货每日商品期市纵览2026年08月11日)

玉米

返回检索

农产品板块 · 最新价:2263.0(日收盘)

日:反弹 | 中周期:震荡(龙轨下方) | 小周期:接近(龙轨下方)

技术面解读: 短期上行波动中, 中周期在轨道下方震荡整理, 小周期贴着下轨, 偏离很小。小周期价格率先下探至轨下。短周期若延续轨下运行, 短期上行终止概率增加。(本内容及观点仅供参考, 不构成任何投资建议。)

近60日主连K线走势(数据来源:同花顺iFinD)



资金情况: 多头71,145手(减9.9%) | 空头76,676手(减12.5%) | 净空扩0.34万 | 多空比0.93

当日成交平稳,近10日主力总持仓回落至63.9万手附近(2026-08-10单日大幅减仓10.2%)。近10日多头持仓明显减仓(2026-08-11单日大幅减仓)。近10日净空持仓由0.93万手收窄至0.58万手。近10日多空力量维持均衡。近10日资金呈现缩量减仓迹象。

仓单分析: 当前注册仓单45,725张合计45,725张。近30日减少4,382张(-8.7%)。历史分位50.0%, 处于中等偏低水平, 交割节奏正常, (仓单数据来源于:同花顺iFinD)

基本面参考: 玉米主力今天走势冲高回落, 走势相对偏强, 在经历持续下跌之后止跌反弹, 主要是近期天气炒作拉升盘面, 其持续性较差, 随着台风天气的过去盘面短期内可能开始走弱, 警惕二次探底风险 (信息来源: 东亚期货每日商品期市纵览2026年08月11日)

菜油

返回检索

农产品板块 · 最新价:10128.0(日收盘)

日:回调 | 中周期:震荡(龙轨上方) | 小周期:震荡(龙轨上方)

技术面解读: 日线呈短期下行波动, 中周期在轨道上方震荡整理, 小周期在轨道上方整理。小周期价格率先回升至轨上。短期下行有减缓迹象。短周期若维持轨上运行, 短期下行终止概率增加。(本内容及观点仅供参考, 不构成任何投资建议。)

近60日主连K线走势(数据来源:同花顺iFinD)



资金情况: 多头20,975手(减22.6%) | 空头27,553手(减20.5%) | 净空扩0.1万 | 多空比0.76

当日成交平稳,近10日主力总持仓回落至15.2万手附近(2026-08-12单日大幅减仓15.4%)。近10日多头持仓明显减仓(2026-08-03单日大幅减仓)。近10日净空持仓由0.78万手收窄至0.68万手。近10日多空力量维持均衡。近10日资金呈现缩量减仓迹象。

仓单分析: 当前注册仓单1,244张合计1,244张。近7日减少200张(-13.9%), 近30日增加844张(+211.0%), 增速明显加快。历史分位57.1%, 处于中等偏高水平, 近期交割量高于均值, 近月移仓压力增加, (仓单数据来源于:同花顺iFinD)

基本面参考: 国内菜油库存38.86万吨, 环比下降, 同比大幅偏低, 库存处于近年低位。菜籽压榨开机率偏低, 现货基差坚挺, 还储需求持续消耗库存。加拿大菜籽产区暂无新增减产题材, 但欧盟菜籽单产因前期热浪下调。短期菜油在油脂板块中相对偏强, 但高价抑制终端成交。(信息来源: 东亚期货每日商品期市纵览2026年08月11日)

本报告仅供参考,不构成投资建议,投资有风险,入市需谨慎。

股指期货板块分析

IC 返回检索

股指期货板块 · 最新价:7914.2(日收盘)

日:反弹 | 中周期:接近(龙轨上方) | 小周期:震荡(龙轨上方)

技术面解读: 中周期贴着龙轨上沿运行, 偏离不大, 小周期在轨道上方整理, 小周期价格回升, 与日线短期上行波动方向一致。日线呈短期上行波动, 短周期价格运行于轨上, 短期上行状态暂时保持。(本内容及观点仅供参考, 不构成任何投资建议。)



资金情况: 多头25,460手(减6.8%) | 空头32,159手(减8.5%) | 净空扩0.11万 | 多空比0.79

当日成交平稳,近10日主力总持仓回落至15.9万手附近(2026-08-03单日大幅减仓6.8%)。近10日多头持仓明显减仓(2026-08-03单日大幅减仓)。近10日净空持仓由0.71万手收窄至0.61万手。近10日多空力量维持均衡。近10日资金呈现缩量减仓迹象。

仓单分析: 当前注册仓单0张合计0张。历史分位50.0%, 处于中等偏低水平, 交割节奏正常, (仓单数据来源于:同花顺iFinD)

基本面参考: 利多因素: 中盘指数在情绪回暖、政策加码阶段跟随市场整体走强, 风格弹性助力阶段性反弹。利空因素: 相对大盘缺乏独立增量驱动, 经济数据边际转弱与外部关税不确定性制约中小盘风险偏好。 总结而言: 多空力量暂时均衡, 趋势走向取决于宏观经济与资金面变化。(信息来源: 东亚期货每日商品期市纵览2026年08月11日)

IF 返回检索

股指期货板块 · 最新价:4641.0(日收盘)

日:反弹 | 中周期:接近(龙轨下方) | 小周期:震荡(龙轨上方)

技术面解读: 日线呈短期上行波动, 中周期贴近龙轨下方运行, 偏离有限, 小周期在轨道上方整理。三周期方向不统一, 各周期独立运行。短周期方向不一致, 上行节奏不统一。等方向统一后, 短期上行趋于明朗。(本内容及观点仅供参考, 不构成任何投资建议。)



资金情况: 多头23,333手(减8.4%) | 空头23,011手(减8.1%) | 净空收0.01万 | 多空比1.01

当日成交平稳,近10日主力总持仓回落至14.3万手附近(2026-07-31单日大幅减仓6.4%)。近10日多头持仓明显减仓(2026-07-30单日大幅减仓)。近10日多空力量维持均衡。近10日资金呈现缩量减仓迹象。

仓单分析: 当前注册仓单0张合计0张。历史分位50.0%, 处于中等偏低水平, 交割节奏正常, (仓单数据来源于:同花顺iFinD)

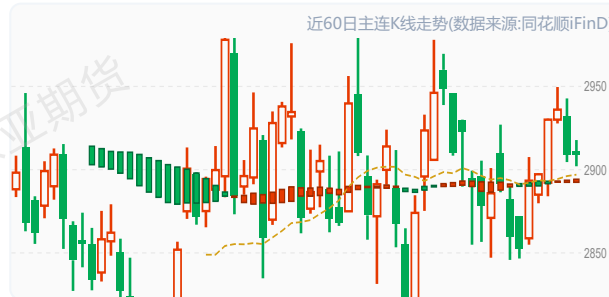
基本面参考: 利多因素: 国内逆周期调节政策持续加码, 为指数提供阶段性上行驱动; 本轮调整主要由情绪面与流动性传导驱动, 国内经济基本面并无重大利空。利空因素: 市场缺乏增量利多因素支撑, 国内经济基本面数据边际转弱; 股债性价比处于历史中等偏低水平, 资金更偏向债券等稳健资产。 总结而言: 政策托底与基本面转弱相互博弈, 短期或以震荡整理为主。(信息来源: 东亚期货每日商品期市纵览2026年08月11日)

IH 返回检索

股指期货板块 · 最新价:2910.0(日收盘)

日:回调 | 中周期:接近(龙轨上方) | 小周期:震荡(龙轨上方)

技术面解读: 短期下行波动中, 中周期贴着龙轨上沿运行, 偏离不大, 小周期在轨道上方整理。小周期价格率先回升至轨上。短周期若延续轨上运行, 短期下行终止概率增加。(本内容及观点仅供参考, 不构成任何投资建议。)



资金情况: 多头9,629手(减5.4%) | 空头16,870手(减6.5%) | 净空扩0.06万 | 多空比0.57

当日成交平稳,近10日主力总持仓回落至6.6万手附近(2026-08-06单日大幅减仓7.0%)。近10日多头持仓明显减仓(2026-08-07单日大幅减仓)。近10日净空持仓由0.77万手收窄至0.71万手。空头控盘格局稳固。近10日资金呈现缩量减仓迹象。

仓单分析: 当前注册仓单0张合计0张。历史分位50.0%, 处于中等偏低水平, 交割节奏正常, (仓单数据来源于:同花顺iFinD)

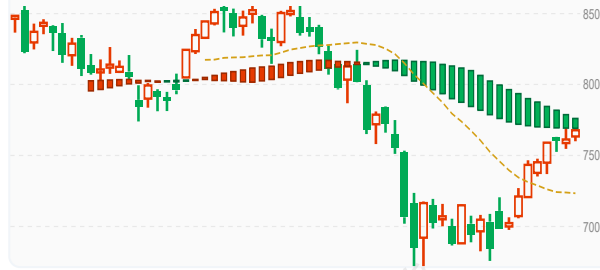
基本面参考: 利多因素: 国内逆周期调节政策持续加码, 为指数提供阶段性上行驱动; 本轮调整主要由情绪面与流动性传导驱动, 国内经济基本面并无重大利空。利空因素: 市场缺乏增量利多因素支撑, 国内经济基本面数据边际转弱; 股债性价比处于历史中等偏低水平, 资金更偏向债券等稳健资产。 总结而言: 政策托底与基本面转弱相互博弈, 短期或以震荡整理为主。(信息来源: 东亚期货每日商品期市纵览2026年08月11日)

股指期货板块 · 最新价:7677.4(日收盘)

日:反弹 | 中周期:接近(龙轨上方) | 小周期:震荡(龙轨上方)

技术面解读: 日线价格运行于轨下呈短期上行, 中周期贴着龙轨上沿运行, 偏离不大, 小周期在轨道上方整理。小周期价格回升, 与日线短期上行波动方向一致。短周期轨上运行配合上行波动, 日线轨下为当前运行框架参考。(本内容及观点仅供参考, 不构成任何投资建议。)

近60日主连K线走势(数据来源:同花顺iFinD)



资金情况: 多头36,879手(减6.3%) | 空头48,303手(减4.4%) | 净空收0.03万 | 多空比0.76

当日成交平稳,近10日主力总持仓回落至23.1万手附近。近10日多头持仓明显减仓(2026-08-03单日大幅减仓)。近10日多空力量维持均衡。近10日资金呈现缩量减仓迹象。

仓单分析: 当前注册仓单0张合计0张。历史分位50.0%, 处于中等偏低水平, 交割节奏正常, (仓单数据来源于:同花顺iFinD)

基本面参考: 利多因素: 指数估值位于历史低位, 成长风格显著, 风险偏好回升阶段弹性较大。利空因素: 成分股市值小、波动性高, 风险担忧情绪扩散时可能出现较大回调。 总结而言: 估值偏低但波动剧烈, 多空取决于风险偏好与政策节奏。(信息来源: 东亚期货每日商品期市纵览2026年08月11日)

本报告仅供参考,不构成投资建议,投资有风险,入市需谨慎。