商品期现数据跟踪日报

研究院 量化组

研究员

高天越

☎ 0755-23887993

✉ gaotianyue@htfc.com

从业资格号：F3055799

投资咨询号：Z0016156

陈辰

☎ 0755-23887993

✉ chenchen@htfc.com

从业资格号：F3024056

投资咨询号：Z0014257

投资咨询业务资格：
证监许可【2011】1289 号

数据跟踪说明

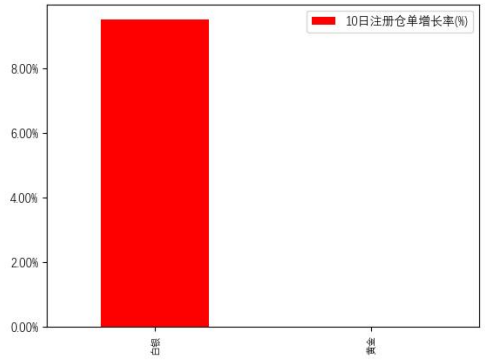
1.现货价格或滞后 2-3 天，当日数据取最新一次更新的现货价格。

2.本文基差，选取全国典型现货指标测算，仅供参考趋势。

3.近月和主力合约价差中，近月使用的近月交割指标。

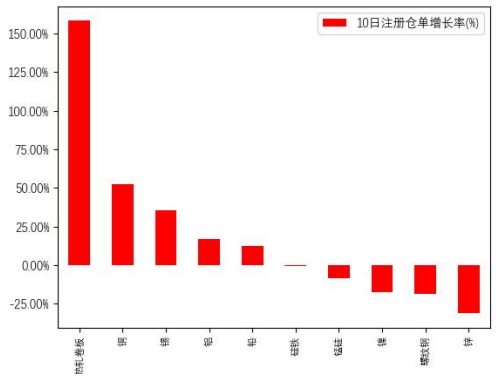
4.主力合约使用的 Wind 主连数据

图 1： 仓单十日增长率-贵金属



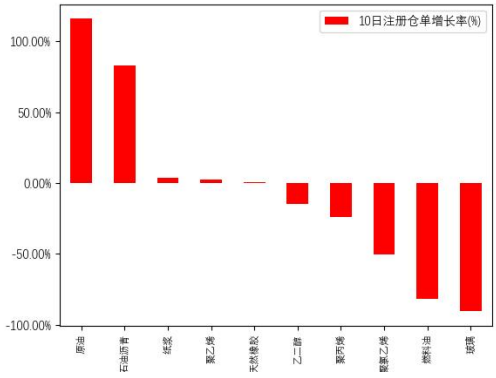
数据来源：Ricequant 华泰期货研究院

图 2： 仓单十日增长率-基本金属



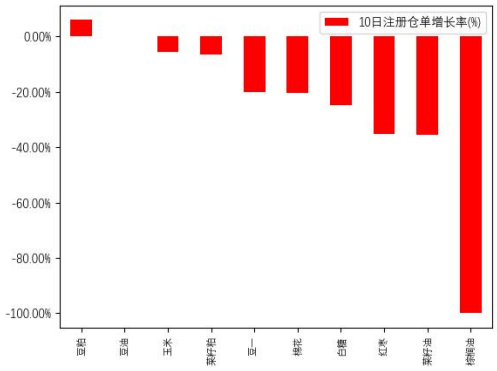
数据来源： Ricequant 华泰期货研究院

图 3： 仓单十日增长率-能源化工



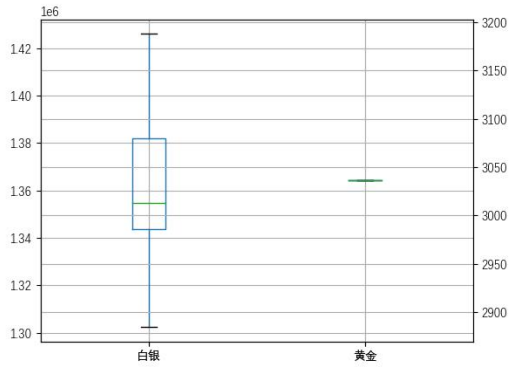
数据来源：Ricequant 华泰期货研究院

图 4： 仓单十日增长率-农产品



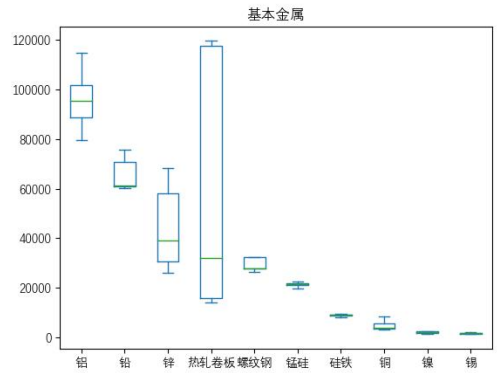
数据来源：Ricequant 华泰期货研究院

图 5： 仓单 BOX 图-贵金属



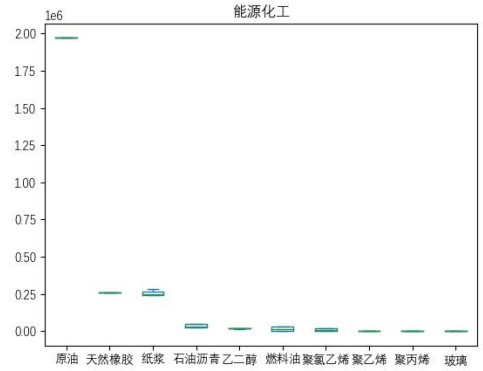
数据来源：Ricequant 华泰期货研究院

图 6： 仓单 BOX 图-基本金属



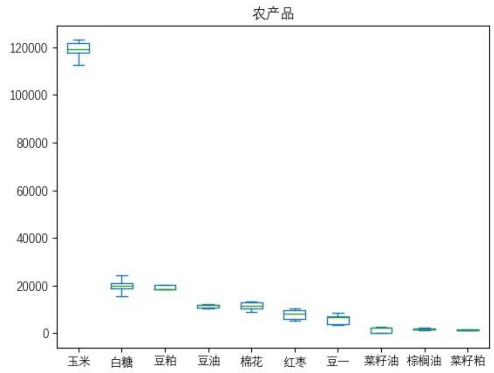
数据来源：Ricequant 华泰期货研究院

图 7： 仓单 BOX 图-能源化工



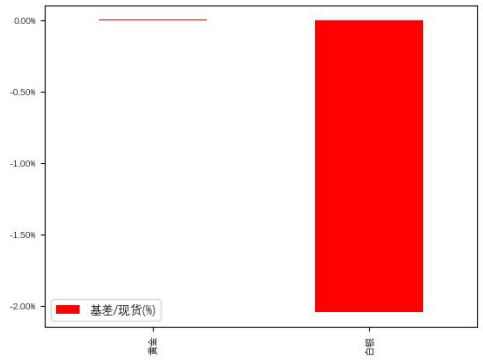
数据来源：Ricequant 华泰期货研究院

图 8： 仓单 BOX 图-农产品



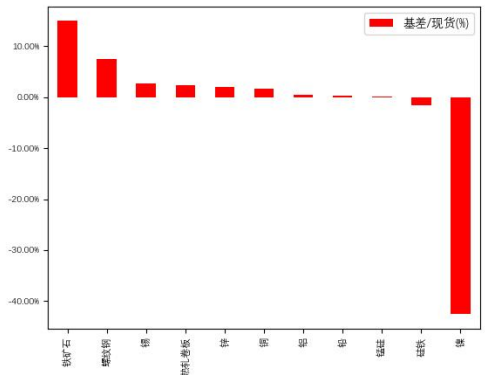
数据来源：Ricequant 华泰期货研究院

图 9： 基差/现货-贵金属



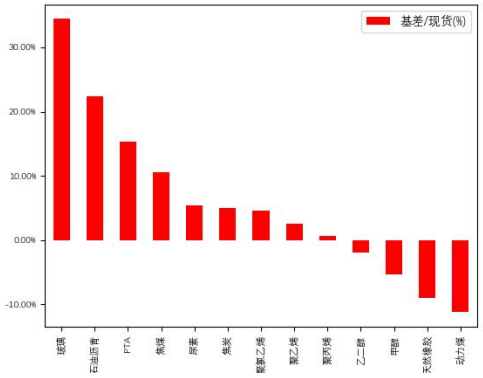
数据来源：Wind 华泰期货研究院

图 10： 基差/现货-基本金属



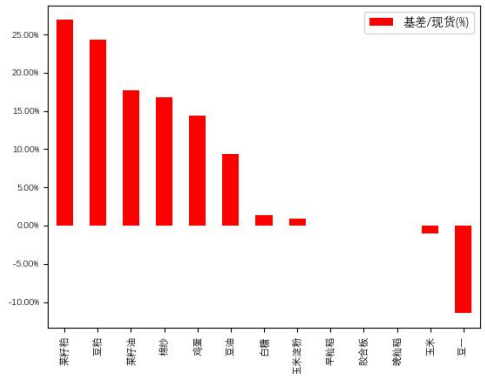
数据来源：Wind 华泰期货研究院

图 11： 基差/现货-能源化工



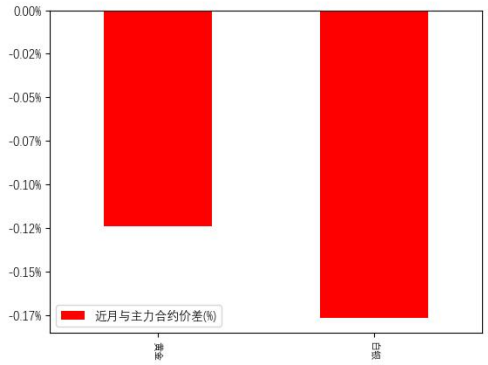
数据来源：Wind 华泰期货研究院

图 12： 基差/现货-农产品



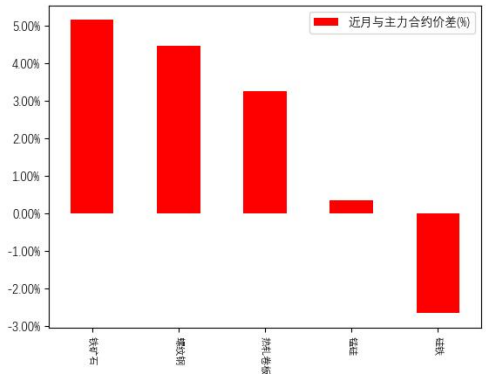
数据来源：Wind 华泰期货研究院

图 13： 近月与主力合约价差/近月-贵金属



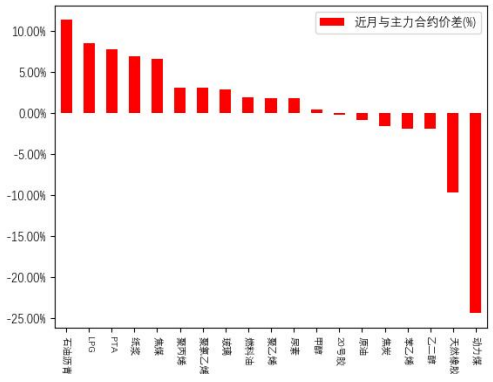
数据来源：Ricequant Wind 华泰期货研究院
注：近月、主力合约相同时，价差为 0

图 14： 近月与主力合约价差/近月-基本金属



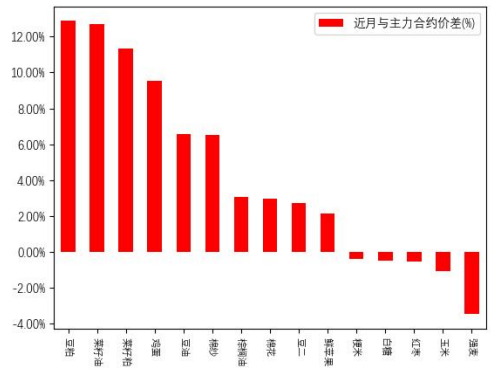
数据来源：Ricequant Wind 华泰期货研究院

图 15： 近月与主力合约价差/近月-能源化工



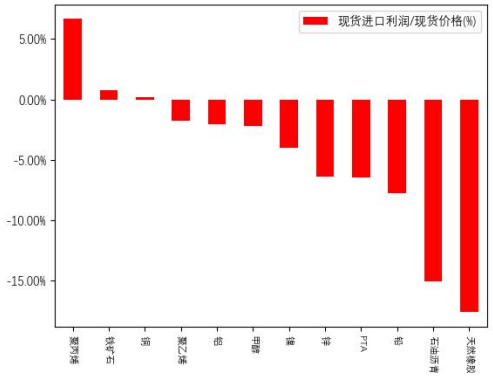
数据来源：Ricequant Wind 华泰期货研究院

图 16： 近月与主力合约价差/近月-农产品



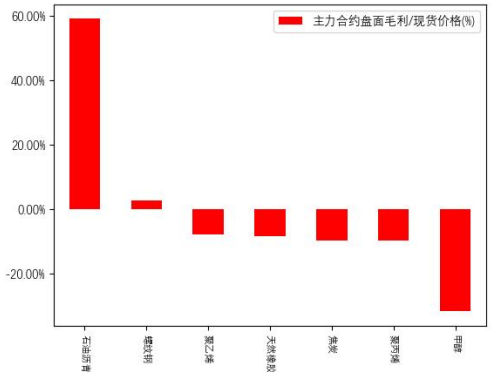
数据来源：Ricequant Wind 华泰期货研究院

图 17： 部分品种现货进口利润



数据来源：Wind 华泰期货研究院

图 18： 部分品种主力合约盘面毛利



数据来源：Wind 华泰期货研究院

免责声明

本报告基于本公司认为可靠的、已公开的信息编制，但本公司对该等信息的准确性及完整性不作任何保证。本报告所载的意见、结论及预测仅反映报告发布当日的观点和判断。在不同时期，本公司可能会发出与本报告所载意见、评估及预测不一致的研究报告。本公司不保证本报告所含信息保持在最新状态。本公司对本报告所含信息可在不发出通知的情形下做出修改， 投资者应当自行关注相应的更新或修改。

本公司力求报告内容客观、公正，但本报告所载的观点、结论和建议仅供参考，投资者并不能依靠本报告以取代行使独立判断。对投资者依据或者使用本报告所造成的一切后果，本公司及作者均不承担任何法律责任。

本报告版权仅为本公司所有。未经本公司书面许可，任何机构或个人不得以翻版、复制、发表、引用或再次分发他人等任何形式侵犯本公司版权。如征得本公司同意进行引用、刊发的，需在允许的范围内使用，并注明出处为“华泰期货研究院”，且不得对本报告进行任何有悖原意的引用、删节和修改。本公司保留追究相关责任的权力。所有本报告中使用的商标、服务标记及标记均为本公司的商标、服务标记及标记。

华泰期货有限公司版权所有并保留一切权利。

公司总部

广州市天河区临江大道 1 号之一 2101-2106 单元丨邮编：510000

电话：400-6280-888

网址：www.htfc.com