



东亚期货
East Asia Futures

每日商品期市纵览

DAILY COMMODITY FUTURES REVIEW

洞察市场趋势 · 把握投资机遇

2026年07月31日



研究员：刘琛瑞 Z0017093、兰雪 Z0018543、岳晋琛 Z0017963、
陈乃轩 Z0023138、许亮 Z0002220。

风险提示：本报告仅供参考，不构成投资建议

Executive Summary | 今日要点

- 活跃品种等权涨跌 -0.50%，28/73 个品种收涨，市场整体偏弱。
- 金融+贵金属领涨（+0.75%），能源化工最弱（-1.53%），板块分化是今日主线。
- 当日变化较突出的品种：燃油（-4.88%，下跌减仓）、沪锡（+2.11%，上涨增仓）、苹果（+1.12%，上涨增仓）。明细统计范围不受本摘要名单限制。

市场涨跌占比

39%涨 / 61%跌

平盘 2 个

增仓品种

33

占活跃品种 45.2%

日均成交活跃度

平稳

+1.7% 较20日均量

一、持仓与成交变化

持仓增幅 TOP5 ■ 按加权持仓变化百分比

① 沪锡	+16.4%
② 苹果	+13.4%
③ 沪铅	+9.3%
④ 沪锌	+7.0%
⑤ 氧化铝	+5.2%

成交放大 TOP5 ■ 较20日均量

① 苹果	+102.7%
② 胶版印刷纸	+102.5%
③ 乙二醇	+72.5%
④ 铁矿石	+52.8%
⑤ 焦煤	+51.2%

二、板块强弱与量仓变化

行情截至 2026-07-31 收盘 · 价格用主连（ZL），量仓用加权（8888）

板块	板块涨跌	上涨 / 下跌	成交较20日均值	持仓变化（万手）
金融+贵金属	+0.75%	9 / 0	+11.8%	+0.0
有色金属+新能源	+0.08%	7 / 4	-1.3%	+7.6
能源化工	-1.53%	2 / 23	-2.7%	-15.8
黑色建材	-0.73%	3 / 6	+27.3%	-1.1
农产品	-0.20%	6 / 10	-8.8%	-5.1

今日涨幅前10

根据当日收盘价格与上一交易日收盘价格对比涨跌幅度。

品种 / 板块	收盘 / 涨跌	日内形态	成交较20日	加权持仓 / 日变化	价仓状态
欧线集运 其他	1780 +3.34%	震荡上行	-8.2%	4.3万 / +0.2万 (+4.8%)	上涨增仓
沪锡 有色金属+新能源	425570 +2.11%	震荡上行	-5.2%	9.4万 / +1.3万 (+16.4%)	上涨增仓
中证1000 金融+贵金属	6987.8 +2.08%	日内走弱	+10.2%	53.1万 / +0.8万 (+1.5%)	上涨增仓
中证500 金融+贵金属	7395 +2.06%	日内走弱	+12.3%	34.3万 / -0.9万 (-2.5%)	上涨减仓
沪银 金融+贵金属	14264 +1.65%	冲高回落	-3.9%	49.6万 / -1.1万 (-2.2%)	上涨减仓
多晶硅 有色金属+新能源	33040 +1.47%	震荡上行	+23.6%	18.4万 / -0.3万 (-1.7%)	上涨减仓
菜粕 农产品	2316 +1.18%	日内走强	-28.0%	144.2万 / +2.5万 (+1.8%)	上涨增仓
苹果 农产品	7827 +1.12%	震荡上行	+102.7%	17.2万 / +2.0万 (+13.4%)	上涨增仓
沪金 金融+贵金属	888.3 +0.78%	冲高回落	+24.8%	29.2万 / +0.5万 (+1.9%)	上涨增仓
沪锌 有色金属+新能源	24890 +0.77%	冲高回落	+21.4%	20.5万 / +1.3万 (+7.0%)	上涨增仓

今日跌幅前10

根据当日收盘价格与上一日收盘价格测算涨跌幅度。

品种 / 板块	收盘 / 涨跌	日内形态	成交较20日	加权持仓 / 日变化	价仓状态
燃油 能源化工	3530 -4.88%	震荡下行	+17.7%	41.3万 / -3.8万 (-8.4%)	下跌减仓
原油 能源化工	546.1 -3.89%	震荡下行	+0.6%	7.9万 / -0.2万 (-2.0%)	下跌减仓
焦煤 黑色建材	1181 -3.75%	日内走弱	+51.2%	87.2万 / +2.0万 (+2.3%)	下跌增仓
纯苯 能源化工	7154 -3.22%	日内走弱	-11.1%	4.2万 / -0.1万 (-3.0%)	下跌减仓
低硫燃油 能源化工	4655 -3.16%	震荡下行	-1.6%	10.6万 / -1.0万 (-8.3%)	下跌减仓
焦炭 黑色建材	1767 -2.97%	震荡下行	+39.8%	8.2万 / +0.4万 (+4.5%)	下跌增仓
丁二烯橡胶 能源化工	12595 -2.89%	日内走弱	-8.7%	12.3万 / +0.4万 (+3.5%)	下跌增仓
苯乙烯 能源化工	8385 -2.70%	震荡下行	-21.2%	50.7万 / -2.2万 (-4.2%)	下跌减仓
LPG 能源化工	5431 -2.36%	震荡下行	-31.3%	14.8万 / -0.3万 (-1.7%)	下跌减仓
碳酸锂 有色金属+新能源	137760 -2.34%	日内走弱	-4.0%	66.7万 / +1.5万 (+2.3%)	下跌增仓

沪深300

利多因素：一季度GDP超预期，宽基ETF净申购创新高，银行板块走强，沪深300估值处于历史低位，具备估值修复空间。同时，政策面稳增长信号明确，增量资金持续入市，为指数提供底部支撑。利空因素：贸易冲突持续影响出口，美联储鹰派立场压制全球流动性，融资余额减少、成交量低迷反映市场情绪偏谨慎。高利率环境下外资回流压力犹存，大盘蓝筹股弹性受限。总结：沪深300估值低位有安全边际，但外部流动性与内部情绪偏弱。

中证500

利多因素：中证500估值修复趋势延续，中小盘成长股弹性可期。国内产业升级与专精特新政策持续利好中盘成长股的基本面改善。利空因素：中证500拥挤度处于高位震荡，交易热度偏高，存在“拥挤”回调风险。外部贸易摩擦及全球制造业周期放缓对出口导向型中盘股形成压制。总结：估值修复提供上行潜力，但高拥挤度与外部风险并存，需警惕回调。

中证1000

利多因素：中证1000市净率回升且略高于中证500，小盘股在估值层面仍具吸引力。小盘成长风格受AI、半导体等新兴赛道活跃资金持续关注。利空因素：中证1000拥挤度在多数时段高于沪深300，资金集中度高，短期波动风险加剧。小盘股对流动性边际收紧更为敏感，融资环境变化易引发快速回调。总结：小盘股估值弹性突出，但拥挤度偏高叠加流动性敏感，波动性较大。

欧线集运

本周，船公司继续落地8月上半月运价，基本上依然是逐步缓降。马士基周二盘后开舱第33周运价，维持和上周一致，市场修正对8月快速下跌的预期，因此盘面大幅反弹。主力合约移仓换月之后，短期跟随油价波动，但从基本面角度来看10合约可能依然存在压力。后续关注其他航线带来的整体外溢，以及船公司后续的价格调整情况。

沪银

利多因素：AI基建与光伏产业持续拉动白银工业需求，2026年工业需求占比预计超60%，全球白银库存大幅去化。利空因素：美联储加息预期升温（9月加息概率57%），美元指数冲高至101.5附近，10年期美债收益率突破4.70%，强势美元与高利率压制无息白银的估值。同时ETF资金短期流出加剧价格波动。总结：供需基本面极度偏紧，但宏观利率压制显著，多空博弈白热化。

沪金

利多因素：全球多国央行持续年度购金计划，实物买盘长期托底；美伊紧张局势升级推升避险需求，黄金ETF双底形态完成，大量资金正流入市场。美国非农数据下降、通胀超预期回落，降息预期仍存。利空因素：美联储鹰派预期持续发酵，2026年3月点阵图显示全年仅降息1次，美元指数走强至101.5，10年期美债收益率突破4.70%，抬高黄金持有机会成本。ETF短期小幅流出、杠杆多头平仓压力未完全释放。总结：央行购金与地缘避险提供坚实底部，但高利率环境下金价上行空间受限。

铂

南非矿区成本压力较大，产量增量有限，市场维持年度供需缺口预期。汽车电动化持续压制传统催化需求，氢能相关需求释放节奏偏慢，国内下游企业采购偏谨慎。海外通胀数据变化扰动美债预期，贵金属板块波动加剧，需求端改善有限制约上行空间。

钯

全球回收原料持续增加，市场逐步进入供应过剩周期。汽车电动化持续削弱尾气催化剂需求，下游厂商仅维持刚需采购。海外利率维持高位压制贵金属板块，实体需求缺少明显增量，宽松基本面持续约束价格反弹力度。

沪铜

铜精矿加工费维持低位，矿端供给偏紧，国内显性库存低位带来支撑。市场处于传统消费淡季，下游企业对高价原料接受度有限，仅开展刚需采购，现货成交表现平淡。海外利率预期持续扰动市场，内需疲软制约上行空间。

沪铝

国内铝锭与铝棒库存同步下降，LME库存延续去化，海外Cash-3M维持高升水，境内外低库存对铝价形成共振支撑。与此同时，下游各板块开工率全面回落，现货升贴水走弱，说明高价正在压制接货意愿，后续需关注库存去化能否在弱需求下持续。

沪锌

锌精矿加工费维持低位，矿端偏紧对价格形成支撑，部分炼厂检修限制精炼锌增量。当前镀锌、压铸行业处于传统消费淡季，下游采购保持谨慎，仅按需拿货，国内库存持续累积。海外利率预期扰动市场，终端需求乏力约束上行空间。

沪铅

铅仍处于供需双弱状态。废电瓶涨价与再生铅亏损限制供应弹性，但原生铅开工不低，再生端也尚未出现足以扭转平衡的减量；电池开工回落、社会库存增加，使成本支撑难以转化为持续上行动力。美国GDP和PCE偏软带来的利率缓和交易主要体现在锌锡，铅反而偏弱，短期定价仍由自身需求和库存主导。

沪镍

印尼镍矿配额管控带来供给预期支撑，冶炼成本形成底部托底。不锈钢行业处于传统淡季，钢厂原料采购节奏偏缓；三元材料开工平稳，但企业主动补库意愿偏弱。全球显性库存维持高位，叠加海外宏观预期持续扰动，充裕库存持续限制上行空间。

沪锡

缅甸矿区受雨季干扰，锡矿外运受限，叠加印尼出口管控，原料端偏紧、低位库存形成支撑。国内3C行业处于消费淡季，下游仅维持刚需采购，现货放量有限。海外宏观预期有所缓和，但终端需求缺乏持续增量。

氧化铝

周度产量及开工率下降，供应边际收缩；期现基差明显扩大，也说明期货价格已提前交易宽松预期。但厂内及港口库存继续增加，几内亚铝土矿出口保持高位，矿端成本缺乏明显上行驱动。

碳酸锂

部分锂盐企业检修带来短期供给收缩，产业链库存延续去化。下游正极材料开工平稳，但原料储备充足，采购仅维持刚需，主动补库意愿偏弱。远期全球锂产能持续投放，宽松供给预期持续约束上行空间，市场情绪转淡。

多晶硅

西南产区装置持续复产爬坡，行业供给维持宽松，产业链整体库存处于高位。下游硅片企业原料备货充足，仅维持刚需采购，光伏终端需求暂无明显提振。生产成本构成底部支撑，但宽松供需格局持续压制上行空间，市场等待产业链排产信号。

工业硅

西南丰水期产能稳步释放，市场整体供应充裕，行业库存维持高位。下游需求分化，多晶硅采购维持刚需，有机硅开工偏弱拖累耗硅量。生产成本形成底部支撑，但宽松供需格局持续压制上方空间，下游缺乏主动补库动作。

螺纹钢

最新产库数据呈供需双弱格局：螺纹表需低位微升1.39%至199万吨，但绝对水平仍偏低，终端采购未明显改善。产量稳定在200万吨附近，钢厂在利润承压背景下维持低负荷生产，供给端弹性减弱。库存结构分化明显：社库累积8万吨、厂库去化7万吨，反映钢厂出货尚可但贸易商环节消化不畅。核心关注点：旺季前需求回暖信号、钢厂产量调整节奏、铁水及原料端联动变化。

热卷

热卷供需格局出现明显弱化：产量大降3.10%至293万吨，表需同步大降4.02%至287万吨，供需双缩。总库存累库扩大至444万吨（+1.24%），此前韧性优势已完全消退，累库压力加剧。制造业用钢需求边际走弱，汽车家电备货力度减弱，出口端维持但增量缩小。核心关注点：8月制造业需求恢复力度、卷螺价差收敛信号、海外贸易政策变化。

铁矿石

供给端整体维持宽松格局：港口库存延续累积趋势，到港量偏高，澳巴发运量环比回升。需求端钢厂日均铁水产量约243万吨维持高位，但高炉利润持续收窄，铁水存在高位回落预期。钢厂按需采购、补库意愿偏弱，现货外矿指数偏弱运行，近月升水走平。核心关注点：铁水产量拐点、港口库存去化节奏、海外矿山发运变化。

焦煤

供应端维持偏紧格局：山西安监常态化制约供给弹性，炼焦煤产量同比下降，主产区复产进度低于预期。蒙煤通关量环比减少，甘其毛都口岸库存低位，进口端补充不足。焦炭提涨落地对原料需求形成一定提振，但钢厂利润收缩已导致高价焦煤采购节奏放缓。核心关注点：蒙煤通关恢复进度、仓单注册后套保行为演变、铁水回落对焦煤采购的传导。

焦炭

焦炭十轮提涨自3月下旬起已全部落地，累计涨幅约500元/吨，准一级干熄焦采购价升至2135元附近。焦企盈利明显改善，吨焦盈利47元，独立焦企理论盈利85元，开工意愿回升。成本端焦煤强势持续推动价格重心上移，但钢厂华北高炉利润已逼近盈亏线，对继续提涨抵触较强。核心关注点：钢厂减产节奏对焦炭采购的传导、焦化利润在煤焦钢产业链中的边际变化。

玻璃

日熔量降至14.28万吨，产线冷修增多但去库缓慢，样本企业库存7529万重箱，同比+21.64%，处近五年同期高位。下游深加工订单仅8.3天，地产需求疲弱，行业全面亏损（天然气燃料利润-185.8元/吨）。供强需弱格局延续，估值偏低但缺乏向上驱动。

纯碱

产量76.85万吨，开工率约81%，厂家库存连续六周累库至180万吨。远兴能源二期持续释放产量，浮法及光伏玻璃日熔下行压制重碱刚需，联碱法、氨碱法均陷亏损。供需过剩格局未改，产能出清周期较长，短期缺乏上涨驱动。

锰硅

周产量17.04万吨，连续四周下降，但63家样本企业库存43.82万吨，持续刷新近年新高。锰矿港口库存高企，矿价持续阴跌，化工焦降价，成本支撑下移。钢厂利润收缩，螺纹产量低位，需求提振有限。供需双弱、库存高压，基本面支撑力度不足。

硅铁

周产量11.26万吨，环比下降2.43%，但60家样本企业库存增至8.49万吨。成本端兰炭、电价持稳，宁夏利润微亏，内蒙小幅盈利。钢材需求环比略增但绝对值偏低，金属镁产量高位回落，非钢需求转弱。供需趋向宽松，上行驱动不足。

原油

行情核心受中东地缘局势主导。消息面：伊朗高级官员表示，德黑兰已否决阿曼提出的霍尔木兹海峡区域共同管理方案，认为该方案没有成功的可能。供应端，美伊对峙持续升级，霍尔木兹海峡通航不确定性上升，市场交易原油外运受阻风险溢价；OPEC+维持增产节奏，但闲置产能有限，全球原油商业库存处于低位，缓冲空间不足。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。

LPG

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，化工需求小幅下降，码头到船增加，积极执行前期合同，出货量增多，整体需求微增。后续高位压力逐步显现，液化气基本面格局预计弱于原油。

PTA

PTA接下来2个月装置面临集中重启，产量有增加预期，基本面属于弱现实强预期，强现实在于当前库存偏低，且近期上游成本端上涨，PTA利润大幅回落。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。

短纤

供减需平，近期利润有一定修复但现金流依旧为负，原料上涨会带来成本支撑。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。成本端支撑占主导，等待下游需求改善，价格或将迎来新一波上涨。

乙二醇

乙二醇7-8月份国内产量变化不大，变量在于进口端，本质就是纯地缘交易，华东港口库存处于去库通道，到港压力不大，未来不太会有大幅累库。下游聚酯负荷小幅回升，但织造终端处于淡季，下游仅刚需零星采买，现货成交清淡，短期或偏强震荡运行。

塑料

美伊局势再度陷入僵持，塑料短期受地缘影响较大。基本面来看，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，下游开工利预计从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。

甲醇

供应端国内多套煤制装置集中检修，周度产量有所收缩；美伊冲突扰动霍尔木兹海峡航运，因台风滞留的进口货物本周开始流通，本周到港量增加带动港口库存累库。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。鉴于海外开工率保持在低位，甲醇远期供应约束仍存，价格相对有支撑。

PVC

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，而原料乙烯价格受地缘变化呈现高波动，盘面PVC也会受此影响，短期PVC价格或维持震荡运行。

聚丙烯

供给端本周聚丙烯平均产能利用率环比上升0.99个百分点至69.93%，预计下周聚丙烯产能利用率提升至70.5%附近。需求端当前PP制品行业进入夏季传统淡季，持续高温压制下游工厂生产及采买节奏，终端市场仅零星刚需拿货，暂无集中补库动作。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。而供应端弱回归与需求疲软博弈，市场难以有效跟进成本端涨幅。

苯乙烯

供需层面，苯乙烯市场低供给格局延续；下游整体需求虽小幅走弱，不过月底集中出口发运将带来基本面小幅边际修复。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。预计苯乙烯价格偏强震荡。

燃油

近期燃油市场受原油地缘溢价带动走强，中东局势升级推升航运燃料风险溢价。新加坡燃料油库存维持偏低水平，高硫燃油供应受中东炼厂检修影响偏紧。低硫燃油供应相对充裕。目前市场关注地缘风险与供需基本面的共振：高硫燃油供应偏紧叠加航运需求韧性提供支撑，但低硫燃油供需宽松限制整体上行空间。后续需关注中东炼厂复产情况及航运需求变化。

沥青

近期沥青开工率维持低位，炼厂库存小幅去化。北方地区施工进入旺季，需求环比改善；南方受降雨影响施工受限。原油价格走强推升成本，沥青生产利润承压。目前市场关注成本驱动与需求季节性改善的博弈：原油走强提供成本支撑，北方施工旺季带动需求边际回升，但南方雨季制约整体需求释放。后续需关注天气变化及专项债发行进度对基建需求的拉动。

尿素

近期尿素日产维持高位，企业库存环比累积。农业需求进入淡季，复合肥开工率回落，工业需求维持刚需采购。出口端仍受政策限制，港口库存低位。目前市场关注高供给与需求淡季的矛盾：日产维持高位使供应压力持续，农业需求季节性走弱及出口受限使供需趋于宽松，企业库存累积速度加快。后续需关注企业库存变化及出口政策动向。

合成橡胶

近期顺丁橡胶开工小幅回升，燕山装置复产抬升产出。多套裂解装置持续检修使丁二烯港口库存小幅去库，原料流通压力有限。下游轮胎行业正值夏季检修期，全钢、半钢开工同步下滑。目前市场关注成本驱动与终端偏弱的博弈：中东地缘持续支撑油价带动丁二烯报价上行提供底部支撑，但淡季需求难以驱动持续走强。后续需关注轮胎检修复工与丁二烯装置运行节奏。

橡胶

近期东南亚进入季节性旺产，原料稳步上量。国内海南、云南新胶持续释放，局部短时降雨小幅扰动产出。青岛港口库存小幅去库但整体仍处同期高位。下游轮胎行业淡季特征明显，全钢、半钢胎开工走低。目前市场关注供需弱格局下的成本支撑：原油走强带动能化板块偏多氛围，但基本面供增需弱限制上行空间。后续需关注产区天气及轮胎检修复工节奏。

烧碱

烧碱仍是供需过剩，本周全国液碱累库，山东和江苏液碱环比累库。本周开工环比下降，开工处于同期低位。液氯价格近期持续反弹，氯碱利润有明显回升，山东氯碱负荷回升。氧化铝运行产能高位，非铝需求弱势，出口仍弱。

生猪

全国外三元均价10.42元/公斤，行业深度亏损。6月末能繁母猪存栏3780万头，逼近3750万头调控红线，产能加速去化。但上半年仔猪出生量仍偏高，三季度理论供应充足，叠加高温抑制消费、冻品库存高位，短期猪价承压磨底，中期供需格局有望改善。

豆粕

美豆受中西部高温干旱天气及中国持续采购支撑，主力合约突破1200美分。国内大豆到港量维持千万吨级，油厂豆粕库存累至96.73万吨，供应宽松。下游饲料企业随采随用，现货基差贴水。短期跟随外盘偏强震荡，但国内累库制约上行空间，关注8月美豆产区降水。

豆油

美豆天气升水及原油走强提供成本支撑，但国内豆油库存升至138.88万吨，环比增6.56%，处四年同期高位。消费淡季下游仅刚需采购，现货基差承压。8-9月大豆到港量偏高，供应预期宽松。短期跟随外盘震荡偏强，但高库存制约上行空间。

棕榈油

马棕6月库存254万吨创同期新高，7月仍处增产周期，SPPOMA显示前20日产量环比-0.77%，但出口数据分化。国内商业库存80.24万吨，同比+35.68%，供应压力持续。印尼B50政策设三个月过渡期，短期驱动不足，厄尔尼诺预期支撑远月，近弱远强格局延续。

菜粕

加拿大菜籽产区高温干燥，天气升水犹存，但加农业部上调新季产量预估至2100万吨。国内水产养殖旺季，菜粕刚需稳固，油厂库存2.45万吨压力可控。乌克兰菜粕出口受阻带来替代需求增量，但豆类粕价差低位限制涨幅。

菜油

国内菜油库存41.08万吨，同比大降42万吨，现货偏紧、基差坚挺。加拿大菜籽产区天气风险及原油走强支撑外盘，ICE菜籽创三年高位。国内油厂因菜籽衔接不畅开机率偏低，叠加还储需求，供应阶段性偏紧。

玉米

产区降雨，美玉米回落，新季美玉米面积下降，短期美玉米偏强震荡。上周糙米成交率下降，东北产区玉米偏弱，港口价格稳定。华北玉米上量减少，玉米现货稳定，小麦价格偏弱，东北玉米与华北玉米价差扩大，玉米现货短期稳定。

鸡蛋

当前鸡蛋，低库存、旺季与中秋备货，养殖端惜淘情绪浓厚，淘汰鸡出栏量维持低位，新开产蛋鸡仍在稳步增加。

棉花

7月30日，中国储备棉管理有限公司计划挂牌出库销售储备棉8000.1240吨，实际成交8000.1240吨，成交率100%。成交均价17007.32元/吨，较29日跌69.64元/吨，折3128B价格17587.53元/吨；成交最高价17810元/吨，最低价16060元/吨。当前棉花市场核心关注点依旧是储备棉的销售情况，成交均价的重心再次往下

白糖

高库存低消费糟糕的国内基本面，叠加外盘糖的下跌，郑糖持续震荡走弱。后续观察基本面变化以及厄尔尼诺天气情况。

苹果

中期基本面没大的变化：供应大增，需求淡季。短期上为技术性与资金博弈，后续观察价格能否突破平台或者需求端能否出现明显改善。

红枣

7月30日郑商所红枣期货仓单录得8636张，较上一交易日减少4张，有效预报录得282张。据钢联统计，截至7月30日，36家样本点物理库存在10420吨，周环比减少46吨，同比增加3.27%。

花生

花生油方面，终端需求表现欠佳，油厂订单稀少，老客户实单有议价空间。花生粕方面，油厂报价稳中有涨，实际成交可议价。主产区价格稳定，消费不振，基本面暂无亮点变化。

【行情口径及筛选说明】

1. **数据来源**：WIND,IFIND,东亚期货研究院。
2. **涨跌幅**：主连合约当日收盘价相对上一交易日收盘价的变化。
3. **成交变化**：当日加权成交量相对前20个交易日平均成交量的变化。
4. **持仓变化**：当日加权持仓量相对上一交易日的增减；增仓不直接代表多头或空头占优。
5. **持仓增幅**：按当日加权持仓量相对上一交易日加权持仓量的变化百分比计算。
6. **板块涨跌**：以板块内纳入统计品种的收盘价涨跌幅进行平均加权测算。
7. **涨跌颜色说明**：**价格上涨显示为红色，价格下跌显示为绿色。**

免责声明： 文中的所有内容和观点须以我公司向客户发布的完整版报告为准。我公司不保证所发布信息及资料处于最新状态，我公司将随时补充、更新和修订有关信息及资料，但不保证及时公开发布。本文所载信息来源被认为是可靠的，但是本公司不保证其准确性或完整性，文中信息及观点仅供参考之用，不构成对任何个人的投资建议。投资者应结合自身情况自行判断是否采用本文所载内容和信息并自行承担风险，我公司及雇员对投资者使用本文内容而造成的一切后果不承担任何法律责任。