



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08月11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 +1.02%，50/73 个品种收涨，市场整体偏强。
- 能源化工领涨 (+2.26%)，金融+贵金属最弱 (-0.12%)，板块分化是今日主线。
- 当日变化较突出的品种：低硫燃油 (+6.31%，上涨增仓)、焦煤 (+5.50%，上涨增仓)、原油 (+6.16%，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

68%涨 / 32%跌

平盘 0 个

增仓品种

41

占活跃品种 56.2%

日均成交活跃度

偏高

+7.9% 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 低硫燃油	+20.1%
② 纸浆	+12.9%
③ 焦煤	+5.9%
④ 沥青	+5.7%
⑤ 原油	+5.0%

成交放大 TOP5 较20日均量

① 锰硅	+146.3%
② 纯碱	+109.7%
③ 玉米淀粉	+78.4%
④ 红枣	+75.8%
⑤ 焦煤	+67.3%

二、板块强弱与量仓变化

行情截至 2026-08-11 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	-0.12%	3 / 7	-0.6%	+1.0
有色金属+新能源	+0.26%	8 / 3	-0.5%	+2.4
能源化工	+2.26%	22 / 3	+6.0%	+11.5
黑色建材	+1.33%	8 / 1	+39.5%	-6.7
农产品	+0.38%	9 / 8	+2.3%	-1.7

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
低硫燃油 能源化工	4868 +6.31%	日内走强	+9.6%	12.3万 / +2.0万 (+20.1%)	上涨增仓
燃油 能源化工	3736 +6.17%	日内走强	-3.9%	47.4万 / +2.0万 (+4.4%)	上涨增仓
原油 能源化工	563.8 +6.16%	日内走强	-11.9%	8.3万 / +0.4万 (+5.0%)	上涨增仓
红枣 农产品	8340 +5.84%	探底回升	+75.8%	25.9万 / -0.0万 (-0.1%)	上涨减仓
焦煤 黑色建材	1343.5 +5.50%	日内走强	+67.3%	90.9万 / +5.1万 (+5.9%)	上涨增仓
LPG 能源化工	5436 +3.82%	日内走强	-14.6%	16.5万 / +0.4万 (+2.2%)	上涨增仓
丙烯 能源化工	7428 +3.82%	日内走强	+52.1%	4.5万 / +0.2万 (+4.4%)	上涨增仓
甲醇 能源化工	2624 +3.67%	日内走强	+18.2%	175.4万 / +1.3万 (+0.7%)	上涨增仓
纯苯 能源化工	7324 +3.14%	日内走强	+14.0%	4.6万 / +0.2万 (+3.8%)	上涨增仓
纯碱 能源化工	996.0 +3.11%	日内走强	+109.7%	244.7万 / -5.9万 (-2.4%)	上涨减仓

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
欧线集运 其他	1569 -2.21%	探底回升	+45.4%	4.2万 / -0.0万 (-0.2%)	下跌减仓
鸡蛋 农产品	3818 -2.20%	日内走弱	-6.8%	81.6万 / -0.7万 (-0.9%)	下跌减仓
纸浆 能源化工	4558 -1.51%	日内走弱	+45.0%	59.0万 / +6.8万 (+12.9%)	下跌增仓
尿素 能源化工	1700 -1.22%	震荡下行	+19.0%	53.9万 / +1.5万 (+2.8%)	下跌增仓
胶版印刷纸 能源化工	3848 -1.08%	日内走弱	+49.6%	2.6万 / +0.0万 (+1.0%)	下跌增仓
沪锡 有色金属+新能源	423900 -0.96%	震荡下行	-16.9%	9.4万 / -0.3万 (-3.3%)	下跌减仓
上证50 金融+贵金属	2909 -0.92%	日内走弱	-33.4%	12.0万 / +0.3万 (+2.4%)	下跌增仓
不锈钢 黑色建材	14525 -0.62%	探底回升	-23.9%	14.1万 / +0.5万 (+3.7%)	下跌增仓
沪深300 金融+贵金属	4625 -0.42%	冲高回落	-33.8%	27.0万 / +0.7万 (+2.9%)	下跌增仓
花生 农产品	8186 -0.41%	震荡下行	-2.4%	35.1万 / -0.2万 (-0.6%)	下跌减仓

沪深300

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。

中证500

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。

中证1000

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。

欧线集运

本周，船公司逐步落地8月下半月运价，继续维持重心下移的态势。马士基周二开舱第34周运价，继续恢复降价态势，环比上周下跌200美元。市场重新回到运价下跌的预期中，叠加中东局势出现缓和，10合约回吐上周全部涨幅。后期继续关注运价下降节奏，来判断10合约的估值。

沪银

利多因素：AI基建需求持续支撑，人工智能基础设施建设持续需要白银作为关键工业金属；全球交易所白银库存持续收紧。利空因素：主要央行维持高利率环境时间长于预期，美联储鹰派信号强化；强势美元对以美元计价的贵金属价格形成明显压制。总结而言：白银期货正处于多空博弈中，供需面偏紧但宏观流动性因素存在下行压力。

沪金

利多因素：全球多国央行持续维持年度购金计划，央行实物买盘长期稳定托底金价；"去美元化"预期与避险情绪构成长期支撑。利空因素：美联储鹰派信号强化、9月加息概率上升，通胀压力令降息预期大幅降温；美元指数走强与美债收益率上行，资金自黄金ETF明显流出。总结而言：央行购金托底与紧缩预期压制相互抗衡，金价高位高波动。

铂

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。

钯

矿产供给保持释放，汽车催化剂回收货源增加，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钯技术影响，汽车领域需求延续承压，下游企业采购偏谨慎。

沪铜

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。

沪铝

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。

沪锌

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。

沪铅

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。

沪镍

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。

沪锡

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。

氧化铝

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。

碳酸锂

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。

多晶硅

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。

工业硅

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。

螺纹钢

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。

热卷

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。

铁矿石

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。

焦煤

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。

焦炭

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。

玻璃

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。

纯碱

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。供强需弱格局未改，关注检修持续性

锰硅

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。

硅铁

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。

原油

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，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，液化气基本面格局相对偏弱。

PTA

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。

短纤

供减需平，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，下游仅刚需零星采购，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。

乙二醇

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。

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

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。

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。

聚丙烯

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。

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。

燃油

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。

沥青

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。

尿素

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。现实供强需弱，靠出口招标、政策、秋肥预期托底，震荡格局，没有单边趋势。

合成橡胶

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。

橡胶

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。

烧碱

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，非铝需求弱势但存旺季预期，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

生猪

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。

豆粕

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。

豆油

港口豆油库存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。短期豆油跟随外围震荡，关注USDA及MPOB报告预期差。

棕榈油

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。

菜粕

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。

菜油

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。

玉米

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

鸡蛋

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。

棉花

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。

白糖

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。

苹果

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

红枣

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。

花生

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。

【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。