大陆期货

每日品种聚焦

玉米

*Y2409 成交/持仓排名（20240613）：

成交量龙虎榜

名次	会员简称	成交量	增减
1	光大期货	154,341	44,070
2	东证期货	83,277	18,979
3	中信期货	69,191	25,864
4	国泰君安	47,477	12,056
5	华泰期货	38,104	9,041
6	银河期货	27,817	11,100
7	广发期货	22,816	3,903
8	华西期货	19,616	3,299
9	中粮期货	18,556	6,261
10	海通期货	16,936	6,066

多头持仓龙虎榜

名次	会员简称	多单量	增减
1	中粮期货	50,133	-5,336
2	中信期货	45,150	3,143
3	国泰君安	42,547	-2,532
4	东证期货	33,025	-3,170
5	华泰期货	24,004	6,500
6	国投安信	23,651	-2,249
7	永安期货	21,536	6,925
8	广发期货	19,318	226
9	中泰期货	18,538	1,383
10	倍特期货	16,607	-848

空头持仓龙虎榜

名次	会员简称	空单量	增减
1	东证期货	82,789	2,649
2	国泰君安	65,404	6,739
3	中信期货	65,366	-1,194
4	光大期货	31,904	-474
5	华泰期货	30,462	-2,598
6	国投安信	30,342	1,191
7	浙商期货	28,775	480
8	中粮期货	27,641	408
9	一德期货	25,857	-869
10	平安期货	22,752	-433

市场动向	6 月 USDA 供需报告显示，将 2024/2025 年全球玉米期末库存从 5 月份的 3.1227 亿吨下调至 3.1077 亿吨。乌克兰谷物协会(UGA)表示，2024/25 年度乌克兰玉米产量和出口量将从上年的 2960 万吨降至 2550 万吨，出口量将从 2600 万吨降至 2050 万吨。市场关注焦点转向美国种植带天气，以及两周后发布的美国作物播种数据。墨西哥长期干旱预计将增加对美国玉米的进口需求，这一需求变化可能会对价格产生进一步影响。华北黄淮产区基层种植户忙于夏收夏种，加之东北粮外运不畅，市场流通粮源减少，持粮主体看涨情绪慢慢升温。中储粮加大小麦收储力度，支撑麦价底部，同时华北贸易商忙于收购小麦，玉米上量减少，深加工刚需补库或刺激价格上涨。
行情研判	整体供需结构对玉米的下方支撑较强，持粮主体看涨情绪慢慢升温。玉米主力 09 合约经过近 2 年的调整后逐步企稳，目前正漫步在缓涨通道里。上海大陆期货投资咨询部认为，目前粮源相对比较集中，主要在中间贸易环节，其抗价能力及心态明显上升，加之刚性需求仍在，且后期需求季节性上升预期较强。关键支撑 2440 一带，支撑有效则视为进入缓涨阶段，由于受制于进口玉米和糙米拍卖，市场上升力度比较趋缓，支撑之上可维持低多策略。

花生

*PK2410 成交/持仓排名(20240613)：

成交量龙虎榜

名次	会员简称	成交量	增减
1	中信期货	34,442	-23,486
2	东证期货	17,033	-17,821
3	国泰君安	15,664	-10,533
4	中泰期货	11,845	-9,318
5	徽商期货	10,078	-6,652
6	中信建投	9,314	-7,024
7	方正中期	7,964	-5,723
8	华泰期货	7,731	-11,552
9	银河期货	7,115	-7,230
10	海通期货	7,016	-8,529

多头持仓龙虎榜

名次	会员简称	多单量	增减
1	方正中期	6,401	1,126
2	中信期货	5,744	1,105
3	中泰期货	5,415	1,832
4	国泰君安	5,071	-50
5	徽商期货	4,378	144
6	长江期货	3,722	158
7	东证期货	3,013	292
8	国投安信期货	2,910	1,743
9	一德期货	2,891	814
10	中信建投	2,821	736

空头持仓龙虎榜

名次	会员简称	空单量	增减
1	瑞达期货	8,041	278
2	中粮期货	7,215	1,406
3	乾坤期货	6,734	409
4	中信期货	5,366	943
5	方正中期	5,140	304
6	摩根大通	4,809	-78
7	中泰期货	4,756	-3,039
8	银河期货	4,623	292
9	国泰君安	4,395	-94
10	东证期货	4,346	757

市场动向	6 月 11 日，农业农村部和中国气象局联合发布农业高温干旱风险预警。6 月 12 日，河南省气候中心发布干旱橙色预警，预计至 6 月 20 日，干旱天气和干旱范围将进一步发展。春花生和蒜茬花生的生长尚未受到干旱影响，麦茬花生正值播种期，土壤墒情不足将延迟其播种进度。河南产区麦茬花生占比在 80%~90%，如果 6 月 20 日之前仍无有效降雨，则将面临花生产量受损以及农户改种玉米和大豆的境地。据统计，河南花生新季种植面积增幅在 20%左右，东北及河北地区种植面积预估增加 20%~30%。两广地区食品米消费下滑 30%左右，局部地区甚至下滑 40%。市场走货不佳，成品冷库较高的库存没有得到有效消耗，冷库货源 7 月份压力较大。
行情研判	天气主导了短期波动，供需格局仍决定中期走向。花生主力 10 合约近期受天气因素刺激波动明显放大，形成宽幅震荡走势。上海大陆期货投资咨询部认为，近两日的干旱天气炒作加剧了花生市场的波动，但新季花生种植面积增加幅度较大，即使天气条件较差，也难以改变整体增产的趋势。因此花生昨日又再次大幅下跌交易现实供需逻辑，但新季花生炒作天气因素条件仍具备，加上中秋需求放量预期，花生也难出现流畅下跌，盘面有修复贴水要求，下方关键支撑 8700-8900 料有较强抵抗，待企稳后可再尝试低多策略。

铁矿

*I2409 成交/持仓排名(20240613）：

成交量龙虎榜

名次	会员简称	成交量	增减
1	国泰君安	54,211	10,288
2	中信期货	46,450	12,123
3	东证期货	33,010	8,500
4	广发期货	23,872	7,726
5	国富期货	20,817	7,007
6	中信建投	19,208	6,154
7	方正中期	18,196	6,618
8	华泰期货	17,997	6,620
9	银河期货	17,786	5,235
10	徽商期货	16,122	5,735

多头持仓龙虎榜

名次	会员简称	多单量	增减
1	中信期货	27,867	-81
2	国泰君安	22,532	943
3	永安期货	14,292	-155
4	东证期货	13,605	2,022
5	银河期货	12,410	208
6	浙商期货	11,183	-128
7	广发期货	10,929	366
8	宝城期货	9,591	335
9	宏源期货	8,911	6
10	乾坤期货	8,614	-166

空头持仓龙虎榜

名次	会员简称	空单量	增减
1	国泰君安	27,852	-1,782
2	永安期货	20,235	1,226
3	中辉期货	19,708	297
4	银河期货	16,218	-644
5	方正中期	15,461	284
6	华泰期货	14,830	-252
7	中信期货	14,515	-709
8	五矿期货	12,653	619
9	东海期货	11,851	158
10	东证期货	11,705	904

市场动向	国内港口铁矿到港量本周由上周 2424 万吨降低至 2256 万吨，铁矿石全球发运量由上周 3326.6 万吨减少至 3248.7 万吨，全球供给收紧;上周 45 港口总库存水平从 14855.327 万吨增加至 14859.71 万吨，钢厂库存从 9338.93 万吨降低至 9203.76 万吨。全球铁矿发运高位环比回落，未来临近季末海外仍有发运冲量预期。国内到港量反弹至相对高位，全国铁矿港口库存继续累增并创下年内新高。港口库存达到 1.49 亿吨的高位，始终未进入去化阶段，给矿价带来较大压力。钢厂维持按需补库状态，进口矿可用天数维持在 20 天不变，以随采随用为主。关注七月份“会议”预期的炒作。
行情研判	铁矿石期货价格已经反馈了近期供需逻辑，在新的利空因素出现前谨慎追空。铁矿主力 09 合约在短期跌破 800 后再度站稳，空头情绪得到一定释放，关键压力仍在 840。目前铁矿石供强需弱状态延续，港库维持高位，但我们看到的基本面情况都已计价，若无新的利空因素，矿价也难再度出现大跌，市场或需要一个短暂修复过程。短期支撑仍是 800 左右，关键压力 840 不变，跌破支撑前警惕反弹，而突破压力前维持空头思路。

文中资讯数据来源：Wind

投资咨询业务资格：证监许可【2011】1457 号
丁忠鑫　投资咨询证号：Z0012101

免责声明：

本文中的信息均来源于被认为可靠的已公开资料，但上海大陆期货对这些信息的准确性及完整性不作任何保证。 本文反映研究人员的不同观点、见解及分析方法，并不代表上海大陆期货或其附属机构的立场。文中所载资料、意见及推测仅反映研究人员于发出本报告当日的判断，可随时更改且不予通告。在任何情况下，报告内容仅供参考，报告中的信息或所表达的意见并不构成所述品种买卖的出价或询价，投资者据此投资，风险自担。